

**ПРАВИЛА ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ
КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ**

Оглавление

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ.....	4
Статья 1. Термины и определения.....	4
Статья 2. Общие положения	10
Статья 3. Порядок проведения клиринга.....	11
Статья 4. Взаимодействие КЦ с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием и Техническим центром.....	12
Статья 5. Общие правила использования информации.....	13
Статья 6. Клиринговые регистры.....	14
Статья 7. Виды клиринговых и торговых счетов.....	17
Статья 8. Порядок регистрации Торгово-клиринговых счетов	20
РАЗДЕЛ II. ПРАВА И ОБЯЗАННОСТИ КЦ И УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА	22
Статья 9. Права, обязанности и ответственность КЦ и Участников клиринга	22
Статья 10. Оплата услуг КЦ, Торговой площадки	23
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ	24
Статья 11. Способы снижения рисков при осуществлении клиринга	24
Статья 12. Обеспечение исполнения обязательств Участников клиринга	25
Статья 13. Ограничение ответственности центрального контрагента (уровни защиты центрального контрагента)	28
Статья 14. Гарантийные фонды	28
Статья 15. Порядок расчета величины Доступных средств	29
Статья 16. Маржинальные требования	31
Статья 17. Последствия нарушения Маржинального требования.....	32
Статья 18. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов и использования Выделенного капитала	35
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ, ИСПОЛЬЗОВАНИЯ И ВОЗВРАТА СРЕДСТВ ОБЕСПЕЧЕНИЯ	38
Статья 19. Порядок внесения, использования и возврата Средств обеспечения...38	
Статья 20. Порядок внесения и возврата взноса в Гарантийные фонды	43
РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ	45
Статья 21. Порядок взаимодействия с Торговой площадкой при подаче Заявок и заключении Договоров. Порядок и условия допуска обязательств к клирингу.....	45
Статья 22. Порядок заключения Внебиржевых договоров ОТС на основании Оферт ОТС.....	47
РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ/ПРЕКРАЩЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ	53

Статья 23. Виды клиринговых пулов. Порядок включения обязательств в клиринговые пулы	53
Статья 24. Порядок формирования клирингового пула по Договорам, расчётного клирингового пула, клирингового пула по Внутриброкерским договорам и клирингового пула ОТС. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу ...	53
Статья 25. Порядок урегулирования ненадлежащего исполнения обязательств ...	59
Статья 26. Донорский договор	69
Статья 27. Порядок формирования клирингового пула по Договорам с полным обеспечением с ЦК. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу	74
Статья 28. Порядок формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов.....	75
Статья 29. Задолженность по денежному регистру	76
Статья 30. Порядок передачи Доходов по Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС, Парам договоров, Договорам купли-продажи облигаций	77
РАЗДЕЛ VII. ПОРЯДОК И СПОСОБЫ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЦ, УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА, РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ, РАСЧЕТНОГО ДЕПОЗИТАРИЯ, ОРГАНИЗАТОРА ТОРГОВЛИ, ТОРГОВОЙ ПЛОЩАДКИ. ОТЧЕТЫ КЦ	80
Статья 31. Порядок взаимодействия КЦ с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием	81
Статья 32. Порядок взаимодействия КЦ с Торговой площадкой.....	81
Статья 33. Способы получения и передачи документов при взаимодействии КЦ с Участниками клиринга, Расчетным депозитарием и Расчетной организацией	82
Статья 34. Отчеты КЦ и иная информация, предоставляемая Участникам клиринга	83
РАЗДЕЛ VIII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ.....	83
Статья 35. Порядок действия КЦ при операциях с ценными бумагами вследствие корпоративных событий	83
Статья 36. Взаимодействие КЦ и Участников клиринга при исполнении КЦ функции Налогового агента, налоговых обязательств по Доходам, полученным по Ценным бумагам эмитентов США и Ценным бумагам эмитентов ФРГ, а также обязательств по уплате Транзакционного налога	85
Статья 37. Хранение и учет документов и информации внутреннего учета	86
Статья 38. Порядок урегулирования неисполненных обязательств в случае прекращения клирингового обслуживания Участника клиринга	87
Статья 39. Существенные события	90

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Статья 1. Термины и определения

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

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

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

Валюта Доступных средств – валюта, установленная КЦ для расчета Доступных средств.

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

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

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

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

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

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

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

Гарантийный фонд – обеспечение, формируемое КЦ за счет взносов всех Участников клиринга.

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

Депозитарий – организация, на имя которой в Расчетном депозитарии открыт Торговый счет депо номинального держателя, которая осуществляет учет прав на ценные бумаги Участника клиринга и (или) Клиента.

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

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

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

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

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

Донорский внебиржевой валютный своп ОТС – Внебиржевой валютный своп ОТС, заключаемый в случаях и в порядке, указанных в статье 26 настоящих Правил.

Донорский договор купли-продажи - Пара договоров, заключаемая в случаях и в порядке, указанных в статье 26 настоящих Правил.

Донорский договор репо - Договор репо или Внебиржевой договор репо ОТС, заключаемый в случаях и в порядке, указанных в статье 26 настоящих Правил.

Дополнительное обеспечение - величина, выраженная в Валюте Доступных средств, используемая для оценки достаточности Средств обеспечения Участников клиринга и рассчитываемая в соответствии с Методикой расчета гарантийного обеспечения.

Доступные средства - сумма, выраженная в Валюте Доступных средств, рассчитываемая КЦ, используемая для ограничения рисков Участника клиринга в соответствии со статьей 15 настоящих Правил.

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

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

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

Квалифицированный дилер деривативов (Qualified Derivatives Dealer, QDD) – Квалифицированный посредник, заключивший соглашение с Налоговой службой США, в соответствии с которым такой посредник вправе предоставлять Бенефициарам дохода налоговые льготы в отношении Дивидендных эквивалентов по Ценным бумагам эмитентов США, являющихся предметом Договора репо, в соответствии с соглашением об избежании двойного налогообложения, заключенным между Республикой Казахстан и США (и других аналогичных соглашений иностранных юрисдикций с США), а также осуществлять сбор и хранение подтверждающих документов о Бенефициарах дохода как основание для возможного получения налоговых льгот.

Квалифицированный посредник (Qualified Intermediary, QI) – Посредник, заключивший соглашение с Налоговой службой США, в соответствии с которым такой Посредник вправе предоставлять Бенефициарам дохода льготы по соглашению об

избежании двойного налогообложения, заключенному между Республикой Казахстан и США (и других аналогичных соглашений иностранных юрисдикций с США), а также осуществлять сбор и хранение подтверждающих документов о Бенефициарах дохода как основание для возможного получения налоговых льгот.

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

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

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

КЦ – International Trading System Limited («ITS Ltd.») acting under Operating a Clearing House license as a Central Counterparty.

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

Лот – количество ценных бумаг / валюты, установленное Торговой площадкой / КЦ для каждой ценной бумаги / валюты, которому должно быть кратно количество ценных бумаг / валюты, указанное в Заявке / Оферте ОТС / Акцепте ОТС.

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

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

Методика установления и изменения риск-параметров – внутренний документ КЦ, утверждаемый единоличным исполнительным органом КЦ, устанавливающий порядок определения риск-параметров и правила определения стоимости имущества, принимаемого в качестве Средств обеспечения и средств Гарантийных фондов.

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

Оператор Торгового счета депо – юридическое лицо, являющееся уполномоченным представителем лица, в отношении которого открыт Торговый счет депо, имеющее право на основании поручения или доверенности отдавать распоряжения в Расчетный депозитарий на выполнение операций по Торговому счету депо в рамках установленных полномочий. ,

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

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

- оба договора заключаются одновременно между одними и теми же лицами;
- дата исполнения одного договора определяется как T+k (далее - Первый договор), а дата другого договора определяется как T+n (далее - Второй договор), где T -

дата заключения Пары договоров, а k и n - число Расчетных дней, определяемое решением КЦ, причем значение «k» не должно превышать значение «n»;

- по Первому договору одна сторона обязуется приобрести у другой стороны (обязуется передать другой стороне) определенное количество ценных бумаг, а по Второму договору она обязуется передать другой стороне (обязуется приобрести у другой стороны) те же ценные бумаги в том же количестве;

- количество ценных бумаг, являющихся предметом обоих договоров, определяется в соответствии с настоящими Правилами;

- по Первому договору и по Второму договору оплата ценных бумаг должна осуществляться в одной и той же валюте;

- цена Второго договора определяется исходя из цены Первого договора и Ставки репо;

- по Второму договору сторона, являющаяся продавцом, обязана передать Доход стороне, являющейся покупателем.

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

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

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

Посредник – финансовый институт в соответствии с Законом США «О налогообложении иностранных счетов» (Foreign Account Tax Compliance Act, FATCA), в том числе участвующий в последовательности учета прав на Ценные бумаги эмитентов США, являющийся Участником клиринга, клиентом Участника клиринга или Депозитарием, ценные бумаги клиентов которого учитываются на Счете депо номинального держателя или на Торговом счете депо номинального держателя.

Правила допуска – внутренний документ International Trading System Limited («ITS Ltd.»), определяющий порядок регистрации Участников клиринга и их клиентов, а также порядок допуска Участников клиринга к клиринговому обслуживанию, приостановления, возобновления и прекращения допуска Участников клиринга к клиринговому обслуживанию и порядок приостановления, возобновления и прекращения регистрации клиентов Участников клиринга.

Правила торговли (Business rules) – внутренний документ Торговой площадки, в котором установлен порядок оказания услуг по проведению организованных торгов ценными бумагами.

Положение по QI/QDD – положение о налоговом администрировании Доходов по ценным бумагам иностранных эмитентов, в том числе являющихся предметами Договоров репо, для последующей передачи информации Налоговому агенту с целью применения последним соответствующих ставок налогообложения.

Раздел «Неторговый» - составная часть Торгового счета депо, предназначенная для учета прав на ценные бумаги, не являющиеся Средствами обеспечения. Виды разделов «Неторговый» устанавливаются решением Расчетного депозитария.

Раздел «Торговый» - составная часть Торгового счета депо, предназначенная для учета прав на ценные бумаги, являющиеся Средствами обеспечения. На данном разделе могут учитываться ценные бумаги, не являющиеся Средствами обеспечения.

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

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

Расчетный депозитарий – юридическое лицо, осуществляющее депозитарную деятельность, которое на основании договора с КЦ осуществляет операции, связанные с исполнением обязательств по передаче ценных бумаг по итогам клиринга.

Регламент клиринга – регламент осуществления КЦ клиринговой деятельности, являющийся внутренним документом КЦ, утверждаемый единоличным исполнительным органом КЦ, раскрываемый на Сайте КЦ, и устанавливающий расписание Расчетного дня КЦ (включая время проведения операций, осуществляемых в соответствии с настоящими Правилами), сроки направления в КЦ и получения от КЦ документов в процессе взаимодействия с Участниками клиринга в соответствии с настоящими Правилами, формы / форматы документов, используемых в документообороте между Участниками клиринга и КЦ, а также иные положения.

Регламент обмена информацией - Регламент обмена информацией в целях исполнения Закона США «О налогообложении иностранных счетов» (ФАТСА) и иных законодательных актов в сфере налогообложения Доходов по Ценным бумагам иностранных эмитентов, который утверждается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ.
Регламент по транзакционным налогам - Регламент налогового администрирования по транзакционным налогам, который утверждается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ.

Сайт КЦ – сайт в сети Интернет по адресу <https://itsx.kz/>, на котором осуществляется раскрытие информации.

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

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

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

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

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

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

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

Торговый счет депо - счет депо, открываемый Расчетным депозитарием Участнику клиринга, Клиенту или Депозитарию и предназначенный для учета прав на ценные бумаги и проведения операций на основании распоряжений КЦ.

Клиент – клиент Участника клиринга, который является так же Участником торгов, и (или) иное лицо, в интересах которого Участником торгов заключаются Договоры

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

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

Технический центр – организация, обеспечивающая Участникам клиринга технический доступ к Системе и (или) обеспечивающая технический доступ Торговой площадке к Клиринговой системе, а также организация, обеспечивающая Участникам клиринга доступ к Системе электронного документооборота.

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

Торговая площадка – International Trading System Limited («ITS Ltd.»), действующее на основании лицензии многосторонней торговой платформы, выданной МФЦА.

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

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

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

Цена урегулирования исполнения обязательств - цена ценной бумаги / валюты, определенная КЦ для целей заключения договоров в соответствии со статьей 25 настоящих Правил, а также для заключения Донорских договоров, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров.

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

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

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

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

Электронная подпись – информация в электронной форме, которая присоединена к другой информации в электронной форме (подписываемой информации)

или иным образом связана с такой информацией и которая используется для определения лица, подписывающего информацию.

Термины, специально не определенные в настоящих Правилах, используются в значениях, установленных Правилами торговли, Правилами допуска и (или) документами Расчетной организации / Расчетного депозитария и (или) положениями нормативных документов и правил Международного финансового центра «Астана» (далее – МФЦА).

Статья 2. Общие положения

2.1. Настоящие Правила разработаны в соответствии с уставом и другими внутренними документами КЦ, а также в соответствии с положениями нормативных документов и правил МФЦА.

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

2.3. Договор об оказании клиринговых услуг заключается и вступает в силу в порядке, определенном Правилами допуска. Прекращение договора об оказании клиринговых услуг осуществляется в порядке, установленном Правилами допуска.

В случае прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг КЦ возвращает Участнику клиринга денежные средства, являющиеся Средствами обеспечения, а также денежные средства, составляющие взнос Участника клиринга в Гарантийный фонд, учитываемый на дату прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг. При этом если в соответствии с настоящими Правилами и решением КЦ по взносам Участников клиринга в Гарантийный фонд начисляются проценты, которые включаются в состав взноса в Гарантийный фонд или в состав Средств обеспечения, то сумма денежных средств, подлежащих возврату Участнику клиринга, определяется с учетом фактически полученных процентов на день прекращения договора об оказании клиринговых услуг. Порядок определения размера процентов, начисленных, но не выплаченных Участнику клиринга, устанавливается решением КЦ о начислении процентов по взносам Участников клиринга в Гарантийный фонд и раскрываются на Сайте КЦ. Проценты начисленные, но не выплаченные на день прекращения договора об оказании клиринговых услуг, включаются в состав взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд или в состав Средств обеспечения и подлежат возврату в соответствии с настоящим пунктом.

Возврат денежных средств, являющихся Средствами обеспечения и (или) средствами Гарантийного фонда, осуществляется не позднее 10 (десяти) рабочих дней с даты прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг, за исключением случаев, указанных в статье 38 настоящих Правил. Возврат денежных средств осуществляется на Счет, зарегистрированный в КЦ. В случае отсутствия у Участника клиринга Счета, зарегистрированного в КЦ или невозможности возврата денежных средств на указанный Счет, КЦ осуществляет возврат денежных средств на банковский счет Участника клиринга, указанный в заявлении об изменении данных Участника клиринга.

В случае прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг КЦ перестает учитывать ценные бумаги Участника клиринга в качестве Средств обеспечения, а также прекращает выполнять функции Оператора Торгового счета депо, о чем уведомляет Расчетный депозитарий.

По усмотрению КЦ его обязательство по возврату Средств обеспечения / средств Гарантийного фонда, выраженное в ценных бумагах, может быть прекращено с возникновением обязательства по перечислению Участнику клиринга денежных средств в сумме, рассчитанной исходя из количества ценных бумаг и расчетной цены соответствующей ценной бумаги по состоянию на дату прекращения договора об оказании клиринговых услуг.

2.4. Регистрация Участников клиринга и Клиентов, а также допуск Участников клиринга к клиринговому обслуживанию, приостановление, возобновление и прекращение допуска Участников клиринга к клиринговому обслуживанию и приостановление, возобновление и прекращение регистрации Клиентов осуществляются в порядке, установленном Правилами допуска.

2.5. КЦ вправе в одностороннем порядке вносить изменения в настоящие Правила. Изменения в настоящие Правила вступают в силу по истечении 5 (пяти) дней после раскрытия информации об этом, если больший срок не установлен КЦ.

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

2.6. К настоящим Правилам и Договорам / Внебиржевым договорам ОТС применяется законодательство МФЦА.

Все споры, разногласия и требования, возникающие в связи с оказанием КЦ услуг в соответствии с настоящими Правилами, с заключением, изменением или прекращением Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, а также исполнением обязательств из Договоров / Внебиржевых договоров ОТС или в связи с ними, подлежат разрешению в суде МФЦА в соответствии с его правилами, действующими на дату подачи искового заявления.

Передача споров на разрешение в суд МФЦА возможна только после соблюдения предварительного претензионного порядка урегулирования споров. В случае полного или частичного отказа в удовлетворении претензии или неполучения ответа в течение 7 (семи) дней с момента получения претензии заявитель вправе предъявить иск в суд МФЦА.

Решения суда МФЦА являются окончательными и обязательными для сторон.

Участники клиринга обязаны воздерживаться от действий, направленных на затягивание процесса рассмотрения спора в суде МФЦА, а в случае вынесения судом МФЦА решения – на затягивание сроков исполнения определений и решений, вынесенных судом МФЦА.

КЦ обязуется хранить документы и сведения, связанные с рассмотрением всех споров, возникших в рамках настоящих Правил, в течение не менее 6 лет со дня поступления соответствующих документов и сведений.

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

Статья 3. Порядок проведения клиринга

3.1. КЦ устанавливает требования к порядку, размеру и срокам предоставления Средств обеспечения, осуществляет контроль достаточности предоставленных Средств обеспечения в целях подачи Заявок на заключение Договоров и (или) Оферт ОТС на заключение Внебиржевых договоров ОТС в порядке, предусмотренном настоящими Правилами. КЦ контролирует достаточность предоставленных Средств обеспечения для проведения расчетов по денежным средствам и ценным бумагам в порядке и сроки, установленные настоящими Правилами.

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

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

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

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

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

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

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

3.5. Расчеты по денежным средствам и ценным бумагам в связи с исполнением Договоров проводятся в Даты исполнения Договоров.

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

3.6. Клиринг обязательств, возникших из Договоров, осуществляется на основании информации о заключенных Договорах без получения от Участников клиринга подтверждений о заключении Договоров. КЦ не осуществляет клиринг по Договорам, заключенным на Торгах с нарушением требований, установленных настоящими Правилами.

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

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

3.8. КЦ осуществляет учет на клиринговых регистрах обязательств Участников клиринга из Договоров, Внебиржевых договоров ОТС, учет информации о ценных бумагах и денежных средствах, являющихся Средствами обеспечения.

3.9. КЦ осуществляет клиринг обязательств из Договоров купли-продажи и Договоров репо, заключенных в отношении ценных бумаг, включенных в Список ценных бумаг.

КЦ осуществляет клиринг обязательств из Внебиржевых договоров ОТС при условии, что предмет таких договоров включен в Список обязательств.

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

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

Статья 4. Взаимодействие КЦ с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием и Техническим центром

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

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

4.3. В случае возникновения обстоятельств, вызывающих и (или) создающих предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Системы / Клиринговой системы и (или) непосредственно препятствующих ее нормальному (штатному) функционированию, в том числе, обстоятельств непреодолимой силы, сбоев, неисправностей и отказов оборудования; сбоев и ошибок программного обеспечения; сбоев, неисправностей и отказов систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иных обстоятельств, таких как случаи нарушения правил разграничения доступа и (или) попыток несанкционированного доступа к Системе / Клиринговой системе, КЦ незамедлительно уведомляет об этом Расчетную организацию, Расчетный депозитарий и (или) Технический центр любым из доступных средств связи и предпринимает все возможные меры, направленные на устранение указанных обстоятельств.

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

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

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

- посредством всех имеющихся средств связи, в том числе Системы, направляя информацию по адресам электронной почты, указанным в анкете, предоставляемой в целях регистрации в качестве Участника клиринга, по форме, указанной в Правилах допуска (далее - Анкета Заявителя), и (или) иным доступным способом.

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

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

Статья 5. Общие правила использования информации

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

5.2. К указанной информации относится, в частности, информация об обязательствах, в отношении которых проводится клиринг, информация, предоставляемая Участниками клиринга в соответствии с Правилами допуска, информация о Торговых счетах депо, об операциях по указанным Торговым счетам депо и об операциях с денежными средствами по денежным регистрам, а также иная информация, которая стала известна в связи с оказанием услуг КЦ (далее в настоящей статье - Информация).

5.3. Участник клиринга, заключая договор об оказании клиринговых услуг, соглашается с тем, что Информация или ее часть может быть предоставлена Расчетной организации, Расчетному депозитарию, Техническому центру, МФЦА и иным лицам, имеющим право запрашивать такую информацию.

КЦ, в частности, передает:

- Расчетному депозитарию поручения на операции по Торговым счетам депо, в том числе на зачисление и списание ценных бумаг с Торгового счета депо по инициативе Участника клиринга и (или) Клиентов, а также при проведении расчетов по итоговым нетто-обязательствам и итоговым нетто-требованиям, определенным по обязательствам, возникшим из Договоров, Внебиржевых договоров ОТС;

- Расчетной организации поручения на возврат денежных средств Участника клиринга и (или) Клиентов с Клирингового счета;

- Техническому центру информацию о регистрации, изменении параметров и удалении ТКС Участников клиринга;

- Техническому центру информацию о заключенных Внебиржевых договорах ОТС.

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

Статья 6. Клиринговые регистры

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

- депо регистры, на которых учитываются позиции по ценным бумагам. Применительно к депо регистрам позицией по ценным бумагам является количество ценных бумаг на разделе «Торговый» Торгового счета депо, учтенное КЦ в качестве Средств обеспечения;

- денежные регистры, на которых учитываются позиции по денежным средствам. Применительно к денежным регистрам, позицией по денежным средствам является сумма денежных средств, учтенная КЦ в качестве Средств обеспечения;

- регистры, на которых учитываются денежные средства, учет которых в качестве Средств обеспечения прекращен решением КЦ, принятым в соответствии со статьей 39 настоящих Правил (далее - Блокировочные регистры);

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

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

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

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

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

- позиции Участника клиринга по ценным бумагам, составляющим Средства обеспечения / средства Гарантийного фонда. Указанные позиции учитываются на депо регистрах. Позиция по ценным бумагам рассчитывается для каждого Торгового счета депо и по каждому идентификационному коду / коду ценных бумаг на основании информации об остатках ценных бумаг на разделе «Торговый» Торговых счетов депо, полученной от Расчетного депозитария;

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- ценной бумагой, в отношении которых заключен договор;

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

- ТКС, с указанием которого заключен договор;

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

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

6.4. Внебиржевые договоры купли-продажи валюты ОТС / Внебиржевой валютный своп ОТС учитываются КЦ на регистрах учета позиций, на которых каждая позиция определяется:

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

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

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

- ТКС, с указанием которого заключен Внебиржевой договор купли-продажи валюты ОТС / Внебиржевой валютный своп ОТС;

- суммой денежных средств в соответствующей валюте, соответствующей размеру денежного обязательства по Внебиржевому договору купли-продажи валюты ОТС / Внебиржевому валютному свопу ОТС.

6.5. 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;

- денежная позиция Участника клиринга по учету средств, внесенных в Гарантийные фонды;

Позиции по ценным бумагам могут иметь следующие типы:

- позиция КЦ;
- позиция Участника клиринга - владельца;
- позиция Участника клиринга – номинального держателя;
- позиция Клиента, имеющего отдельный Торговый счет депо;
- позиция Участника клиринга - доверительного управляющего;
- позиция Участника клиринга - владельца, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий;
- позиция Участника клиринга – номинального держателя, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий;
- позиция Участника клиринга - доверительного управляющего, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий;
- позиция Участника клиринга по ценным бумагам, внесенным в Гарантийные фонды;
- позиция Участника клиринга, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий по ценным бумагам, внесенным в Гарантийные фонды.

6.6. Клиринговые регистры группируются в рамках ТКС.

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

6.7. ТКС учитывает соответственно позиции Участника клиринга или Клиента (Клиентов).

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

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

6.10. КЦ открывает регистры учета средств Гарантийных фондов без дополнительных заявлений от Участников клиринга при принятии решения о формировании Гарантийных фондов (для существующих Участников клиринга) или при предоставлении Участнику клиринга допуска к клиринговому обслуживанию (для вновь зарегистрированных Участников клиринга).

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

Статья 7. Виды клиринговых и торговых счетов

7.1. Клиринговые счета используются для внесения Средств обеспечения и Гарантийного фонда в денежных средствах.

КЦ имеет право открыть несколько Клиринговых счетов в одной или нескольких Расчетных организациях.

Информация о реквизитах Клиринговых счетов, предназначенных для учета денежных средств, составляющих Средства обеспечения и Гарантийный фонд, размещается на Сайте КЦ. Об изменении реквизитов указанных счетов КЦ извещает Участников клиринга путем размещения соответствующей информации на Сайте КЦ не позднее, чем за 1 (один) рабочий день до введения этих изменений в действие. Размещение указанной информации на Сайте КЦ считается надлежащим способом информирования Участников клиринга об изменении реквизитов Клиринговых счетов.

КЦ по своему усмотрению определяет Расчетные организации.

Для внесения Средств обеспечения и Гарантийного фонда в ценных бумагах используются Торговые счета депо.

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

КЦ по своему усмотрению определяет Расчетные депозитарии.

Гарантийные фонды учитываются на регистрах учета средств Гарантийных фондов после поступления денежных средств на Клиринговые счета, предназначенные для учета средств Гарантийного фонда и (или) зачисления ценных бумаг на Торговый счет депо, предназначенный для учета ценных бумаг Гарантийного фонда.

7.2. Условием заключения Участником клиринга от своего имени и за свой счет Договоров является открытие этому Участнику клиринга Торгового счета депо владельца или открытие Участником клиринга счета депо в Депозитарии при условии открытия указанному Депозитарию соответствующего Торгового счета депо номинального держателя Депозитария в Расчетном депозитарии.

Условием заключения Участником клиринга от своего имени и за свой счет Внебиржевых договоров ОТС, за исключением:

- Внебиржевых договоров купли-продажи валюты ОТС;
- Внебиржевого валютного свопа ОТС;

является открытие этому Участнику клиринга Торгового счета депо владельца или открытие Участником клиринга счета депо в Депозитарии при условии открытия указанному Депозитарию соответствующего Торгового счета депо номинального держателя Депозитария в Расчетном депозитарии.

Условием заключения Участником клиринга в интересах и за счет Клиентов Договоров является открытие такому Участнику клиринга или его Клиенту, либо Депозитарию, который учитывает права Клиентов на ценные бумаги, Торгового счета депо номинального держателя.

Условием заключения Участником клиринга в интересах и за счет Клиентов Внебиржевых договоров ОТС, за исключением:

- Внебиржевых договоров купли-продажи валюты ОТС;
- Внебиржевого валютного свопа ОТС;

является открытие такому Участнику клиринга или Клиенту, либо Депозитарию, который учитывает права Клиентов на ценные бумаги, Торгового счета депо номинального держателя.

Условием заключения Участником клиринга, являющимся доверительным управляющим, в интересах и за счет Клиентов Договоров является открытие такому Участнику клиринга Торгового счета депо номинального держателя.

Условием заключения Участником клиринга, являющимся доверительным управляющим, в интересах и за счет его клиентов Внебиржевых договоров ОТС, за исключением:

- Внебиржевых договоров купли-продажи валюты ОТС;
- Внебиржевого валютного свопа ОТС;

является открытие такому Участнику клиринга Торгового счета депо номинального держателя.

Участник клиринга открывает отдельные Торговые счета депо для учета средств Гарантийных фондов в ценных бумагах.

7.3. Условием открытия Торгового счета депо является представление Расчетному депозитарию документов, перечень которых определен Расчетным депозитарием.

При открытии Торгового счета депо лицо, которому осуществляется открытие указанного Торгового счета депо, обязано назначить КЦ Оператором Торгового счета депо, проставив соответствующую отметку в заявлении об открытии Торгового счета депо.

Документы могут быть представлены непосредственно в Расчетный депозитарий или в КЦ. КЦ, получивший документы для открытия Торгового счета депо, обязан передать их в Расчетный депозитарий.

7.4. Документы для открытия Торгового счета депо Участнику клиринга Клиенту или Депозитарию предоставляются лицом, которому открывается Торговый счет депо, либо его уполномоченным представителем.

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

7.6. Закрытие Торгового счета депо возможно по инициативе лица, которому открыт указанный Торговый счет депо, или его уполномоченного представителя.

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

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

7.8. Подача лицом, которому открыт Торговый счет депо, или его уполномоченным представителем в КЦ поручения на зачисление ценных бумаг на Торговый счет депо считается заверением о том, что если указанные поручения поданы в связи с совершением сделок и (или) операций, при совершении которых в соответствии с иностранным законодательством подлежит уплате Транзакционный налог, то на день подачи указанного поручения отсутствует нарушение обязанности по уплате Транзакционного налога в связи с совершением указанных сделок и (или) операций.

Подача уполномоченным представителем лица, которому открыт Торговый счет депо, в КЦ поручения на зачисление ценных бумаг на Торговый счет депо или поручения на списание ценных бумаг с такого Торгового счета депо считается заверением уполномоченного лица о наличии у него на день подачи указанного поручения полномочий на его подачу и (или) совершение иных действий, которые могут повлечь проведение операций по указанному Торговому счету депо.

Указанные заверения считаются заверением об обстоятельствах (representations) по смыслу главы 4 AIFC REGULATIONS ON OBLIGATIONS.

Участник клиринга обязан обеспечить, чтобы он и Клиенты надлежащим образом исполняли все обязанности, связанные с уплатой Транзакционного налога самостоятельно и (или) с привлечением иных лиц, в том числе КЦ, согласно статье 36 настоящих Правил, в связи с совершением сделок и (или) операций с ценными бумагами, учитываемыми на Торговом счете депо, которые возлагаются на них в соответствии с применимым законодательством.

7.9. В отношении каждого открытого Торгового счета депо КЦ вправе:

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

Статья 8. Порядок регистрации Торгово-клиринговых счетов

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

Торговый счет депо, не зарегистрированный в составе ТКС, не используется для целей заключения договоров и проведения клиринга обязательств по договорам.

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

Участник клиринга при регистрации ТКС вправе указать один Торговый счет депо, в соответствии с остатками ценных бумаг на разделе «Торговый» которого КЦ будет производить учет позиции по ценным бумагам Участника клиринга.

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

ТКС для учета денежных средств и (или) ценных бумаг, внесенных Участником клиринга в Гарантийные фонды, открывается одновременно с открытием регистра учета средств Гарантийных фондов без подачи Участником клиринга заявления на регистрацию Торгово-клирингового счета.

Перечень допустимых ТКС:

- собственный ТКС Участника клиринга, в который входят позиция Участника клиринга – владельца по ценным бумагам и (или) позиция Участника клиринга по денежным средствам;
- ТКС доверительного управляющего, в который входят позиция по ценным бумагам Участника клиринга - доверительного управляющего и (или) позиция по денежным средствам Участника клиринга - доверительного управляющего;
- клиентский ТКС, в который входят позиция по ценным бумагам Участника клиринга - номинального держателя и (или) клиентская позиция по денежным средствам;
- клиентский ТКС, в который входят позиция по ценным бумагам клиента – доверительного управляющего и (или) позиция по денежным средствам клиента – доверительного управляющего;
- собственный ТКС Участника клиринга, в который входят позиция Участника клиринга - владельца по ценным бумагам, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий и (или) позиция Участника клиринга по денежным средствам;
- ТКС доверительного управляющего, в который входят позиция по ценным бумагам Участника клиринга - доверительного управляющего, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий и (или) позиция Участника клиринга по денежным средствам;

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

- клиентский ТКС, в который входят позиция по ценным бумагам Клиента Участника клиринга, которому открыт Торговый счет депо владельца и (или) клиентская позиция по денежным средствам;

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

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

8.2. ТКС может содержать признак, указывающий на осуществление КЦ обособленного учёта Средств обеспечения Участника клиринга, учитываемых в составе данного ТКС. Обособленный учёт Средств обеспечения Участника клиринга, учитываемых в составе ТКС, устанавливается при регистрации данного ТКС, в случае указания Участником клиринга в заявлении о регистрации Торгово-клирингового счета такого признака. Средства обеспечения, учитываемые в составе ТКС, в отношении которого установлен признак обособленного учета Средств обеспечения (далее – Обособленный ТКС), участвуют в расчете Доступных средств в порядке, предусмотренном статьей 15 настоящих Правил. Признак обособленного учета Средств обеспечения, учитываемых в составе ТКС, открытого Участнику клиринга – доверительному управляющему, а также в составе ТКС, открытого в целях отдельного учета имущества Обособленного клиента Участника клиринга, предоставленного в качестве Средств обеспечения, и обязательств Участника клиринга, возникших из Договоров /Внебиржевых договоров ОТС, заключённых за счет Обособленного клиента Участника клиринга, проставляется автоматически.

8.3. В целях учета в составе ТКС обязательств и требований Участника клиринга из заключенных Внебиржевых договоров купли-продажи валюты ОТС, Внебиржевых валютных свопов ОТС, указанный Участник клиринга вправе зарегистрировать ТКС без указания в заявлении на его регистрацию Торгового счета депо.

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

8.5. КЦ аннулирует регистрацию ТКС в следующих случаях:

- на основании заявления Участника клиринга, который зарегистрировал этот ТКС. В этом случае КЦ аннулирует регистрацию ТКС, в отношении которого подано заявление;

- в случае прекращения договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга, зарегистрировавшим ТКС. В этом случае КЦ аннулирует регистрацию всех ТКС Участника клиринга;

- в случае отсутствия операций с использованием ТКС в течение 6 (шести) месяцев подряд.

Аннулирование регистрации ТКС производится при условии, что на клиринговых регистрах, открытых в рамках данного ТКС, на дату аннулирования регистрации ТКС не учитываются Объекты учета. В случае если на указанную дату на ТКС, в отношении которого было принято решение об аннулировании регистрации, учитываются Объекты учета, КЦ после исполнения / прекращения неисполненных обязательств / требований Участника клиринга осуществляет перевод денежных средств на счет, зарегистрированный Участником клиринга для вывода денежных средств в соответствии с пунктом 8.6 настоящих Правил, уведомляет Расчетный депозитарий о прекращении выполнения функции Оператора Торгового счета депо и осуществляет обратные изменения суммы лимита обеспечения по данному ТКС в сочетании с ТКС, с которыми

были осуществлены первоначальные изменения суммы лимита в соответствии с пунктом 15.8 настоящих Правил.

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

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

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

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

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

8.8. 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.

РАЗДЕЛ II. ПРАВА И ОБЯЗАННОСТИ КЦ И УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА

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

9.1. Порядок взаимодействия Участников клиринга и КЦ, а также права, обязанности Участников клиринга и КЦ определяются положениями нормативных документов и правил МФЦА и договором об оказании клиринговых услуг.

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

- действий или бездействия Участника клиринга, в том числе несвоевременного предоставления Участником клиринга информации и (или) предоставления Участником клиринга неполной или недостоверной информации;
- возникновения Чрезвычайной ситуации (при условии надлежащего информирования Участников клиринга о ее возникновении);
- неисполнения или ненадлежащего исполнения Расчетной организацией, Расчетным депозитарием, лицами, в которых открыты денежные счета Расчетной организации или счета депо Расчетного депозитария, Техническим центром и (или) иными лицами своих обязанностей, в том числе в случае приостановления или прекращения операций с денежными средствами и (или) ценными бумагами (кроме случаев, когда указанное неисполнение или ненадлежащее исполнение допущено по вине КЦ);
- решения и действия органов государственной власти Республики Казахстан, МФЦА, иных органов, учреждений и организаций Республики Казахстан (в том числе внесение изменений в законодательство Республики Казахстан, МФЦА, издание предписания МФЦА в отношении КЦ) и (или) органов государственной власти, регуляторов на финансовом рынке, учреждений, организаций иных государств.

9.3. КЦ не отвечает по обязательствам Участника клиринга.

9.4. Участник клиринга или КЦ освобождается от ответственности за неисполнение или ненадлежащее исполнение своих обязательств, если указанное лицо докажет, что надлежащее исполнение своих обязанностей оказалось невозможным вследствие обстоятельств непреодолимой силы.

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

Статья 10. Оплата услуг КЦ, Торговой площадки, Расчетного депозитария

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

- сумму платы за оказание клиринговых услуг, а также иные платежи, предусмотренные настоящими Правилами или тарифами КЦ, включая вознаграждение за учет Средств обеспечения и вознаграждение за учет средств Гарантийных фондов (далее – Клиринговый сбор);

- сумму платы за оказание услуг по проведению Торгов, а также иные платежи, предусмотренные Правилами торговли или тарифами Торговой площадки (далее – Торговый сбор);

- сумму платы за оказание депозитарных и иных услуг в отношении Торговых счетов депо, предусмотренных условиями осуществления деятельности Расчетного депозитария и тарифами Расчетного депозитария (далее – Депозитарный сбор).

10.2. Размер Клирингового сбора рассчитывается КЦ в соответствии с установленными КЦ тарифами. Тарифы КЦ раскрываются на Сайте КЦ.

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

1) расходов, связанных с уплатой Транзакционного налога и суммы, эквивалентной сумме Транзакционного налога, в соответствии со статьей 36 настоящих Правил. Указанные расходы определяются в соответствии с Регламентом по транзакционным налогам;

2) иных расходов, подлежащих возмещению Участниками клиринга в соответствии с настоящими Правилами, тарифами КЦ и (или) тарифами за услуги Расчетных организаций.

10.3. Размер Торгового сбора рассчитывается и взимается КЦ в соответствии с тарифами Торговой площадки, за исключением случаев, если указанными тарифами или Правилами торговли предусмотрено, что Торговый сбор рассчитывается и взимается непосредственно Торговой площадкой.

10.4. Размер Депозитарного сбора рассчитывается и взимается КЦ в соответствии с тарифами Расчетного депозитария, за исключением случаев, если указанными тарифами или условиями осуществления депозитарной деятельности предусмотрено, что Депозитарный сбор рассчитывается и взимается непосредственно Расчетным депозитарием.

10.5. Обязательства по уплате сборов, взимаемых КЦ с Участников клиринга, допускаются к клирингу на основании информации о размерах сборов, рассчитанных КЦ. При этом обязательства по уплате сборов, связанных с заключением Договоров, допускаются к клирингу с момента регистрации соответствующего Договора в реестре Договоров, а обязательства по уплате иных сборов допускаются к клирингу с момента возникновения оснований для взимания соответствующих сборов.

10.6. Если иное не предусмотрено настоящим пунктом или тарифами КЦ, допущенные к клирингу обязательства по уплате сборов, взимаемых в связи с заключением Участниками клиринга Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в дату заключения Участниками клиринга соответствующих договоров, а в случае заключения указанных договоров по истечении времени формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов – в ближайший клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов, формируемый после даты заключения соответствующего договора. Обязательства по уплате сборов, взимаемых в связи с заключением Участниками клиринга Пар договоров / Внебиржевых валютных свопов ОТС включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в дату заключения Пары договоров / Внебиржевого валютного свопа ОТС.

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

РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

Статья 11. Способы снижения рисков при осуществлении клиринга

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

- предъявляет требования к финансовой устойчивости Участников клиринга и осуществляет мониторинг финансовой устойчивости Участников клиринга не реже одного раза в квартал;
- проверяет соответствие Участников клиринга требованиям, предъявляемым КЦ к Участникам клиринга;
- предъявляет к Участникам клиринга требование о внесении Средств обеспечения;
- осуществляет предварительный контроль достаточности Средств обеспечения по каждому Участнику клиринга при подаче Заявок на заключение Договоров и Оферт ОТС, в которых указан данный Участник клиринга (в случае осуществления указанного контроля);
- осуществляет расчет и контроль Доступных средств при подаче Заявок и Оферт ОТС, при заключении Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, при исполнении / прекращении обязательств из Договоров и Внебиржевых договоров ОТС, при возврате Средств обеспечения;
- устанавливает риск-параметры и лимиты в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;
- формирует Гарантийный фонд / Гарантийные фонды для обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу;
- не реже одного раза в течение Расчетного дня осуществляет переоценку Гарантийного обеспечения, Дополнительного обеспечения, Средств обеспечения и контроль достаточности Доступных средств, в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование;

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

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

- ограничивает размер своей ответственности в соответствии со статьей 13 настоящих Правил;

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

11.2. КЦ устанавливает перечень валют и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств обеспечения, в порядке, установленном статьей 19 настоящих Правил.

11.3. Ценные бумаги, эмитентом которых является Участник клиринга или связанное с ним лицо, учитываемые по ТКС, в состав которого входит Торговый счет депо владельца такого Участника клиринга, учитываются при определении стоимости Средств обеспечения в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров с дисконтом 100%.

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

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

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

11.6. КЦ вправе утвердить список валютных пар и соответствующих им дат исполнения (далее - Список валютных пар с полным обеспечением). Участник клиринга вправе заключать Внебиржевые договоры ОТС в отношении валютной пары с соответствующей датой исполнения, указанными в Списке валютных пар с полным обеспечением (далее – Внебиржевой валютный договор ОТС с полным обеспечением), на условиях полного обеспечения как со стороны покупателя, так и со стороны продавца, то есть при условии наличия в качестве Средств обеспечения валюты в сумме, достаточной для надлежащего исполнения обязательств по указанным договорам. Список валютных пар с полным обеспечением публикуется на Сайте КЦ.

Статья 12. Обеспечение исполнения обязательств Участников клиринга

12.1. Если иное не предусмотрено положениями нормативных документов и правил МФЦА, а также настоящими Правилами, обязательства Участников клиринга, допущенные к клирингу, обеспечиваются Средствами обеспечения и средствами Гарантийных фондов.

12.2. Условием обеспечения исполнения допущенных к клирингу обязательств Участников клиринга является обязательное предварительное резервирование Участниками клиринга на Клиринговых счетах денежных средств и (или) на разделе «Торговый» Торговых счетов депо ценных бумаг для прохождения процедуры контроля обеспечения в порядке, определенном статьями 21 и 22 настоящих Правил.

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

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

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

где:

Penalty – величина штрафа;

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

Forfeit rate prepayment – штрафная ставка, установленная КЦ для валюты, в которой возникла недостаточность по денежным средствам, и определенная в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

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

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

Обязательство Участника клиринга по уплате штрафа допускается к клирингу в момент его возникновения и включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов, формируемый в соответствии со статьей 28 настоящих Правил, в дату допуска указанного обязательства к клирингу.

12.3. Имущество, предназначенное для использования в качестве Средств обеспечения, могут составлять денежные средства, а также ценные бумаги. Имущество, обремененное залогом, не может являться Средствами обеспечения.

12.4. Имущество, являющееся Средствами обеспечения, может использоваться для обеспечения исполнения и (или) исполнения обязательств, допущенных к клирингу, в том числе итоговых нетто-обязательств.

12.5. Условием обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга является передача имущества, составляющего Средства обеспечения, до заключения Договоров / Внебиржевых договоров ОТС.

12.6. Доходы от денежных средств, являющихся Средствами обеспечения, не зачисляются в Средства обеспечения.

12.7. Средства обеспечения учитываются на Клиринговых счетах и на разделе «Торговый» Торговых счетов депо.

12.8. Передача имущества, предназначенного для использования в качестве Средств обеспечения, осуществляется путем зачисления денежных средств на Клиринговые счета, а ценных бумаг - на раздел «Торговый» Торговых счетов депо.

Имущество включается КЦ в состав Средств обеспечения и учитывается в качестве Средств обеспечения с момента зачисления денежных средств и (или) ценных бумаг на соответствующие счета. Особенности внесения и возврата Средств обеспечения определены в статье 19 настоящих Правил.

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

- при недостаточности Доступных средств Заявка, поданная Участником клиринга, не регистрируется в реестре Заявок и (или) КЦ не акцептует Оферту ОТС;

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

- итоговые нетто-обязательства Участника клиринга должны обеспечиваться Средствами обеспечения на Дату исполнения, на дату исполнения Внебиржевого договора ОТС в полном объеме (за исключением случаев, когда условиями соответствующего договора предусмотрено иное): итоговое нетто-обязательство по денежным средствам в размере нетто-обязательства - денежными средствами в соответствующей валюте, итоговое нетто-обязательство по ценным бумагам в размере нетто-обязательства - ценными бумагами того же эмитента, вида, категории, типа, выпуска.

12.10. Обязанность по представлению КЦ достаточного количества имущества, являющегося Средствами обеспечения, возлагается на Участника клиринга.

12.11. КЦ вправе использовать в своих интересах денежные средства, являющиеся Средствами обеспечения. В этом случае денежные средства, являющиеся Средствами обеспечения, зачисляются КЦ на собственный банковский счет КЦ.

КЦ обязан вернуть в состав Средств обеспечения денежные средства в сумме и срок, которые необходимы для удовлетворения требований, обеспеченных Средствами обеспечения.

Доходы от использования КЦ в своих интересах денежных средств, являющихся Средствами обеспечения, не зачисляются в Средства обеспечения.

12.12. КЦ в целях обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу, любого из Участников клиринга, формирует один или несколько Гарантийных фондов. Условия и порядок формирования Гарантийных фондов указаны в настоящей статье и в статье 14 настоящих Правил

12.13. Особенности внесения и возврата взноса в Гарантийный фонд определены в статье 20 настоящих Правил.

12.14. Передача имущества, предназначенного для использования в качестве взноса в Гарантийный фонд, осуществляется путем зачисления денежных средств на Клиринговые счета, а также ценных бумаг на Торговые счета депо, предназначенные для учета средств Гарантийных фондов.

12.15. КЦ вправе использовать в своих интересах денежные средства, составляющие Гарантийный фонд. В этом случае денежные средства, составляющие Гарантийный фонд, зачисляются КЦ на его собственный банковский счет.

КЦ обязан вернуть в состав Гарантийного фонда денежные средства в сумме и срок, которые необходимы для удовлетворения требований, обеспеченных Гарантийным фондом.

Доходы от использования КЦ в своих интересах денежных средств, составляющих Гарантийный фонд, не зачисляются в Гарантийный фонд, если решением КЦ не предусмотрено иное.

КЦ вправе принять решение о начислении и выплате процентов по взносам Участников клиринга в Гарантийный фонд. Процентная ставка, порядок и сроки начисления и выплаты указанных процентов определяются решением КЦ. Кроме того,

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

Статья 13. Ограничение ответственности центрального контрагента (уровни защиты центрального контрагента)

13.1. В случае наличия Участника клиринга, не исполнившего свои обязательства (далее – Должник), учитываемые на клиринговых регистрах ТКС, КЦ использует имущество и меры в следующей очередности:

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

Имущество каждой последующей очереди используется только в случае недостаточности имущества предыдущей очереди в порядке, установленном статьей 18 настоящих Правил.

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

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

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

Статья 14. Гарантийные фонды

14.1. КЦ формирует один или несколько Гарантийных фондов за счет взносов Участников клиринга.

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

14.3. В качестве взносов в Гарантийные фонды могут быть внесены денежные средства и (или) ценные бумаги.

Имущество, обремененное залогом, не может составлять Гарантийные фонды.

14.4. Перечень валют и (или) ценных бумаг, внесение которых возможно в качестве взносов в Гарантийные фонды, устанавливается КЦ.

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

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

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

14.6. Совокупный размер Гарантийных фондов определяется КЦ исходя из необходимости его поддержания на уровне, достаточном для покрытия потенциальных убытков КЦ в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения допущенных к клирингу обязательств двумя крупнейшими по величине потенциальных потерь Участниками клиринга. При этом размер потенциальных убытков определяется с доверительной вероятностью 99,5% с учетом Средств обеспечения таких Участников клиринга и Выделенного капитала КЦ.

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

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

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

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

КЦ в порядке, определенном настоящими Правилами, и по форме, указанной в Регламенте клиринга, уведомляет Участников клиринга о доле имущества соответствующего Участника клиринга в Гарантийном фонде.

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

Статья 15. Порядок расчета величины Доступных средств

15.1. Величина Доступных средств используется для проверки возможности подачи Участником клиринга Заявок в целях заключения Договоров, направления Оферт ОТС, прекращения обязательств из Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, возврата Участнику клиринга Средств обеспечения, предъявления Маржинального требования и контроля за его исполнением. Указанная проверка осуществляется исходя из анализа изменения величины Доступных средств Участника клиринга как до, так и после совершения действий, указанных в пункте 15.2 настоящих Правил.

15.2. КЦ рассчитывает величину Доступных средств при изменении размера Средств обеспечения Участника клиринга, при подаче Участником клиринга Заявок на

заключение Договоров, отзыве или аннулировании таких Заявок, при заключении Участником клиринга Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, при направлении Участником клиринга Оферт ОТС, исполнении / прекращении обязательств из Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, изменении риск-параметров.

15.3. Величина Доступных средств Участника клиринга рассчитывается с учетом Объявленных Заявок и направленных Оферт ОТС данного Участника клиринга.

15.4. КЦ осуществляет расчет следующих величин:

15.4.1. Величина Доступных средств по каждому ТКС Участника клиринга:

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

где:

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

CLT_{TCA} - величина оценочной стоимости Средств обеспечения по данному ТКС, в Валюте Доступных средств;

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

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

15.4.2. Величина Доступных средств Участника клиринга:

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

где:

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

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

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

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

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

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

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

15.7. Перечень Валют Доступных средств устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ.

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

В указанном заявлении Участник клиринга указывает:

- сумму лимита обеспечения;

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

Статья 16. Маржинальные требования

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

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

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

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

где:

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

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

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

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

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

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

Маржинальное требование Участника клиринга считается исполненным, когда величина Маржинального требования, рассчитанная в соответствии с формулой, указанной в пункте 16.2 настоящих Правил, станет неотрицательной величиной.

16.4. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем внесения Средств обеспечения в порядке, установленном статьей 19 настоящих Правил.

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

- исполнение обязательств из Договоров с наступившей Датой исполнения и (или) обязательств из Внебиржевых договоров ОТС с наступившей датой исполнения;
- отзыв объявленных Заявок / направленных Оферт ОТС;
- заключение Договоров / Внебиржевых договоров ОТС.

Статья 17. Последствия нарушения Маржинального требования

17.1. В случае нарушения Участником клиринга Маржинального требования к такому Участнику клиринга КЦ применяет процедуру принудительного закрытия в соответствии с настоящей статьей.

КЦ уведомляет Торговую площадку о невозможности регистрации новых Заявок, подаваемых Должником.

КЦ уведомляет Должника о невозможности акцепта направленных Оферт ОТС.

КЦ уведомляет Торговую площадку о необходимости удаления зарегистрированных Заявок, поданных Должником.

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

При наличии у Участника клиринга, у которого возникло Маржинальное требование, отрицательных Доступных средств по Обособленному ТКС процедура принудительного закрытия производится в первую очередь в отношении такого ТКС до момента, когда Доступные средства Обособленного ТКС перестанут быть отрицательными.

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

17.2. В целях осуществления процедуры принудительного закрытия КЦ вправе:

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

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

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

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

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

данной ценной бумаге / валюте каждого Участника клиринга, с которым КЦ заключает договоры;

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

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

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

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

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

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

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

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

При наличии у Должника отрицательных Доступных средств по Обособленному ТКС погашение Задолженности Должника в размере, равном абсолютному значению указанных отрицательных Доступных средств, производится за счет Средств обеспечения, учитываемых на денежных и депо регистрах, относящихся к такому Обособленному ТКС. Если после указанного использования Средств обеспечения сохраняется отрицательное значение Доступных средств по такому Обособленному ТКС, то погашение Задолженности Должника в размере, равном абсолютному значению указанных отрицательных Доступных средств, производится за счет Средств обеспечения, учитываемых на собственных ТКС Участника клиринга. При этом КЦ вправе осуществлять процедуру принудительного закрытия в отношении собственных ТКС Участника клиринга.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

17.12. В случае отсутствия у Должника Средств обеспечения в иной валюте и (или) ценных бумагах либо если в результате использования КЦ Средств обеспечения Должника в иной валюте и (или) ценных бумагах Задолженность Должника не погашена полностью и Должник не внес имущество, являющееся Средством обеспечения, для погашения Задолженности, КЦ вправе предпринять действия в соответствии со статьями 22 настоящих Правил и (или) вправе требовать от такого Должника погашения Задолженности в судебном порядке.

Статья 18. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов и использования Выделенного капитала

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

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

18.3. В случае использования для погашения Задолженности Должника вноса Должника в Гарантийный фонд, выраженного в валюте, отличной от Валюты Доступных средств, в счет погашения указанной Задолженности перечисляется сумма, полученная в результате продажи указанной валюты за Валюту Доступных средств. КЦ продаёт валюту за Валюту Доступных средств на условиях, указанных в статье 17 настоящих Правил.

В случае использования для погашения Задолженности Должника вноса Должника в Гарантийный фонд в ценных бумагах, в счет погашения указанной Задолженности перечисляется сумма, полученная в результате продажи указанных ценных бумаг за Валюту Доступных средств. КЦ продаёт ценные бумаги за Валюту Доступных средств на условиях, указанных в статье 17 настоящих Правил.

18.4. Погашение Задолженности Должника за счет вноса Должника в Гарантийный фонд осуществляется КЦ без согласия и предварительного уведомления Должника.

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

18.6. В случае если Задолженность Должника возникла в связи с наличием отрицательных Доступных средств по ТКС, входящих в Группу ТКС, и вноса Должника в Гарантийный фонд оказалось недостаточно для полного погашения Задолженности Должника, КЦ производит принудительное закрытие Должника по Обособленным ТКС.

18.7. В случае если Задолженность Должника возникла в связи с наличием отрицательных Доступных средств по Обособленному ТКС и вноса Должника в Гарантийный фонд оказалось недостаточно для полного погашения Задолженности Должника, КЦ производит следующие действия:

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

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

Величина Дополнительного обеспечения и величина Доступных средств по собственным ТКС определяются на момент начала выполнения действий, указанных в пункте 17.1 настоящих Правил.

18.8. В случае если Задолженность не погашена полностью, КЦ уменьшает величину Выделенного капитала и величину Задолженности на минимальное значение из суммы Задолженности Должника и величины Выделенного капитала.

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

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

В случае использования для погашения Задолженности Должника взноса Добросовестного Участника клиринга в Гарантийный фонд, выраженного в валюте, отличной от Валюты Доступных средств, в счет погашения указанной Задолженности перечисляется сумма, полученная в результате продажи указанной валюты за Валюту Доступных средств на условиях, указанных в статье 17 настоящих Правил.

В случае использования для погашения Задолженности Должника взноса Добросовестного Участника клиринга в Гарантийный фонд в ценных бумагах, в счет погашения указанной Задолженности перечисляется сумма, полученная в результате продажи указанных ценных бумаг за Валюту Доступных средств. КЦ продаёт ценные бумаги за Валюту Доступных средств на условиях, указанных в статье 17 настоящих Правил.

Погашение оставшейся Задолженности Должника осуществляется пропорционально Размелу взноса каждого из Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд. Взносы Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд уменьшаются на сумму средств, использованных для погашения Задолженности Должника.

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

18.10. Требования КЦ по Задолженности Должника прекращаются в объеме использованного взноса Должника в Гарантийные фонды и использованных взносов Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд в Размелу взносов. При этом у Должника возникает обязанность возместить использованные средства Гарантийных фондов.

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

Уведомление о необходимости возмещения использованных средств Гарантийных фондов, содержащее информацию о сумме использованных средств, подлежащей возмещению Должником, о сроке, в течение которого указанные средства Гарантийных фондов должны быть возмещены, направляется Должнику в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном

виде, не позднее Расчетного дня, следующего за датой использования средств Гарантийных фондов.

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

18.12. КЦ использует средства, возмещенные Должником, для увеличения размера взносов Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд;

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

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

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

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.

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

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

18.16. В случае если Должник не погасил Задолженность в соответствии с настоящей статьей, КЦ производит действия, направленные на уменьшение требований Добросовестных Участников клиринга по возврату Средств обеспечения на размер Задолженности Должника в объеме, определенном как положительная разница между величиной Задолженности Должника до начала использования взносов Добросовестных Участников клиринга в Гарантийные фонды и размером использованных в целях погашения указанной Задолженности взносов Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд.

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

Определение размера требований в соответствии с настоящей статьей Правил производится КЦ не позднее следующего дня после истечения срока погашения Задолженности Должником в соответствии с пунктом 18.14 настоящих Правил.

В процессе клиринга КЦ формирует и предоставляет Участникам клиринга информацию о рассчитанных требованиях по Дополнительному обеспечению в порядке, установленном статьей 34 настоящих Правил.

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

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ, ИСПОЛЬЗОВАНИЯ И ВОЗВРАТА СРЕДСТВ ОБЕСПЕЧЕНИЯ

Статья 19. Порядок внесения, использования и возврата Средств обеспечения

19.1. В качестве Средств обеспечения могут быть внесены денежные средства, включенные в Перечень валют, ценные бумаги, включенные в Перечень ценных бумаг.

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

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

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

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

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

19.5. Средства обеспечения используются:

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

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

19.6. Внесение Средств обеспечения в валюте Участником клиринга возможно следующими способами:

- путем перевода денежных средств на Клиринговый счет;
- путем перевода денежных средств между денежными регистрами на основании поручения на перевод денежных средств, поданного Участником клиринга с использованием Системы;
- путем перевода денежных средств между денежными регистрами на основании заявления на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения;
- путем перевода денежных средств между денежными регистрами в связи исполнением итоговых нетто-обязательств / нетто-требований Участниками клиринга в соответствии с настоящими Правилами.

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

В случае поступления денежных средств на Клиринговый счет по расчётным документам с неправильно или неполно указанным назначением платежа, эти средства не включаются в состав Средств обеспечения. Платательщик должен предоставить письмо, подтверждающего соответствующее назначение платежа по внесению Средств обеспечения в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью. Указанное в настоящем абзаце письмо может быть направлено в КЦ банком, являющимся отправителем денежных средств по расчётным документам с неправильно или неполно указанным назначением платежа с использованием системы SWIFT.

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

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

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

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

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

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

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

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

- если сумма денежных средств в соответствующей валюте, указанная Участником клиринга в поручении, не превышает сумму денежных средств в этой же валюте, учитываемых в качестве Средств обеспечения Участника клиринга по денежному регистру, с которого денежные средства должны быть списаны;

- если остатка денежных средств на денежном регистре после списания будет достаточно для обеспечения исполнения обязательств по денежным средствам;

- если величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, соответствующему денежному регистру, с которого денежные средства, учитываемые в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, должны быть списаны, а также величина Доступных средств Участника клиринга в результате такого списания не станут отрицательными и величина оценочной стоимости Средств обеспечения Участника клиринга не станет меньше размера обязательств по передаче Дохода, в случае наличия у Участника клиринга таких обязательств;

- если величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, соответствующему денежному регистру, с которого денежные средства, учитываемые в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, должны быть списаны, а также величина Доступных средств Участника клиринга были отрицательными до момента такого списания, то указанные величины Доступных средств, рассчитанные с учетом такого списания, не станут меньше величин Доступных средств, рассчитанных до момента такого списания.

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

КЦ может осуществить возврат Участнику клиринга денежных средств в соответствии с поручением на возврат денежных средств при невыполнении указанных условий в пределах суммы, равной величине итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам, подлежащего исполнению в дату получения поручения на возврат денежных средств. При этом при наличии условий, указанных в пункте 24.10 настоящих Правил, КЦ осуществляет в отношении указанного Участника клиринга процедуру урегулирования ненадлежащего исполнения обязательств в порядке, определенном статьей 25 настоящих Правил, а при нарушении указанным Участником клиринга Маржинального требования, КЦ применяет к нему процедуру принудительного закрытия в порядке, определенном статьей 17 настоящих Правил.

После списания денежных средств с Клирингового счета Расчетной организацией поручение на возврат денежных средств считается исполненным, сумма денежных средств в соответствующей валюте, учитываемая в качестве Средств обеспечения Участника клиринга по денежному регистру, с которого списывались денежные средства, уменьшается на сумму возвращенных денежных средств, обязательство КЦ по возврату денежных средств в сумме списания считается прекращенным.

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

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

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

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

- Заявление на замену денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, направляется Участником клиринга в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, или посредством Системы в виде электронного сообщения, подписанного АСП. Указанное заявление должно содержать указание на валюту и количество денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, подлежащих замене;

- Замена денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, осуществляется КЦ по курсу на момент совершения операции.

- КЦ исполняет заявление на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, не позднее сроков, указанных в Регламенте клиринга;

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

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

19.13. Внесение Средств обеспечения в ценных бумагах возможно путем зачисления ценных бумаг на раздел «Торговый» Торгового счета депо.

19.14. Зачисление ценных бумаг на Торговый счет депо осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий и составленного на основании поручения лица, которому открыт Торговый счет депо, либо его уполномоченного представителя, поданного в КЦ. Исполнение поручения КЦ на зачисление ценных бумаг на Торговый счет депо осуществляется Расчетным депозитарием в соответствии с внутренними документами Расчетного депозитария.

КЦ учитывает на соответствующих клиринговых регистрах информацию о зачислении ценных бумаг на разделе «Торговый» Торгового счета депо после получения

от Расчетного депозитария отчета, подтверждающего зачисление ценных бумаг на раздел «Торговый» соответствующего Торгового счета депо.

После зачисления ценных бумаг на Торговый счет депо у КЦ возникает обязательство вернуть ценные бумаги Участнику клиринга.

КЦ вправе принять решение в соответствии со статьей 39 настоящих Правил, устанавливающее ограничения на зачисление ценных бумаг на Торговый счет депо. В случае принятия указанного решения об установлении ограничений КЦ информирует о таком решении Участников клиринга лиц путем направления Электронного документа, подписанного Электронной подписью, либо на Сайте КЦ.

19.15. Списание ценных бумаг с Торгового счета депо осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий и составленного на основании поручения лица, которому открыт Торговый счет депо, либо его уполномоченного представителя, поданного в КЦ. Исполнение поручения КЦ на списание ценных бумаг с Торгового счета депо осуществляется Расчетным депозитарием в соответствии с внутренними документами Расчетного депозитария.

КЦ, получив поручение на списание ценных бумаг с раздела «Торговый» Торгового счета депо от лица, которому открыт Торговый счет депо, либо его уполномоченного представителя, уменьшает Средства обеспечения Участника клиринга, учитываемые на соответствующих клиринговых регистрах, и дает поручение Расчетному депозитарию на списание ценных бумаг с раздела «Торговый» Торгового счета депо, при соблюдении следующих условий:

1) при списании ценных бумаг, которые не входят в Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения, с раздела «Торговый» Торгового счета депо количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает значения соответствующей позиции по ценным бумагам Участника клиринга, учитываемой на депо регистре.

2) при списании ценных бумаг, которые входят в Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения, с раздела «Торговый» Торгового счета депо:

- количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает значения соответствующей позиции по ценным бумагам Участника клиринга;

- величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, в состав которого входит соответствующая позиция по ценным бумагам, а также величина Доступных средств Участника клиринга в результате такого списания не станут отрицательными;

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

- величина оценочной стоимости Средств обеспечения Участника клиринга не станет меньше размера обязательств по передаче Дохода, в случае наличия у Участника клиринга таких обязательств.

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

КЦ, получив поручение на списание ценных бумаг с раздела «Неторговый» Торгового счета депо от лица, которому открыт Торговый счет депо, либо его уполномоченного представителя, дает поручение Расчетному депозитарию на списание ценных бумаг с раздела «Неторговый» Торгового счета депо, при условии, что количество

ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает количество ценных бумаг, учитываемых на разделе «Неторговый» Торгового счета депо.

Поручение на списание ценных бумаг с Торгового счета депо лица, которому открыт Торговый счет депо, либо его уполномоченного представителя считается исполненным с момента получения КЦ от Расчетного депозитария информации о списании ценных бумаг с Торгового счета депо.

КЦ вправе принять решение в соответствии со статьей 39 настоящих Правил, устанавливающее ограничения на списание ценных бумаг с Торгового счета депо. В случае принятия указанного решения об установлении ограничений КЦ информирует о таком решении Участников клиринга путем направления Электронного документа, подписанного Электронной подписью, либо на Сайте КЦ.

19.16. КЦ вправе потребовать от лица, которому открыт Торговый счет депо, либо его уполномоченного представителя, направившего поручение на списание ценных бумаг, предоставления документов и (или) информации, требуемых Расчетным депозитарием при списании ценных бумаг с Торгового счета депо. Если лицо, которому открыт Торговый счет депо, либо его уполномоченный представитель не исполнил надлежащим образом обязанность по предоставлению КЦ указанных документов и (или) информации, то КЦ не несет ответственности за возможное неисполнение Расчетным депозитарием поручения на списание ценных бумаг с Торгового счета депо. Порядок и срок предоставления указанных документов и информации указывается КЦ в соответствующем запросе.

19.17. КЦ вправе отказать лицу, которому открыт Торговый счет депо, либо его уполномоченному представителю в приеме поручения на зачисление ценных бумаг на Торговый счет депо, на списание ценных бумаг с Торгового счета депо или перевод ценных бумаг между Торговыми счетами депо при проведении корпоративного события, в результате которого изменяется количество ценных бумаг. В случае принятия решения об установлении ограничений по приему указанных поручений КЦ информирует о таком решении Участников клиринга путем направления Электронного документа, подписанного Электронной подписью, либо на Сайте КЦ.

19.18. КЦ не осуществляет учет на клиринговых регистрах ТКС денежных средств и (или) ценных бумаг в дату регистрации ТКС и (или) в дату регистрации Торгового счета депо.

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

Информация о размере Средств обеспечения и об изменении размера Средств обеспечения передаётся Участнику клиринга в составе сведений, предоставляемых КЦ Участникам клиринга в соответствии со статьей 34 настоящих Правил.

Статья 20. Порядок внесения и возврата взноса в Гарантийные фонды

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

20.2. Участники клиринга перечисляют денежные средства на Клиринговые счета, предназначенные для учета средств Гарантийных фондов, с обязательным указанием в назначении платежа слов «Гарантийный фонд», вида Гарантийного фонда, номера и даты договора об оказании клиринговых услуг.

КЦ учитывает денежные средства, переведенные на Клиринговый счет, в качестве взноса в соответствующий Гарантийный фонд по денежному регистру, который соответствует ТКС Участника клиринга, открытому для учета средств Гарантийных фондов, после получения от Расчетной организации выписки по Клиринговому счету, содержащей информацию, в том числе о размере взноса и лице, предоставившем указанный взнос. Указанные денежные средства, переведенные Участником клиринга, учитываются на указанном денежном регистре не ранее допуска этого Участника клиринга к клиринговому обслуживанию.

Внесение денежных средств в качестве взноса в Гарантийный фонд может быть осуществлено путем перевода денежных средств с ТКС, предназначенного для учета Средств обеспечения, с соблюдением условий, предусмотренных пунктом 19.8 настоящих Правил.

20.3. Зачисление ценных бумаг на Торговый счет депо, предназначенный для учета средств Гарантийного фонда, осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий и составленного на основании поручения Участника клиринга или Депозитария, поданного в КЦ. Исполнение поручения КЦ на зачисление ценных бумаг на Торговый счет депо осуществляется Расчетным депозитарием в соответствии с внутренними документами Расчетного депозитария.

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

Внесение ценных бумаг в качестве взноса в Гарантийный фонд может быть осуществлено путем перевода ценных бумаг с раздела «Торговый» Торгового счета депо, предназначенного для учета Средств обеспечения, с соблюдением условий, предусмотренных пунктом 19.15 настоящих Правил.

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

В случае если стоимость валюты и (или) ценных бумаг, внесенных в качестве взноса в Гарантийный фонд, становится меньше Размера взноса, КЦ уведомляет Участника клиринга о необходимости увеличения взноса в Гарантийный фонд. Участник клиринга обязан увеличить свой взнос в Гарантийный фонд до Размера взноса.

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

20.5. В случае поступления денежных средств на Клиринговые счета по платёжным поручениям с неправильно или неполно указанным назначением платежа, эти средства не включаются в состав Гарантийного фонда. Плательщик должен предоставить письмо за подписью руководителя и главного бухгалтера организации плательщика, подтверждающего соответствующее назначение платежа по внесению средств в состав Гарантийных фондов.

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

Информация об увеличении Размера взноса, о необходимости внесения дополнительных денежных средств в валюту, а также ценных бумаг для увеличения текущего размера взноса в соответствующий Гарантийный фонд до вновь установленного

Размера вноса, а также о сроке вступления измененного Размера вноса в силу размещается на Сайте КЦ, а также направляется каждому Участнику клиринга в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном виде.

20.7. Дополнительные денежные средства, а также ценные бумаги, внесенные Участником клиринга, увеличивают учитываемый КЦ размер вноса Участника клиринга в соответствующий Гарантийный фонд и размер обязательства КЦ по возврату денежных средств, а также ценных бумаг в размере вноса, внесенного соответствующим лицом.

20.8. Возврат Участнику клиринга его вноса в соответствующий Гарантийный фонд осуществляется по усмотрению КЦ в виде имущества, составляющего взнос Участника клиринга в соответствующий Гарантийный фонд, или денежных средств, стоимость которых определяется исходя из стоимости имущества, составляющего соответствующий Гарантийный фонд, рассчитанной на день прекращения договора об оказании клиринговых услуг, пропорционально взносу такого Участника клиринга, в порядке, определенном пунктом 9.5 настоящих Правил.

20.9. Участник клиринга вправе предоставить КЦ заявление о возврате вноса в Гарантийный фонд.

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

Заявление о возврате вноса в Гарантийный фонд 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.

Возврат денежных средств, являющихся взносом Участника клиринга в Гарантийный фонд, осуществляется на счета, предварительно зарегистрированные Участником клиринга в КЦ.

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

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ

Статья 21. Порядок взаимодействия с Торговой площадкой при подаче Заявок и заключении Договоров. Порядок и условия допуска обязательств к клирингу

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

- у Участника торгов, подавшего Заявку, есть действующий допуск к клиринговому обслуживанию;
- по поданной Заявке ценная бумага включена в Список ценных бумаг, валюта включена в Список валют.

При подаче Заявки автоматизированный электронно-цифровой обмен запросами между Системой проведения торгов Торговой площадки и Клиринговой системой осуществляется также в целях проверки, что подача указанной Заявки не приведет к нарушению следующих условий:

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

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

При подаче Участником клиринга Заявки для заключения Договора, предметом которого являются ценные бумаги, включенные в Список ценных бумаг с полным обеспечением, и в котором этот Участник клиринга является продавцом, КЦ проверяет, чтобы суммарно количество ценных бумаг по Договору и объем нетто-требований по ценным бумагам учитываемых на клиринговых регистрах, входящих в состав ТКС, указанного в данной Заявке, не были меньше количества ценных бумаг, требуемых для исполнения обязательств, возникающих из Договора, заключенного на основании указанной Заявки.

21.2. При выполнении условий, указанных в пункте 21.1 настоящих Правил, КЦ подтверждает возможность регистрации Заявки в реестре Заявок. Такая Заявка считается обеспеченной. В этом случае КЦ в качестве Доступных средств по ТКС, определяемому Поданной Заявкой, а также Доступных средств Участника клиринга учитывает величины, рассчитанные с учетом указанной Поданной Заявки.

При невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте 21.1 настоящих Правил, КЦ уведомляет Торговую площадку о невозможности регистрации Поданной Заявки в реестре Заявок. В указанном случае величины Доступных средств Участника клиринга, указанного в Поданной Заявке, не пересчитываются и считаются равными последним рассчитанным величинам.

21.3. В случае аннулирования Объявленной Заявки Торговая площадка извещает КЦ об указанном факте.

При отзыве Объявленной Заявки в определенных в Business Rules случаях осуществляется автоматизированный электронно-цифровой обмен запросами между Системой проведения торгов Торговой площадки и Клиринговой системой в целях проверки возможности ее отзыва. КЦ уведомляет Торговую площадку об отказе в отзыве Объявленной Заявки в случае заключения сделки на организованных торгах, проводимых иностранными биржами, или заключения внебиржевой сделки. Если указанные сделки не заключены, КЦ уведомляет Торговую площадку о возможности отзыва Объявленной Заявки.

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

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

- рассчитывает величину Доступных средств по ТКС, определяемому Объявленной Заявкой, на основании которой был заключен Договор, а также величину Доступных средств Участника клиринга без учета Объявленной Заявки, на основании которой был заключен Договор, но с учетом указанного Договора;

- изменяет с учетом указанного заключенного Договора купли-продажи / Договора репо нетто-обязательство и (или) нетто-требование Участника клиринга из Договоров в валюте и ценных бумагах с указанием даты исполнения, соответствующей

Дате исполнения по заключенному Договору, учитываемые по регистру учета позиций, соответствующему ТКС, определяемому Объявленной Заявкой, на основании которой заключен указанный Договор.

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

Статья 22. Порядок заключения Внебиржевых договоров ОТС на основании Оферт ОТС

22.1. Направление Оферт ОТС осуществляется с использованием Системы.

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

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

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

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

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

- Оферта ОТС направляется в период времени, который установлен КЦ и в течение которого могут направляться Оферты ОТС;

- ценная бумага, в отношении которой (ого) направлена Оферта ОТС, включен(а) в перечень предметов обязательств в Списке обязательств, а также в перечень ценных бумаг, в отношении которых могут направляться Оферты ОТС (в случае его установления), а также валюта цены и валюта расчетов, указанные в Оферте ОТС, являются валютами, установленными КЦ для данной ценной бумаги;

- валюты валютной пары, в отношении которой направлена Оферта ОТС, включены в перечень предметов обязательств в Списке обязательств, а также в перечень валютных пар, в отношении которых могут направляться Оферты ОТС (в случае его установления);

- Оферта ОТС соответствует иным требованиям, установленным КЦ;

- величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, определяемому направленной Офертой ОТС, а также величина Доступных средств Участника клиринга рассчитанные с учетом Оферты ОТС, не станут отрицательными;

- если величина Доступных средств по ТКС, определяемому направленной Офертой ОТС, а также величина Доступных средств Участника клиринга были отрицательными до момента направления Оферты ОТС, то указанные величины Доступных средств, рассчитанные с учетом направленной Оферты ОТС, не станут меньше величин Доступных средств, рассчитанных до момента направления указанной Оферты ОТС.

- если Оферта ОТС направлена на заключение Внебиржевого валютного договора ОТС с полным обеспечением, КЦ проверяет, чтобы суммарно сумма передаваемой валюты по Внебиржевому валютному договору ОТС с полным обеспечением и объем нетто-требований по этой валюте, учитываемых на клиринговых регистрах, входящих в состав ТКС, указанного в данной Оферте ОТС, не были меньше суммы валюты, требуемой для исполнения обязательств, возникающих из Внебиржевого валютного договора ОТС с полным обеспечением, заключенного на основании указанной Оферты ОТС.

При направлении Участником клиринга Оферты ОТС для заключения Внебиржевого договора ОТС, предметом которого являются ценные бумаги, включенные в Список ценных бумаг с полным обеспечением, и в котором этот Участник клиринга является продавцом, КЦ проверяет, чтобы суммарно количество ценных бумаг по Внебиржевому договору ОТС и объем нетто-требований по ценным бумагам, учитываемых на клиринговых регистрах, входящих в состав ТКС, указанного в данной Оферты ОТС, не были меньше количества ценных бумаг, требуемых для исполнения обязательств, возникающих из Внебиржевого договора ОТС, заключенного на основании указанной Оферты ОТС.

22.3. При выполнении условий, указанных в пункте 22.2 настоящих Правил, КЦ вправе заключить с Участником клиринга, направившим Оферту ОТС, Внебиржевой договор ОТС, а в случае наличия встречной Оферты ОТС по отношению к направленной Оферте ОТС КЦ обязан заключить Внебиржевой договор ОТС.

При невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте 22.2 настоящих Правил, Оферта ОТС не направляется, и КЦ информирует Участника клиринга, направившего Оферту ОТС, о невозможности заключения Внебиржевого договора ОТС. В указанном случае величины Доступных средств Участника клиринга, указанного в направленной Оферте ОТС, не пересчитываются и считаются равными последним рассчитанным величинам.

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

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

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

22.7. Акцепт ОТС формируется КЦ в Системе.

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

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

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

22.9. Оферта ОТС может содержать Идентификатор Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга, который может направить Оферту ОТС, имеющую противоположенную первоначальной Оферте ОТС направленность (далее – связанная Оферта ОТС). При направлении Оферты ОТС и связанной Оферты ОТС заключаются одновременно два Внебиржевых договора ОТС между КЦ и каждым из Участников клиринга, направивших Оферту ОТС и связанную Оферту ОТС.

22.10. В целях настоящего пункта под Внебиржевым договор ОТС понимается Внебиржевой договор ОТС, предметом которого являются ценная бумага.

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

- в Оферте ОТС и в Акцепте ОТС указаны одинаковые коды ценных бумаг, которые будут являться предметом этого Внебиржевого договора ОТС;

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

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

- Ставка репо, указанная в Акцепте ОТС, направленном на покупку ценных бумаг, не больше, чем Ставка репо, указанная в Оферте ОТС, направленной на продажу ценных бумаг, или Ставка репо, указанная в Акцепте ОТС, направленном на продажу ценных бумаг, не меньше, чем Ставка репо, указанная в Оферте ОТС, направленной на покупку ценных бумаг (для заключения Внебиржевых договоров репо ОТС и Пар внебиржевых договоров ОТС);

- цена первой части Внебиржевого договора репо ОТС, указанная в Оферте ОТС, совпадает с ценой первой части Внебиржевого договора репо ОТС, указанной в Акцепте ОТС (для заключения Внебиржевых договоров репо ОТС);

- цена Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, указанная в Оферте ОТС, совпадает с ценой Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, указанной в Акцепте ОТС (для заключения Пар внебиржевых договоров ОТС);

- валюта расчетов, указанная в Оферте ОТС, совпадает с валютой расчетов, указанной в Акцепте ОТС;

- срок исполнения обязательств, возникших из Внебиржевого договора ОТС, указанный в Оферте ОТС, совпадает со сроком исполнения обязательств, возникших из Внебиржевого договора ОТС, указанным в Акцепте ОТС.

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

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

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

В случае если в Оферте ОТС указан Идентификатор Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга, который может направить связанную Оферту ОТС,

Внебиржевой договор ОТС заключается при условии, что Оферта ОТС, связанная Оферта ОТС и Акцепты ОТС одновременно удовлетворяют следующим условиям:

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

22.10.1. В целях настоящего подпункта под Внебиржевым договор ОТС понимается Внебиржевой договор ОТС, предметом которого является валютная пара.

В отношении валютной пары используются следующие понятия:

- валютная пара состоит из Первой (Базовой) валюты и Второй (Расчетной) валюты;
- цена валютной пары – сумма Второй (Расчетной) валюты, уплачиваемая за единицу (или иное число) Первой (Базовой) валюты;
- под покупкой понимается покупка (получение) Первой (Базовой) валюты и уплата (перечисление) Второй (Расчетной) валюты;
- под продажей понимается уплата (перечисление) Первой (Базовой) валюты и покупка (получение) Второй (Расчетной) валюты.

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

- в Оферте ОТС и в Акцепте ОТС указаны одинаковые коды валютной пары, валюты которой будут являться предметом этого Внебиржевого договора ОТС;
- цена, указанная в Акцепте ОТС, направленном на покупку, не меньше, чем цена, указанная в Оферте ОТС, направленной на продажу, или
- цена, указанная в Акцепте ОТС, направленном на продажу, не больше, чем цена, указанная в Оферте ОТС, направленной на покупку (для заключения Внебиржевых договоров купли-продажи валюты ОТС, если в Оферте ОТС указана цена);
- Ставка своп, указанная в Акцепте ОТС, направленном на покупку, не больше, чем Ставка своп, указанная в Оферте ОТС, направленной на продажу, или Ставка своп, указанная в Акцепте ОТС, направленном на продажу, не меньше, чем Ставка своп, указанная в Оферте ОТС, направленной на покупку (для заключения Внебиржевых валютных свопов ОТС);

- цена Первого договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, указанная в Оферте ОТС, совпадает с ценой Первого договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, указанной в Акцепте ОТС (для заключения Внебиржевых валютных свопов ОТС);

- срок исполнения обязательств, возникших из Внебиржевого договора ОТС, указанный в Оферте ОТС, совпадает со сроком исполнения обязательств, возникших из Внебиржевого договора ОТС, указанным в Акцепте ОТС.

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

Для целей заключения Внебиржевого договора ОТС, под Акцептом ОТС, направленным на покупку, понимается Акцепт ОТС, представляющий собой согласие КЦ на заключение с Участником клиринга Внебиржевого договора ОТС, в котором КЦ будет являться покупателем по Внебиржевому договору купли-продажи валюты ОТС / по Первому договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС.

Для целей заключения Внебиржевого договора ОТС под Акцептом ОТС, направленным на продажу, понимается Акцепт ОТС, представляющий собой согласие КЦ на заключение с Участником клиринга Внебиржевого договора ОТС, в котором КЦ будет являться продавцом по Внебиржевому договору купли-продажи валюты ОТС / по Первому договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС.

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

- в Оферте ОТС / связанной Оферте ОТС и в Акцептах ОТС указаны одинаковые коды валютной пары, валюты которой будут являться предметом этого Внебиржевого договора ОТС;

- сроки исполнения обязательств из Внебиржевого договора ОТС, указанные в Оферте ОТС, связанной Оферте ОТС и Акцептах ОТС, совпадают;

- цены, указанные в Оферте ОТС, связанной Оферте ОТС и Акцептах ОТС, совпадают (для заключения Внебиржевых договоров купли-продажи валюты ОТС);

- Ставки своп, указанная в Оферте ОТС, связанной Оферте ОТС и Акцептах ОТС, совпадают (для заключения Внебиржевых валютных свопов ОТС);

- цены Первого договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, указанные в Оферте ОТС, связанной Оферте ОТС и Акцептах ОТС, совпадают (для заключения Внебиржевых валютных свопов ОТС);

- суммы валют, указанные в Оферте ОТС, связанной Оферте ОТС и Акцептах ОТС, совпадают;

- Идентификатор Участника клиринга, указанный в Оферте ОТС и присвоенный Участнику клиринга, который может направить связанную Оферту ОТС, совпадает с Идентификатором Участника клиринга, направившим связанную Оферту ОТС.

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

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

22.11.1. Внебиржевой договор купли-продажи валюты ОТС заключается по цене, указанной в Акцепте ОТС, в отношении меньшей суммы Первой валюты из указанных в Оферте ОТС и Акцепте ОТС.

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

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

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

22.12.1. Внебиржевой валютный своп ОТС заключается исходя из Ставки своп, указанной в Акцепте ОТС, в отношении меньшей суммы Первой валюты из указанных в Оферте ОТС и Акцепте ОТС.

Внебиржевой валютный своп ОТС заключается на основании Оферты ОТС и связанной Оферты ОТС исходя из Ставки своп, указанной в Акцептах ОТС, и суммы Первой валюты, указанной в Акцептах ОТС.

22.13. Пара внебиржевых договоров ОТС заключается исходя из Ставки репо, указанной в Акцепте ОТС, в отношении меньшего количества ценных бумаг, из указанных в Оферте ОТС и Акцепте ОТС.

Пара внебиржевых договоров ОТС заключается на основании Оферты ОТС и связанной Оферты ОТС исходя из Ставки репо, указанной в Акцептах ОТС, и в количестве, указанном в Акцептах ОТС.

22.14. Обязательства по Внебиржевому договору ОТС включаются в клиринговый пул в соответствии с настоящими Правилами.

22.15. КЦ при заключении Внебиржевого договора ОТС:

- рассчитывает величину Доступных средств по ТКС, указанному в Оферте ОТС / связанной Оферте ОТС, а также величину Доступных средств Участника клиринга

- изменяет с учетом Внебиржевого договора ОТС, заключенного на основании Оферты ОТС, нетто-обязательство и (или) нетто-требование Участника клиринга по Внебиржевым договорам ОТС в валюте с указанием даты исполнения в соответствии с условиями указанных договоров, учитываемые по регистру учета позиций, соответствующему ТКС, указанному в Оферте ОТС / связанной Оферте ОТС.

22.16. КЦ вправе не направлять Акцепт ОТС Участнику клиринга, направившему Оферту ОТС, кроме случая наличия встречной Оферты ОТС по отношению к направленной Оферте ОТС. В случае если КЦ не направил Участнику клиринга Акцепт ОТС, то направленная Участником клиринга Оферта ОТС действует до времени окончания Операционного дня, определенного в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров.

22.17. Информация об Офертах ОТС, о заключенных Внебиржевых договорах ОТС и об обязательствах, возникших из указанных договоров, предоставляется Участникам клиринга в порядке, установленном статьей 34 настоящих Правил.

22.18. КЦ допускает обязательства из Внебиржевых договоров ОТС к клирингу в момент заключения указанных договоров. Указанные обязательства принимаются КЦ к учету с момента их допуска к клирингу.

22.19. Справедливая (оценочная) стоимость Внебиржевого договора репо ОТС определяется исходя из произведения расчетной цены ценной бумаги, устанавливаемой КЦ в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров, и количества ценных бумаг, являющихся предметом Внебиржевого договора репо ОТС.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ/ПРЕКРАЩЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

Статья 23. Виды клиринговых пулов. Порядок включения обязательств в клиринговые пулы

23.1. Для целей осуществления клиринга обязательств КЦ формирует следующие клиринговые пулы:

- обязательства, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов Tn и Код расчетов TkTn (за исключением обязательств, возникших из Внутриброкерских договоров и Внутриброкерских Внебиржевых договоров ОТС) включаются в клиринговый пул по Договорам в соответствии со статьей 24 настоящих Правил;

- обязательства, возникшие из Внутриброкерских договоров и Внутриброкерских Внебиржевых договоров ОТС, включаются в клиринговый пул по Внутриброкерским договорам в соответствии со статьей 24 настоящих Правил;

- обязательства, возникшие из Внебиржевых валютных договоров ОТС с полным обеспечением, включаются в клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением с ЦК в соответствии со статьей 27 настоящих Правил;

- обязательства, возникшие из Внебиржевых договоров ОТС (за исключением обязательств, возникших из Внебиржевых валютных договоров ОТС с полным обеспечением), включаются в клиринговый пул ОТС в соответствии со статьей 24 настоящих Правил;

- обязательства, определенные статьей 24 настоящих Правил, включаются в расчетный клиринговый пул в соответствии со статьей 24 настоящих Правил;

- обязательства, указанные в статье 28 настоящих Правил, включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в соответствии со статьей 28 настоящих Правил;

- обязательства, указанные в статье 38 настоящих Правил, включаются в ликвидационный клиринговый пул в соответствии со статьей 38 настоящих Правил.

В указанные клиринговые пулы не могут быть включены обязательства, не допущенные к клирингу.

23.2. Обязательство, включённое в клиринговый пул, не может быть исключено из соответствующего клирингового пула.

Статья 24. Порядок формирования клирингового пула по Договорам, расчётного клирингового пула, клирингового пула по Внутриброкерским договорам и клирингового пула ОТС. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу

24.1. Для определения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по Договорам, в которых указан Код расчетов Tn и Код расчетов TkTn, КЦ формирует клиринговый пул по Договорам, в который включаются обязательства, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов Tn и Код расчетов TkTn, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 21 настоящих Правил, с наступившими Датами исполнения.

24.2. КЦ формирует клиринговый пул по Договорам в срок, установленный Регламентом клиринга:

1) КЦ включает в клиринговый пул по Договорам:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам, возникшие из Договоров, в которых указаны Код расчетов Tn или Код расчётов TkTn, с наступившей Датой исполнения;

- обязательства по передаче / требования по получению Дохода, размер и срок передачи которых определен в соответствии со статьей 30 настоящих Правил;

2) обязательства, указанные в подпункте 1 настоящего пункта, прекращаются зачетом встречных однородных требований, указанных в подпункте 1 настоящего пункта и учитываемых на тех же регистрах учета позиций, что и указанные обязательства, и КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Торговому счету депо.

24.3. Для определения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по Внебиржевым договорам ОТС КЦ формирует клиринговый пул ОТС, в который включаются обязательства, возникшие из Внебиржевых договоров ОТС (за исключением обязательств, возникших из Внебиржевых валютных договоров ОТС с полным обеспечением), допущенные к клирингу в соответствии со статьей 22 настоящих Правил, с наступившими датами исполнения.

24.4. КЦ формирует клиринговый пул ОТС в срок, установленный Регламентом клиринга:

1) КЦ включает в клиринговый пул ОТС:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам, возникшие из Внебиржевых договоров ОТС (за исключением обязательств, возникших из Внебиржевых валютных договоров ОТС с полным обеспечением), с наступившей датой исполнения;

- обязательства по передаче / требования по получению Дохода;

2) обязательства, указанные в подпункте 1 настоящего пункта, прекращаются зачетом встречных однородных требований, указанных в подпункте 1 настоящего пункта и учитываемых на тех же регистрах учета позиций, что и указанные обязательства, и КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Торговому счету депо.

24.5. После определения нетто-обязательств / нетто-требований в соответствии с пунктами 24.2 и 24.4 настоящих Правил КЦ формирует расчетный клиринговый пул. В указанный клиринговый пул включаются:

- нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, определенные в соответствии с подпунктом 2 пункта 24.2 настоящих Правил;

- нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, определенные в соответствии с подпунктом 2 пункта 24.4 настоящих Правил;

- задолженность по денежному регистру, определенную в соответствии со статьей 29 настоящих Правил по итогам формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов предыдущего Расчетного дня, в случае принятия соответствующего решения КЦ в соответствии со статьей 29 настоящих Правил.

24.5.1. По обязательствам / требованиям, включенным в расчетный клиринговый пул в соответствии с пунктом 24.5 настоящих Правил, КЦ проводит неттинг (зачет), по итогам которого определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам КЦ в отношении каждого Участника клиринга, а также нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам каждого Участника клиринга в отношении КЦ. Указанные нетто-обязательства / нетто-требования определяются по каждому денежному регистру / Торговому счету депо. Определенные в соответствии с настоящим пунктом нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в отношении КЦ составляют итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования такого Участника клиринга.

24.6. Участники клиринга обязаны исполнить свои итоговые нетто-обязательства в срок, установленный Регламентом клиринга.

КЦ вправе установить срок, в течение которого Участники клиринга обязаны исполнить свои итоговые нетто-обязательства, отличный от срока, установленного в Регламенте клиринга, о чем КЦ извещает Участников клиринга посредством Системы,

Сайта КЦ и (или) в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, не менее чем за 1 (один) Расчетный день до даты вступления в силу решения КЦ об изменении указанного срока.

КЦ исполняет свои итоговые нетто-обязательства за счет денежных средств и ценных бумаг, полученных в результате исполнения итоговых нетто-обязательств Участников клиринга, а также, за исключением исполнения итоговых нетто-обязательств, являющихся результатом прекращения обязательств, возникших из Договоров и Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются Ценные бумаги эмитентов Гонконга, свободных денежных средств и ценных бумаг КЦ, учитываемых на Торговых счетах депо.

Исполнение итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований осуществляется в порядке, определенном в пункте 24.9 настоящих Правил.

Итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования, возникшие по итогам клиринга обязательств, могут быть включены в другие клиринговые пулы.

24.7. Удовлетворение итоговых нетто-требований Участника клиринга, определенных в отношении денежного регистра / Торгового счета депо, относящихся к определенному ТКС, возможно только после исполнения этим Участником клиринга итоговых нетто-обязательств, определённых по денежному регистру / Торговому счету депо, относящихся к тому же ТКС.

24.8. Для исполнения итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого в отношении определённого денежного регистра / Торгового счета депо, используются денежные средства / ценные бумаги, учитываемые по тому же денежному регистру / Торговому счету депо.

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

КЦ исполняет итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в следующем порядке:

- итоговое нетто-обязательство по денежным средствам исполняется путем уменьшения размера Средств обеспечения в денежных средствах по денежному регистру, в отношении которого определено исполняемое итоговое нетто-обязательство, на размер этого итогового нетто-обязательства;

- в случае наличия у Участника клиринга задолженности перед КЦ в валюте, указанная задолженность прекращается (полностью или частично) зачетом встречного однородного итогового нетто-требования по денежным средствам. Итоговое нетто-требование по денежным средствам, с учетом прекращения задолженности, исполняется путем увеличения размера Средств обеспечения в денежных средствах по денежному регистру, в отношении которого определено исполняемое итоговое нетто-требование, на размер этого итогового нетто-требования;

- для исполнения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по ценным бумагам КЦ передает в Расчетный депозитарий сводное поручение депо на проведение расчетов по разделу «Торговый» Торговых счетов депо /. Подтверждением исполнения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований является получение КЦ от Расчетного депозитария отчета, подтверждающего исполнение указанного поручения.

Итоговое нетто-обязательство / итоговое нетто-требование по денежным средствам считается исполненным с момента внесения предусмотренных настоящим пунктом изменений в учете на клиринговых регистрах Участника клиринга.

Итоговое нетто-обязательство / итоговое нетто-требование по ценным бумагам считается исполненным с момента получения КЦ от Расчетного депозитария отчета об исполнении сводного поручения депо на проведение расчетов по разделу «Торговый» Торговых счетов депо. Информация об их исполнении отражается в учете на клиринговых регистрах Участника клиринга.

24.10. В случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга перед КЦ итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, определенного в соответствии с пунктом 24.5.1. настоящих Правил, в результате недостаточности ценных бумаг, учитываемых на депо регистрах в отношении определенного Торгового счета депо, данный Участник клиринга признается недобросовестным Участником клиринга, и КЦ выполняет действия, направленные на исполнение указанного итогового нетто-обязательства, в порядке, определенном статьей 25 настоящих Правил.

24.11. После проведения в соответствии со статьей 25 настоящих Правил процедуры урегулирования исполнения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по ценным бумагам, по которым Участником клиринга было допущено ненадлежащее исполнение обязательств, КЦ формирует клиринговый пул по Договорам и (или) клиринговый пул ОТС.

В Дату исполнения первой части Договоров, в которых указан Код расчетов ТкТп, в Дату исполнения Первых договоров, составляющих Пары договоров, в дату исполнения первой части Внебиржевых договоров репо ОТС, заключенных в порядке, предусмотренном статьей 25 или статьей 26 настоящих Правил:

1) КЦ включает в клиринговый пул по Договорам:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов ТкТп, и из Пар биржевых договоров с наступившей Датой исполнения, заключенных в соответствии со статьей 25 настоящих Правил;

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по Донорским договорам, являющимся Парам биржевых договоров, с наступившей Датой исполнения;

2) КЦ включает в клиринговый пул ОТС:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Внебиржевым договорам репо ОТС и по Парам внебиржевых договоров ОТС с наступившей датой исполнения, заключенным в соответствии со статьей 25 настоящих Правил;

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по Донорским договорам репо, являющимся Внебиржевыми договорами репо ОТС, и по Донорским договорам купли-продажи, являющимся Парам внебиржевых договоров ОТС, заключенным в соответствии со статьей 26 настоящих Правил, с наступившей датой исполнения;

3) обязательства, указанные в подпункте 1 настоящего пункта, прекращаются зачетом встречных однородных требований, указанных в подпункте 1 настоящего пункта и учитываемых на тех же регистрах учета позиций, что и указанные обязательства, и КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Торговому счету депо;

4) обязательства, указанные в подпункте 2 настоящего пункта, прекращаются зачетом встречных однородных требований, указанных в подпункте 2 настоящего пункта и учитываемых на тех же регистрах учета позиций, что и указанные обязательства, а в оставшейся части КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Торговому счету депо;

5) КЦ после проведения действий, указанных в подпунктах 1 - 4 настоящего пункта, формирует расчетный клиринговый пул. В указанный расчетный клиринговый пул включаются:

- нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам, возникшие по итогам клиринга обязательств в клиринговом пуле по Договорам и в клиринговом пуле ОТС в соответствии с подпунктами 1 - 4 настоящего пункта;

- неисполненные итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам, определенные в соответствии с пунктом 24.5.1 настоящих Правил.

б) по обязательствам / требованиям, включенным в расчетный клиринговый пул, КЦ проводит неттинг (зачет), по итогам которого определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам КЦ в отношении каждого Участника клиринга, а также нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам каждого Участника клиринга в отношении КЦ. Указанные нетто-обязательства / нетто-требования определяются по каждому денежному регистру / Торговому счету депо. Определённые в соответствии с настоящим подпунктом нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в отношении КЦ составляют итоговые нетто-обязательства/итоговые нетто-требования такого Участника клиринга.

7) исполнение итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований, определенных в соответствии с подпунктом 6 настоящего пункта, осуществляется в порядке, установленном пунктами 24.6 – 24.9 настоящих Правил.

24.12. В случае недостаточности у Участника клиринга денежных средств для исполнения итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, определенного в соответствии с пунктом 24.11 настоящих Правил, данный Участник клиринга признается недобросовестным Участником клиринга, и КЦ выполняет действия, направленные на исполнение указанного итогового нетто-обязательства в порядке, определенном статьей 25 настоящих Правил.

24.13. После проведения в соответствии со статьей 25 настоящих Правил процедуры урегулирования исполнения итоговых нетто-обязательств, КЦ формирует клиринговый пул по Договорам и клиринговый пул ОТС.

В Дату исполнения первой части Договоров, в которых указан Код расчётов ТкТп, в Дату исполнения Первых договоров, составляющих Пары договоров, в дату исполнения первой части Внебиржевых договоров репо ОТС, в дату исполнения Первых договоров купли-продажи валюты ОТС, составляющих Внебиржевой валютный своп ОТС, заключенных в порядке, предусмотренном статьей 25 или 26 настоящих Правил, в клиринговый пул по Договорам или в клиринговый пул ОТС:

1) КЦ включает в клиринговый пул по Договорам:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам, в которых указан Код расчётов ТкТп, и из Пар биржевых договоров с наступившей Датой исполнения, заключенным в соответствии со статьей 25 настоящих Правил;

- обязательства / требования Участника клиринга и КЦ по Донорским договорам, являющимся Парам биржевых договоров, заключенным в соответствии со статьей 26 настоящих Правил, с наступившей Датой исполнения;

2) КЦ включает в клиринговый пул ОТС:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Внебиржевым договорам репо ОТС и по Парам внебиржевых договоров ОТС с наступившей датой исполнения, заключенным в соответствии со статьей 25 настоящих Правил;

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам из Внебиржевого валютного свопа ОТС с наступившей датой исполнения, заключенным в соответствии со статьей 25 настоящих Правил;

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по Донорским договорам репо, являющимся Внебиржевыми договорами репо ОТС, по Донорским договорам купли-продажи, являющимся Парам внебиржевых договоров ОТС, и по Донорским

внебиржевым валютным свопам ОТС, заключенным в соответствии со статьей 26 настоящих Правил, с наступившей датой исполнения;

3) обязательства, указанные в подпункте 1 настоящего пункта, прекращаются зачетом встречных однородных требований, указанных в подпункте 1 настоящего пункта и учитываемых на тех же регистрах учета позиций, что и указанные обязательства, а в оставшейся части КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Торговому счету депо;

4) обязательства, указанные в подпункте 2 настоящего пункта, прекращаются зачетом встречных однородных требований, указанных в подпункте 2 настоящего пункта и учитываемых на тех же регистрах учета позиций, что и указанные обязательства, а в оставшейся части КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Торговому счету депо .

24.14. После определения нетто-обязательств / нетто-требований в соответствии с пунктом 24.13 настоящих Правил КЦ формирует расчетный клиринговый пул. В указанный расчетный клиринговый пул включаются:

- неисполненные итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам, определенные в соответствии с пунктом 24.5.1. настоящих Правил, или неисполненные итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам, определенные в соответствии с подпунктом 6 пункта 24.11 настоящих Правил;

- нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам, определенные в соответствии с подпунктами 3 и 4 пункта 24.13. настоящих Правил.

По обязательствам / требованиям, включенным в указанный расчетный клиринговый пул, КЦ проводит неттинг (зачет), по итогам которого определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам КЦ в отношении каждого Участника клиринга, а также нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам каждого Участника клиринга в отношении КЦ. Указанные нетто-обязательства / нетто-требования определяются по каждому денежному регистру / Торговому счету депо. Определённые в соответствии с настоящим пунктом нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в отношении КЦ составляют итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования такого Участника клиринга.

Исполнение итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований, определенных в соответствии с настоящим пунктом, осуществляется в порядке, установленном пунктами 24.6 – 24.9 настоящих Правил.

24.15. Если в случаях, предусмотренных пунктом 24.12 настоящих Правил, Участником клиринга не были заключены Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС, Пары договоров, Внебиржевые валютные свопы ОТС итоговое нетто-обязательство по денежным средствам исполняется в соответствии с пунктом 24.9 настоящих Правил в пределах суммы денежных средств, учитываемой на том денежном регистре, по которому должно быть исполнено итоговое нетто-обязательство. Величину превышения указанного итогового нетто-обязательства над суммой денежных средств, учитываемой на том денежном регистре, по которому оно должно быть исполнено, КЦ учитывает в качестве задолженности по данному денежному регистру.

24.16. Для определения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по Внутриброкерским Договорам и (или) по Внутриброкерским Внебиржевым договорам ОТС КЦ формирует клиринговый пул по Внутриброкерским договорам.

В Дату исполнения Внутриброкерских Договоров и (или) в дату исполнения Внутриброкерских Внебиржевых договоров ОТС в клиринговый пул по Внутриброкерским договорам включаются обязательства / требования по денежным

средствам, ценным бумагам, возникшие из Внутриброкерских Договоров, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 21 настоящих Правил, с наступившими Датами исполнения и из Внутриброкерских Внебиржевых договоров ОТС, допущенных к клирингу в соответствии со статьей 21 настоящих Правил, с наступившими датами исполнения.

Обязательства и требования Участника клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Внутриброкерским Договорам и по Внутриброкерским Внебиржевым договорам ОТС прекращаются зачетом в клиринговом пуле по Внутриброкерским договорам.

24.17. 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 34 настоящих Правил.

Статья 25 Порядок урегулирования ненадлежащего исполнения обязательств

25.1. При наличии условий, указанных в пункте 24.10 и (или) 24.12 настоящих Правил, КЦ заключает Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС, Пары договоров и (или) Внебиржевой валютный своп ОТС на условиях и в порядке, определенных настоящей статьей.

Пара договоров заключается между КЦ и Участником клиринга, если:

- при регистрации или изменении параметров ТКС Участник клиринга указал, что в случае ненадлежащего исполнения обязательств, учитываемых в отношении определённого денежного регистра / Торгового счета депо, урегулирование указанных обязательств в соответствии с настоящей статьей производится путем заключения Пары договоров; или

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

Договоры, предусмотренные настоящим пунктом, заключаются на следующих условиях:

- первая часть Договора репо / первая часть Внебиржевого договора репо / Первый договор, составляющий Пару договоров / Первый договор купли-продажи валюты ОТС, составляющий Внебиржевой валютный своп ОТС, исполняются в день заключения, а вторая часть Договора репо / вторая часть Внебиржевого договора репо / Второй договор, составляющий Пару договоров / Второй договор купли-продажи валюты ОТС, составляющий Внебиржевой валютный своп ОТС, исполняются в следующий Расчетный день;

- Договор репо, Пара биржевых договоров заключается на Торгах без подачи Заявок;

- Внебиржевой договор репо ОТС, Пара внебиржевых договоров ОТС и Внебиржевой валютный своп ОТС заключаются КЦ без подачи Оферты ОТС и Акцепта ОТС в отношении себя лично от имени Участника клиринга без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

Договоры, предусмотренные настоящим пунктом, заключаются в соответствии с настоящими Правилами в дату неисполнения итоговых нетто-обязательств, определенных в соответствии со статьей 24 настоящих Правил.

25.2. Договоры, предусмотренные пунктом 25.1 настоящим Правил, заключаются при соблюдении следующих условий:

а) у КЦ отсутствует информация об обстоятельствах, которые влекут или могут повлечь прекращение клирингового обслуживания Участника клиринга;

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

в) отсутствует решение об исключении ценной бумаги, по которой учитывается итоговое нетто-обязательство, из Списка ценных бумаг, отсутствует решение об исключении обязательства, являющегося предметом Внебиржевых договоров репо ОТС или Пар внебиржевых договоров, из Списка обязательств со следующего Расчетного дня;

г) отсутствует решение КЦ о незаключении указанных договоров в отношении ценной бумаги в связи с консолидацией, дроблением ценных бумаг, в связи с реорганизацией эмитента ценных бумаг / лица, выдавшего ценные бумаги в форме слияния, присоединения, выделения или разделения, в связи с изменением параметров ценной бумаги, а также в связи с приостановкой торгов ценной бумагой или запретом подачи заявок и заключения договоров в отношении ценной бумаги;

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

25.3. Договоры, предусмотренные пунктом 25.1 настоящих Правил, заключаются между КЦ и недобросовестным Участником клиринга в следующих случаях:

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

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

а) по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, КЦ обязан передать Участнику клиринга ценные бумаги, являющиеся предметом итогового нетто-обязательства, в количестве, равном количеству, в отношении которого итоговое нетто-обязательство не было исполнено, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить. Для Договоров репо и Пар биржевых договоров указанное количество устанавливается кратным Лоту с округлением в большую сторону;

б) по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги, являющиеся предметом Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС или Пары договоров, в том же количестве, а КЦ обязан принять их и оплатить;

- в случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга итогового нетто-обязательства по денежным средствам КЦ заключает с этим Участником клиринга Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС, Пары договоров и (или) Внебиржевой валютный своп ОТС.

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

а) по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги в количестве, не превышающем количества ценных бумаг, определенного исходя из суммы неисполненной части итогового денежного обязательства и цены одной ценной бумаги, а КЦ обязан принять их и оплатить. Для Договоров репо и Пар биржевых договоров указанное количество устанавливается кратным Лоту с округлением в большую сторону;

б) по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, КЦ обязан передать

Участнику клиринга ценные бумаги, являющиеся предметом Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС или Пары договоров, в том же количестве, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить;

в) КЦ по своему усмотрению определяет ценные бумаги, являющиеся предметом Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС или Пары договоров. При этом Участник клиринга считается согласившимся заключить Договор репо, Внебиржевой договор репо ОТС или Пару договоров в отношении таких ценных бумаг;

- цена одной ценной бумаги по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, считается равной Цене урегулирования исполнения обязательств по этой ценной бумаге.

- цена одной ценной бумаги по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, определяется исходя из цены одной ценной бумаги по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, сроков исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой и второй частям Договора репо (Внебиржевого договора репо ОТС) или по Первому договору и по Второму договору, составляющим Пару договоров, и Ставки репо. Указанная Ставка репо устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;

- обязательства по передаче ценных бумаг и их оплате по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, подлежат исполнению в день заключения соответствующего договора;

- обязательства по передаче ценных бумаг и их оплате по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, подлежат исполнению в Расчетный день, следующий за днем заключения соответствующего договора;

- определение и исполнение обязательств по Договору репо, по Внебиржевому договору репо ОТС или по Парам договоров осуществляется в соответствии с настоящими Правилами.

Внебиржевой валютный своп ОТС заключается КЦ на следующих условиях:

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

б) по Второму договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, Участник клиринга обязан передать КЦ валюту, полученную по Первому договору купли-продажи валюты ОТС, в том же количестве, а КЦ обязан принять указанную валюту и оплатить;

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

- цена единицы валюты, передаваемой КЦ Участнику клиринга по Первому договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, считается равной Цене урегулирования исполнения обязательств по этой валюте;

- цена единицы валюты по Второму договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, определяется исходя из цены Первого договора купли-продажи валюты ОТС, сроков исполнения обязательств по Первому и Второму договорам купли-продажи валюты ОТС, составляющим Внебиржевой валютный своп ОТС, и Ставки своп. Указанная Ставка своп устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;

- обязательства по передаче валюты, являющейся предметом Внебиржевого валютного свопа ОТС, и их оплате по Первому договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, подлежат исполнению в день заключения соответствующего договора;

- обязательства по передаче валюты, являющихся предметом Внебиржевого валютного свопа ОТС, и их оплате по Второму договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, подлежат исполнению в Расчетный день, следующий за днем заключения соответствующего договора;

- определение и исполнение обязательств по Внебиржевым валютным свопам ОТС осуществляется в соответствии с настоящими Правилами.

КЦ взимает штраф с недобросовестного Участника клиринга.

Величина штрафа рассчитывается по следующей формуле:

а) в случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга итогового нетто-обязательства по ценным бумагам:

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

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

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

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

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

где:

Penalty – величина штрафа;

Sum – сумма, рассчитываемая исходя из цены первой части Договора репо, первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Первого договора, составляющего Пару договоров, или Первого договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и количества ценных бумаг / количества валюты, являющихся предметом этого договора. При этом, если предметом соответствующего договора являются облигации, в расчете величины Sum учитывается также накопленный купонный доход, рассчитываемый в соответствии с решением о выпуске ценных бумаг;

fine_short, fine_long – штрафные ставки, установленные КЦ для каждой ценной бумаги, включенных в Список ценных бумаг / Список обязательств, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

Forfeit_rate – штрафные ставки, установленные КЦ для каждой валюты, включенной в Список обязательств, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

T₃₆₅ – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой

исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или датой исполнения Первого договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и соответственно Датой исполнения второй части Договора репо, датой исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Второго договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или датой исполнения Второго договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, которое приходится на календарный год, состоящий из 365 дней;

T_{366} - количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или датой исполнения Первого договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и соответственно Датой исполнения второй части Договора репо, датой исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Второго договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или датой исполнения Второго договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, которое приходится на календарный год, состоящий из 366 дней.

Обязательство Участника клиринга по уплате штрафа допускается к клирингу в момент его возникновения на основании информации, указанной в настоящем пункте, и включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов, формируемый в соответствии со статьей 28 настоящих Правил, в дату заключения Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС или Пары договоров.

При наличии у Участника клиринга итогового нетто-обязательства по денежным средствам, которое не может быть исполнено, и учитываемого в отношении определенного денежного регистра, Договор репо, Внебиржевой договор репо ОТС, Пара договоров или Внебиржевой валютный своп ОТС в соответствии с настоящим пунктом заключается в отношении ценных бумаг/ валюты, которые учитываются на депо регистре / денежном регистре, входящем в тот же ТКС, что и указанный денежный регистр.

25.4. В случае недостаточности свободных собственных денежных средств и (или) ценных бумаг КЦ, учитываемых на Торговых счетах депо, а также при наличии недобросовестных Участников клиринга, итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам добросовестных Участников клиринга удовлетворяются или прекращаются КЦ путем выполнения КЦ действий в следующей последовательности:

25.4.1. заключение Донорского договора в соответствии со статьей 26 настоящих Правил;

25.4.2. в случае невозможности заключения Донорского договора - заключение КЦ с добросовестным Участником клиринга без подачи Заявок на Торгах Договоров репо, в которых указывается Код расчетов ТкТп, или Пары биржевых договоров либо заключение без подачи Оферты ОТС и Акцепта ОТС Внебиржевого договора репо ОТС, Пары внебиржевых договоров ОТС, Внебиржевого валютного свопа ОТС в следующих случаях:

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

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

а) по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, Участник клиринга

обязан передать КЦ ценные бумаги, являющиеся предметом итогового нетто-обязательства, в количестве, равном количеству, в отношении которого итоговое нетто-обязательство не было исполнено, а КЦ обязан принять их и оплатить. Для Договоров репо и Пар биржевых договоров указанное количество устанавливается кратным Лоту с округлением в большую сторону;

б) по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, КЦ обязан передать Участнику клиринга ценные бумаги, являющиеся предметом соответствующего договора, в том же количестве, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить;

- в случае ненадлежащего исполнения КЦ итогового нетто-обязательства по денежным средствам, КЦ заключает с добросовестным Участником клиринга Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС, Пары договоров и (или) Внебиржевой валютный своп ОТС.

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

а) по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, КЦ обязан передать Участнику клиринга ценные бумаги в количестве, не превышающем количества ценных бумаг, определенного исходя из суммы неисполненной части итогового денежного обязательства и цены одной ценной бумаги, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить. Для Договоров репо и Пар биржевых договоров указанное количество устанавливается кратным Лоту с округлением в большую сторону;

б) по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги, являющиеся предметом соответствующего договора, в том же количестве, а КЦ обязан принять их и оплатить;

в) КЦ по своему усмотрению определяет ценные бумаги, являющиеся предметом Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС или Пары договоров, при этом Участник клиринга считается согласившимся заключить Договор репо, Внебиржевой договор репо ОТС или Пару договоров в отношении таких ценных бумаг;

- цена одной ценной бумаги по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, считается равной Цене урегулирования исполнения обязательств по этой ценной бумаге;

- цена одной ценной бумаги по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, определяется исходя из цены одной ценной бумаги по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, сроков исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой и второй частям Договора репо или Внебиржевого договора репо ОТС либо по Первому договору и Второму договору, составляющим Пару договоров, и Ставки репо. Указанная Ставка репо устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;

- обязательства по передаче ценных бумаг и их оплате по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, подлежат исполнению в день заключения соответствующего договора;

- обязательства по передаче ценных бумаг и их оплате по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, подлежат исполнению в Расчетный день, следующий за днем заключения соответствующего договора;

- определение и исполнение обязательств по Договору репо, по Внебиржевому договору репо ОТС или по Паре договоров осуществляется в соответствии с настоящими Правилами.

Внебиржевой валютный своп ОТС заключается КЦ на следующих условиях:

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

б) по Второму договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, КЦ обязан передать Участнику клиринга валюту, полученную по Первому договору купли-продажи валюты ОТС, в том же количестве, а Участник клиринга обязан принять указанную валюту и оплатить;

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

- цена единицы валюты, передаваемой Участником клиринга КЦ по Первому договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, считается равной Цене урегулирования исполнения обязательств по этой валюте;

- цена единицы валюты по Второму договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, определяется исходя из цены Первого договора купли-продажи валюты. сроков исполнения обязательств по Первому и Второму договору купли-продажи валюты ОТС, составляющим Внебиржевой валютный своп ОТС, и Ставки своп. Указанная Ставка своп устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;

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

- обязательства по передаче валюты, являющейся предметом Внебиржевого валютного свопа ОТС, и их оплате по Второму договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, подлежат исполнению в Расчетный день, следующий за днем заключения соответствующего договора;

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

КЦ уплачивает добросовестному Участнику клиринга штраф.

Величина штрафа рассчитывается по следующей формуле:

а) в случае ненадлежащего исполнения КЦ итогового нетто-обязательства по ценным бумагам:

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

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

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

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

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

где:

Penalty – величина штрафа;

Sum – сумма, рассчитываемая исходя из цены первой части Договора репо, первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Первого договора, составляющего Пару договоров, или Первого договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и количества ценных бумаг / валюты, являющихся предметом этого договора. При этом, если предметом соответствующего договора являются облигации, в расчете величины Sum учитывается также накопленный купонный доход, рассчитываемый в соответствии с решением о выпуске ценных бумаг;

ch_fine_short, ch_fine_long – штрафные ставки, установленные КЦ для каждой ценной бумаги, включенных в Список ценных бумаг / Список обязательств, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

ch_forfeit_rate – штрафные ставки, установленные КЦ для каждой валюты, включенной в Список обязательств, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

T_{365} – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или датой исполнения Первого договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и соответственно Датой исполнения второй части Договора репо, датой исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Второго договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или датой исполнения Второго договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, которое приходится на календарный год, состоящий из 365 дней;

T_{366} – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или датой исполнения Первого договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и соответственно Датой исполнения второй части Договора репо, датой исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Второго договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или датой исполнения Второго договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, которое приходится на календарный год, состоящий из 366 дней.

Обязательство КЦ по уплате штрафа допускается к клирингу в момент его возникновения и включается в клиринговый пул для расчётов по итогам Торгов, формируемый в соответствии со статьей 28 настоящих Правил, в дату заключения Договора репо, в котором указан Код расчетов TkTn, Внебиржевого договора репо ОТС, Пары договоров или Внебиржевого валютного свопа ОТС.

25.5. В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам вследствие обстоятельств непреодолимой силы, штраф, определяемый в соответствии с пунктом 25.3 настоящих Правил, не взимается. О возникновении указанных обстоятельств Участник клиринга обязан уведомить КЦ любыми доступными средствами связи до установленного

Регламентом клиринга времени исполнения итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам.

Участник клиринга обязан предоставить КЦ документы, подтверждающие наличие обстоятельств непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга в КЦ таких документов в указанный срок КЦ взыскивает с Участника клиринга штраф, определяемый в соответствии с пунктом 25.3 настоящих Правил, в расчете на количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Первого договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и датой расчета неустойки.

25.6. КЦ вправе, несмотря на наличие обязанности по заключению договоров, предусмотренной пунктом 25.1 настоящих Правил, известить Участников клиринга о незаключении Договоров репо, Внебиржевых договоров репо ОТС, Пары договоров или Внебиржевого валютного свопа ОТС в случаях:

- несоблюдение условий, указанных в пункте 25.2 настоящих Правил;
- принятие решения об исключении ценной бумаги, по которой учитывается итоговое нетто-обязательство, из Списка ценных бумаг и (или) принятие решения об исключении предметов обязательств, возникших из Внебиржевых договоров репо ОТС или Пар внебиржевых договоров или Внебиржевых валютных свопов ОТС, из Списка обязательств со следующего Расчетного дня;
- консолидации, дробления ценных бумаг, реорганизации эмитента ценных бумаг / лица, выдавшего ценные бумаги, в форме слияния, присоединения, выделения или разделения, изменения параметров ценной бумаги, а также при приостановке торгов ценными бумагами или запрете подачи заявок и заключения договоров в отношении ценной бумаги;
- принятия решения эмитента или лица, выдавшего ценные бумаги, о выплате Дохода ценными бумагами;
- принятия решения КЦ о незаключении Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС, Пар договоров, Внебиржевого валютного свопа ОТС с обязательным уведомлением Участника клиринга за 4 (четыре) Расчетных дня до даты незаключения указанных договоров, посредством Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

25.7. В случае принятия решения о незаключении КЦ Договоров репо, Внебиржевых договоров репо ОТС, Пар договоров, Внебиржевого валютного свопа ОТС КЦ осуществляет процедуру принудительного закрытия позиций Участника клиринга, в отношении которого КЦ принял решение о незаключении указанных договоров, в соответствии со статьей 21 настоящих Правил. КЦ вправе принять решение о начале процедуры принудительного закрытия за два Расчетных дня до даты, с которой КЦ принял решение о незаключении Договоров репо, Внебиржевых договоров репо ОТС, Пар договоров, Внебиржевого валютного свопа ОТС в случае, если такое решение принято в связи с основаниями, предусмотренными абзацами 3 - 5 пункта 25.6 настоящих Правил.

Принудительное закрытие производится при соблюдении следующих условий:

- Сторонами по Договору, Внебиржевому договору ОТС является КЦ и Участник клиринга, в отношении которого осуществляется принудительное закрытие;
- Дата исполнения и (или) дата исполнения, установленная Внебиржевым договором ОТС, приходится на дату, с которой КЦ принял решение о незаключении Договоров репо, Внебиржевых договоров репо ОТС, Пар договоров, Внебиржевого валютного свопа ОТС;
- цена одной ценной бумаги по Договору / Внебиржевому договору ОТС равна Цене урегулирования исполнения обязательств по данной ценной бумаге / валюте;

- в случае заключения Договора / Внебиржевого договора купли-продажи ОТС предметом которого являются ценные бумаги иностранных эмитентов КЦ рассчитывает сумму компенсации.

Сумма компенсации рассчитывается по следующей формуле:

$$\text{Refund} = (\text{RefP}_t - \text{PD}) \times Q,$$

где:

Refund – сумма компенсации;

RefP_t – расчетная цена ценной бумаги, являющейся предметом Договора или Внебиржевого договора купли-продажи ОТС, определенная по итогам проведения следующей после заключения Договора / Внебиржевого договора ОТС Клиринговой сессии;

PD – цена одной ценной бумаги по заключённому Договору или Внебиржевому договору купли-продажи ОТС;

Q – количество ценных бумаг, являющихся предметом Договора или Внебиржевого договора купли-продажи ОТС.

Если сумма компенсации, рассчитанная по указанной формуле, является положительной величиной, то в случае наличия у Участника клиринга нетто-обязательства по денежным средствам, в отношении которых осуществляется процедура принудительного закрытия, сумма компенсации зачисляется КЦ указанному Участнику клиринга, а в случае наличия у Участника клиринга, в отношении которого осуществляется процедура принудительного закрытия, нетто-требования по денежным средствам, сумма компенсации подлежит списанию с указанного Участника клиринга в пользу КЦ.

Если сумма компенсации, рассчитанная по указанной формуле, является отрицательной величиной, то в случае наличия у Участника клиринга нетто-обязательства по денежным средствам, в отношении которых осуществляется процедура принудительного закрытия, то абсолютное значение этой величины подлежит списанию с указанного Участника клиринга в пользу КЦ, а в случае наличия у Участника клиринга, в отношении которого осуществляется процедура принудительного закрытия, нетто-требования по денежным средствам, абсолютное значение суммы компенсации подлежит зачислению КЦ указанным Участником клиринга.

Обязательство по уплате / требование по получению компенсации допускается к клирингу с момента возникновения указанного обязательства. Обязательство по уплате / требование по получению компенсации включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов, формируемый в соответствии со статьей 28 настоящих Правил, в дату, следующую за датой заключения Договора или Внебиржевого договора купли-продажи ОТС, указанного в настоящем пункте.

25.8. Обязательства, возникшие из договоров, заключаемых в соответствии с пунктами 25.3, 25.4 и 25.7 настоящих Правил, допускаются к клирингу в момент возникновения указанных обязательств и включаются в клиринговый пул по Договорам в Дату исполнения и (или) в клиринговый пул ОТС в дату исполнения, определяемую условиями Внебиржевого договора купли-продажи ОТС / Внебиржевого договора репо ОТС.

25.9. Для целей урегулирования ненадлежащего исполнения обязательств в соответствии с настоящей статьей, КЦ вправе использовать информацию о кодах Клиентов, предоставленную Участником клиринга по форме, установленной Регламентом клиринга, в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью. Указанная информация может быть также использована для целей принудительного закрытия Участника клиринга.

25.10. В дату заключения Договоров или Внебиржевых договоров ОТС в соответствии с пунктами 25.3, 25.4 и 25.7 настоящих Правил, информация об указанных

договорах включается в состав сведений, предоставляемых КЦ Участникам клиринга в соответствии со статьей 34 настоящих Правил.

Статья 26. Донорский договор

26.1. Между Участником клиринга и КЦ может быть заключен Донорский договор, являющийся Договором репо, Внебиржевым договором репо ОТС, Парой договоров, Внебиржевым валютным свопом ОТС.

26.2. Пара договоров, являющаяся Донорским договором, заключается КЦ с Участником клиринга в случае, если:

- при регистрации или изменении параметров ТКС Участник клиринга указал, что в случае ненадлежащего исполнения обязательств, учитываемых в отношении определённого денежного регистра / Торгового счета депо, урегулирование указанных обязательств в соответствии с настоящей статьей производится путем заключения Пары договоров; или

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

Договоры, предусмотренные пунктом 26.1 настоящих Правил, заключаются на следующих условиях:

- первая часть Договора репо / первая часть Внебиржевого договора репо / Первый договор, составляющий Пару договоров / Первый договор купли-продажи валюты ОТС, составляющий Внебиржевой валютный своп ОТС, исполняются в день заключения, а вторая часть Договора репо / вторая часть Внебиржевого договора репо / Второй договор, составляющий Пару договоров / Второй договор купли-продажи валюты ОТС, составляющий Внебиржевой валютный своп ОТС, исполняются в следующий Расчетный день.

26.3. В соответствии с настоящей статьей:

- Договор репо, Пара биржевых договоров заключаются на Торгах без подачи Заявок;

- Внебиржевой договор репо ОТС, Пара внебиржевых договор ОТС и Внебиржевой валютный своп ОТС заключается КЦ без подачи Оферты ОТС и Акцепта ОТС в отношении себя лично от имени Участника клиринга без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

Договоры, предусмотренные настоящим пунктом, заключаются в соответствии с настоящими Правилами в дату неисполнения итоговых нетто-обязательств, определенных в соответствии со статьей 24 настоящих Правил.

26.4. Предметом Донорского договора могут являться исключительно ценные бумаги, включенные в Список ценных бумаг (если он заключается на Торгах) или в Список обязательств (если он заключается не на Торгах), а также валюта, включенная в Список обязательств.

26.5. В случае недостаточности у КЦ ценных бумаг для исполнения нетто-обязательств перед добросовестным Участником клиринга, по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, продавцом ценных бумаг является Участник клиринга, а покупателем является КЦ. По второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, продавцом ценных бумаг является КЦ, а покупателем является Участник клиринга.

В случае недостаточности у КЦ денежных средств для исполнения нетто-обязательств перед добросовестным Участником клиринга, по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, продавцом ценных бумаг является КЦ, а покупателем является Участник клиринга. По второй части Договора репо, по второй части

Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, продавцом ценных бумаг является Участник клиринга, а покупателем является КЦ.

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

26.6. Донорский договор может быть заключен с Участником клиринга, который представил соответствующее заявление, при условии, что:

- в заявлении указаны ТКС и объёмы денежных средств и (или) ценных бумаг, доступных для заключения Донорских договоров;
- заявление составлено по форме и в порядке, установленной Регламентом клиринга, в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью;
- заявление действует и не отозвано Участником клиринга.

Участник клиринга, предоставляя указанное заявление КЦ, заверяет о том, что он обладает всеми необходимыми поручениями, полномочиями и корпоративными одобрениями на заключение Донорских договоров в отношении денежных средств и (или) ценных бумаг, учитываемых на Клиринговом счете, разделе «Торговый» Торгового счета депо, указанных в предоставляемом заявлении.

Указанное заверение считается заверением об обстоятельствах (representations) по смыслу главы 4 AIFC REGULATIONS ON OBLIGATIONS.

КЦ при заключении Донорских договоров вправе начать использовать информацию о ТКС и об объемах денежных средств и (или) ценных бумаг, указанных в заявлении, в любой момент времени в течение 3 (трех) Расчетных дней с даты получения указанного заявления от Участника клиринга. Выбор Участника клиринга, с которым в случае необходимости заключается Донорский договор, а также определение количества денежных средств и (или) ценных бумаг, выраженное в штуках, в отношении которых заключается Донорский договор, осуществляется КЦ с учетом информации, указанной в заявлении.

26.7. Условия Донорского договора:

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

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

А) по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги, являющиеся предметом итогового нетто-обязательства КЦ перед добросовестным Участником клиринга в количестве, не превышающем объем нехватки ценных бумаг КЦ для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга, а КЦ обязан принять их и оплатить. Для Договоров репо и Пар биржевых договоров указанное количество устанавливается кратным Лоту с округлением в большую сторону;

Б) по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, КЦ обязан передать Участнику клиринга ценные бумаги, являющиеся предметом соответствующего договора, в том же количестве, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить;

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

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

А) по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, КЦ обязан передать Участнику клиринга ценные бумаги, являющиеся предметом итогового нетто-обязательства добросовестного Участника клиринга перед КЦ, в количестве, определенном исходя из суммы нехватки денежных средств КЦ для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга и цены одной ценной бумаги, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить. Для Договоров репо и Пар биржевых договоров указанное количество устанавливается кратным Лоту с округлением в большую сторону;

Б) по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги, являющиеся предметом соответствующего договора, в том же количестве, а КЦ обязан принять их и оплатить;

- цена одной ценной бумаги по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, считается равной Цене урегулирования исполнения обязательств по этой ценной бумаге;

- цена одной ценной бумаги по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, определяется исходя из цены одной ценной бумаги соответственно по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, из сроков исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой и второй частям Договора репо КЦ или Внебиржевого договора репо ОТС либо по Первому договору и Второму договору, составляющим Пару договоров, и из Ставки репо. Указанная Ставка репо устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;

- обязательства по передаче ценных бумаг и их оплате по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, подлежат исполнению в день заключения соответствующего договора;

- обязательства по передаче ценных бумаг и их оплате по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, подлежат исполнению в Расчетный день, в который осуществлялось заключение соответствующего договора или в Расчетный день, следующий за днем заключения соответствующего договора. Сроки исполнения обязательств по передаче ценных бумаг и их оплате по второй части соответствующего договора определяются КЦ при его заключении с Участником клиринга;

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

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

А) по Первому договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, Участник клиринга обязан передать КЦ валюту, являющуюся предметом итогового нетто-обязательства КЦ перед добросовестным Участником клиринга, в количестве, определенном исходя из суммы нехватки денежных средств КЦ для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным

Участником клиринга, а КЦ обязан передать Участнику клиринга другую валюту в количестве, определенном исходя из суммы неисполненной части итогового денежного обязательства и цены этой валюты. Количество валюты, являющейся предметом Внебиржевого валютного свопа ОТС, устанавливается кратным Лоту с округлением в большую сторону;

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

- цена единицы валюты, передаваемой Участником клиринга КЦ по Первому договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, считается равной Цене урегулирования исполнения обязательств по этой валюте;

- цена единицы валюты по Второму договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, определяется исходя из цены Первого договора купли-продажи валюты ОТС, сроков исполнения обязательств по Первому и Второму договорам купли-продажи валюты ОТС, составляющим Внебиржевой валютный своп ОТС, и Ставки своп. Указанная Ставка своп устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;

- обязательства по передаче валюты, являющейся предметом Внебиржевого валютного свопа ОТС, и их оплате по Первому договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, подлежат исполнению в день заключения соответствующего договора;

- обязательства по передаче валюты, являющихся предметом Внебиржевого валютного свопа ОТС, и их оплате по Второму договору купли-продажи валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, подлежат исполнению в Расчетный день, следующий за днем заключения соответствующего договора;

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

КЦ уплачивает Участнику клиринга штраф.

Величина штрафа рассчитывается по следующей формуле:

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

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

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

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

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

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

где:

Penalty – величина штрафа;

Sum – сумма, рассчитываемая исходя из цены первой части Договора репо, первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Первого договора, составляющего Пару договоров, или Первого договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и количества ценных бумаг / валюты, являющихся

предметом этого договора. При этом, если предметом соответствующего договора являются облигации, в расчете величины Sum учитывается также накопленный купонный доход, рассчитываемый в соответствии с решением о выпуске ценных бумаг;

ch_fine_borrow money, ch_fine_borrow_security – штрафная ставка, установленная КЦ для каждой ценной бумаги, включенной в Список ценных бумаг / Список обязательств, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

ch_forfeit_borrow money – штрафная ставка, установленная КЦ для каждой валюты, включенной в Список обязательств, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

T₃₆₅ – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Первого договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и соответственно Датой исполнения второй части Договора репо, датой исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Второго договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Второго договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, которое приходится на календарный год, состоящий из 365 дней;

T₃₆₆ - количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Первого договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и соответственно Датой исполнения второй части Договора репо, датой исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Второго договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Второго договора купли-продажи валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, которое приходится на календарный год, состоящий из 366 дней.

Обязательство КЦ по уплате штрафа допускается к клирингу в момент его возникновения и включается в клиринговый пул для расчётов по итогам Торгов, формируемый в соответствии со статьей 28 настоящих Правил, в дату заключения Договора репо, Внебиржевого договора ОТС, Пары договоров или Внебиржевого валютного свопа ОТС.

26.8. КЦ заключает Договоры репо, Пары договоров или Внебиржевой валютный своп ОТС в объеме не более, чем указано в заявлении на заключение Донорского договора, в случае недостаточности у КЦ ценных бумаг и (или) денежных средств для исполнения итоговых нетто-требований добросовестных Участников клиринга, с Участниками клиринга, предоставившими указанное заявление с использованием ТКС, указанных в данном заявлении, при условии, что на денежном регистре / разделе «Торговый» Торгового счета депо, входящем в состав данного ТКС, учитываются недостающие у КЦ ценные бумаги и (или) денежные средства.

Участник клиринга, предоставляя указанное заявление в КЦ, заверяет о том, что ценные бумаги, доступные для заключения Донорских договоров, не обременены правами Участника клиринга и иных лиц.

Указанное заверение считается заверением об обстоятельствах (representations) по смыслу главы 4 AIFC REGULATIONS ON OBLIGATIONS.

26.9. Обязательства, возникшие из Донорских договоров, допускаются к клирингу в момент заключения Донорских договоров в соответствии с настоящей статьей Правил и включаются в клиринговый пул по Договорам или в клиринговый пул ОТС в Дату исполнения / дату исполнения.

26.10. В дату заключения Донорских договоров информация об указанных договорах включается в состав сведений, предоставляемых КЦ Участникам клиринга в соответствии со статьей 34 настоящих Правил.

Статья 27. Порядок формирования клирингового пула по Договорам с полным обеспечением с ЦК. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу

27.1. Для определения итоговых нетто-обязательств / нетто-требований по Внебиржевым валютным договорам ОТС с полным обеспечением КЦ формирует клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением с ЦК, в который включаются обязательства, возникшие из Внебиржевых валютных договоров ОТС с полным обеспечением, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 22 настоящих Правил, с наступившими датами исполнения.

27.2. Сроки, в которые КЦ формирует клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением с ЦК, устанавливаются Регламентом клиринга. КЦ вправе установить срок, отличный от срока, установленного в Регламенте клиринга, известив Участников клиринга об изменении срока посредством Системы, Сайта КЦ и (или) в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, не менее чем за 1 (один) Расчетный день до даты вступления в силу решения КЦ об изменении указанного срока.

27.3. В дату формирования клирингового пула по Договорам с полным обеспечением с ЦК:

- КЦ включает в клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением с ЦК обязательства и требования по денежным средствам, возникшие из Внебиржевых валютных договоров ОТС с полным обеспечением, с наступившей датой исполнения;

- обязательства зачитываются со встречными однородными требованиями Участников клиринга по денежным средствам по вышеуказанным договорам, с наступившей датой исполнения, а в части, в которой обязательства и встречные однородные требования не были зачтены, КЦ определяет итоговые нетто-обязательства и (или) итоговые нетто-требования по денежным средствам каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру, через который будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и (или) итоговых нетто-требований.

27.4. 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.

27.5. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам может быть исполнено по денежному регистру, в отношении которого оно определено, если сумма денежных средств по тому же денежному регистру не меньше, чем размер итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, определенного по тому же денежному регистру.

КЦ исполняет итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам следующем порядке:

- итоговое нетто-обязательство по денежным средствам исполняется путем уменьшения размера Средств обеспечения в денежных средствах по денежному регистру, в отношении которого определено исполняемое итоговое нетто-обязательство, на размер этого итогового нетто-обязательства;

- итоговое нетто-требование по денежным средствам исполняется путем увеличения размера Средств обеспечения в денежных средствах по денежному регистру, в

отношении которого определено исполняемое итоговое нетто-требование, на размер этого итогового нетто-требования.

Итоговое нетто-обязательство / итоговое нетто-требование по денежным средствам считается исполненным с момента внесения предусмотренных настоящим пунктом изменений в учете на клиринговых регистрах Участника клиринга.

27.6. В процессе клиринга КЦ формирует и предоставляет Участникам клиринга информацию об итоговых нетто-обязательствах / итоговых нетто-требованиях по денежным средствам в порядке, установленном статьей 34 настоящих Правил.

Статья 28. Порядок формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов

28.1. Каждый Расчетный день в сроки, установленные Регламентом клиринга, КЦ формирует клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов.

КЦ включает в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов:

- обязательства по уплате сумм, предусмотренных настоящими Правилами и Тарифами, в том числе Торгового сбора, Депозитарного сбора и Клирингового сбора, определенных в соответствии со статьей 10 настоящих Правил. Размер обязательств по оплате указанных сумм подлежит математическому округлению с точностью до двух знаков после запятой. При наличии хотя бы одного Договора взимается не менее 0,01 (одной сотой) валюты Торгового сбора, Клирингового сбора;

- обязательства по возмещению КЦ убытков, предусмотренных разделом VI настоящих Правил;

- обязательства по уплате штрафов, возникшие при нехватке денежных средств Участника клиринга для обеспечения исполнения обязательств по денежным средствам до даты исполнения в соответствии со статьей 12 настоящих Правил;

- обязательства по уплате / требования по получению штрафов и компенсаций, возникших при урегулировании случаев исполнения обязательств в соответствии со статьей 25 настоящих Правил;

- требования по получению штрафов, возникших при заключении Донорских договоров в соответствии со статьей 26 настоящих Правил;

- обязательства по уплате штрафов, возникшие при наличии у Участника клиринга задолженности по денежным регистрам в соответствии со статьей 29 настоящих Правил;

- обязательства по возврату выплаченного и переданного Дохода в соответствии с пунктом 30.9 настоящих Правил;

- обязательства по уплате суммы, эквивалентной сумме Транзакционного налога, определенной в соответствии со статьей 36 настоящих Правил;

КЦ зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и КЦ по денежным средствам, а в части, в которой обязательства и требования не были зачтены – определяет итоговые нетто-обязательства и (или) итоговые нетто-требования по денежным средствам каждого Участника клиринга и КЦ в отношении каждого Участника клиринга и КЦ соответственно по каждому денежному регистру, через который будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и (или) итоговых нетто-требований. Определённые в соответствии с настоящим пунктом нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в отношении КЦ соответственно совокупно составляют итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования такого Участника клиринга.

28.2. Для исполнения итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, учитываемого в отношении определенного денежного регистра, используются денежные средства, учитываемые по тому же денежному регистру.

28.3. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам в определенной валюте может быть исполнено по денежному регистру, в отношении

которого оно определено, если размер денежных средств в той же валюте по тому же денежному регистру не меньше, чем итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам, учитываемое по денежному регистру.

28.4. В случае если размер итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам по денежному регистру, в отношении которого определено указанное обязательство, больше размера денежных средств, учитываемых по тому же денежному регистру, КЦ исполняет итоговое нетто-обязательство в объеме равном размеру учитываемых по указанному денежному регистру денежных средств. При этом в первую очередь исполняются обязательства Участника клиринга перед КЦ, а во вторую очередь - обязательства Участника клиринга перед другими Участниками клиринга. В случае недостаточности денежных средств для полного исполнения обязательств Участника клиринга перед другими Участниками клиринга указанные обязательства исполняются пропорционально их размеру.

Объем неисполненного итогового нетто-обязательства КЦ учитывает в качестве задолженности по данному денежному регистру. КЦ учитывает задолженность Участника клиринга перед другими Участниками клиринга и перед КЦ соответственно.

28.5. В процессе клиринга КЦ формирует и предоставляет Участникам клиринга информацию об итоговых нетто-обязательствах / итоговых нетто-требованиях по денежным средствам / ценным бумагам в порядке, установленном статьей 34 настоящих Правил.

Статья 29. Задолженность по денежному регистру

29.1. 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 24 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 перед КЦ.

29.2. Участник клиринга погашает возникшую задолженность перед КЦ путем зачисления денежных средств на Клиринговый счет, с указанием ТКС, который соответствует денежному регистру, по которому возникла данная задолженность. Участник клиринга обязан погасить возникшую задолженность перед КЦ до момента начала формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов следующего Расчетного дня.

29.3. В случае если задолженность по денежному регистру не была погашена в срок, указанный в пункте 29.2 настоящих Правил, КЦ взимает в свою пользу штраф, рассчитываемый по следующей формуле:

$$\text{Penalty} = \text{Debt} \times \text{fine}_{\text{debt}} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

где:

Penalty – величина штрафа;

Debt – величина задолженности по денежному регистру;

fine_debt – штрафная ставка, установленная КЦ и определенная в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

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

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

Обязательство Участника клиринга по уплате штрафа допускается к клирингу в момент его возникновения и включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов, формируемый в соответствии со статьей 28 настоящих Правил, в дату возникновения указанного обязательства.

КЦ вправе включить обязательство по погашению задолженности по денежному регистру в расчетный клиринговый пул, формируемый в Расчетный день, следующий за Расчетным днем, в котором у Участника клиринга возникла задолженность по денежному регистру.

КЦ вправе потребовать от Участника клиринга, у которого учитывается задолженность перед КЦ по денежному регистру, погасить указанную задолженность в течение одного Расчетного дня с момента получения уведомления КЦ. КЦ направляет Участнику клиринга уведомление в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, или в бумажном виде.

В случае непогашения Участником клиринга задолженности по денежному регистру в установленный уведомлением срок, КЦ использует для ее погашения Средства обеспечения в соответствии со статьей 17 настоящих Правил.

Статья 30. Порядок передачи Доходов по Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС, Парам договоров, Договорам купли-продажи облигаций

30.1. КЦ определяет обязательства по передаче Дохода, по ценным бумагам, по которым принято решение о выплате Дохода. Обязательства по передаче Дохода возникают:

- из Договоров репо, из Внебиржевых договоров репо ОТС и из Пар договоров, заключенных в соответствии со статьями 25 и 26 настоящих Правил и не исполненных на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода;

- из Договоров купли-продажи облигаций, дата исполнения обязательств по которым приходится на период между датой составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода и датой окончания купонного периода, не включая указанные даты.

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

Далее в целях настоящей статьи:

- Договор репо и Внебиржевой договор репо ОТС, в которых на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, исполнено обязательство по передаче ценных бумаг по первой части соответствующего договора и не исполнено обязательство по передаче ценных бумаг по второй части соответствующего договора, совместно именуются неисполненными договорами репо;

- Пары договоров, по которым на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, исполнено обязательство по передаче ценных бумаг по Первому договору, составляющему Пару договоров, и не исполнено обязательство по передаче ценных бумаг по Второму договору, составляющему Пару договоров, совместно именуется неисполненными договорами купли-продажи;

- Договоры купли-продажи облигаций, дата исполнения обязательств по которым приходится на период между датой составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода и датой окончания купонного периода, не включая указанные даты, именуется Договорами с обязательством передачи Дохода.

КЦ не позднее Расчетного дня, следующего за Расчетным днем, в который в целях передачи Дохода были определены обязательства в соответствии с настоящей статьей, направляет Участникам клиринга, заключившим неисполненные договоры репо, неисполненные договоры купли-продажи, Договоры с обязательством передачи Дохода, уведомление в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, о

размере рассчитанных обязательств в порядке, предусмотренном статьей 34 настоящих Правил.

30.2. По Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС или Парам договоров, предметом которых являются ценные бумаги иностранных эмитентов, кроме финансовых инструментов, квалифицированных в качестве облигаций, в случае если эмитентом (лицом выдавшим ценную бумагу) принято решение о выплате Дохода денежными средствами и (или) ценными бумагами (кроме случая, предусмотренного пунктом 30.4 настоящих Правил), размер обязательства по передаче Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

$Inc = ROUND(N \times d; 2) - ROUND(N \times d \times tx; 2)$, где:	
Inc	размер обязательства по передаче Дохода;
N	количество ценных бумаг, подлежащих передаче по Договору репо, Внебиржевому договору репо ОТС, Парам договоров (в штуках);
d	сумма начисления на одну ценную бумагу, установленная эмитентом ценных бумаг или иным лицом, обязанным по ценным бумагам (в валюте, установленной эмитентом);
tx	налоговая ставка, применимая к доходам в виде дивидендов по ценным бумагам в соответствии с налоговым законодательством страны, резидентом которой является эмитент ценной бумаги или иное лицо, обязанное по ценным бумагам.

В случае если валюта сумм начислений, установленная эмитентом, отличается от валюты цены Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС, Пары договоров, КЦ вправе принять решение об определении обязательств по передаче Дохода в валюте цены Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС, Пары договоров, исходя из курса из источника, указанного на Сайте КЦ, определяемого на дату, следующую за датой составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода.

Передача указанных в настоящем пункте Доходов осуществляется с учетом Положения по QI/QDD.

30.3. По Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС, Парам договоров, предметом которых являются облигации, и по Договорам с обязательством передачи Дохода размер обязательства по передаче Дохода рассчитывается по формуле:

$Inc = ROUND(N \times (n + p); 2) - ROUND(N \times n \times tx; 2)$, где:	
Inc	размер обязательства по передаче Дохода (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата Дохода);
N	количество облигаций, подлежащих передаче по Договору репо, Внебиржевому договору репо ОТС, Парам договоров, Договорам с обязательством передачи Дохода (в штуках);
n	размер начисленного купонного дохода на одну облигацию, установленный эмитентом ценных бумаг (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата Дохода);
tx	налоговая ставка, применяемая к доходам в виде НКД по ценным бумагам в соответствии с налоговым законодательством страны, резидентом которой является эмитент ценной бумаги
p	размер премии, выплачиваемой эмитентом при досрочном погашении облигации (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата Дохода).

В случае если валюта сумм начислений, установленная эмитентом, отличается от валюты цены Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС, Пары договоров или Договора с обязательством передачи Дохода КЦ вправе принять решение об определении обязательств по передаче Дохода в валюте цены соответствующего договора исходя из курса из источника, указанного на Сайте КЦ, определяемого на дату, следующую за датой составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода.

30.4. По Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС или Парам договоров, предметом которых являются ценные бумаги, в случае если эмитентом (лицом, обязанным по ценным бумагам) принято решение о выплате Дохода исключительно ценными бумагами, размер обязательства по передаче Дохода определяется исходя из следующих условий:

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

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

30.4.2. в случае если ценные бумаги, которые подлежат передаче в виде Дохода, на дату, на которую Расчетный депозитарий производит распределение Дохода по итогам корпоративного события, не допущены к Торгам и к заключению Внебиржевых договоров ОТС, но допущены к торгам, проводимым иной биржей / торговой площадкой, передача Дохода осуществляется в форме денежных средств и размер обязательств по передаче указанного Дохода определяется исходя из цены закрытия ценной бумаги, которая подлежит передаче в виде Дохода. Цена закрытия указанной ценной бумаги определяется на последний день, в который торги по ценной бумаге проводятся на такой бирже / торговой площадке с правом получения Дохода приобретателем таких ценных бумаг;

30.4.3. в случае если ценные бумаги, которые подлежат передаче в виде Дохода, на дату, на которую Расчетный депозитарий производит распределение Дохода по итогам корпоративного события, не допущены к Торгам и к заключению Внебиржевых договоров ОТС, и не допущены к торгам, проводимым иной биржей / торговой площадкой, передача Дохода осуществляется в форме денежных средств и размер обязательств по передаче указанного Дохода определяется КЦ с учетом, в частности, предполагаемой денежной оценки размера Дохода, подлежащего выплате, на основании решения эмитента.

30.4.4. Передача указанных в пункте 30.2. и 30.4. настоящих Правил Доходов осуществляется с учетом Положения по QI/QDD.

30.5. Передача Дохода, размер которого определяется в соответствии с пунктами 30.2 - 30.4 настоящих Правил, осуществляется в следующие сроки, если решением КЦ не установлено иное:

- передача Дохода по Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС или Парам договоров, предметом которых являются ценные бумаги, за исключением облигаций осуществляется в течение 30 (тридцати) дней с даты раскрытия эмитентом информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода;

- передача Дохода по Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС, Парам договоров, предметом которых являются облигации, или Договорам с обязательством передачи Доход, осуществляется в течение 30 (тридцати) дней с даты раскрытия эмитентом информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода.

В случае если дата передачи Дохода приходится не на рабочий день, то передача Дохода происходит в следующий за ним рабочий день.

30.6. КЦ допускает рассчитанные обязательства по передаче и (или) требования по получению Дохода каждого Участника клиринга к клирингу в следующем порядке:

- обязательства по передаче Дохода, определенные на основании информации о неисполненных договорах репо / неисполненных договорах купли-продажи, предметом которых являются ценные бумаги, за исключением облигаций допускаются к клирингу в течение 1 (одного) дня с даты составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода. В случае если в указанный срок КЦ не может определить размер обязательств в соответствии с настоящей статьей, обязательства по передаче Дохода допускаются к клирингу сразу после получения КЦ недостающей информации, при этом срок исполнения указанного обязательства не может превышать срок, установленный пунктом 30.5 настоящих Правил;

- обязательства по передаче Дохода, определенные на основании информации о неисполненных договорах репо / неисполненных договорах купли-продажи предметом которых являются облигации, Договорах с обязательством передачи Дохода, допускаются к клирингу в течение 5 (пяти) дней с даты раскрытия эмитентом информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода. В случае если в указанный срок КЦ не может определить размер обязательств в соответствии с настоящей статьей, обязательства по передаче Дохода допускаются к клирингу сразу после получения КЦ недостающей информации, при этом срок исполнения указанного обязательства не может превышать срок, установленный пунктом 30.5 настоящих Правил.

30.7. В дату, определенную в пункте 30.5 настоящих Правил, обязательства по передаче Дохода включаются в клиринговый пул по Договорам и (или) в клиринговый пул ОТС и исполняются в порядке, установленном статьей 24 настоящих Правил.

30.8. КЦ предоставляет Участникам клиринга информацию о возникновении, прекращении и исполнении обязательств по передаче Доходов, начиная с момента допуска обязательств по передаче Дохода к клирингу и до момента прекращения указанных обязательств в клиринговом пуле в соответствии с настоящими Правилами, по форме, установленной в Регламенте клиринга. КЦ вправе предоставить Участникам клиринга информацию в размере обязательств по передаче Дохода в порядке, установленном Регламентом клиринга.

30.9. В случае если по обстоятельствам, не зависящим от КЦ, суммы выплаченного и переданного Дохода подлежат возврату, Участники клиринга обязаны возвратить соответствующие суммы в срок, определенный КЦ. Соответствующие обязательства допускаются к клирингу в момент принятия решения о возврате Дохода и включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в день принятия такого решения.

РАЗДЕЛ VII. ПОРЯДОК И СПОСОБЫ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЦ, УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА, РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ, РАСЧЕТНОГО ДЕПОЗИТАРИЯ, ОРГАНИЗАТОРА ТОРГОВЛИ, ТОРГОВОЙ ПЛОЩАДКИ. ОТЧЕТЫ КЦ

Статья 31. Порядок взаимодействия КЦ с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием

31.1. В целях оказания клиринговых услуг, в том числе для целей открытия и закрытия Торговых счетов депо, совершения операций с ценными бумагами, учитываемыми на Торговых счетах депо, получения информации о движении ценных бумаг по данным счетам, КЦ взаимодействует с Расчетным депозитарием на основании заключенного договора, внутренних документов Расчетного депозитария и (или) регламента взаимодействия.

31.2. В целях оказания клиринговых услуг, в том числе для открытия и закрытия Клирингового счета и совершения операций по нему, получения информации о движении денежных средств по указанному счету, КЦ взаимодействует с Расчетной организацией в соответствии с заключенными договорами, регламентами взаимодействия и внутренними документами Расчетной организации.

31.3. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием при открытии Торговых счетов депо определяется в статье 7 настоящих Правил.

После открытия каждого Торгового счета депо Расчетный депозитарий представляет в КЦ уведомление об открытии соответствующего Торгового счета депо.

31.4. Закрытие Торгового счета депо в Расчетном депозитарии осуществляется на основании заявления лица, которому открыт указанный Торговый счет депо. В случае направления заявления на закрытие Торгового счета депо Участником клиринга КЦ, КЦ передает его в Расчетный депозитарий.

31.5. По факту проведения операций, а также в сроки, установленные Регламентом клиринга, Расчетный депозитарий формирует и передает в КЦ выписку о состоянии Торговых счетов депо, содержащую информацию о ценных бумагах, учитываемых на Торговых счетах депо. На основании полученных от Расчетного депозитария выписок о состоянии раздела «Торговый» Торговых счетов депо, КЦ изменяет значения депо регистров.

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

31.7. Исполнение сводного поручения депо осуществляется Расчетным депозитарием по разделу «Торговый» Торговых счетов депо в корреспонденции с Торговым счетом депо КЦ, открытым в Расчетном депозитарии.

31.8. Расчетный депозитарий в сроки, установленные договором с Расчетным депозитарием, предоставляет в КЦ отчет (акт, или иной документ, установленный договором с Расчетным депозитарием), подтверждающий проведение расчетов по итогам клиринга.

31.9. Поручение КЦ и иные документы, указанные в настоящей статье Правил, предоставляются в электронном виде в форме Электронных документов, подписанных Электронной подписью.

Статья 32. Порядок взаимодействия КЦ с Торговой площадкой

32.1. КЦ уведомляет Торговую площадку о зарегистрированных ТКС.

32.2. Торговая площадка информирует КЦ о включении / исключении ценных бумаг в / из Список ценных бумаг / Списка ценных бумаг, приостановлении, возобновлении и прекращении Торгов ценными бумагами, а также об установлении и (или) изменении параметров ценных бумаг.

32.3. При установлении даты допуска ценных бумаг к Торгам, начиная с которой возможно заключение Договоров, КЦ устанавливает риск-параметры по этим ценным бумагам.

КЦ вправе изменять риск-параметры в порядке, установленном Методикой установления и изменения риск-параметров.

Статья 33. Способы получения и передачи документов при взаимодействии КЦ с Участниками клиринга, Расчетным депозитарием и Расчетной организацией

33.1. 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.

33.2. Документооборот между КЦ, Участниками клиринга, 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.

33.3. 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).

33.4. АСП используется при подаче в Клиринговую систему электронных сообщений, предусмотренных настоящими Правилами, в следующем порядке:

- Электронное сообщение, подписанное АСП, признается Электронным документом, равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному Участником клиринга/КЦ.

- Электронное сообщение считается подписанным АСП с момента отправки Участником клиринга / КЦ в Систему такого сообщения при условии успешного прохождения Участником клиринга / КЦ процедуры аутентификации в порядке, предусмотренном настоящей статьёй Правил.

- Присвоение Имени и Пароля Участнику клиринга / КЦ осуществляется Техническим центром, определенным КЦ и информация о котором раскрыта на Сайте КЦ, на основании договора (соглашения), заключенного между Участником клиринга / КЦ и Техническим центром, посредством внесения указанных Имени и Пароля в базу данных Системы.

- Процедура аутентификации осуществляется Техническим центром с использованием Системы при осуществлении Технического доступа Участника клиринга/КЦ в Систему путем сопоставления введенных Имени и Пароля соответствующим Имени и Паролю Участника клиринга / КЦ, информация о которых содержится в базе данных Клиринговой системы. В случае успешного прохождения процедуры аутентификации Участник клиринга / КЦ получает возможность осуществления операций в Системе. Аутентификация Участника клиринга/КЦ осуществляется автоматическим способом при каждом входе Участника клиринга/КЦ в Систему.

- Участник клиринга соглашается с тем, что КЦ могут быть изготовлены (распечатаны) копии электронных сообщений, подписанных АСП, на бумажном носителе, которые удостоверяются подписью уполномоченного лица КЦ и являются доказательством факта направления электронного сообщения с использованием Системы, а также подтверждают соответствие электронного сообщения содержанию копии электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.

33.5. 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.

33.6. 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.

33.7. Документы, полученные на бумажном носителе, вводятся в Систему сотрудниками КЦ. Дальнейшая обработка документов производится в Системе автоматически.

Статья 34. Отчеты КЦ и иная информация, предоставляемая Участникам клиринга

34.1. В процессе осуществления клиринга КЦ формирует и предоставляет Участнику клиринга отчеты по форме, установленной в Регламенте клиринга, содержащие сведения:

- об обязательствах, допущенных к клирингу;
- об обязательствах, определенных по итогам клиринга;
- об использовании Средств 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.

34.2. Отчеты, указанные в пункте 34.1 настоящих Правил, предоставляются Участнику клиринга в форме Электронных документов, подписанных Электронной подписью, в течение сроков, определенных Регламентом клиринга.

34.3. КЦ вправе представлять Участнику клиринга дополнительную информацию в виде уведомлений в форме Электронных документов, подписанных Электронной подписью и установленных в Регламенте клиринга. Дополнительная информация в виде уведомлений представляется Участникам клиринга в сроки, установленные в Регламенте клиринга.

РАЗДЕЛ VIII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

Статья 35. Порядок действия КЦ при операциях с ценными бумагами вследствие корпоративных событий

35.1. В случае проведения операции объединения дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг КЦ не позднее даты получения Расчётным депозитарием уведомления держателя реестра о проведённой операции объединения дополнительных выпусков ценных бумаг, получает от Расчётного депозитария уведомление о проведении операции объединения дополнительных выпусков ценных бумаг, которое должно содержать:

- полное наименование эмитента, объединение выпусков которого проведено;
- индивидуальные номера (коды) объединяемых выпусков ценных бумаг и индивидуальный номер (код) объединенного выпуска;
- дату проведения операции объединения выпусков ценных бумаг эмитента.

35.2. В случае проведения операции аннулирования кода дополнительного выпуска эмиссионных ценных бумаг КЦ не позднее даты проведения операции аннулирования кода дополнительного выпуска получает от Расчетного депозитария уведомление о проведении операции аннулирования кода дополнительного выпуска, которое должно содержать:

- полное наименование эмитента;
- индивидуальный номер (код) дополнительного выпуска ценных бумаг и индивидуальный номер (код) выпуска, по отношению к которому данный выпуск является дополнительным;
- дату проведения операции аннулирования кода.

35.3. Клиринговая система обеспечивает на клиринговых регистрах сохранность информации об учете ценных бумаг и операциях с ними до объединения выпусков и до аннулирования кода дополнительного выпуска.

35.4. После завершения операции объединения выпусков/аннулирования кода дополнительного выпуска и присвоения объединенным выпускам нового номера, поручения Участников клиринга, содержащие старый номер выпуска, не принимаются.

35.5. Операции по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и (или) аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг осуществляются в Клиринговой системе на следующий Расчетный день после получения соответствующего уведомления от Расчетного депозитария и по окончании расчетов по Договорам по итогам клиринга этого Расчетного дня. Проведение операций по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и (или) аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг в Клиринговой системе сопровождается корректировкой информации по Договорам, Дата исполнения которых еще не наступила. Коды объединяемых выпусков ценных бумаг в реквизитах указанных Договоров заменяются кодом объединенного выпуска, а аннулируемый код дополнительного выпуска ценных бумаг - кодом выпуска, по отношению к которому данный выпуск является дополнительным.

35.6. Если иное не предусмотрено настоящими Правилами, информация по Договорам / Внебиржевым договорам ОТС, предметом которых являются ценные бумаги, в отношении которых была осуществлена процедура дробления и (или) консолидации, может быть скорректирована с учетом проведенной процедуры, в течение Торгового дня, следующего за днем проведения процедуры дробления и (или) консолидации соответственно, на основании информации, полученной от эмитента ценных бумаг / лица, выдавшего ценные бумаги.

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

35.7.1. об изменении КЦ в одностороннем порядке условий Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, обязательства по которым не исполнены, и (или) порядка исполнения обязательств по Договорам / Внебиржевым договорам ОТС, с учетом условий

реорганизации эмитента ценных бумаг / лица, выдавшего ценные бумаги или условий иных действий (событий), происходящих с эмитентом / лицом, выдавшим ценные бумаги и (или) ценными бумагами эмитента;

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

35.8. КЦ при совершении действия, указанного в пункте 35.7.2 настоящих Правил, осуществляет действия, направленные на определение подлежащих исполнению обязательств в соответствии с настоящими Правилами.

35.9. Информация о решении, принятом КЦ в соответствии с пунктом 35.7 настоящих Правил, раскрывается на Сайте КЦ, а также направляется Участникам клиринга в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

Статья 36. Взаимодействие КЦ и Участников клиринга при исполнении КЦ функции Налогового агента, налоговых обязательств по Доходам, полученным по Ценным бумагам эмитентов США, а также обязательств по уплате Транзакционного налога

36.1. В целях исполнения требований Закона США «О налогообложении иностранных счетов» (Foreign Account Tax Compliance Act, FATCA), Стандарта по автоматическому обмену информацией о финансовых счетах (Common Reporting Standard) и иных законодательных актов в сфере налогообложения Доходов в виде дивидендов по Ценным бумагам эмитентов США (далее для целей настоящей статьи, информации, связанной с настоящей статьей, приведенной в иных статьях настоящих Правил, и иных принятых в соответствии с настоящей статьей документов – Ценные бумаги иностранных эмитентов), а также обеспечения возможности получения Участниками клиринга, Клиентами налоговых льгот в отношении Доходов в виде дивидендов и процентов по Ценным бумагам иностранных эмитентов, Участники клиринга обязаны направлять в КЦ документы и информацию, определенные Положением по QI/QDD и Регламентом обмена информацией, в порядке, определенном указанными внутренними документами КЦ.

36.2. КЦ обеспечивает возможность получения Участниками клиринга, Клиентами налоговых льгот по Дивидендным эквивалентам, величина которых зависит от Дохода по Ценным бумагам эмитентов США. В целях обеспечения возможности получения налоговых льгот по Доходам в виде Дивидендных эквивалентов по Ценным бумагам иностранных эмитентов, Участники клиринга обязаны предоставлять в КЦ документы и информацию, определенные Положением по QI/QDD и Регламентом обмена информацией, в порядке, определенном указанными внутренними документами КЦ.

36.3. Права, обязанности и ответственность Участников клиринга при взаимодействии с КЦ при исполнении налоговых обязательств по Доходам, полученным по Ценным бумагам иностранных эмитентов, определены Положением по QI/QDD.

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

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

- у КЦ, действующего от имени Участника клиринга или от имени КЦ, но в интересах Участника клиринга возникает обязательство осуществить фактические и юридические действия по уплате Транзакционного налога (далее – услуги по уплате

Транзакционного налога). Конкретный перечень действий КЦ устанавливается Регламентом по транзакционным налогам;

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

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

Обязательство Участника клиринга по уплате КЦ суммы, эквивалентной сумме Транзакционного налога, допускается к клирингу с момента его возникновения и подлежит включению в клиринговый пул, формируемый в порядке, определенном статьей 28 настоящих Правил. Порядок определения суммы, эквивалентной сумме Транзакционного налога, срок и порядок исполнения обязательства по ее уплате устанавливаются Регламентом по транзакционным налогам.

Уплата КЦ Транзакционного налога осуществляется в порядке и сроки, установленные Регламентом по транзакционным налогам с учетом требований налогового законодательства страны, в которой уплачивается Транзакционный налог.

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

Указанные заверения считаются заверением об обстоятельствах (representations) по смыслу главы 4 AIFC REGULATIONS ON OBLIGATIONS.

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

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

Статья 37. Хранение и учет документов и информации внутреннего учета

37.1. КЦ осуществляет хранение и учет документов, связанных с осуществлением клиринговой деятельности, и информации внутреннего учета, связанных с осуществлением внутреннего учета, в том числе:

- документов, 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.

37.2. 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 Клиентов в соответствии с Правилами допуска;
- иные реестры и журналы, ведение которых позволяет группировать документы и информацию внутреннего учета.

37.3. КЦ хранит документы, связанные с осуществлением им клиринговой деятельности, в течение 10 лет. При этом указанный срок в отношении документов, связанных с клирингом обязательств, исчисляется с даты прекращения и (или) исполнения этого обязательства по итогам клиринга.

37.4. Ведение реестров и журналов осуществляется в электронной форме и позволяет составлять списки и выписки из них за любой календарный день и за любой период, в пределах срока хранения информации. КЦ осуществляет ежедневное резервное копирование информации, содержащейся в регистрах и реестрах.

Статья 38. Порядок урегулирования неисполненных обязательств в случае прекращения клирингового обслуживания Участника клиринга

38.1.. При принятии КЦ решения о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга (далее в настоящей статье – Ликвидант) и наличием у Ликвиданта неисполненных обязательств на дату принятия указанного решения, в дату принятия указанного решения (далее – Дата решения о прекращении клирингового обслуживания) Даты исполнения обязательств из Договоров, даты исполнения обязательств из Внебиржевых договоров ОТС считаются наступившими, и обязательства и требования, возникшие из указанных договоров, прекращаются в дату включения указанных обязательств в клиринговый пул, формируемый в соответствии с настоящей статьей. При этом прекращаются все обязательства Ликвиданта, допущенные к клирингу.

Допущенные к клирингу обязательства Ликвиданта, возникшие из Внебиржевых договоров ОТС, Договоров включаются в ликвидационный клиринговый пул и подлежат прекращению в указанном пуле, формируемом в соответствии с пунктом 38.2 настоящих Правил. При этом обязательства Ликвиданта, возникшие из Договоров прекращаются возникновением нетто-обязательства Ликвиданта в отношении КЦ, рассчитанного в соответствии с пунктом 38.2 настоящих Правил. При этом в указанный клиринговый пул не включаются обязательства по возмещению убытков в форме упущенной выгоды и по уплате неустоек (штрафов, пеней).

В случаях, предусмотренных настоящим пунктом, Договоры, которые были заключены Ликвидантом в Дату решения о прекращении клирингового обслуживания или после указанной даты, могут быть признаны недействительными в случаях, предусмотренных законодательством МФЦА, и к ним могут быть применены последствия недействительности в соответствии с законодательством МФЦА. КЦ вправе предъявить требование о возмещении убытков, связанных с недействительностью Договоров, а также об уплате неустоек (штрафов, пеней) в общем порядке, предусмотренном законодательством МФЦА.

КЦ направляет Ликвиданту уведомление о прекращении обязательств по Договорам, в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, в течение 2 (двух) Расчетных дней, следующих за Датой решения о прекращении клирингового обслуживания. Указанное уведомление содержит информацию о рассчитанных в соответствии с пунктом 38.2 настоящих Правил нетто-обязательствах

Ликвиданта в отношении КЦ. 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 в соответствии с пунктом 2.3. настоящих Правил.

Денежные средства / ценные бумаги Ликвиданта, оставшиеся у КЦ после исполнения нетто-обязательств, определенных в соответствии с пунктом 38.2 настоящих Правил, подлежат возврату КЦ Ликвиданту в сумме / количестве, оставшемся после исполнения соответствующего нетто-обязательства.

В случае нехватки Средств обеспечения Ликвиданта и (или) его взноса в Гарантийный фонд для исполнения нетто-обязательства, определённого в соответствии с пунктом 38.2 настоящих Правил, КЦ вправе предъявить к Ликвиданту требование об исполнении указанного нетто-обязательства в порядке, предусмотренном в AIFC INSOLVENCY REGULATIONS и AIFC INSOLVENCY RULES, а также законодательством о несостоятельности (банкротстве) Республики Казахстан.

38.2. В целях определения нетто-обязательства Ликвиданта КЦ осуществляет следующие действия.

38.2.1. Не позднее окончания рабочего дня, следующего за Датой решения о прекращении клирингового обслуживания, по всем Договорам, заключённым Ликвидантом:

1) КЦ включает в ликвидационный клиринговый пул:

- обязательства и требования по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам купли-продажи / Договорам репо, не исполненные по состоянию на Дату решения о прекращении клирингового обслуживания;

- обязательства и требования по денежным средствам по Внебиржевому договору купли-продажи валюты ОТС / Внебиржевому валютному свопу ОТС, не исполненные по состоянию на Дату решения о прекращении клирингового обслуживания;

- обязательства и требования по денежным средствам и ценным бумагам по Внебиржевым договорам ОТС и Внебиржевым договорам репо ОТС, не исполненные по состоянию на Дату решения о прекращении клирингового обслуживания;

- обязательства по уплате Задолженности или задолженности, определённой в соответствии со статьёй 29 настоящих Правил, не исполненные по состоянию на Дату решения о прекращении клирингового обслуживания;

- обязательства Ликвиданта по передаче КЦ Дохода, не исполненные по состоянию на Дату решения о прекращении клирингового обслуживания.

2) не исполненные по состоянию на дату формирования ликвидационного клирингового пула обязательства по передаче ценных бумаг, в том числе обязательства по передаче Дохода в форме ценных бумаг, зачитываются со встречными однородными требованиями по получению ценных бумаг, и в части, в которой обязательства не были прекращены зачетом, КЦ определяет итоговые обязательства (требования) Ликвиданта по ценным бумагам;

3) итоговые обязательства (требования) Ликвиданта по ценным бумагам, определённые в соответствии с подпунктом 2 настоящего пункта, переводятся в валюту расчётов путем умножения количества ценных бумаг, составляющих указанное итоговое обязательство (требование), на Верхнюю (Нижнюю) цену принудительного закрытия, определённую в рамках последней Клиринговой сессии в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров. При этом Верхняя цена принудительного закрытия используется в целях перевода в валюту расчетов итогового обязательства Ликвиданта, а Нижняя цена принудительного закрытия - в целях перевода в валюту расчетов итогового требования Ликвиданта;

4) в целях определения нетто-обязательства Ликвиданта размер обязательств по передаче Дохода в форме денежных средств определяется в соответствии со статьёй 30 настоящих Правил;

5) обязательства по денежным средствам, определённые в соответствии с подпунктами 1 - 4 настоящего пункта, зачитываются со встречными однородными требованиями по денежным средствам, определёнными в соответствии с подпунктами 1 - 4 настоящего пункта, и в части, в которой указанные обязательства не были прекращены зачетом, КЦ определяет итоговые обязательства (требования) Ликвиданта по денежным средствам;

6) итоговые обязательства (требования) Ликвиданта по денежным средствам, определённые в соответствии с подпунктом 5 настоящего пункта в разных валютах, пересчитываются в одну валюту по выбору КЦ по курсу из источника, указанного на Сайте КЦ, установленному на дату формирования в соответствии с настоящим пунктом ликвидационного клирингового пула.

38.2.2. Нетто-обязательство Ликвиданта по денежным средствам исполняется за счет его Средств обеспечения и его взноса в Гарантийный фонд в срок, не превышающий 2 (двух) рабочих дней с даты определения указанного нетто-обязательства, в следующем порядке:

1) исполнение нетто-обязательства по денежным средствам осуществляется путем уменьшения размера Средств обеспечения в валюте определенного нетто-обязательства на размер такого нетто-обязательства;

2) использование взноса Ликвиданта в Гарантийный фонд в валюте определенного нетто-обязательства осуществляется путем перечисления денежных средств, составляющих взнос Ликвиданта в Гарантийный фонд, в счет исполнения его нетто-обязательства;

3) замена Средств обеспечения Ликвиданта в валюте, отличной от валюты определенного нетто-обязательства, на валюту такого нетто-обязательства по курсу в момент совершения операции;

4) замена валюты, составляющей взнос Ликвиданта в Гарантийный фонд, на валюту определенного нетто-обязательства по курсу в момент совершения операции;

5) осуществление действий, направленных на продажу КЦ ценных бумаг, составляющих Средства обеспечения Ликвиданта. В случае если в результате указанной продажи КЦ получены денежные средства, выраженные в валюте, отличной от валюты определенного нетто-обязательства, то КЦ осуществляет замену указанной валюты на валюту такого нетто-обязательства по курсу в момент совершения операции. Сумма денежных средств, полученная в результате указанных действий, используется КЦ для прекращения нетто-обязательства Ликвиданта по денежным средствам.

Размер Средств обеспечения Ликвиданта в денежных средствах, размер его Средств обеспечения в ценных бумагах, а также его взнос в Гарантийный фонд уменьшаются на сумму использованных денежных средств/ценных бумаг из указанных Средств обеспечения / Гарантийного фонда из Размера взноса Ликвиданта.

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

Если в результате действий, указанных в подпунктах 1 - 5 настоящего пункта, нетто-обязательство Ликвиданта не прекратилось в полном объеме, Ликвидант признается не исполнившим нетто-обязательство по денежным средствам. КЦ учитывает не прекращенное нетто-обязательство Ликвиданта как Задолженность Ликвиданта и осуществляет действия по погашению Задолженности в общем порядке, предусмотренном в AIFC INSOLVENCY REGULATIONS и AIFC INSOLVENCY RULES, а также законодательством о несостоятельности (банкротстве) Республики Казахстан.

КЦ при проведении действий в соответствии с настоящей статьей Правил с целью минимизации рисков центрального контрагента вправе заключать Договоры / Внебиржевые договоры ОТС с Участниками клиринга на Торгах и (или) на внебиржевых торгах. В случае невозможности заключения Договоров / Внебиржевых договоров ОТС на Торгах и (или) на внебиржевых торгах КЦ вправе заключать Договоры / Внебиржевые

договоры ОТС с Участниками клиринга без подачи Заявок, без направления Оферт ОТС и Акцептов ОТС в соответствии со статьей 17 настоящих Правил.

38.3. Для целей определения нетто-обязательства Ликвиданта по уплате Торгового сбора и Депозитарного сбора КЦ не позднее окончания рабочего дня, следующего за Датой решения о прекращении клирингового обслуживания, включает в ликвидационный клиринговый пул по Торговому сбору и Депозитарному сбору обязательства Ликвиданта по уплате Торгового сбора и Депозитарного сбора, не исполненные на дату формирования клирингового пула и определяемые на основании информации о размере Торгового сбора и Депозитарного сбора, полученной от Расчетного депозитария .

Нетто-обязательства Ликвиданта по денежным средствам, выраженные в валюте, отличной от валюты определенного нетто-обязательства, подлежат пересчету в валюту такого обязательства по курсу из источника, указанного на Сайте КЦ, установленному на дату формирования в соответствии с настоящим пунктом ликвидационного клирингового пула по уплате Торгового сбора.

Нетто-обязательство Ликвиданта по уплате Торгового сбора исполняется за счет Средств обеспечения Ликвиданта и вноса Ликвиданта в Гарантийный фонд в срок, не превышающий 2 (двух) Расчетных дней с даты определения указанного нетто-обязательства.

Статья 39. Существенные события

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

- решения и действия органов государственной власти, МФЦА, иных органов, учреждений и организаций Республики Казахстан (в том числе внесение изменений в законодательство), а также органов государственной власти, регуляторов на финансовом рынке, учреждений и (или) организаций иностранных государств;

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

- действия / бездействия банков (включая юридических лиц, являющихся нерезидентами, которые на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) уполномоченного органа государства учреждения имеют право осуществлять банковские операции, предусмотренные личном законом такого лица) или небанковских кредитных организаций (включая юридических лиц, являющихся нерезидентами, которые на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) уполномоченного органа государства учреждения имеют право осуществлять определенные таким разрешением банковские операции, предусмотренные личном законом данного лица), в том числе в которых Расчетным организациям открыты денежные счета, повлекшие невозможность исполнения КЦ обязательств перед Участником клиринга / Участниками клиринга, определенных по итогам клиринга, а также по возврату денежных средств Участнику клиринга / Участникам клиринга по не зависящим от КЦ, Расчетной организации и (или) Участника клиринга / Участников клиринга причинам, включая случаи введения вышеуказанными организациями специальных режимов переводов денежных средств и (или) ограничений проведения операций с денежными средствами;

- действия / бездействия депозитариев и (или) иностранных учетных институтов, осуществляющих учет и переход прав на ценные бумаги, учитываемые на Торговом счете депо в Расчетном депозитарии, повлекшие невозможность исполнения КЦ обязательств

перед Участником клиринга / Участниками клиринга, определенных по итогам клиринга, а также обязательств по возврату ценных бумаг, учитываемых на Торговом счете депо, Участнику клиринга / Участникам клиринга по не зависящим от КЦ, Расчетного депозитария и (или) Участника клиринга / Участников клиринга причинам, включая случаи введения вышеуказанными организациями специальных режимов переводов ценных бумаг и (или) ограничений проведения операций с ценными бумагами;

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

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

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

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

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

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

39.4 В качестве мер по урегулированию существенного события КЦ могут быть приняты следующие решения:

39.4.1. об изменении порядка и сроков осуществления документооборота в процессе взаимодействия КЦ с Участниками клиринга, Расчетной организацией, Расчетным депозитарием;

39.4.2. о прекращении учета (полностью или в части) ценных бумаг / валюты, определенных решением КЦ, в качестве Средств обеспечения Участника клиринга / Участников клиринга, в отношении которого / которых событие признано существенным (далее – Блокировка обеспечения Участника клиринга / Участников клиринга);

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

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

39.4.5. об изменении способа, порядка и (или) срока исполнения КЦ обязательства по возврату Участникам клиринга денежных средств, установлении ограничений на проведение операций с денежными средствами, в том числе, в отношении которых установлена Блокировка обеспечения Участников клиринга;

39.4.6. об изменении способа, порядка и (или) срока исполнения КЦ поручений Участников клиринга, установлении ограничений на проведение операций с ценными бумагами, учитываемыми на Торговых счетах депо, в том числе, в отношении которых установлена Блокировка обеспечения Участников клиринга;

39.4.7. о приостановлении / прекращении клирингового обслуживания Участника клиринга / Участников клиринга;

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

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

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

39.5. В решении КЦ, принятом в соответствии с пунктом 39.4.2 настоящих Правил, о Блокировке обеспечения в отношении Участников клиринга указывается сумма валюты / количество ценных бумаг, которое прекращает учитываться в качестве Средств обеспечения каждого из Участников клиринга, в отношении которых событие признано существенным. КЦ также вправе принять иные решения, необходимые для обеспечения реализации решения о прекращении учета валюты / ценных бумаг в качестве Средств обеспечения Участников клиринга.

39.5.1. Сумма валюты, учет которой в качестве Средств обеспечения Участников клиринга прекращен решением КЦ, принятым в соответствии с пунктом 39.4.2 настоящих Правил, распределяется и учитывается КЦ на Блокировочных регистрах, открытых КЦ в рамках тех же ТКС, на которых на момент начала Блокировки обеспечения Участников клиринга валюта учитывалась в качестве Средств обеспечения. Одновременно с началом учета валюты на Блокировочном регистре ТКС на соответствующую сумму уменьшается сумма денежных средств в этой валюте, учитываемая на денежном регистре того же ТКС.

39.5.2. Количество ценных бумаг, учет которых в качестве Средств обеспечения Участников клиринга прекращен решением КЦ, принятым в соответствии с пунктом 39.4.2. настоящих Правил, распределяется и переводится Расчетным депозитарием по поручению КЦ с раздела «Торговый» на раздел «Неторговый» Торговых счетов депо, на которых на момент начала Блокировки обеспечения Участников клиринга ценные бумаги учитывались в качестве Средств обеспечения. Одновременно с переводом ценных бумаг на раздел «Неторговый» Торгового счета депо на соответствующее количество уменьшается количество ценных бумаг, учитываемых на депо регистре ТКС, зарегистрированного с указанием такого Торгового счета депо.

39.6. В решении КЦ, принятом в соответствии с пунктом 39.4.3 настоящих Правил, о Списании обеспечения Участников клиринга указывается сумма валюты / количество ценных бумаг, которая(-ое) прекращает учитываться в качестве Средств обеспечения с одновременным уменьшением обязательства КЦ по возврату каждому из Участников клиринга, в отношении которых событие признано существенным.

39.6.1. Сумма валюты, указанная в решении КЦ, принятым в соответствии с пунктом 39.4.3 настоящих Правил, распределяется КЦ и уменьшает значения денежных и (или) Блокировочных регистров ТКС, на которых на момент начала Списания обеспечения Участников клиринга учитывалась валюта, с одновременным уменьшением на соответствующую величину обязательства КЦ по возврату валюты Участникам клиринга.

39.6.2. Количество ценных бумаг, указанных в решении КЦ, принятым в соответствии с пунктом 39.4.3 настоящих Правил, распределяется КЦ и списывается Расчетным депозитарием по поручению КЦ с раздела «Торговый» и (или) с раздела «Неторговый» Торговых счетов депо с одновременным уменьшением на

соответствующую величину обязательства КЦ по возврату ценных бумаг Участникам клиринга.

39.7. После прекращения обстоятельств, являющихся основанием признания события существенным, КЦ принимает решение о полном или частичном прекращении признания события существенным и о полном или частичном прекращении мер по урегулированию этого существенного события. КЦ также вправе принять решение об изменении мер по урегулированию этого существенного события.

О принятом решении КЦ извещает Участников клиринга, в отношении которых принято решение о прекращении признания события существенным, а также Расчетную организацию / Расчетный депозитарий (при необходимости).

39.7.1. После прекращения обстоятельств, являющихся основанием признания события существенным и Блокировки обеспечения в соответствии с пунктом 39.4.2 настоящих Правил, КЦ принимает решение о возобновлении учета (полностью или в части) в качестве Средств обеспечения валюты / ценных бумаг, учет которой(-ых) в качестве Средств обеспечения Участников клиринга ранее был прекращен решением КЦ о Блокировке обеспечения принятым (далее - Снятие блокировки обеспечения Участников клиринга).

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

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

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

39.9. В случае неисполнения Участником клиринга, в отношении которого событие признано существенным, обязательств, предусмотренных настоящими Правилами, в том числе возникших в результате признания события существенным в отношении такого Участника клиринга и (или) исполнения мер по урегулированию существенного события, принятых КЦ, КЦ урегулирует данные неисполненные обязательства в порядке, предусмотренном настоящими Правилами, в том числе использует уровни защиты центрального контрагента, предусмотренные настоящими Правилами об ограничении размера ответственности КЦ, а также уменьшение размера обязательства по возврату Средств обеспечения Добросовестным Участникам клиринга на сумму, равную оставшейся непогашенной Задолженности Должника, предусмотренное настоящими Правилами.

39.10. При принятии решений по урегулированию существенных событий КЦ вправе:

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

39.11. О мерах, принятых по решению КЦ в целях урегулирования существенного события, Участник клиринга / Участники клиринга, в отношении которых событие признано существенным, оповещаются имеющимися доступными средствами связи не позднее дня принятия данных мер.

39.12. КЦ освобождается и не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть в связи с неосуществлением клирингового обслуживания Участника клиринга / Участников клиринга в соответствии с настоящими Правилами / неисполнением своих обязательств перед Участником клиринга / Участниками клиринга в соответствии с настоящими Правилами / применением мер по урегулированию существенного события в случае признания события существенным в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 39.1 настоящих Правил.