

УТВЕРЖДЕНЫ  
решением Совета директоров  
Акционерного общества  
«Санкт-Петербургская Валютная Биржа»  
(протокол от 16.01.2026 № 453)

**ПРАВИЛА КЛИРИНГА**  
**Акционерного общества**  
**«Санкт-Петербургская Валютная Биржа»**

## ОГЛАВЛЕНИЕ

1.	Общие положения .....	4
1.1.	Термины и определения.....	4
1.2.	Основные сведения о клиринговой деятельности АО СПВБ и раскрытие иной информации .....	9
1.3.	Список Расчетных организаций и Расчетных депозитариев .....	10
1.4.	Утверждение, изменение и дополнение Правил клиринга .....	10
1.5.	Конфиденциальность информации .....	10
1.6.	Порядок документооборота при осуществлении клиринга.....	11
2.	Договор об оказании клиринговых услуг .....	11
2.1.	Предмет Договора об оказании клиринговых услуг .....	11
2.2.	Заключение и расторжение Договора об оказании клиринговых услуг .....	12
2.3.	Ответственность Клиринговой организации и Участника клиринга .....	13
2.4.	Порядок разрешения споров между Клиринговой организацией и Участником клиринга .....	14
3.	Требования к Участникам клиринга.....	15
3.1.	Категории Участников клиринга .....	15
3.2.	Требования к кандидатам в Участники клиринга.....	15
3.3.	Допуск к клиринговому обслуживанию .....	16
3.4.	Порядок регистрации Участников клиринга и клиентов Участника клиринга .....	17
3.5.	Порядок приостановления, возобновления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию .....	18
4.	Права и обязанности Клиринговой организации и Участников клиринга .....	23
4.1.	Обязанности Клиринговой организации.....	23
4.2.	Права Клиринговой организации.....	23
4.3.	Обязанности Участника клиринга .....	24
4.4.	Права Участника клиринга .....	25
5.	Порядок проведения клиринга .....	26
5.1.	Порядок и условия допуска обязательств к клирингу .....	26
5.2.	Порядок и условия включения обязательств в клиринговый пул (исключения обязательств из клирингового пула).....	26
5.3.	Порядок проведения клиринга в рамках клиринговых сессий.....	27
5.4.	Процедура контроля обеспечения.....	30
5.5.	Порядок исполнения (прекращения) обязательств по итогам клиринга .....	31
5.6.	Порядок проведения сверки результатов расчетов .....	34
5.7.	Порядок действий в случае расхождения данных при сверке .....	34

5.8. Порядок прекращения обязательств в связи с введением процедур банкротства Участника клиринга и определения размера денежного обязательства, возникающего в связи с таким прекращением.....	35
6. Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу .....	36
6.1. Индивидуальное клиринговое обеспечение .....	36
7. Виды торговых и клиринговых счетов и порядок совершения операций по ним 37	
7.1. Виды торговых и клиринговых счетов.....	37
7.2. Порядок проведения операций по торговым банковским счетам .....	39
7.3. Порядок проведения операций по торговым счетам депо и Специальному техническому счету.....	40
7.4. Порядок проведения операций по клиринговым счетам.....	41
8. Клиринговые регистры и иные формы внутреннего учета, их назначение, порядок ведения.....	43
8.1. Клиринговые регистры учета ценных бумаг .....	43
8.2. Клиринговые регистры учета обязательств по ценным бумагам.....	43
8.3. Клиринговые регистры учета денежных средств.....	45
8.4. Клиринговые регистры учета обязательств по денежным средствам .....	46
8.5. Порядок ведения клиринговых регистров.....	46
8.6. Реестры и иные формы внутреннего учета Клиринговой организации .....	47
8.7. Торгово-клиринговые регистры .....	48
9. Порядок представления Участникам клиринга отчетов по итогам клиринга ...	51
9.1. Формы отчетов .....	51
9.2. Порядок и сроки предоставления отчетов Участникам клиринга .....	51
10. Меры, направленные на управление рисками при осуществлении клиринга ...	52
10.1. Система управления рисками.....	52
10.2. Документы АО СПВБ по управлению рисками.....	53
10.3. Общие принципы управления рисками .....	53
10.4. Порядок установления лимитов по допустимому объему договоров .....	54
11. Определение чрезвычайных ситуаций и порядок взаимодействия с Участниками клиринга в чрезвычайных ситуациях.....	54
12. Оплата клиринговых услуг .....	54
13. Взаимодействие с Биржей, Расчетной организацией и Расчетным депозитарием 55	
13.1. Порядок взаимодействия с Биржей .....	55
13.2. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией.....	56
13.3. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием .....	57

## **1. Общие положения**

### **1.1. Термины и определения**

АО СПВБ – Акционерное общество «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

Биржа – АО СПВБ, осуществляющее деятельность организатора торговли.

Биржевой инструмент (биржевой инструмент) – тип депозитных договоров, кредитных договоров, договоров купли-продажи иностранной валюты, заключаемых на Бирже на условиях одной Спецификации. Биржа присваивает каждому Биржевому инструменту уникальный код (тикер).

Валюта лота (валюта лота) – валюта, в которой номинирован лот ценной бумаги / Биржевого инструмента.

Валютный биржевой инструмент (валютный биржевой инструмент) – тип договоров купли-продажи иностранной валюты, заключаемых на Бирже на условиях одной Спецификации.

Внутренние документы Биржи – Правила организованных торгов Биржи, Спецификации Биржевых инструментов, а также иные внутренние документы Биржи, регламентирующие деятельность по проведению организованных торгов, утвержденные Биржей в установленном порядке и раскрытые на Сайте Биржи.

Внутренние документы Клиринговой организации – «Правила клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», «Расписание предоставления клиринговых услуг Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», «Положение о формах и форматах документов Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», «Порядок присвоения регистрационных кодов Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», регламентирующие клиринговую деятельность, утвержденные Клиринговой организацией в установленном порядке и раскрытые на Сайте Клиринговой организации.

Гарантийное обеспечение (гарантийное обеспечение) – индивидуальное клиринговое обеспечение Участника клиринга в ценных бумагах и/или денежных средствах, которое используется для обеспечения и/или исполнения обязательств Участников клиринга, допущенных к клирингу в соответствии с Правилами клиринга. Требование по внесению гарантийного обеспечения не распространяется на Участников клиринга, перечисленных в п. 5 ст. 23 Федерального закона от 07.02.2011 № 7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте».

Группа валютных биржевых инструментов (группа валютных биржевых инструментов) – один или несколько валютных биржевых инструментов, валюта лота и сопряженная валюта которых совпадают.

Держатель (держатель) – организация, осуществляющая на основании лицензии на осуществление депозитарной деятельности депозитарное обслуживание Участников клиринга, имеющая торговые счета депо в Расчетном депозитарии для проведения операций с ценными бумагами Участников клиринга и/или их клиентов по результатам клиринга.

Договор об оказании клиринговых услуг – договор, заключаемый между Участником клиринга и Клиринговой организацией, по которому Клиринговая организация обязуется в соответствии с Правилами клиринга оказывать Участнику клиринга клиринговые услуги, а Участники клиринга обязуются оплачивать указанные услуги, если иное не предусмотрено законодательством Российской Федерации.

Клиринговая организация – АО СПВБ.

Клиринговый пул (клиринговый пул) – совокупность обязательств с наступившей датой исполнения, допущенных к клирингу и подлежащих полностью прекращению зачетом и/или иным способом в соответствии с Правилами клиринга и/или исполнением.

Клиринг (клиринг) – определение подлежащих исполнению обязательств, возникших из договоров, в том числе в результате неттинга обязательств, и подготовка документов (информации), являющихся основанием прекращения и/или исполнения таких обязательств, а также обеспечение исполнения таких обязательств.

Клиринг с полным обеспечением (клиринг с полным обеспечением) – клиринг обязательств из договора, условием заключения которого является наличие ценных бумаг / денежных средств Участника клиринга и/или наличие допущенных к клирингу требований Участника клиринга по получению ценных бумаг / денежных средств (обязательств противоположной направленности) со сроком исполнения не позднее даты исполнения обязательств по данному договору, в размере, необходимом для исполнения обязательств по такому договору в полном объеме.

Клиринг без предварительного обеспечения (клиринг без предварительного обеспечения) – клиринг обязательств из договора, при заключении которого не проверяется наличие обеспечения.

Клиринговая сессия (клиринговая сессия) – период времени, в течение которого Клиринговой организацией проводятся операции, предусмотренные п. 5.3.2 Правил клиринга.

Клиринговая система – совокупность программно-технических средств, баз данных, телекоммуникационных средств, иного оборудования и программного обеспечения Клиринговой организации, предназначенных для осуществления клиринговой деятельности в соответствии с Правилами клиринга.

Клиринговое обслуживание (клиринговое обслуживание) – оказание клиринговых услуг Участникам клиринга.

Клиринговый регистр КБС – клиринговый регистр, предназначенный для учета средств Участника клиринга или Обособленного клиента / клиентов Участника клиринга, зачисленных на Клиринговый банковский счет Клиринговой организации.

Код расчетов T0 (код расчетов T0) – код расчетов, определяющий, что при подаче заявки проводится контроль обеспечения обязательств, подлежащих исполнению, в полном объеме, а датой исполнения обязательств по договору является дата заключения договора.

Код расчетов Вn (код расчетов Вn) – код расчетов, определяющий, что при подаче заявки контроль обеспечения не проводится, а датой исполнения обязательств по договору является дата, определяемая как T+n, где T – дата заключения договора, а n – число календарных дней.

Код Участника клиринга (код Участника клиринга) – уникальный буквенно-цифровой код Участника клиринга, клиента Участника клиринга, соответствующий требованиям законодательства Российской Федерации, присваиваемый Клиринговой организацией Участнику клиринга, клиенту Участника клиринга и однозначно определяющий Участника клиринга или клиента Участника клиринга.

Лот (лот) – стандартное количество ценных бумаг, валюты Российской Федерации, иностранной валюты, определяемое применительно к каждой ценной бумаге / Биржевому инструменту в соответствии с решением Биржи о включении ценной бумаги в список ценных бумаг, допущенных к организованным торгам, и/или Спецификацией, кратко которому определяется объем договора.

Неттинг – полное или частичное прекращение обязательств, допущенных к клирингу, зачетом и/или иным способом, установленным Правилами клиринга.

Обособленный клиент Участника клиринга (обособленный клиент) – клиент Участника клиринга, обязательства из договоров, заключенных в интересах которого, учитываются отдельно и для учета обеспечения и/или исполнения обязательств из которых Участником клиринга открыт отдельный торговый банковский счет / используется отдельный Клиринговый регистр КБС и Отдельный специальный торговый счет депо.

Основная клиринговая сессия в Секции ДВР – клиринговая сессия, осуществляемая с особенностями, установленными п. 5.4.6, п. 5.5.16 и п. 5.5.17 Правил клиринга.

Отдельный специальный брокерский счет (отдельный специальный брокерский счет) – торговый банковский счет Участника клиринга – профессионального участника рынка ценных бумаг, имеющего лицензию Банка России на осуществление брокерской деятельности, в Расчетной организации для учета индивидуального клирингового обеспечения Обособленного клиента Участника клиринга, которое будет использоваться только для исполнения и/или обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу и возникших из договоров, заключенных за счет Обособленного клиента, зарегистрированного в Клиринговой организации.

Отдельный специальный торговый счет (отдельный специальный торговый счет) – торговый банковский счет Участника клиринга – кредитной организации в Расчетной организации для учета индивидуального клирингового обеспечения Обособленного клиента Участника клиринга, которое будет использоваться только для исполнения и/или обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу и возникших из договоров, заключенных за счет Обособленного клиента, зарегистрированного в Клиринговой организации.

Отдельный специальный торговый счет депо (отдельный специальный торговый счет депо) – торговый счет депо в Расчетном депозитарии для учета индивидуального клирингового обеспечения Обособленного клиента Участника клиринга, которое будет использоваться только для исполнения и/или обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу и возникших из договоров, заключенных за счет Обособленного клиента, зарегистрированного в Клиринговой организации.

Покупатель – Участник клиринга, являющийся стороной договора купли-продажи (поставки) ценных бумаг / иностранной валюты, имеющий требования по поставке ценных бумаг / денежных средств в валюте лота и обязательства по уплате денежных средств (денежных средств в сопряженной валюте). Для целей депозитного договора покупателем является Участник клиринга, являющийся стороной депозитного договора, принявший денежные средства в день размещения депозита и имеющий обязательство по возврату денежных средств в день исполнения обязательств по возврату депозита. Для целей кредитного договора покупателем является Участник клиринга, имеющий требование по поставке денежных средств в день исполнения обязательств по предоставлению/привлечению кредита и обязательство по поставке денежных средств в день исполнения обязательств по возврату кредита.

Положение о формах и форматах документов – внутренний документ Клиринговой организации «Положение о формах и форматах документов Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

Порядок присвоения регистрационных кодов – внутренний документ Клиринговой организации «Порядок присвоения регистрационных кодов Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

Правила клиринга – внутренний документ Клиринговой организации «Правила клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

Продавец (Поставщик) – Участник клиринга, являющийся стороной договора купли-продажи (поставки) ценных бумаг / иностранной валюты и имеющий обязательство по поставке ценных бумаг / денежных средств в валюте лота и требование по поставке денежных средств (денежных средств в сопряженной валюте). Для целей депозитного договора продавцом является Участник клиринга, являющийся стороной депозитного договора, передавший денежные средства в день размещения депозита и имеющий требование по возврату денежных средств в день исполнения обязательств по возврату депозита. Для целей кредитного договора продавцом является Участник клиринга, имеющий обязательство по поставке денежных средств в день исполнения обязательств по предоставлению/привлечению кредита и требование по поставке денежных средств в день исполнения обязательств по возврату кредита.

Промежуточная клиринговая сессия в Секции ДВР – клиринговая сессия, осуществляемая с особенностями, установленными п. 5.4.5 Правил клиринга.

Раздел «к размещению» / «к выкупу» (раздел «к размещению» или раздел «к выкупу») – отдельный раздел, открытый Расчетным депозитарием на Специальном техническом счете, не предназначенном для учета прав на ценные бумаги, используемый для проведения операций при размещении/выкупе ценных бумаг.

Расписание предоставления клиринговых услуг – внутренний документ Клиринговой организации «Расписание предоставления клиринговых услуг Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

Расчетная организация – кредитная организация, осуществляющая операции, связанные с исполнением обязательств по передаче денежных средств по итогам клиринга обязательств из заключенных на Бирже договоров на основании договора с Клиринговой организацией. Наименование Расчетной организации указывается в Спецификации Биржевого инструмента или в решении Биржи о включении ценной бумаги в список ценных бумаг, допущенных к организованным торгам, а также раскрывается на Сайте Клиринговой организации в соответствии с законодательством Российской Федерации.

Расчетный депозитарий – депозитарий, имеющий лицензию Банка России на право осуществления депозитарной деятельности, осуществляющий расчеты по результатам сделок, совершенных на организованных Биржей торгах на основании договора с Клиринговой организацией. Наименование Расчетного депозитария указывается в решении Биржи о включении ценной бумаги в список ценных бумаг, допущенных к организованным торгам, а также раскрывается на Сайте Клиринговой организации в соответствии с законодательством Российской Федерации.

Сайт Биржи (Сайт Клиринговой организации) – официальный сайт АО СПВБ в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» по адресу <https://www.spvb.ru>.

Свободные денежные средства (свободные денежные средства, свободные от обязательств денежные средства) – денежные средства на клиринговых регистрах, предназначенных для учета денежных средств на торговых банковских счетах или Клиринговых регистрах КБС, за вычетом суммы денежных средств в размере требования к обеспечению, необходимому для обеспечения и исполнения обязательств из договоров, допущенных к клирингу, в полном объеме или в части, определенной в соответствии со Спецификацией.

Секция – торговая (биржевая) секция Биржи, организованные торги в которой проводятся в соответствии с отдельными правилами проведения организованных торгов.

Секция денежного и валютного рынков (Секция ДВР) – торговая (биржевая) секция АО СПВБ, в которой проводятся организованные торги по привлечению/размещению денежных средств и покупке/продаже иностранной валюты в соответствии с Правилами проведения организованных торгов в Секции денежного и валютного рынков Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

Сопряженная валюта (сопряженная валюта) – валюта, отличная от валюты, в которой номинирован лот Валютного биржевого инструмента, за которую производится покупка или продажа лота Валютного биржевого инструмента / в которой устанавливается цена лота Валютного биржевого инструмента.

Специальный технический счет – счет, открытый в Расчетном депозитарии и предназначенный для проведения расчетов по обязательствам по итогам клиринга. Счет не предназначен для учета прав на ценные бумаги. Остаток ценных бумаг на Специальном техническом счете после проведения расчетов по итогам клиринга не допускается.

Спецификация Биржевого инструмента (Спецификация) – внутренний документ АО СПВБ, содержащий стандартные условия (параметры) заключения договоров, в том числе депозитных договоров, кредитных договоров, договоров купли-продажи иностранной валюты. Группа однотипных Биржевых инструментов может быть описана одной Спецификацией.

Тарифы АО СПВБ – внутренний документ Клиринговой организации, содержащий размер и порядок оплаты клиринговых услуг АО СПВБ, который раскрывается на Сайте Клиринговой организации в соответствии с законодательством Российской Федерации.

Торговая сессия (торги) – период торгового дня, в течение которого Участниками торгов в режимах, предусмотренных правилами организованных торгов, подаются адресные и безадресные заявки и заключаются договоры.

Торгово-клиринговый регистр (ТКР) – клиринговый регистр, предназначенный для учета информации о Гарантийном обеспечении Участника клиринга и/или обязательств из договоров, стороной по которым является Участник клиринга. ТКР является одним из существенных условий (параметров) заявок, подаваемых в ходе организованных торгов на АО СПВБ. В зависимости от типа ТКР, в рамках каждого ТКР открываются клиринговые регистры в соответствии с разделом 8 Правил клиринга.

Транзитный счет – Клиринговый банковский счет Клиринговой организации, открытый в Расчетной организации, на который зачисляются денежные средства, которые используются исключительно для проведения расчетов по итогам клиринга. После исполнения обязательств по итогам клиринга остаток денежных средств на указанном счете не допускается.

Участник клиринга – лицо, заключившее с Клиринговой организацией Договор об оказании клиринговых услуг.

Фондовая секция – торговая (биржевая) секция АО СПВБ, в которой проводятся организованные торги ценными бумагами в соответствии с Правилами проведения организованных торгов в Фондовой секции Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

Термины и определения, специально не определенные в Правилах клиринга, используются в значениях, установленных правилами организованных торгов АО СПВБ, а также законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

## **1.2. Основные сведения о клиринговой деятельности АО СПВБ и раскрытие иной информации**

1.2.1. Клиринг в соответствии с Правилами клиринга осуществляется без участия центрального контрагента.

1.2.2. Клиринговая организация осуществляет раскрытие информации на Сайте Клиринговой организации согласно требованиям законодательства Российской Федерации о раскрытии информации.

1.2.3. Клиринговая организация в соответствии с Правилами клиринга осуществляет клиринг обязательств из следующих договоров:

1.2.3.1. договоров купли-продажи ценных бумаг, заключенных в Фондовой секции;

1.2.3.2. депозитных договоров, заключенных в Секции ДВР;

1.2.3.3. кредитных договоров, заключенных в Секции ДВР;

1.2.3.4. договоров купли-продажи иностранной валюты, заключенных в Секции ДВР.

1.2.4. Клиринговая организация осуществляет определение обязательств по договорам купли-продажи ценных бумаг каждого из Участников клиринга в отношении каждого заключенного от имени Участника клиринга договора купли-продажи ценных бумаг и организует расчеты по всем заключенным от имени данного Участника клиринга договорам с единой датой исполнения обязательств по сальдо обязательств, определенных по каждому Торгово-клиринговому регистру.

1.2.5. Клиринговая организация осуществляет определение обязательств каждого из Участников клиринга в отношении каждого заключенного от имени Участника клиринга депозитного договора и организует расчеты по всем заключенным от имени данного Участника клиринга депозитным договорам с единой датой исполнения обязательств по сальдо обязательств, определенных по каждому Торгово-клиринговому регистру.

1.2.6. Клиринговая организация осуществляет определение обязательств каждого из Участников клиринга в отношении каждого заключенного от имени Участника клиринга кредитного договора и организует расчеты по всем заключенным от имени данного Участника клиринга кредитным договорам с единой датой исполнения обязательств по сальдо обязательств, определенных по каждому Торгово-клиринговому регистру.

1.2.7. Клиринговая организация осуществляет определение обязательств каждого из Участников клиринга в отношении каждого заключенного от имени Участника клиринга договора купли-продажи иностранной валюты и организует расчеты по всем заключенным от имени данного Участника клиринга договорам купли-продажи иностранной валюты с единой датой исполнения обязательств по сальдо обязательств, определенных по каждому Торгово-клиринговому регистру.

1.2.8. Клиринговая организация осуществляет в отношении договоров с кодом расчетов Т0 клиринг с полным обеспечением.

1.2.9. Клиринговая организация осуществляет в отношении договоров с кодом расчетов Вп клиринг без предварительного обеспечения.

1.2.10. Клиринговая организация оказывает клиринговые услуги и проводит клиринговые сессии по рабочим дням в соответствии с нормативными правовыми актами Российской Федерации во время, установленное в Расписании предоставления клиринговых услуг, утверждаемом Клиринговой организацией и раскрываемом на Сайте Клиринговой организации. В случае необходимости продолжительность работы Клиринговой организации может быть изменена по решению Клиринговой организации.

Указанное решение и сроки его ввода в действие раскрываются на Сайте Клиринговой организации не позднее следующего рабочего дня после принятия такого решения.

### **1.3. Список Расчетных организаций и Расчетных депозитариев**

1.3.1. Список Расчетных организаций и Расчетных депозитариев опубликован на Сайте Клиринговой организации, согласно требованиям законодательства Российской Федерации к раскрытию информации.

1.3.2. Участники клиринга уведомляются о предполагаемых изменениях в списке Расчетных организаций и Расчетных депозитариев путем размещения информации об этом событии на Сайте Клиринговой организации. В случае предполагаемого прекращения взаимодействия Клиринговой организации с Расчетной организацией и/или Расчетным депозитарием Участники клиринга информируются об этом событии не менее чем за 1 (один) месяц.

### **1.4. Утверждение, изменение и дополнение Правил клиринга**

1.4.1. Правила клиринга разработаны в соответствии с законодательством Российской Федерации и требованиями нормативных актов Банка России.

1.4.2. Правила клиринга и изменения к ним утверждаются Советом директоров АО СПВБ и подлежат регистрации в Банке России в соответствии с законодательством Российской Федерации, требованиями нормативных актов Банка России.

1.4.3. Изменения в Правила клиринга вносятся Клиринговой организацией в одностороннем порядке.

1.4.4. Правила клиринга и изменения к Правилам клиринга вступают в силу после выполнения следующих условий:

1.4.4.1. регистрация Банком России;

1.4.4.2. раскрытие информации о Правилах клиринга или изменений к ним более чем за 5 (пять) дней до даты вступления в силу, если законодательством Российской Федерации, требованиями нормативных актов Банка России не установлен более длительный срок между моментом раскрытия информации о Правилах клиринга и вступлением в силу Правил клиринга и изменений к ним;

1.4.4.3. наступление даты вступления в силу, определенной Советом директоров АО СПВБ или исполнительным органом по поручению Совета директоров АО СПВБ.

1.4.5. Клиринговая организация раскрывает информацию о Правилах клиринга и изменениях к ним путем их размещения на Сайте Клиринговой организации после регистрации Банком России.

### **1.5. Конфиденциальность информации**

1.5.1. Любые документы, представленные и подготовленные Участником клиринга и/или Клиринговой организацией для исполнения Договора об оказании клиринговых услуг, рассматриваются как конфиденциальные.

1.5.2. Клиринговая организация обязана обеспечить конфиденциальность следующей информации, о которой стало известно в связи с оказанием клиринговых услуг:

1.5.2.1. составляющей коммерческую, банковскую и иную охраняемую законом тайну;

1.5.2.2. об обязательствах, в отношении которых проводится клиринг;

1.5.2.3. о торговых банковских счетах, торговых счетах депо, разделах «к размещению» / «к выкупу», клиринговых регистрах и информации об операциях по указанным счетам / клиринговым регистрам;

1.5.2.4. о финансовом состоянии Участника клиринга;

1.5.2.5. содержащейся в документах, полученных от Участника клиринга, согласно требованиям подраздела 3.2 Правил клиринга.

1.5.3. Клиринговая организация не вправе передавать указанную выше информацию третьим лицам без письменного согласия Участника клиринга за исключением случаев, предусмотренных законодательством Российской Федерации, требованиями нормативных актов Банка России, а также Правилами клиринга.

1.5.4. Участник клиринга подтверждает, что все персональные данные, передаваемые Участником клиринга Клиринговой организации в соответствии с Правилами клиринга, в случае если это требуется в целях исполнения Договора об оказании клиринговых услуг, достоверны и получены от субъекта персональных данных в законном порядке и передаются с согласия субъекта персональных данных, в случае если такое согласие предусмотрено законодательством Российской Федерации. Участник клиринга заверяет, что им получены необходимые письменные согласия субъектов персональных данных на обработку и передачу их персональных данных. Участник клиринга обязуется предоставить Клиринговой организации по первому требованию полученные им от указанных лиц согласия на обработку персональных данных, предусматривающие обработку и передачу персональных данных в объеме и целях, необходимых для осуществления Клиринговой организацией любых прав и обязанностей, связанных с исполнением Договора об оказании клиринговых услуг.

1.5.5. В целях исполнения требований законодательства Российской Федерации, предъявляемых к хранению документов, связанных с осуществлением клиринговой деятельности, Участник клиринга при присоединении к Правилам клиринга дает согласие Клиринговой организации на передачу таких документов, полученных или изготовленных в рамках осуществления клиринговой деятельности на бумажном носителе (архивных документов), в организации, осуществляющие хранение архивных документов на условиях обеспечения их конфиденциальности и сохранности в течение установленных законодательством Российской Федерации сроков хранения.

## **1.6. Порядок документооборота при осуществлении клиринга**

1.6.1. В целях обмена электронными документами в процессе получения клиринговых услуг Участник клиринга должен присоединиться к Правилам эксплуатации информационной системы Цифровая Платформа (Личный кабинет) и электронного документооборота с использованием информационной системы Цифровая Платформа (Личный кабинет).

1.6.2. Форматы и способы обмена документами, в том числе электронными, Участников клиринга с Клиринговой организацией установлены Положением о формах и форматах документов.

## **2. Договор об оказании клиринговых услуг**

### **2.1. Предмет Договора об оказании клиринговых услуг**

2.1.1. По Договору об оказании клиринговых услуг Клиринговая организация обязуется оказывать Участнику клиринга клиринговые услуги, а Участник клиринга обязуется оплачивать указанные услуги, за исключением случаев, установленных законодательством Российской Федерации.

2.1.2. Состав услуг, условия и порядок их оказания, порядок оплаты, а также иные права и обязанности сторон, связанные с оказанием клиринговых услуг, устанавливаются Правилами клиринга.

## **2.2. Заключение и расторжение Договора об оказании клиринговых услуг**

2.2.1. В целях присоединения к условиям Договора об оказании клиринговых услуг, определенным Правилами клиринга, кандидат в Участники клиринга подает в Клиринговую организацию заявление (оферту) по форме и в порядке, приведенными в Положении о формах и форматах документов, а также выполняет иные требования, изложенные в разделе 3 Правил клиринга.

2.2.2. Клиринговая организация вправе потребовать от кандидата в Участники клиринга предоставления дополнительных документов в необходимых случаях в целях, не противоречащих законодательству Российской Федерации и требованиям нормативных актов Банка России. Кандидат в Участники клиринга обязан предоставить данные документы в срок, указанный в запросе, но не более 3 (трех) рабочих дней со дня получения запроса от Клиринговой организации. В случае, если указанного срока недостаточно для ответа на запрос, Участник клиринга обязан до окончания установленного срока сообщить Клиринговой организации о причинах невозможности соблюдения срока ответа и предполагаемой дате предоставления запрашиваемой информации. При этом продление срока ответа на запрос Клиринговой организации не может быть более чем на 10 (десять) рабочих дней.

2.2.3. С целью получения информации о юридическом лице Клиринговая организация вправе использовать сведения (информацию) о юридическом лице из официальных источников, в том числе из электронного сервиса Федеральной налоговой службы.

2.2.4. Если кандидат в Участники клиринга ранее предоставил АО СПВБ один или несколько из требуемых документов и указанные документы действительны на дату запроса Клиринговой организации, то он освобождается от повторного предоставления указанных документов.

2.2.5. Решение Клиринговой организации о заключении с кандидатом в Участники клиринга Договора об оказании клиринговых услуг доводится до сведения кандидата в Участники клиринга в срок не позднее 5 (пяти) рабочих дней путем направления соответствующего уведомления по форме и в порядке, приведенными в Положении о формах и форматах документов. Клиринговая организация вправе принять решение об отказе от принятия на клиринговое обслуживание кандидата в Участники клиринга и заключения с ним Договора об оказании клиринговых услуг без объяснения причин.

2.2.6. Договор об оказании клиринговых услуг вступает в силу с момента подписания и действует до 31 декабря года подписания. В случае если ни одна из сторон не позднее, чем за 30 (тридцать) рабочих дней до окончания указанного срока действия, не заявила в письменном виде о своем желании расторгнуть Договор об оказании клиринговых услуг, срок действия Договора об оказании клиринговых услуг считается автоматически продленным на следующий календарный год на тех же условиях.

2.2.7. Договор об оказании клиринговых услуг может быть расторгнут до окончания срока его действия по письменному заявлению одной из сторон, направленному в адрес другой стороны.

2.2.8. Участник клиринга вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг только при отсутствии у него имущественных обязательств по указанному договору, а также не исполненных им обязательств, допущенных к клирингу.

2.2.9. Клиринговая организация вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга, в том числе в случае нарушения им требований, предъявляемых Правилами клиринга к Участникам клиринга, в порядке, установленном п. 2.2.10 Правил клиринга. При этом возмещение убытков, связанных с таким отказом, Клиринговой организацией Участнику клиринга не осуществляется.

2.2.10. Клиринговая организация отказывается от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг в одностороннем порядке, в том числе в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию в порядке, предусмотренном подразделом 3.5 Правил клиринга, при этом:

2.2.10.1. при отсутствии на дату принятия решения об отказе от Договора об оказании клиринговых услуг обязательств Участника клиринга, Договор об оказании клиринговых услуг прекращается в день, следующий за днем принятия указанного решения;

2.2.10.2. при наличии обязательств Участника клиринга, возникших до принятия Клиринговой организацией решения об отказе от Договора об оказании клиринговых услуг, Договор об оказании клиринговых услуг прекращается в день, следующий за днем завершения проведения клиринга и осуществления расчетов по обязательствам Участника клиринга.

2.2.11. Прекращение Договора об оказании клиринговых услуг в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию в порядке, предусмотренном подразделом 3.5 Правил клиринга, не требует предварительного уведомления Участника клиринга. Клиринговая организация не позднее рабочего дня, следующего за днем принятия решения об отказе от Договора об оказании клиринговых услуг в одностороннем порядке, информирует Участника клиринга о принятом решении путем направления уведомления, в том числе в электронной форме.

2.2.12. В случае прекращения Договора об оказании клиринговых услуг Участнику клиринга возвращаются имущество, являющееся индивидуальным клиринговым обеспечением, или денежные средства. Клиринговая организация возвращает Участнику клиринга денежные средства не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг. При этом Клиринговая организация обеспечивает принятие обоснованных и доступных ей в сложившихся обстоятельствах мер, направленных на возврат Участнику клиринга денежных средств, являющихся индивидуальным клиринговым обеспечением, в том числе наличие достаточного объема денежных средств на Клиринговом банковском счете на момент передачи в Расчетную организацию распоряжения Клиринговой организации на возврат денежных средств Участнику клиринга. Обязательство Клиринговой организации по возврату денежных средств считается исполненным с момента списания средств с Клирингового банковского счета. Возврат денежных средств Участнику клиринга осуществляется с использованием банковских реквизитов, указанных в Анкете данного Участника клиринга, предоставляемой в соответствии с подп. 3.2.3.2 Правил клиринга, или в перечне допустимых к использованию счетов данного Участника клиринга, согласованном Клиринговой организацией согласно п. 7.4.8 Правил клиринга.

### **2.3. Ответственность Клиринговой организации и Участника клиринга**

2.3.1. Клиринговая организация и Участники клиринга несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение Договора об оказании клиринговых услуг в соответствии с законодательством Российской Федерации и Правилами клиринга.

2.3.2. Клиринговая организация не несет ответственности:

2.3.2.1. по обязательствам Участника клиринга перед третьими лицами;

2.3.2.2. за неисполнение Клиринговой организацией своих обязанностей в результате ненадлежащего исполнения Участником клиринга своих обязанностей в соответствии с Правилами клиринга, вызванное действием или бездействием Участника клиринга;

2.3.2.3. за неисполнение Биржей, либо Участником клиринга своих обязательств по обеспечению правильности, своевременности и достоверности информации, передаваемой в Клиринговую организацию;

2.3.2.4. за неисполнение или ненадлежащее исполнение Расчетными организациями и Расчетными депозитариями поручений Участника клиринга и/или распоряжений Клиринговой организации на проведение операций по торговым банковским счетам, Клиринговым банковским счетам и/или торговым счетам депо и Специальному техническому счету (кроме случаев, когда указанное неисполнение или ненадлежащее исполнение допущено по вине Клиринговой организации).

#### **2.4. Порядок разрешения споров между Клиринговой организацией и Участником клиринга**

2.4.1. Все споры и разногласия, вытекающие из Договора об оказании клиринговых услуг или в связи с ним, в том числе касающиеся его исполнения, нарушения или действительности, решаются Клиринговой организацией и Участником клиринга путем переговоров.

2.4.2. Клиринговая организация и Участник клиринга обязаны соблюдать претензионный порядок урегулирования споров и разногласий, возникающих из Договора об оказании клиринговых услуг.

2.4.3. Претензия направляется второй стороне (Участнику клиринга / Клиринговой организации) в письменном виде и должна быть подписана уполномоченным представителем стороны. Претензия должна содержать:

2.4.3.1. полное наименование лица, предъявляющего претензию;

2.4.3.2. полное наименование лица, к которому предъявляется претензия;

2.4.3.3. изложение требований лица, предъявляющего претензию;

2.4.3.4. указание суммы претензии и ее расчет (если претензия подлежит денежной оценке);

2.4.3.5. изложение обстоятельств, на которых основываются требования лица, предъявляющего претензию;

2.4.3.6. доказательства, подтверждающие обоснованность требований, со ссылкой на соответствующие нормы материального права;

2.4.3.7. перечень прилагаемых к претензии документов и других доказательств;

2.4.3.8. иные сведения, необходимые для урегулирования спора.

2.4.4. Претензия в отношении результатов клиринга может быть направлена Участником клиринга в адрес Клиринговой организации не позднее следующего рабочего дня после дня предоставления отчетов в соответствии с разделом 9 Правил клиринга.

2.4.5. Сторона, получившая претензию, обязана рассмотреть ее в срок, не превышающий 15 (пятнадцать) рабочих дней с даты получения претензии, и предоставить отправителю претензии мотивированный отказ либо согласие на удовлетворение претензионных требований. В случае необходимости запроса дополнительных документов и материалов в целях объективного и всестороннего рассмотрения претензии указанный срок рассмотрения претензии может быть продлен, но не более чем на 10 (десять) рабочих

дней, если иное не предусмотрено законодательством Российской Федерации. Сторона, получившая претензию, обязана уведомить отправителя претензии о продлении срока рассмотрения претензии с указанием обоснования такого продления, направив соответствующее уведомление.

2.4.6. Ответ на претензию предоставляется в письменной форме и направляется отправителю претензии заказным письмом или с курьером в сроки, указанные в п. 2.4.5 Правил клиринга.

2.4.7. В случае, если сторонам не удалось разрешить спор путем переговоров, спор подлежит передаче для разрешения в Арбитражный суд по месту нахождения Клиринговой организации в соответствии с законодательством Российской Федерации.

### **3. Требования к Участникам клиринга**

#### **3.1. Категории Участников клиринга**

3.1.1. Клиринговая организация в соответствии с Правилами клиринга устанавливает для Участников клиринга следующие категории:

3.1.1.1. категория «Ц» – присваивается Банку России;

3.1.1.2. категория «Ф» – присваивается в целях осуществления клиринга обязательств из договоров, заключаемых в Фондовой секции;

3.1.1.3. категории «И», «Б», «В» – присваиваются в целях осуществления клиринга обязательств из договоров, заключаемых в Секции ДВР.

3.1.2. Участнику клиринга может быть присвоена категория «Ф», если он предварительно допущен / допущен к торгам в Фондовой секции.

3.1.3. Участнику клиринга может быть присвоена категория «Б», если он предварительно допущен / допущен к торгам в Секции ДВР без присвоения особой категории Участника торгов – «Инициатор торгов» в соответствии с Внутренними документами Биржи.

3.1.4. Участнику клиринга может быть присвоена категория «И», если он предварительно допущен / допущен к торгам в Секции ДВР и указал в заявлении (оферте), поданном в соответствии с п. 2.2.1 Правил клиринга, категорию Участника торгов – «Инициатор торгов». Участники клиринга категории «И» используют для исполнения обязательств по депозитным и кредитным договорам свой торговый банковский счет, открытый в Расчетной организации.

3.1.5. Участнику клиринга может быть присвоена категория «В», если он предварительно допущен / допущен к торгам в Секции ДВР и указал в заявлении (оферте), поданном в соответствии с п. 2.2.1 Правил клиринга, категорию Участника торгов – «Инициатор торгов». Участники клиринга категории «В» используют для исполнения обязательств по депозитным и кредитным договорам Клиринговый банковский счет.

3.1.6. Один Участник клиринга может принадлежать одновременно к нескольким категориям Участников клиринга в целях осуществления клиринга обязательств из договоров, заключаемых в различных Секциях. В целях осуществления клиринга обязательств из договоров, заключаемых в одной Секции, Участник клиринга может иметь только одну категорию.

#### **3.2. Требования к кандидатам в Участники клиринга**

3.2.1. Участниками клиринга могут стать юридические лица, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации, в том числе кредитные организации, Банк России, государственные корпорации, а также нерезиденты Российской

Федерации, международные организации и иные лица, предварительно допущенные к торгам на Бирже или являющиеся Участниками торгов Биржи и соответствующие требованиям Правил клиринга.

3.2.2. Кандидат в Участники клиринга должен быть предварительно допущен / допущен к торгам АО СПВБ (кандидат в Участники клиринга с категориями «Ф», «Б», «И», «В»).

3.2.3. Кандидат в Участники клиринга обязан выполнить следующие требования:

3.2.3.1. предоставить Клиринговой организации оферту на заключение Договора об оказании клиринговых услуг, условия которого предусмотрены Правилами клиринга, путем подписания Заявления по форме и в порядке, предусмотренными Положением о формах и форматах документов;

3.2.3.2. предоставить Клиринговой организации заполненную Анкету по форме и в порядке, предусмотренными Положением о формах и форматах документов (далее – Анкета Участника клиринга), и иные документы в зависимости от категории, перечень которых предусмотрен Положением о формах и форматах документов.

### **3.3. Допуск к клиринговому обслуживанию**

3.3.1. В целях получения допуска к клиринговому обслуживанию Участники клиринга обязаны выполнить следующие требования в зависимости от категории:

3.3.1.1. Для получения допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «Ф»:

– открыть торговые банковские счета в российских рублях в Расчетной организации или выразить намерение об использовании Клирингового банковского счета в российских рублях;

– открыть торговые счета депо в Расчетном депозитарии;

– предоставить Клиринговой организации Уведомление о взаимосвязи ТКР и счетов Участника клиринга по форме и в порядке, предусмотренными Положением о формах и форматах документов. При этом в указанном уведомлении Участником клиринга должна быть установлена взаимосвязь между торговым банковским счетом / Клиринговым регистром КБС и торговым счетом депо, предназначенными для учета собственных средств Участника клиринга, и Торгово-клиринговым регистром, и/или между торговым банковским счетом / Клиринговым регистром КБС и торговым счетом депо, предназначенными для учета клиентских средств Участника клиринга, и Торгово-клиринговым регистром.

3.3.1.2. Для получения допуска к клиринговому обслуживанию с категориями «Б», «И» и «В»:

– открыть торговые банковские счета в российских рублях в Расчетной организации или выразить намерение об использовании Клирингового банковского счета в российских рублях. Открытие торгового банковского счета в российских рублях обязательно для допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «И»;

– открыть торговые банковские счета в иностранной валюте в Расчетной организации или выразить намерение об использовании Клирингового банковского счета в иностранной валюте. Открытие торгового банковского счета в иностранной валюте или использование Клирингового банковского счета в иностранной валюте обязательно для возможности исполнения обязательств из договоров купли-продажи иностранной валюты;

– предоставить Клиринговой организации Уведомление о взаимосвязи ТКР и счетов Участника клиринга по форме и в порядке, предусмотренными Положением о формах и форматах документов. При этом в указанном уведомлении Участником клиринга должна быть установлена взаимосвязь между торговым банковским счетом / Клиринговым регистром КБС, предназначенными для учета собственных средств Участника клиринга, и Торгово-клиринговым регистром, и/или между торговым банковским счетом / Клиринговым регистром КБС, предназначенными для учета клиентских средств Участника клиринга, и Торгово-клиринговым регистром;

– для допуска к клиринговому обслуживанию в отношении обязательств из договоров купли-продажи иностранной валюты определенной Группы валютных биржевых инструментов в Уведомлении о взаимосвязи ТКР и счетов Участника клиринга установить взаимосвязь между Торгово-клиринговым регистром и торговым банковским счетом / Клиринговым регистром КБС в иностранной валюте, соответствующей валюте лота данной Группы валютных биржевых инструментов, а также торговым банковским счетом / Клиринговым регистром КБС в иностранной валюте, соответствующей сопряженной валюте данной Группы валютных биржевых инструментов.

3.3.1.3. Решение о допуске Участника клиринга к клиринговому обслуживанию с определенной категорией принимается Клиринговой организацией в срок не позднее 2 (двух) рабочих дней с момента выполнения Участником клиринга требований, установленных п. 3.3.1 Правил клиринга.

3.3.1.4. Решение Клиринговой организации о допуске Участника клиринга к клиринговому обслуживанию с определенной категорией доводится до сведения Участника клиринга в срок не позднее 5 (пяти) рабочих дней со дня принятия решения путем направления соответствующего уведомления по форме и в порядке, приведенными в Положении о формах и форматах документов.

#### **3.4. Порядок регистрации Участников клиринга и клиентов Участника клиринга**

3.4.1. Клиринговая организация на основании предоставленной Участниками клиринга информации осуществляет регистрацию Участников клиринга и клиентов Участников клиринга с присвоением каждому Участнику клиринга и каждому клиенту Участника клиринга регистрационного кода в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России, позволяющего идентифицировать Участника клиринга / клиента Участника клиринга. Присвоение регистрационных кодов Участникам клиринга и клиентам Участников клиринга осуществляется в соответствии с Порядком присвоения регистрационных кодов.

3.4.2. Регистрационные коды Участнику клиринга могут присваиваться на основании кодов, присвоенных этим лицам Биржей, если это не противоречит нормативным актам Банка России.

3.4.3. Регистрация клиентов Участников клиринга осуществляется на основании Поручения на регистрацию клиентов, направляемого Участником клиринга в Клиринговую организацию по форме и в порядке, приведенными в Порядке присвоения регистрационных кодов.

3.4.4. Клиринговая организация при регистрации Участников клиринга и клиентов Участника клиринга вносит присвоенный регистрационный код в «Реестр участников клиринга» или «Реестр клиентов участника клиринга» и информирует Участника клиринга о присвоенных регистрационных кодах путем направления соответствующего уведомления

по форме и в порядке, приведенными в Положении о формах и форматах документов в отношении кода Участника клиринга и в Порядке присвоения регистрационных кодов в отношении кодов клиентов Участника клиринга.

3.4.5. Клиринговая организация вправе использовать сокращенный код, позволяющий идентифицировать Участника клиринга, не содержащий всех необходимых элементов регистрационного кода (клиринговый код Участника клиринга). Присвоение клиринговых кодов Участникам клиринга осуществляется в соответствии с Порядком присвоения регистрационных кодов.

3.4.6. Для регистрации Обособленного клиента Участника клиринга, Участник клиринга должен указать в Поручении на регистрацию клиентов номер отдельного торгового банковского счета / выразить намерение об использовании отдельного Клирингового регистра КБС и номер Отдельного специального торгового счета депо (в случае необходимости), открытых для учета индивидуального клирингового обеспечения и/или исполнения обязательств Участника клиринга, подлежащих исполнению за счет этого клиента.

3.4.7. В случае необходимости отдельного учета индивидуального клирингового обеспечения клиента Участника клиринга, планирующего размещение ценных бумаг такого клиента, Участник клиринга должен открыть отдельный торговый банковский счет / использовать отдельный Клиринговый регистр КБС для совершения операций с денежными средствами такого клиента, для учета размещаемых ценных бумаг такого клиента используется раздел «к размещению».

3.4.8. В случае необходимости отдельного учета индивидуального клирингового обеспечения Обособленного клиента Участника клиринга, планирующего заключение договоров купли-продажи иностранной валюты определенной Группы валютных биржевых инструментов, Участник клиринга должен открыть отдельные торговые банковские счета / использовать отдельные Клиринговые регистры КБС в валютах, соответствующих валюте лота / сопряженной валюте данной Группы валютных биржевых инструментов, для совершения операций с денежными средствами такого клиента.

### **3.5. Порядок приостановления, возобновления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию**

3.5.1. Клиринговая организация в зависимости от обстоятельств, послуживших основанием для приостановления допуска, вправе приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в отношении всех обязательств или обязательств из определенного вида договоров, допускаемых к клирингу, или приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию с определенной категорией.

3.5.2. Клиринговая организация вправе приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в случае реализации следующих событий:

3.5.2.1. приостановление в отношении Участника клиринга, имеющего категорию «Ф», «Б», «И» или «В», действия лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг (при этом Клиринговая организация приостанавливает допуск Участника клиринга категории «Б», «И» или «В» к клиринговому обслуживанию только в отношении обязательств из договоров купли-продажи иностранной валюты);

3.5.2.2. введение Банком России ограничений (запрета) на проведение операций в качестве профессионального участника рынка ценных бумаг в отношении Участника клиринга, имеющего категорию «Ф», «Б», «И» или «В» (при этом Клиринговая организация приостанавливает допуск Участника клиринга категории

«Б», «И» или «В» к клиринговому обслуживанию только в отношении обязательств из договоров купли-продажи иностранной валюты);

3.5.2.3. приостановление в отношении Участника клиринга, имеющего категорию «Ф», действия лицензий на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами, негосударственными пенсионными фондами;

3.5.2.4. приостановление в отношении Участника клиринга, имеющего категорию «Ф», «Б», «И» или «В», действия аккредитации филиала иностранной кредитной организации на территории Российской Федерации;

3.5.2.5. применение в отношении Участника клиринга одной из процедур, которая впоследствии может привести к неспособности выполнять Участником клиринга финансовые обязательства по договорам (за исключением конкурсного производства), в порядке, предусмотренном законодательством Российской Федерации или законодательством страны, резидентом которой является Участник клиринга;

3.5.2.6. блокировка (приостановление совершения операций, арест, закрытие) в Расчетной организации или в Расчетном депозитарии торгового счета (торговых счетов) Участника клиринга, используемого (используемых) для исполнения и/или обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга. В случае блокировки не всех торговых счетов Участника клиринга возможно продолжение клирингового обслуживания в отношении тех обязательств, для исполнения и/или обеспечения которых используются неблокированные торговые счета;

3.5.2.7. не уведомление Клиринговой организации Участником клиринга об изменении реквизитов его банковского счета согласно требованиям, установленным подп. 4.3.1.3 Правил клиринга, в результате чего денежные средства, перечисляемые Участнику клиринга в соответствии с Правилами клиринга, были возвращены на Клиринговый банковский счет;

3.5.2.8. неоднократная (два и более раза) в течение одного календарного года неоплата Участником клиринга услуг Клиринговой организации в порядке и сроки, установленные Тарифами АО СПбБ;

3.5.2.9. неоднократное (два и более раза) в течение 2 (двух) календарных лет непредоставление Анкеты Участника клиринга в целях проведения Клиринговой организацией процедуры идентификации и/или форм самосертификации (анкеты иностранного налогоплательщика физического лица и/или анкеты иностранного налогоплательщика юридического лица или структуры без образования юридического лица) в целях определения налогового резидентства Участника клиринга в соответствии с подп. 4.3.1.4 Правил клиринга;

3.5.2.10. в случае наличия риска потери деловой репутации Клиринговой организации в связи с продолжением клирингового обслуживания Участника клиринга.

3.5.3. Клиринговая организация приостанавливает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в случае реализации следующих событий:

3.5.3.1. введение Банком России ограничений (запрета) на осуществление банковских операций в отношении Участника клиринга, имеющего категории «Б», «И» или «В»;

3.5.3.2. введение Банком России ограничений (запрета) на осуществление банковских операций для осуществления деятельности на территории Российской

Федерации через свой филиал в отношении Участника клиринга, имеющего категорию «Ф», «Б», «И» или «В»;

3.5.3.3. при получении Клиринговой организацией информации и/или письменного сообщения и/или решения органа государственной власти Российской Федерации, которое делает невозможным полное или частичное дальнейшее клиринговое обслуживание Участника клиринга;

3.5.3.4. приостановление в отношении Участника клиринга, имеющего категории «Ф», «Б», «И» или «В», действия специального разрешения (лицензии) на осуществление банковских операций, выданного компетентным органом страны, резидентом которой является Участник клиринга или иностранная кредитная организация, осуществляющая деятельность на территории Российской Федерации через свой филиал;

3.5.3.5. введение Банком России ограничений (запрета) на осуществление операций со средствами в иностранной валюте в отношении Участника клиринга, имеющего категории «Б», «И» или «В» (при этом Клиринговая организация приостанавливает допуск к клиринговому обслуживанию только в отношении обязательств из договоров купли-продажи иностранной валюты);

3.5.3.6. закрытие у Участника клиринга, имеющего категорию «Ф», всех торговых счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии для работы на АО СПББ;

3.5.3.7. применение в отношении Участника клиринга мер Банка России в порядке надзора и/или иных уполномоченных органов в случае нарушения Участником клиринга федеральных законов и нормативных актов Банка России (включая запрет на совершение определенных операций и/или при применении административных наказаний), делающих невозможным исполнение заключенных договоров, обязательства из которых допускаются к клирингу;

3.5.3.8. применение в отношении Участника клиринга процедур, связанных с банкротством, кроме конкурсного производства, в порядке, предусмотренном законодательством Российской Федерации или законодательством страны, резидентом которой является Участник клиринга;

3.5.3.9. несоответствие Участника клиринга установленным Правилами клиринга требованиям.

3.5.4. При наличии оснований для приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию допуск к клиринговому обслуживанию приостанавливается в соответствии с решением Клиринговой организацией не позднее рабочего дня, следующего за днем, когда стало известно о наличии таких оснований. Обязательства Участника клиринга по договорам, заключенным после приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, к клирингу не допускаются, допуск обязательств возобновляется после возобновления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию.

3.5.5. Клиринговая организация не позднее рабочего дня, следующего за днем приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, информирует Участника клиринга о данном факте путем направления соответствующего уведомления по форме и в порядке, приведенными в Положении о формах и форматах документов.

3.5.6. В случае если допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию был приостановлен, допуск возобновляется на основании решения Клиринговой организации на следующий рабочий день после установления факта прекращения действия оснований приостановления допуска, указанных в Правилах клиринга.

3.5.7. Клиринговая организация не позднее рабочего дня, следующего за днем возобновления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию информирует Участника клиринга о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию путем направления соответствующего уведомления по форме и в порядке, приведенными в Положении о формах и форматах документов.

3.5.8. Клиринговая организация в зависимости от обстоятельств, послуживших основанием для прекращения допуска, вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в отношении всех обязательств или обязательств из определенного вида договоров, допускаемых к клирингу, или прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию с определенной категорией.

3.5.9. Клиринговая организация вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в случае реализации следующих событий:

3.5.9.1. введение в отношении Участника клиринга любой из процедур банкротства (за исключением процедуры наблюдения или в случае официального заявления Банка России об оказании финансовой поддержки в целях обеспечения непрерывной деятельности Участника клиринга – кредитной организации);

3.5.9.2. аннулирование у Участника клиринга категории «Ф», «Б», «И» или «В» лицензий профессионального участника рынка ценных бумаг (при этом Клиринговая организация прекращает допуск Участника клиринга категории «Б», «И» или «В» к клиринговому обслуживанию только в отношении обязательств из договоров купли-продажи иностранной валюты);

3.5.9.3. аннулирование у Участника клиринга, имеющего категорию «Ф», лицензий на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами, негосударственными пенсионными фондами;

3.5.9.4. наличие риска потери деловой репутации Клиринговой организации в связи с осуществлением клирингового обслуживания Участника клиринга;

3.5.9.5. в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств по договорам и/или иных обязательств Участника клиринга, возникающих при осуществлении клиринга, а также в случае, когда Клиринговая организация имеет в отношении Участника клиринга информацию о наступлении события, которое не позволит Участнику клиринга исполнить указанные обязательства.

3.5.10. Клиринговая организация прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в случае реализации следующих событий:

3.5.10.1. прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, в том числе в связи с ликвидацией Участника клиринга в случаях и порядке, предусмотренном законодательством Российской Федерации или законодательством страны, резидентом которой является Участник клиринга;

3.5.10.2. аннулирования/отзыва у Участника клиринга, имеющего категории «Б», «И» или «В», лицензии Банка России на осуществление банковских операций;

3.5.10.3. аннулирование/отзыв у Участника клиринга, имеющего категорию «Ф», «Б», «И» или «В», действия лицензии Банка России на осуществление банковских операций для осуществления деятельности на территории Российской Федерации через свой филиал;

3.5.10.4. аннулирование/отзыв у Участника клиринга, имеющего категории «Ф», «Б», «И» или «В», специального разрешения (лицензии) на осуществление

банковских операций, выданного компетентным органом страны, резидентом которой является Участник клиринга или иностранная кредитная организация, осуществляющая деятельность на территории Российской Федерации через свой филиал;

3.5.10.5. аннулирование/отзыв у Участника клиринга, имеющего категории «Б», «И» или «В», лицензии Банка России на осуществление банковских операций со средствами в иностранной валюте (при этом Клиринговая организация прекращает допуск к клиринговому обслуживанию только в отношении обязательств из договоров купли-продажи иностранной валюты);

3.5.10.6. внесение изменений в законодательство Российской Федерации в части определения круга лиц, имеющих право участвовать в организованных торгах иностранной валютой или заключать на территории Российской Федерации сделки купли-продажи иностранной валюты (при этом Клиринговая организация прекращает допуск к клиринговому обслуживанию только в отношении обязательств из договоров купли-продажи иностранной валюты);

3.5.10.7. прекращение международного договора или внесение изменений в международный договор и/или учредительные документы международной организации, которые ограничивают право данной международной организации в заключении на территории Российской Федерации сделок купли-продажи иностранной валюты;

3.5.10.8. исключение государства, резидентом которого является Участник клиринга или иностранная кредитная организация, осуществляющая деятельность на территории Российской Федерации через свой филиал, из утвержденного Правительством Российской Федерации перечня государств, резиденты которых могут быть допущены к организованным торгам<sup>1</sup>;

3.5.10.9. принятие арбитражным судом или компетентным органом страны, резидентом которой является Участник клиринга, решения о введении в отношении Участника клиринга конкурсного производства, в порядке, предусмотренном законодательством Российской Федерации или законодательством страны, резидентом которой является Участник клиринга;

3.5.10.10. получение от Биржи информации о прекращении Участника клиринга допуска к торгам в одной или нескольких Секциях АО СПбБ;

3.5.10.11. при предоставлении Участником клиринга заявления о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию в определенной категории.

3.5.11. При наличии оснований для прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию допуск к клиринговому обслуживанию прекращается в соответствии с решением Клиринговой организации не позднее рабочего дня, следующего за днем, когда стало известно о наличии таких оснований. Обязательства Участника клиринга по договорам, заключенным после прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, к клирингу не допускаются.

---

<sup>1</sup> Распоряжение Правительства Российской Федерации от 20 сентября 2023 года № 2530-р «Перечень иностранных государств, в которых зарегистрированы иностранные банки (иностранная кредитные организации), действующие от своего имени и за свой счет, и иностранные юридические лица, осуществляющие деятельность, аналогичную деятельности брокера, которые могут быть допущены к участию в организованных торгах иностранной валютой и в организованных торгах, на которых заключаются договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются валюта и(или) процентные ставки» и иные нормативно-правовые акты, дополняющие это перечню.

3.5.12. Клиринговая организация не позднее рабочего дня, следующего за днем прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, информирует Участника клиринга о данном факте путем направления соответствующего уведомления по форме и в порядке, приведенными в Положении о формах и форматах документов.

#### **4. Права и обязанности Клиринговой организации и Участников клиринга**

##### **4.1. Обязанности Клиринговой организации**

4.1.1. Клиринговая организация обязана:

4.1.1.1. Осуществлять клиринговое обслуживание Участников клиринга в соответствии с требованиями Правил клиринга, законодательства Российской Федерации и требованиями нормативных актов Банка России.

4.1.1.2. Уведомлять Участников клиринга об изменениях и дополнениях, внесенных в Правила клиринга, путем размещения информации об их регистрации и дате вступления в силу на Сайте Клиринговой организации.

4.1.1.3. Вести отдельный внутренний учет средств Участников клиринга и клиентов Участников клиринга.

4.1.1.4. Осуществлять определение обязательств Участников клиринга в соответствии с Правилами клиринга.

4.1.1.5. Обеспечивать обособленный учет обязательств каждого Участника клиринга посредством ведения клиринговых регистров.

4.1.1.6. Осуществлять определение и учет обязательств в разбивке по собственным обязательствам Участника клиринга и обязательствам, возникшим из договоров, заключенных за счет его клиентов, соответственно вести клиринговые регистры отдельно по каждому Участнику клиринга и его клиентам.

4.1.1.7. Организовывать расчеты по итогам клиринга.

4.1.1.8. Осуществлять формирование отчетов по итогам клиринга, в том числе в отношении обязательств из договоров, заключенных в интересах каждого клиента, зарегистрированного в порядке согласно подразделу 3.4 Правил клиринга, и их передачу Участникам клиринга в сроки, установленные разделом 9 Правил клиринга.

4.1.1.9. Организовать систему мер по хранению и защите информации.

4.1.1.10. Осуществлять дублированное хранение информации о договорах, остатках на торговых счетах и Клиринговых регистрах КБС денежных средств и ценных бумаг, результатах клиринга, переданных в Расчетную организацию и Расчетный депозитарий распоряжениях.

4.1.1.11. Организовать систему управления рисками при осуществлении клиринговой деятельности.

4.1.1.12. Для обеспечения исполнения обязательств организовать использование индивидуального клирингового обеспечения.

##### **4.2. Права Клиринговой организации**

4.2.1. Клиринговая организация имеет право:

4.2.1.1. В одностороннем порядке вносить изменения и дополнения в Правила клиринга.

4.2.1.2. Предоставить, приостановить, возобновить или прекратить доступ Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, в порядке, определенном подразделом 3.5 Правил клиринга.

4.2.1.3. Отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг в порядке, определенном подразделом 2.2. Правил клиринга.

4.2.1.4. Требовать от Участника клиринга предоставления дополнительной информации, характеризующей его финансовое состояние, сведений о примененных к нему санкциях за нарушение законодательства Российской Федерации, информации, необходимой для проведения проверки операций, а также иной информации, предусмотренной законодательством Российской Федерации, нормативными актами Банка России и Правилами клиринга. В рамках указанных запросов Клиринговая организация вправе устанавливать формы и сроки предоставления информации и отчетности Участниками клиринга.

### **4.3. Обязанности Участника клиринга**

4.3.1. Участник клиринга обязан:

4.3.1.1. Выполнять требования Правил клиринга, незамедлительно информировать Клиринговую организацию о несоответствии указанным требованиям.

4.3.1.2. Своевременно и в полном объеме оплачивать клиринговые услуги в соответствии с Тарифами АО СПВБ.

4.3.1.3. В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете Участника клиринга или иных предоставленных Клиринговой организации документах, Участник клиринга обязан в течение 10 (десяти) рабочих дней после таких изменений предоставить Клиринговой организации Анкету Участника клиринга с обновленной информацией и подтверждающие изменения документы. Подтверждающие изменения документы могут не предоставляться Участником клиринга, если информация, содержащаяся в них, раскрывается Участником клиринга на официальном сайте Участника клиринга в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», либо на официальных сайтах организаций, уполномоченных для раскрытия информации о кредитных организациях, об участниках финансового рынка, о лицах, зарегистрированных в ЕГРЮЛ. В случае не предоставления Участником клиринга информации об изменениях и дополнениях в документы или предоставления им неполной или недостоверной информации об изменениях и дополнениях в документы, Клиринговая организация не несет ответственности за причиненные Участнику клиринга в связи с этим убытки.

4.3.1.4. В целях проведения Клиринговой организацией процедуры идентификации ежегодно в период с 01 января до 01 июля текущего года представлять Клиринговой организации Анкету Участника клиринга. Указанное требование не распространяется на Банк России, федеральные органы исполнительной власти, исполнительные органы государственной власти субъектов Российской Федерации. Также в целях определения Клиринговой организацией налогового резидентства Участника клиринга и его выгодоприобретателя Участник клиринга обязан по запросу Клиринговой организации, направленному не позднее 15 февраля текущего года, до 15 марта текущего года предоставить Клиринговой организации заполненные формы самосертификации (анкеты иностранного налогоплательщика физического лица и/или анкеты иностранного налогоплательщика юридического лица или структуры без образования юридического лица) по форме и в порядке, приведенными в Положении о формах и форматах документов.

4.3.1.5. Участник клиринга, имеющий обязательства по денежным средствам с текущей датой исполнения, должен обеспечить наличие денежных средств на соответствующем торговом банковском счете в Расчетной организации или на

соответствующем Клиринговом регистре КБС в размере, необходимом для исполнения его обязательств, в срок не позднее времени начала формирования соответствующего Клирингового пула.

4.3.1.6. Участник клиринга, имеющий обязательство по ценным бумагам с текущей датой исполнения, должен обеспечить наличие ценных бумаг в количестве, необходимом для исполнения его обязательств по ценным бумагам на соответствующем торговом счете депо и/или на счете депо номинального держателя в Расчетном депозитарии для зачисления на Специальный технический счет и его разделы «к размещению» / «к выкупу».

4.3.1.7. Участник клиринга несет ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение своих обязательств, допущенных к клирингу, включая обязательства, исполняемые за счет клиента, независимо от способа обеспечения исполнения обязательств и наличия имущества Участника клиринга или его клиента, в том числе имущества клиента Участника клиринга, учет которого осуществляется отдельно.

4.3.1.8. В случае неисполнения обязательств из договоров купли-продажи ценных бумаг, заключенных по итогам проведения аукционов по размещению облигаций федеральных займов, Участник клиринга обязан уплатить неустойку в адрес контрагента по соответствующему договору купли-продажи ценных бумаг в размере 0,1% от суммы договора. Клиринговая организация направляет такому Участнику клиринга уведомление о необходимости оплаты неустойки с указанием сроков и реквизитов для оплаты. Участник клиринга обязан исполнить обязательство по оплате неустойки в срок, указанный в уведомлении, с направлением в адрес Клиринговой организации подтверждения об плате в форме копии платежного поручения с отметкой об исполнении. В случае неисполнения обязательства по оплате неустойки Клиринговая организация приостанавливает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию с категорией «Ф» до момента подтверждения оплаты Участником клиринга неустойки.

4.3.1.9. Предоставлять Клиринговой организации запрашиваемую информацию, в том числе в соответствии с подп. 4.2.1.4 Правил клиринга, в указанные в запросе сроки, а в случае, если таковой не указан, то в течение 5 (пяти) рабочих дней со дня получения запроса. В случае, если указанного срока недостаточно для ответа на запрос, Участник клиринга обязан до окончания установленного срока сообщить Клиринговой организации о причинах невозможности соблюдения срока ответа и предполагаемой дате предоставления запрашиваемой информации. При этом продление срока ответа на запрос Клиринговой организации не может быть более чем на 14 (четырнадцать) рабочих дней.

#### **4.4. Права Участника клиринга**

4.4.1. Участник клиринга имеет право:

4.4.1.1. Получать клиринговые услуги в объеме и на условиях, установленных Правилами клиринга.

4.4.1.2. Подать претензию в порядке, предусмотренном подразделом 2.4 Правил клиринга, для урегулирования споров и разногласий, возникающих из Договора об оказании клиринговых услуг.

4.4.1.3. Расторгнуть Договор об оказании клиринговых услуг в порядке, установленном подразделом 2.2 Правил клиринга.

## **5. Порядок проведения клиринга**

### **5.1. Порядок и условия допуска обязательств к клирингу**

5.1.1. Допуск обязательств к клирингу осуществляется Клиринговой организацией на основании реестра договоров, предоставленного Биржей, путем внесения записей в соответствующие регистры во время, установленное Расписанием предоставления клиринговых услуг.

5.1.2. В случае недействительности договора, обязательство по которому допущено к клирингу и не прекращено, такое обязательство исключается из числа обязательств, допущенных к клирингу.

5.1.3. В случае недействительности договора, обязательство по которому допущено к клирингу и прекращено исполнением, на основании части 2 статьи 162 Гражданского кодекса Российской Федерации каждая из сторон такого договора обязана возвратить другой все полученное по договору, а в случае невозможности возвратить полученное в натуре возместить его стоимость. Возникшие двусторонние взаимные обязательства Участников клиринга по недействительным договорам, исполняются Участниками клиринга без участия Клиринговой организации. По результатам урегулирования обязательств Участники клиринга должны представить в Клиринговую организацию отчет об урегулировании обязательств в произвольной форме в срок не позднее 5 (пяти) рабочих дней с даты урегулирования обязательств.

5.1.4. В случае неисполнения Участниками клиринга обязанности, указанной в п. 5.1.3 Правил клиринга, и непредоставления в Клиринговую организацию отчета об урегулировании обязательств в течение 1 (одного) месяца со дня, когда Клиринговая организация узнала о недействительности договора, Клиринговая организация направляет Участникам клиринга запрос о предоставлении отчета об урегулировании обязательств. Участники клиринга обязаны предоставить ответ на такой запрос в сроки, указанные в подп. 4.3.1.9 Правил клиринга.

### **5.2. Порядок и условия включения обязательств в клиринговый пул (исключения обязательств из клирингового пула)**

5.2.1. Клиринговый пул формируется по обязательствам, по которым наступил срок исполнения.

5.2.2. Обязательства из договоров, заключенных в различных биржевых Секциях, а также обязательства, имеющие различные условия (в том числе временные) расчетов, включаются в отдельные Клиринговые пулы. Клиринговые пулы формируются во время, установленное Расписанием предоставления клиринговых услуг.

5.2.3. Клиринговая организация формирует следующие клиринговые пулы:

5.2.3.1. обязательства из депозитных договоров с кодом расчетов T0 с текущей датой исполнения первой части договора (размещение/привлечение денежных средств);

5.2.3.2. обязательства из депозитных договоров с кодом расчетов Vn с текущей датой исполнения первой части договора (размещение/привлечение денежных средств);

5.2.3.3. обязательства из депозитных договоров с кодом расчетов T0 с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств);

5.2.3.4. обязательства из депозитных договоров с кодом расчетов Vn с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств);

5.2.3.5. обязательства из кредитных договоров с кодом расчетов Т0 с текущей датой исполнения первой части договора (привлечение/размещение денежных средств);

5.2.3.6. обязательства из кредитных договоров с кодом расчетов Вп с текущей датой исполнения первой части договора (привлечение/размещение денежных средств);

5.2.3.7. обязательства из кредитных договоров с кодом расчетов Т0 с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств);

5.2.3.8. обязательства из кредитных договоров с кодом расчетов Вп с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств);

5.2.3.9. обязательства из договоров купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Т0;

5.2.3.10. обязательства из договоров купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Вп с текущей датой исполнения;

5.2.3.11. обязательства из договоров купли-продажи иностранной валюты с кодом расчетов Т0.

5.2.4. Если иное не установлено Правилами клиринга, обязательства, не прошедшие контроль обеспечения в соответствии с подразделом 5.4 Правил клиринга, исключаются из Клирингового пула.

5.2.5. Клиринговая организация исключает из Клирингового пула в первую очередь обязательства из договоров, заключенных в более позднее время. Время заключения договора определяется по данным из реестра договоров Биржи, в том числе по номеру договора, присвоенному Биржей.

5.2.6. Обязательства по уплате комиссионного вознаграждения в Клиринговые пулы не включаются.

5.2.7. Если документами, устанавливающими порядок расчетов по отдельным Биржевым инструментам в Секции ДВР, не установлено иное, обязательства по уплате процентов за использование денежных средств по депозитным договорам или по кредитным договорам Клиринговой организацией не допускаются к клирингу и не определяются, в Клиринговые пулы не включаются.

5.2.8. Срок исполнения / частичного исполнения обязательств из депозитных/кредитных договоров устанавливается Клиринговой организацией на основании уведомления Участника клиринга с категорией «И» или «В» по форме и в порядке, приведенными в Положении о формах и форматах документов.

### **5.3. Порядок проведения клиринга в рамках клиринговых сессий**

5.3.1. Клиринговая организация осуществляет клиринг в рамках клиринговых сессий. Время проведения клиринговых сессий установлено Расписанием предоставления клиринговых услуг.

5.3.2. В ходе каждой клиринговой сессии Клиринговая организация выполняет следующие действия:

5.3.2.1. получение реестра договоров от Биржи;

5.3.2.2. допуск обязательств к клирингу;

5.3.2.3. включение обязательств в Клиринговый пул;

5.3.2.4. расчет обязательств;

5.3.2.5. получение информации из Расчетной организации / Расчетного депозитария;

5.3.2.6. процедура контроля обеспечения;

5.3.2.7. исключение обязательств из Клирингового пула;

5.3.2.8. прекращение обязательств, в том числе исполнением.

5.3.3. Обязательства (требования) Участника клиринга рассчитываются в отношении каждого Торгово-клирингового регистра Участника клиринга. Отрицательное значение обязательства означает обязательство Участника клиринга, положительное значение обязательства – требование Участника клиринга по ценным бумагам и/или денежным средствам в отношении другого Участника клиринга.

5.3.4. Обязательства по денежным средствам определяются в валюте лота или валюте расчетов / сопряженной валюте.

5.3.5. Обязательства по ценным бумагам определяются в разрезе каждой ценной бумаги.

5.3.6. Для договора купли-продажи ценных бумаг обязательство (требование) по ценным бумагам равно количеству ценных бумаг, проданных (купленных) в соответствии с заключенным договором, обязательства из которого включены в Клиринговый пул.

5.3.7. Для договоров купли-продажи ценных бумаг обязательство (требование) по денежным средствам определяется следующим образом:

5.3.7.1. Для ценных бумаг, за исключением указанных в подп. 5.3.7.2 Правил клиринга:

$$O = K * P, \text{ где}$$

O – обязательство (требование);

K – количество ценных бумаг в договоре;

P – цена одной ценной бумаги в договоре.

5.3.7.2. Для облигаций:

$$O = K * (N * P + ACI), \text{ где}$$

O – обязательство (требование);

K – количество ценных бумаг в договоре;

N – номинал ценной бумаги;

P – цена одной ценной бумаги в договоре;

ACI – накопленный купонный доход.

В случае, если номинал ценной бумаги и накопленный купонный доход выражены в иностранной валюте, расчет осуществляется по курсу соответствующей иностранной валюты, установленному Банком России на дату определения обязательств (требований), с точностью до второго знака после запятой (округление второго знака после запятой производится по правилам математического округления).

5.3.8. Для кредитных договоров и депозитных договоров обязательство (требование) по денежным средствам в день исполнения обязательств по предоставлению/привлечению кредитов, размещению депозитов равно сумме кредитных и депозитных договоров. Если Участник клиринга размещает (привлекает) денежные средства, то у него возникает обязательство (требование) по денежным средствам

соответственно. Соответственно, у Участника клиринга – контрагента возникает требование (обязательство) по привлечению (размещению) денежных средств.

5.3.9. Для кредитных договоров и депозитных договоров обязательство (требование) по денежным средствам в день исполнения обязательств по возврату кредитов (депозитов) (либо их части) равно сумме (остатку суммы) выданных/привлеченных кредитов (размещенных депозитов).

5.3.10. Если документами, устанавливающими порядок расчетов по договорам с отдельными Биржевыми инструментами в Секции ДВР, установлено, что Участник клиринга категории «Б», являющийся стороной по договору, у которой возникло требование по привлечению денежных средств, обязан предоставить в Клиринговую организацию выписку по депозитному счету, открытому во исполнение заключенного депозитного договора, Клиринговая организация блокирует денежные средства, полученные таким Участником клиринга по депозитному договору на клиринговом регистре «Денежные средства Участника клиринга – заблокированные», открытом такому Участнику клиринга до момента получения соответствующей выписки по депозитному счету. Выписка по депозитному счету предоставляется одним из способов, установленных в Положении о формах и форматах документов.

5.3.11. Для договоров купли-продажи иностранной валюты обязательство (требование) по денежным средствам определяется следующим образом:

5.3.11.1. Обязательство Продавца Валютного биржевого инструмента равно сумме договора, обязательства из которого включены в Клиринговый пул, выраженной в валюте лота:

$$O = K * R, \text{ где}$$

O – обязательство Продавца;

K – количество лотов Валютного биржевого инструмента в договоре;

R – размер лота Валютного биржевого инструмента.

5.3.11.2. Обязательство Покупателя Валютного биржевого инструмента равно сумме договора, обязательства из которого включены в Клиринговый пул, выраженной в сопряженной валюте:

$$O = K * R * P / P_n, \text{ где}$$

O – обязательство Покупателя;

K – количество лотов Валютного биржевого инструмента в договоре;

R – размер лота Валютного биржевого инструмента;

P – цена Валютного биржевого инструмента в сопряженной валюте в договоре;

P<sub>n</sub> – количество единиц валюты лота, за которое указывается цена Валютного биржевого инструмента.

5.3.11.3. Требование Продавца Валютного биржевого инструмента равно сумме договора, обязательства из которого включены в Клиринговый пул, выраженной в сопряженной валюте:

$$T = K * R * P / P_n, \text{ где}$$

T – требование Продавца;

K – количество лотов Валютного биржевого инструмента в договоре;

R – размер лота Валютного биржевого инструмента;

P – цена Валютного биржевого инструмента в сопряженной валюте в договоре;

$P_n$  – количество единиц валюты лота, за которое указывается цена Валютного биржевого инструмента.

5.3.11.4. Требование Покупателя Валютного биржевого инструмента равно сумме договора, обязательства из которого включены в Клиринговый пул, выраженной в валюте лота:

$T = K * R$ , где

T – требование Покупателя;

K – количество лотов Валютного биржевого инструмента в договоре;

R – размер лота Валютного биржевого инструмента.

5.3.12. Если документами, определяющими заключение договоров с определенным Биржевым инструментом, установлено, что комиссионное вознаграждение Биржи по договору подлежит оплате с использованием счетов в Расчетной организации, то распоряжение на оплату комиссионного вознаграждения передаются Клиринговой организацией в Расчетную организацию в дату исполнения обязательств по уплате комиссионного вознаграждения.

#### **5.4. Процедура контроля обеспечения**

5.4.1. После формирования Клирингового пула Клиринговая организация проверяет обеспеченность ценными бумагами и денежными средствами всех обязательств Участника клиринга, включенных в Клиринговый пул.

5.4.2. Клиринговая организация проверяет обеспеченность всех обязательств, включенных в Клиринговый пул ценными бумагами путем сравнения значений клиринговых регистров, перечисленных в подразделе 8.2 Правил клиринга, со значениями клиринговых регистров, перечисленных в подразделе 8.1 Правил клиринга и содержащих информацию о значениях остатков на торговых счетах депо Участников клиринга, на разделе «к размещению»/«к выкупу» после получения информации из Расчетного депозитария. Сравнение производится только для отрицательных значений регистров обязательств из договоров с кодом расчетов Вп. Для обязательств из договоров с кодом расчетов Т0 сравнение производится с учетом исполнения всех обязательств, включенных в данный Клиринговый пул.

5.4.3. В том случае, когда модули отрицательных значений обязательств Участников клиринга по ценным бумагам не превышают значения клиринговых регистров, содержащих информацию о значениях остатков по ценным бумагам на торговых счетах депо Участников клиринга, на разделе «к размещению»/«к выкупу» все договоры Участника клиринга считаются обеспеченными ценными бумагами.

5.4.4. Клиринговая организация проверяет обеспеченность всех обязательств, включенных в Клиринговый пул, денежными средствами путем сравнения значений клиринговых регистров, перечисленных в подразделе 8.4 Правил клиринга, со значениями клиринговых регистров, перечисленных в п. 8.3.2, п. 8.3.5, п. 8.3.8 Правил клиринга и содержащих информацию о сумме денежных средств, свободных от обязательств, на торговых банковских счетах Участников клиринга или Клиринговых регистрах КБС. Вычисление значений регистров, указанных в п. 8.3.2, п. 8.3.5, п. 8.3.8 Правил клиринга, производится на основании значений регистров, указанных в п. 8.3.1, п. 8.3.3, п. 8.3.4, п. 8.3.6, п. 8.3.7, п. 8.3.9 Правил клиринга, после получения данных из Расчетной

организации. Сравнение производится только для отрицательных значений регистров обязательств из договоров с кодом расчетов Вп. Для обязательств из договоров с кодом расчетов Т0 сравнение производится с учетом исполнения всех обязательств, включенных в данный Клиринговый пул.

5.4.5. В ходе Промежуточной клиринговой сессии в Секции ДВР Клиринговая организация проверяет обеспеченность обязательств из депозитных договоров и кредитных договоров с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств) денежными средствами путем сравнения обязательств из каждого депозитного/кредитного договора со значениями клиринговых регистров, перечисленных в п. 8.3.3 Правил клиринга и содержащих информацию о сумме денежных средств, поступивших с указанием номера такого договора в назначении платежа. Указание номера договора в назначении платежа осуществляется Участником клиринга в формате, приведенном в Положении о формах и форматах документов.

5.4.6. В ходе Основной клиринговой сессии в Секции ДВР Клиринговая организация вначале проверяет обеспеченность обязательств из депозитных договоров и кредитных договоров с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств) денежными средствами путем сравнения обязательств из каждого депозитного/кредитного договора со значениями клиринговых регистров, перечисленных в п. 8.3.3 Правил клиринга и содержащих информацию о сумме денежных средств, поступивших с указанием номера такого договора в назначении платежа, а при отсутствии / недостатке таких денежных средств, в соответствии с п. 5.4.4 Правил клиринга.

5.4.7. В том случае, когда объем обязательств Участника клиринга по денежным средствам не превышает значения клиринговых регистров, содержащих информацию о свободных денежных средствах на торговых банковских счетах Участника клиринга или Клиринговых регистрах КБС, все договоры Участника клиринга считаются обеспеченными денежными средствами.

## **5.5. Порядок исполнения (прекращения) обязательств по итогам клиринга**

5.5.1. Расчеты по обязательствам и требованиям Участников клиринга по денежным средствам осуществляет Расчетная организация на основании распоряжений на проведение операций, полученных от Клиринговой организации.

5.5.2. Расчеты по обязательствам и требованиям Участников клиринга по ценным бумагам осуществляет Расчетный депозитарий на основании распоряжений на проведение операций, полученных от Клиринговой организации.

5.5.3. Расчеты по результатам клиринга проводятся с определением сальдо обязательств каждого из Участников клиринга по каждому Торгово-клиринговому регистру.

5.5.4. На основании значений клиринговых регистров, перечисленных в подразделах 8.2 и 8.4 Правил клиринга, Клиринговая организация формирует и передает:

5.5.4.1. в Расчетный депозитарий – распоряжение на проведение операций по торговым счетам депо, по Специальному техническому счету и его разделам «к размещению» / «к выкупу», являющиеся основаниями для проведения операций по торговым счетам депо, по Специальному техническому счету и его разделам «к размещению» / «к выкупу». Распоряжения передаются в Расчетный депозитарий, в котором открыты торговые счета, Специальный технический счет и его разделы «к размещению» / «к выкупу»;

5.5.4.2. в Расчетную организацию – распоряжение на проведение операций, являющееся основанием для проведения операций по торговым банковским счетам Участников клиринга и Клиринговым банковским счетам.

5.5.5. На основании полученных от Клиринговой организации распоряжений Расчетный депозитарий и Расчетная организация осуществляют переводы ценных бумаг и денежных средств по торговым счетам Участников клиринга, Клиринговым банковским счетам, по Специальному техническому счету и его разделам «к размещению» / «к выкупу» соответственно.

5.5.6. При проведении расчетов по итогам клиринга Расчетная организация проводит списание денежных средств с торговых банковских счетов Участников клиринга / Клирингового банковского счета в размере отрицательного сальдо их обязательств на Транзитный счет.

5.5.7. При проведении расчетов по итогам клиринга Расчетная организация проводит зачисление денежных средств на торговые банковские счета Участников клиринга / Клиринговый банковский счет в размере положительного сальдо их обязательств с Транзитного счета.

5.5.8. Если в соответствии с п. 7.1.12 Правил клиринга установлено, что для исполнения и/или обеспечения исполнения обязательств в определенной иностранной валюте, допущенных к клирингу, может быть использован исключительно Клиринговый банковский счет, исполнение обязательств в такой иностранной валюте осуществляется путем увеличения (уменьшения) суммы Гарантийного обеспечения, учитываемой на соответствующем Клиринговом регистре КБС, на сумму в размере положительного (отрицательного) сальдо обязательств Участника клиринга в такой иностранной валюте.

5.5.9. Расчетный депозитарий на основании распоряжения на проведение операций по торговым счетам депо осуществляет списание ценных бумаг с разделов «к размещению» Специального технического счета и с торговых счетов депо для учета ценных бумаг Участников клиринга, имеющих отрицательное сальдо обязательств по ценным бумагам, и их зачисление на разделы «к выкупу» Специального технического счета и на торговые счета депо для учета ценных бумаг Участников клиринга, имеющих положительное сальдо обязательств по ценным бумагам в день исполнения обязательств.

5.5.10. Расчетный депозитарий осуществляет переводы по торговым счетам депо в корреспонденции со Специальным техническим счетом. Указанный Специальный технический счет используется Расчетным депозитарием для обеспечения процедуры поставки ценных бумаг в соответствии с распоряжением Клиринговой организации на перевод ценных бумаг. Операции по такому техническому счету производятся на основании распоряжения Клиринговой организации. После исполнения обязательств по итогам клиринга остаток ценных бумаг на указанном счете не допускается. Наименование, обозначение и режим указанного счета определяется Условиями осуществления депозитарной деятельности данного Расчетного депозитария и договором между Клиринговой организацией и Расчетным депозитарием.

5.5.11. В течение одного дня возможно проведение нескольких размещений ценных бумаг. При проведении размещения ценных бумаг Расчетный депозитарий на основании распоряжения Клиринговой организации на зачисление размещаемых ценных бумаг и получения необходимых отчетов от вышестоящего депозитария зачисляет размещаемые ценные бумаги на раздел «к размещению» Специального технического счета. Далее Расчетный депозитарий на основании распоряжения Клиринговой организации на проведение операций по разделу «к размещению» осуществляет списание ценных бумаг в размере обязательств с раздела «к размещению» и их зачисление на торговые счета депо для учета ценных бумаг Участников клиринга, имеющих требования по получению ценных

бумаг в день исполнения обязательств по размещению ценных бумаг. Если после исполнения вышеуказанного распоряжения на разделе «к размещению» остались неразмещенные ценные бумаги, то Расчетный депозитарий на основании распоряжения Клиринговой организации осуществляет действия по возврату неразмещенных ценных бумаг. Не допускается наличие остатка ценных бумаг на разделе «к размещению» после проведения всех операций на конец рабочего дня размещения.

5.5.12. При проведении выкупа ценных бумаг эмитентом Расчетный депозитарий, на основании распоряжения Клиринговой организации, осуществляет списание ценных бумаг с торговых счетов депо и их зачисление на раздел «к выкупу» в день исполнения обязательств по выкупу ценных бумаг. После исполнения вышеуказанного распоряжения Расчетный депозитарий на основании распоряжения Клиринговой организации на списание выкупленных ценных бумаг с раздела «к выкупу» осуществляет соответствующие действия по перечислению ценных бумаг на казначейский счет эмитента. После проведения всех операций остаток на конец рабочего дня проведения расчетов по выкупу на разделе «к выкупу» не допускается.

5.5.13. Расчетная организация и Расчетный депозитарий передают Клиринговой организации информацию о денежных средствах и ценных бумагах на торговых счетах, на разделах «к размещению»/«к выкупу», сформированную по итогам обработки распоряжений, указанных в п. 5.5.4 Правил клиринга, в виде информации об остатках на торговых счетах, остатках на разделах «к размещению»/«к выкупу». Время, порядок обмена электронными документами определяется договорами между Клиринговой организацией и Расчетной организацией, Клиринговой организацией и Расчетным депозитарием.

5.5.14. Для депозитного договора и кредитного договора соглашением между Инициатором торгов и Участниками торгов может быть предусмотрена возможность для Участника клиринга категории «И» или «В» (Участника торгов – Инициатора торгов) отказаться от исполнения договора до проведения расчетов по размещению депозита и размещению/привлечению кредита. В этом случае обязательства по указанному договору могут быть прекращены путем расторжения договора, заключенного на условиях соглашения между Инициатором торгов и Участниками торгов. При получении Клиринговой организацией от Участника клиринга категории «И» или «В» (Участника торгов – Инициатора торгов) Уведомления о расторжении договора, Клиринговая организация вносит в клиринговые регистры сведения о прекращении обязательств Участников клиринга по указанному договору.

5.5.15. В момент завершения расчетов все исполненные обязательства прекращаются в Клиринговом пуле.

5.5.16. В ходе Основной клиринговой сессии в Секции ДВР обязательства из депозитных/кредитных договоров с текущей датой исполнения первой части договора, не прошедшие контроль обеспечения в соответствии с подразделом 5.4 Правил клиринга, признаются неисполненными и прекращаются.

5.5.17. В ходе Основной клиринговой сессии в Секции ДВР обязательства из депозитных/кредитных договоров с текущей датой исполнения второй части договора, не прошедшие контроль обеспечения в соответствии с подразделом 5.4 Правил клиринга, признаются неисполненными, Клиринговая организация вносит в клиринговые регистры сведения о прекращении учета соответствующих обязательств. Прекращение обязательств осуществляется в соответствии с условиями соглашения между Инициатором торгов и Участниками торгов.

5.5.18. В ходе клиринговой сессии обязательства из договоров купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Вп с текущей датой исполнения, не прошедшие контроль

обеспечения в соответствии с подразделом 5.4 Правил клиринга, признаются неисполненными и прекращаются.

## **5.6. Порядок проведения сверки результатов расчетов**

5.6.1. Клиринговая организация на основании полученных из Расчетного депозитария и Расчетной организации информации об остатках ценных бумаг на торговых счетах депо, на разделах «к размещению»/«к выкупу» и информации об остатках денежных средств на торговых банковских счетах, Клиринговых банковских счетах, сформированных по итогам обработки распоряжения на проведение операций по разделам торговых счетов депо, по разделам «к размещению»/«к выкупу» и распоряжения на проведение операций по торговым банковским счетам, Клиринговым банковским счетам, соответственно, присваивает значения клиринговым регистрам, перечисленным в пп. 8.1.1 – 8.1.10, п. 8.3.1, п. 8.3.4, п. 8.3.7 Правил клиринга.

5.6.2. В Клиринговой системе проводится сверка значений соответствующих клиринговых регистров, указанных в п. 5.6.1 Правил клиринга, с данными, полученными в результате расчетов Клиринговой системы на основании предыдущих значений указанных клиринговых регистров и регистров по учету обязательств, по каждому Участнику клиринга.

5.6.3. При отсутствии расхождений Клиринговая организация направляет в Расчетную организацию, в Расчетный депозитарий Уведомления о завершении расчетов.

5.6.4. С момента направления Уведомлений о завершении расчетов, расчеты по обязательствам Участников клиринга считаются завершенными, обязательства Участников клиринга по договорам Клирингового пула считаются исполненными.

5.6.5. Порядок взаимодействия, время начала и сроки исполнения операций, проведения сверки значений соответствующих клиринговых регистров определяются договорами Клиринговой организации с Расчетной организацией и с Расчетным депозитарием.

## **5.7. Порядок действий в случае расхождения данных при сверке**

5.7.1. В случае обнаружения расхождений при проведении сверки в соответствии с подразделом 5.6 Правил клиринга, Клиринговая организация формирует протокол расхождения данных при проведении сверки и направляет его в Расчетную организацию и/или Расчетный депозитарий для установления причин расхождения данных. Сроки выявления расхождений определяются договором, заключаемым Клиринговой организацией с Расчетной организацией и/или Расчетным депозитарием.

5.7.2. Клиринговая организация, Расчетная организация и/или Расчетный депозитарий, руководствуясь собственными внутренними процедурами, предпринимают действия по поиску и выявлению причин, приведших к расхождению данных, и их устранению.

5.7.3. В зависимости от характера выявленных причин расхождения данных Клиринговая организация, Расчетная организация или Расчетный депозитарий проводят действия по устранению выявленных расхождений, в том числе повторно выполняют действия, описанные в подразделе 5.5 Правил клиринга и Договорах о взаимодействии между Клиринговой организацией и Расчетной организацией, между Клиринговой организацией и Расчетным депозитарием.

## **5.8. Порядок прекращения обязательств в связи с введением процедур банкротства Участника клиринга и определения размера денежного обязательства, возникающего в связи с таким прекращением**

5.8.1. В случае введения процедуры банкротства в отношении Участника клиринга (за исключением процедуры наблюдения) или отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации все обязательства этого Участника клиринга, допущенные к Клирингу, прекращаются путем ликвидационного Неттинга, установленным настоящим подразделом. Клиринговая организация рассчитывает денежные обязательства / требования, возникающие в связи проведением ликвидационного Неттинга (далее в настоящем подразделе – ликвидационные Нетто-обязательства / Нетто-требования).

5.8.2. Обязательства/требования Участника клиринга – кредитной организации прекращаются возникновением ликвидационных Нетто-обязательств / Нетто-требований на дату, следующую за датой отзыва у такого Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций. Обязательства/требования Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, прекращаются возникновением ликвидационных Нетто-обязательств / Нетто-требований на дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства.

5.8.3. Клиринговая организация рассчитывает ликвидационные Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга, возникающие взамен прекращенных в соответствии с п. 5.8.1 Правил клиринга, в отношении каждого иного Участника клиринга, перед которым указанный Участник клиринга имеет обязательства или к которому указанный Участник клиринга имеет требования (далее – контрагент), отдельно по следующим договорам:

5.8.3.1. заключенным за счет Участника клиринга,

5.8.3.2. заключенным за счет клиентов Участника клиринга,

5.8.3.3. заключенным за счет средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

5.8.4. Ликвидационное Нетто-обязательство / Нетто-требование рассчитывается в российских рублях и не включает в себя возмещение убытков в форме упущенной выгоды и взыскание неустоек (штрафов, пеней).

5.8.5. Ликвидационное Нетто-обязательство / Нетто-требование рассчитывается по следующей формуле:

$$НО = \sum_i (RT_i - RO_i) + \sum_{k,l} (S_k T_l - S_k O_l) * C_{kl},$$

где НО – ликвидационное Нетто-обязательство / Нетто-требование в отношении соответствующего контрагента по договорам соответствующего вида, указанного в п. 5.8.3 Правил клиринга,

$RT_i$  – денежное (в российских рублях) требование Участника клиринга по  $i$ -тому договору на дату признания Участника клиринга банкротом / отзыва лицензии на осуществление банковских операций;

$RO_i$  – денежное (в российских рублях) обязательство Участника клиринга по  $i$ -тому договору на дату признания Участника клиринга банкротом / отзыва лицензии на осуществление банковских операций;

при определении  $RT_i$  и  $RO_i$  учитываются все денежные требования/обязательства, выраженные в российских рублях (если требования/обязательства определены в

иностранной валюте, расчёт осуществляется по курсу соответствующей иностранной валюты, установленному Банком России на дату расчета, с точностью до второго знака после запятой, округление второго знака после запятой производится по правилам математического округления), по договорам соответствующего вида во всех Секциях Биржи;

при определении  $RT_i$  и  $RO_i$  учитываются обязательства/требования по возврату средств по депозитным/кредитным договорам у Участника клиринга или контрагента до даты признания Участника клиринга банкротом / даты отзыва лицензии (не включая указанные даты);

$S_{kT_1}$  и  $S_{kO_1}$  – требование и обязательство по k-той ценной бумаге по l-тому договору с этой ценной бумагой;

$S_{k1}$  – цена k-той ценной бумаге по l-тому договору, равная расчетной цене k-ой ценной бумаги, определенной Биржей в соответствии с Правилами проведения организованных торгов в Фондовой секции АО СПВБ по итогам Торгового дня прекращения обязательств, или последней использовавшейся расчетной цены такой ценной бумаги, и НКД на дату прекращения обязательств (при условии его расчета для данной ценной бумаги). Если расчетная цена и НКД для k-ой ценной бумаги определены в иностранной валюте, расчёт цены осуществляется по курсу соответствующей иностранной валюты, установленному Банком России на дату прекращения обязательств, с точностью до второго знака после запятой, округление второго знака после запятой производится по правилам математического округления.

Отрицательное значение НО означает Нетто-обязательство Участника клиринга, положительное значение НО – Нетто-требование Участника клиринга.

5.8.6. Клиринговая организация направляет Участнику клиринга и его контрагентам Уведомление о прекращении обязательств/требований по договорам, допущенным к клирингу, и рассчитанных в соответствии с п. 5.8.5 Правил клиринга размерах ликвидационных Нетто-обязательств / Нетто-требований в дату расчета.

5.8.7. Денежные средства и иное имущество Участника клиринга, находящиеся на торговых банковских счетах и Клиринговых регистрах КБС после расчетов по ликвидационным Нетто-обязательств / Нетто-требований, подлежат возврату Участнику клиринга, в том числе для включения в конкурсную массу. В этом случае Клиринговая организация вправе запросить у Участника клиринга либо его правопреемника (представителя) реквизиты счетов для перечисления денежных средств и иного имущества не позднее рабочего дня, следующего за днем расчета ликвидационных Нетто-обязательств. Возврат денежных средств и иного имущества осуществляется в течение 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг.

## **6. Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу**

### **6.1. Индивидуальное клиринговое обеспечение**

6.1.1. Индивидуальным клиринговым обеспечением является Гарантийное обеспечение.

6.1.2. Гарантийное обеспечение принимается в виде денежных средств и/или ценных бумаг.

6.1.3. Гарантийное обеспечение Участника клиринга категорий «Ф», «И», «В» и «Б» может учитываться на торговых счетах Участника клиринга и/или Клиринговом банковском счете.

6.1.4. Порядок использования Гарантийного обеспечения регулируется Правилами клиринга. Подписание отдельного соглашения о Гарантийном обеспечении не требуется.

6.1.5. При заключении договоров за счет Участника клиринга или его клиентов в клиринговые регистры, указанные соответственно в п. 8.3.3, п. 8.3.6, п. 8.3.9 Правил клиринга, вносятся сведения о суммах заблокированного Гарантийного обеспечения.

6.1.6. Клиринговая организация не использует в своих интересах денежные средства, являющиеся предметом индивидуального клирингового обеспечения.

## **7. Виды торговых и клиринговых счетов и порядок совершения операций по ним**

### **7.1. Виды торговых и клиринговых счетов**

7.1.1. В соответствии с договором, заключенным с Участником клиринга, Расчетная организация для учета денежных средств и проведения расчетов по итогам клиринга открывает Участнику клиринга следующие торговые банковские счета:

7.1.1.1. торговый банковский счет Участника клиринга, в том числе счет собственных средств, счет для учета обеспечения Обособленного клиента / клиентов Участника клиринга;

7.1.1.2. специальный брокерский счет Участника клиринга – профессионального участника рынка ценных бумаг, имеющего лицензию Банка России на осуществление брокерской деятельности;

7.1.1.3. отдельный специальный брокерский счет Участника клиринга – профессионального участника рынка ценных бумаг, имеющего лицензию Банка России на осуществление брокерской деятельности, для учета обеспечения Обособленного клиента, зарегистрированного в Клиринговой организации;

7.1.1.4. специальный торговый счет Участника клиринга – кредитной организации;

7.1.1.5. отдельный специальный торговый счет Участника клиринга – кредитной организации, для учета обеспечения Обособленного клиента, зарегистрированного в Клиринговой организации;

7.1.1.6. торговый банковский счет Участника клиринга для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

7.1.2. Участникам клиринга могут быть открыты в Расчетной организации торговые банковские счета для учета средств клиентов. В этом случае Клиринговая организация формирует распоряжение на проведение операций по таким счетам на основании обязательств Участника клиринга по договорам, заключенным за счет и по поручению таких клиентов. В дальнейшем, под торговым банковским счетом Участника клиринга понимается также соответствующий торговый банковский счет Участника клиринга для учета денежных средств Обособленного клиента / клиентов Участника клиринга.

7.1.3. На торговом банковском счете для учета собственных средств, указанном в п. 7.1.1.1 Правил клиринга, учитываются средства Участника клиринга, предназначенные для исполнения обязательств и обеспечения исполнения обязательств по договорам, заключенным за счет Участника клиринга.

7.1.4. На специальном брокерском счете учитываются средства клиентов Участника клиринга – профессионального участника рынка ценных бумаг, имеющего лицензию Банка России на осуществление брокерской деятельности, предназначенные для исполнения обязательств и обеспечения исполнения обязательств по договорам, заключенным за счет клиентов Участника клиринга.

7.1.5. На специальном торговом счете учитываются средства клиентов Участника клиринга – кредитной организации, предназначенные для исполнения обязательств и обеспечения исполнения обязательств по договорам, заключенным за счет клиентов Участника клиринга.

7.1.6. На торговом банковском счете, указанном в подп. 7.1.1.6 Правил клиринга, учитываются средства, находящиеся в доверительном управлении, средства негосударственного пенсионного фонда, имеющего лицензию на осуществление деятельности по пенсионному обеспечению и пенсионному страхованию, средства пенсионных резервов негосударственного пенсионного фонда или средства пенсионных накоплений негосударственного пенсионного фонда.

7.1.7. В соответствии с договором, заключенным с Клиринговой организацией, Расчетный депозитарий для учета ценных бумаг и проведения операций с ценными бумагами по результатам клиринга договоров, заключенных при размещении ценных бумаг, использует Специальный технический счет и его разделы «к размещению» / «к выкупу».

7.1.8. Расчетный депозитарий для учета ценных бумаг и проведения операций с ценными бумагами по результатам клиринга заключенных договоров открывает лицам, указанным в п. 7.1.10 Правил клиринга, торговые счета депо.

7.1.9. На торговых счетах депо учитываются ценные бумаги, которые могут быть использованы для исполнения и/или обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу.

7.1.10. Торговые счета депо подразделяются на:

7.1.10.1. торговый счет депо владельца, открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве;

7.1.10.2. торговый счет депо номинального держателя, открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;

7.1.10.3. торговый счет депо доверительного управляющего, открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг, находящихся у Участника клиринга в доверительном управлении;

7.1.10.4. торговый казначейский счет депо эмитента (лица, обязанного по ценным бумагам) для приобретения или отчуждения собственных ценных бумаг в процессе их обращения;

7.1.10.5. торговый счет депо номинального держателя, открытый Держателю для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве;

7.1.10.6. торговый счет депо номинального держателя, открытый Держателю для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;

7.1.10.7. торговый счет депо номинального держателя, открытый Держателю для учета ценных бумаг, находящихся у Участника клиринга в доверительном управлении;

7.1.10.8. торговый счет депо иностранного номинального держателя, открытый иностранному номинальному держателю для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;

7.1.10.9. торговый счет депо иностранного уполномоченного держателя, открытый иностранному уполномоченному держателю, для учета ценных бумаг, переданных в

управление иностранному уполномоченному держателю, обслуживаемому Участником клиринга.

7.1.11. В соответствии с договором между Клиринговой организацией и Расчетной организацией последняя открывает Клиринговой организации Клиринговые банковские счета для учета денежных средств, которые используются для обеспечения и исполнения обязательств, допущенных к клирингу, в том числе Транзитный счет.

7.1.12. Клиринговой организацией может быть установлено, что для исполнения и/или обеспечения исполнения обязательств в определенной иностранной валюте, допущенных к клирингу, может быть использован исключительно Клиринговый банковский счет в одной из Расчетных организаций. Такая информация указывается в Спецификации Валютного биржевого инструмента.

## **7.2. Порядок проведения операций по торговым банковским счетам**

7.2.1. Операции по торговым банковским счетам производятся согласно распоряжениям Клиринговой организации в порядке, установленном подразделом 5.5 Правил клиринга, или по поручению владельца счета с согласия Клиринговой организации, в порядке, установленном настоящим подразделом.

7.2.2. Денежные средства на торговые банковские счета для исполнения обязательств и обеспечения исполнения обязательств зачисляются:

7.2.2.1. с любого счета в любой кредитной организации с обязательным указанием назначения платежа по форме, установленной Положением о формах и форматах документов;

7.2.2.2. по распоряжению Клиринговой организации с Клирингового банковского счета, в порядке, установленном подразделом 5.5 Правил клиринга.

7.2.3. Денежные средства с торговых банковских счетов списываются:

7.2.3.1. по распоряжению Клиринговой организации;

7.2.3.2. по поручению Участника клиринга с согласия Клиринговой организации.

7.2.4. На период проведения расчетов по итогам клиринга Расчетная организация блокирует операции на торговых банковских счетах, производимые по поручению Участника клиринга. Блокировка означает, что списание и зачисление денежных средств по торговым банковским счетам Участника клиринга производится только на основании распоряжения Клиринговой организации на проведение операций по торговым банковским счетам, предусмотренного Правилами клиринга.

7.2.5. Зачисление и списание денежных средств по торговым банковским счетам по поручению Участника клиринга производится с согласия Клиринговой организации, получаемого Расчетной организацией в отношении каждой суммы по определенному торговому банковскому счету.

7.2.6. Клиринговая организация после получения запроса от Расчетной организации на списание денежных средств с торгового банковского счета Участника клиринга осуществляет проверку достаточности денежных средств на этом счете, в том числе с учетом необходимости обеспечения обязательств из договоров, заключенных в ходе текущей Торговой сессии.

7.2.7. Сумма списания денежных средств с торгового банковского счета Участника клиринга в период проведения Торговой сессии должна быть меньше или равна сумме остатка на торговом банковском счете на момент начала текущей Торговой сессии и сумм всех зачислений и списаний на данный торговый банковский счет в течение текущей

Торговой сессии. Кроме того, не подлежат списанию суммы, обеспечивающие исполнение обязательств из депозитных/кредитных договоров с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств), поступивших с указанием номера такого договора в назначении платежа.

7.2.8. При успешной проверке достаточности денежных средств Клиринговая организация направляет Расчетной организации подтверждение, на основании которого Расчетная организация производит списание денежных средств. Если результат проверки отрицательный, Клиринговая организация направляет Расчетной организации отказ в подтверждении.

7.2.9. Зачисление средств на торговые банковские счета и списание средств с торговых банковских счетов при исполнении обязательств по итогам клиринга производится на основании распоряжения на проведение операций по торговым банковским счетам в порядке, установленном подразделом 5.5 Правил клиринга.

### **7.3. Порядок проведения операций по торговым счетам депо и Специальному техническому счету**

7.3.1. Открытие и закрытие торгового счета депо производится Расчетным депозитарием с согласия Клиринговой организации. Порядок получения согласия Клиринговой организации на открытие торгового счета депо регулируется договором АО СПВБ с Расчетным депозитарием. Согласие Клиринговой организации на закрытие торгового счета депо направляется Расчетному депозитарию в ответ на запрос о возможности такого закрытия.

7.3.2. Ценные бумаги с торговых счетов депо списываются или зачисляются по поручению Участника клиринга с согласия Клиринговой организации, за исключением зачисления или списания ценных бумаг при расчетах по итогам клиринга.

7.3.3. Клиринговая организация после получения запроса на списание ценных бумаг с торгового счета депо осуществляет проверку достаточности ценных бумаг на этом счете, в том числе с учетом необходимости обеспечения договоров, заключенных в ходе текущей Торговой сессии.

7.3.4. Количество списываемых ценных бумаг с торгового счета депо в период проведения Торговой сессии должно быть меньше или равно количеству ценных бумаг на торговом счете депо на момент начала текущей Торговой сессии и сумм всех зачислений и списаний на данный торговый счет депо в течение текущей Торговой сессии.

7.3.5. Зачисление и списание ценных бумаг по торговым счетам депо, при исполнении обязательств по итогам клиринга, производится на основании распоряжений на проведение операций по торговым счетам депо, в порядке, установленном подразделом 5.5 Правил клиринга, с использованием Специального технического счета. При размещении ценных бумаг зачисление размещенных ценных бумаг на торговые счета депо производится на основании распоряжений Клиринговой организации с раздела «к размещению» Специального технического счета. При выкупе ценных бумаг списание ценных бумаг с торговых счетов депо производится на основании распоряжений Клиринговой организации на разделы «к выкупу» Специального технического счета.

7.3.6. Расчетный депозитарий исполняет поручения Участника клиринга по торговым счетам депо после получения согласия Клиринговой организации на проведение этих операций.

#### **7.4. Порядок проведения операций по клиринговым счетам**

7.4.1. Клиринговая организация может открывать в Расчетной организации несколько Клиринговых банковских счетов. Клиринговая организация ведет отдельный внутренний учет средств Участников клиринга и средств клиентов Участников клиринга на Клиринговом банковском счете.

7.4.2. Денежные средства на Клиринговом банковском счете, открытом в Расчетной организации, используются для обеспечения и исполнения обязательств Участников клиринга по денежным средствам. Участники клиринга зачисляют денежные средства на Клиринговый банковский счет самостоятельно, в установленное регламентом Расчетной организации время.

7.4.3. В период проведения расчетов по итогам клиринга зачисление денежных средств на Клиринговый банковский счет осуществляется по распоряжению Клиринговой организации с торгового банковского счета Участника клиринга, Клирингового банковского счета или Транзитного счета в порядке, установленном подразделом 5.5 Правил клиринга. Денежные средства зачисляются в размере положительных сальдо обязательств Участников клиринга по договорам, включенным в Клиринговый пул.

7.4.4. В период проведения расчетов по итогам клиринга списание денежных средств с Клирингового банковского счета, открытого в Расчетной организации, осуществляется по распоряжению Клиринговой организации на торговый банковский счет Участника клиринга, Клиринговый банковский счет или Транзитный счет в порядке, установленном подразделом 5.5 Правил клиринга, в размере отрицательных сальдо обязательств Участников клиринга по договорам, включенным в Клиринговый пул.

7.4.5. До начала и по окончании проведения расчетов по итогам клиринга денежные средства на Клиринговый банковский счет зачисляются с банковских (корреспондентских) счетов с обязательным указанием назначения платежа по форме, установленной Положением о формах и форматах документов.

7.4.6. Денежные средства могут списываться с Клирингового банковского счета на банковский (корреспондентский) счет Участника клиринга или на торговый банковский счет Участника клиринга на основании поручения Участника клиринга по форме, приведенной в Положении о формах и форматах документов. Поручение на списание средств должно содержать реквизиты счета Участника клиринга, на который должны быть переведены средства, и номер Торгово-клирингового регистра, с которого производится списание.

7.4.7. Денежные средства могут списываться с Клирингового банковского счета на банковский (корреспондентский) счет клиента Участника клиринга на основании поручения Участника клиринга по форме, приведенной в Положении о формах и форматах документов. Поручение на списание средств должно содержать реквизиты счета клиента Участника клиринга, на который должны быть переведены средства, и номер Торгово-клирингового регистра, в рамках которого учитываются обязательства из договоров, заключенных за счет данного клиента, с которого производится списание.

7.4.8. Перечень счетов, на которые возможен вывод денежных средств с Клирингового банковского счета (далее – Перечень счетов), должен быть предварительно согласован Клиринговой организацией.

7.4.8.1. Для согласования Перечня счетов Участник клиринга должен направить в Клиринговую организацию соответствующий запрос по форме и в порядке, приведенными в Положении о формах и форматах документов, в срок не позднее 15 (пятнадцати) календарных дней до даты планируемого использования счетов для совершения операций.

7.4.8.2. В случае, если владельцем банковского (корреспондентского) счета, предназначенного для вывода денежных средств с Клирингового банковского счета, является клиент Участника клиринга, Участник клиринга должен вместе с запросом на согласование Перечня счетов предоставить в Клиринговую организацию документы, предусмотренные Положением о формах и форматах документов.

7.4.8.3. При рассмотрении запроса на согласование Перечня счетов Клиринговая организация вправе запросить у Участника клиринга дополнительную информацию, а также отказать во включении счета в Перечень счетов в случае, если по заключению Клиринговой организации это может повлечь нарушение законодательства Российской Федерации или порядка внутреннего контроля, осуществляемого Клиринговой организацией в соответствии с нормативными актами Банка России.

7.4.8.4. По итогам рассмотрения запроса на согласование Перечня счетов Клиринговая организация направляет Участнику клиринга уведомление о согласовании Перечня счетов по форме и в порядке, предусмотренными в Положении о формах и форматах документов, в срок не позднее 15 (пятнадцати) календарных дней с момента получения запроса Участника клиринга на согласование Перечня счетов или с момента получения от Участника клиринга ответа на запрос Клиринговой организации, предусмотренный подп. 7.4.8.3 Правил клиринга.

7.4.8.5. Клиринговая организация вправе приостановить совершение операций в отношении счета, ранее включенного в Перечень счетов, в том числе посредством отказа в обработке поручения на списание средств Участника клиринга, в случае если по заключению Клиринговой организации это может повлечь нарушение законодательства Российской Федерации, а также нарушение порядка внутреннего контроля, осуществляемого Клиринговой организацией в соответствии с нормативными актами Банка России. При выявлении оснований для приостановки операций в отношении счета, ранее включенного в Перечень счетов, Клиринговая организация направляет Участнику клиринга уведомление с актуальным Перечнем счетов по форме и в порядке, предусмотренными в Положении о формах и форматах документов, в срок не позднее следующего рабочего дня после выявления указанных оснований или в день обработки поручения на списание средств Участника клиринга, в обработке которого отказано.

7.4.9. Клиринговая организация после получения поручения на списание денежных средств с Клирингового банковского счета осуществляет проверку достаточности денежных средств на Клиринговом регистре КБС, в том числе с учетом необходимости обеспечения обязательств из договоров, заключенных в ходе текущей Торговой сессии.

7.4.10. При списании денежных средств в период проведения Торговой сессии, сумма списания денежных средств Участника клиринга с Клирингового банковского счета должна быть меньше или равна сумме остатка на Клиринговом регистре КБС на момент начала текущей Торговой сессии и сумм всех зачислений и списаний на данный клиринговый регистр в течение текущей Торговой сессии. Кроме того, не подлежат списанию суммы, обеспечивающие исполнение обязательств из депозитных/кредитных договоров с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств), поступивших с указанием номера такого договора в назначении платежа.

## **8. Клиринговые регистры и иные формы внутреннего учета, их назначение, порядок ведения**

### **8.1. Клиринговые регистры учета ценных бумаг**

8.1.1. Регистр «Ценные бумаги Участника клиринга» – клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных ценных бумаг Участника клиринга на торговом счете депо владельца в Расчетном депозитарии.

8.1.2. Регистр «Ценные бумаги Участника клиринга – клиенты» – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга на торговом счете депо номинального держателя, открытого Участнику клиринга в Расчетном депозитарии.

8.1.3. Регистр «Ценные бумаги Участника клиринга – ДУ» – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга на торговом счете депо доверительного управляющего в Расчетном депозитарии.

8.1.4. Регистр «Ценные бумаги для размещения/выкупа» – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг для размещения/выкупа. Регистр соответствует разделу «к размещению» / «к выкупу», выделенному на Специальном техническом счете, не предназначенном для учета прав на ценные бумаги, который используется для проведения операций при размещении/выкупе ценных бумаг.

8.1.5. Регистр «Ценные бумаги эмитента, на казначейском торговом счете депо» – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг эмитента (лица, обязанного по ценным бумагам) под управлением Участника клиринга, приобретаемых или отчуждаемых эмитентом (лицом, обязанным по ценным бумагам) в процессе их обращения на торговом казначейском счете депо эмитента (лица, обязанного по ценным бумагам).

8.1.6. Регистр «Ценные бумаги у Держателя – свои» – клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных ценных бумаг Участника клиринга, находящихся на торговом счете депо Держателя в Расчетном депозитарии.

8.1.7. Регистр «Ценные бумаги у Держателя – клиенты» – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, находящихся на торговом счете депо Держателя в Расчетном депозитарии.

8.1.8. Регистр «Ценные бумаги у Держателя – ДУ» – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга, находящихся на торговом счете депо Держателя в Расчетном депозитарии.

8.1.9. Регистр «Ценные бумаги у иностранного номинального держателя» – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, находящихся на торговом счете депо иностранного номинального держателя в Расчетном депозитарии.

8.1.10. Регистр «Ценные бумаги у иностранного уполномоченного держателя» – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг, находящихся на торговом счете депо иностранного уполномоченного держателя в Расчетном депозитарии.

### **8.2. Клиринговые регистры учета обязательств по ценным бумагам**

8.2.1. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга из собственных договоров» – клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по ценным бумагам Участника клиринга из договоров, заключенных за счет Участника клиринга. Регистры формируются по обязательствам, подлежащим исполнению с собственного счета депо Участника клиринга, открытого в Расчетном депозитарии для

учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве.

8.2.2. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга из клиентских договоров» – клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по ценным бумагам клиентов Участника клиринга из договоров, заключенных в интересах клиентов Участника клиринга. Регистры формируются по обязательствам, подлежащим исполнению со счета депо номинального держателя, открытого Участнику клиринга в Расчетном депозитарии для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга.

8.2.3. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга из договоров ДУ» – клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по ценным бумагам, находящимся в доверительном управлении Участника клиринга, из заключенных договоров с ценными бумагами. Регистры формируются по обязательствам, подлежащим исполнению со счета депо доверительного управляющего, открытого Участнику клиринга в Расчетном депозитарии для учета ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга.

8.2.4. Регистр «Обязательства по ценным бумагам для размещения/выкупа» – клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по ценным бумагам при их размещении/выкупе, из договоров с ценными бумагами, заключенных за счет Участника клиринга в процессе их размещения/выкупа с использованием раздела «к размещению» / «к выкупу».

8.2.5. Регистр «Обязательства по ценным бумагам эмитента – казначейский» – клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по ценным бумагам эмитента из договоров с ценными бумагами, заключенных за счет Участника клиринга по поручению эмитента при приобретении или отчуждении ценных бумаг в процессе их обращения.

8.2.6. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга – свои у Держателя» – клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по ценным бумагам Участника клиринга. Регистры формируются по обязательствам, подлежащим исполнению с торгового счета депо Держателя в Расчетном депозитарии.

8.2.7. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга – клиенты у Держателя» – клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по ценным бумагам клиентов Участника клиринга. Регистры формируются по обязательствам, подлежащим исполнению с торгового счета депо номинального держателя, открытого Держателю в Расчетном депозитарии.

8.2.8. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга – ДУ у Держателя» – клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по ценным бумагам в доверительном управлении Участника клиринга из заключенных за его счет договоров с ценными бумагами. Регистры формируются по обязательствам, подлежащим исполнению с торгового счета депо, открытого Держателю в Расчетном депозитарии для учета ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга.

8.2.9. Регистр «Обязательства по ценным бумагам – клиенты у иностранного номинального держателя» – клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по ценным бумагам клиентов Участника клиринга. Регистры формируются по обязательствам, подлежащим исполнению с торгового счета депо иностранного номинального держателя, открытого иностранному номинальному держателю в Расчетном депозитарии.

8.2.10. Регистр «Обязательства по ценным бумагам иностранного уполномоченного держателя» – клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по ценным

бумагам иностранного уполномоченного держателя, являющегося клиентом Участника клиринга. Регистры формируются по обязательствам, подлежащим исполнению с торгового счета депо иностранного уполномоченного держателя, открытого иностранному уполномоченному держателю в Расчетном депозитарии.

### **8.3. Клиринговые регистры учета денежных средств**

8.3.1. Регистр «Денежные средства Участника клиринга» – клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных денежных средств Участника клиринга, зачисленных на торговый банковский счет или Клиринговый регистр КБС в целях исполнения и/или обеспечения исполнения обязательств из договоров в Фондовой секции и Секции ДВР. Регистр соответствует торговому банковскому счету собственных средств, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации, или Клиринговому регистру КБС. На регистре учитывается суммарное значение денежных средств, учтенных на регистре «Денежные средства Участника клиринга – свободные» и регистре «Денежные средства Участника клиринга – заблокированные».

8.3.2. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – свободные» – клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных денежных средств Участника клиринга, свободных от обязательств из договоров в Фондовой секции и договоров в Секции ДВР.

8.3.3. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – заблокированные» – клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных денежных средств Участника клиринга, заблокированных в целях обеспечения исполнения обязательств из договоров в Фондовой секции и договоров в Секции ДВР.

8.3.4. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – клиенты» – клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств клиентов Участника клиринга, зачисленных на торговый банковский счет или Клиринговый регистр КБС в целях исполнения и/или обеспечения исполнения обязательств из договоров в Фондовой секции и Секции ДВР. Регистр, предназначенный для учета денежных средств клиентов Участника клиринга, соответствует торговому банковскому счету, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации и указанному в подп. 7.1.1.1-7.1.1.5 Правил клиринга, или Клиринговому регистру КБС. На регистре учитывается суммарное значение денежных средств, учтенных на регистре «Денежные средства клиентов Участника клиринга – свободные» и регистре «Денежные средства клиентов Участника клиринга – заблокированные».

8.3.5. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга – свободные» – клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств клиентов Участника клиринга, свободных от обязательств из договоров в Фондовой секции и договоров в Секции ДВР.

8.3.6. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга – заблокированные» – клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств клиентов Участника клиринга, заблокированных под исполнение обязательств из договоров в Фондовой секции и договоров в Секции ДВР.

8.3.7. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – ДУ» – клиринговый регистр, предназначенный для учета находящихся в доверительном управлении Участника клиринга денежных средств, зачисленных на торговый банковский счет или Клиринговый регистр КБС в целях исполнения и/или обеспечения исполнения обязательств из договоров в Фондовой секции и Секции ДВР. Регистр соответствует торговому банковскому счету Участника клиринга для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении, открытому в Расчетной организации, или Клиринговому регистру КБС. На

регистре учитывается суммарное значение денежных средств, учтенных на регистре «Денежные средства Участника клиринга – ДУ – свободные» и регистре «Денежные средства Участника клиринга – ДУ – заблокированные».

8.3.8. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – ДУ – свободные» – клиринговый регистр, предназначенный для учета находящихся в доверительном управлении Участника клиринга денежных средств, свободных от обязательств из договоров в Фондовой секции и договоров в Секции ДВР.

8.3.9. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – ДУ – заблокированные» – клиринговый регистр, предназначенный для учета находящихся в доверительном управлении Участника клиринга денежных средств, заблокированных в целях обеспечения исполнения обязательств из договоров в Фондовой секции и договоров в Секции ДВР.

8.3.10. Клиринговые регистры, предназначенные для учета денежных средств, открываются отдельно для учета денежных средств в российских рублях и каждой из иностранных валют.

#### **8.4. Клиринговые регистры учета обязательств по денежным средствам**

8.4.1. Регистр «Обязательства по денежным средствам из собственных договоров Участника клиринга» – клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным средствам Участника клиринга из договоров в Фондовой секции и договоров в Секции ДВР, заключенных за счет Участника клиринга.

8.4.2. Регистр «Обязательства по денежным средствам из договоров, заключенных в интересах клиентов Участника клиринга» – клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным средствам Участника клиринга из договоров в Фондовой секции и договоров в Секции ДВР, заключенных в интересах клиентов Участника клиринга.

8.4.3. Регистр «Обязательства по денежным средствам из договоров, заключенных за счет средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга» – клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным средствам из договоров в Фондовой секции и договоров в Секции ДВР, заключенных за счет средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

8.4.4. Клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по денежным средствам, открываются отдельно для учета обязательств по денежным средствам в российских рублях и каждой из иностранных валют.

#### **8.5. Порядок ведения клиринговых регистров**

8.5.1. Начальные значения клиринговых регистров учета ценных бумаг, описанных в подразделе 8.1 Правил клиринга, устанавливаются на основании информации, полученной от Расчетного депозитария в соответствии с договором Клиринговой организации с Расчетным депозитарием.

8.5.2. Клиринговая организация производит изменение значений клиринговых регистров учета ценных бумаг в соответствии с информацией, вновь полученной от Расчетного депозитария, в течение не более 20 минут после получения информации.

8.5.3. Взаимодействие между Клиринговой организацией и Расчетным депозитарием при изменении остатков ценных бумаг на торговых счетах депо, на разделе «к размещению» / «к выкупу» осуществляется в том же порядке, что и при первоначальном установлении значений клиринговых регистров в Клиринговой системе.

8.5.4. В клиринговые регистры учета обязательств по ценным бумагам, указанные в подразделе 8.2 Правил клиринга, вносятся обязательства и требования по ценным

бумагам, определяемые в соответствии с разделом 5 Правил клиринга. При этом обязательства вносятся в регистры с отрицательным знаком, а требования – с положительным.

8.5.5. Начальные значения клиринговых регистров денежных средств, указанных в п. 8.3.1, п. 8.3.4, п. 8.3.7 Правил клиринга, устанавливаются равными величине денежных средств, находящихся на соответствующих торговых банковских счетах / Клиринговых регистрах КБС, в соответствии с информацией, полученной Клиринговой организацией от Расчетной организации в порядке, установленном договором Клиринговой организации с Расчетной организацией.

8.5.6. Значения клиринговых регистров, предназначенных для учета свободных средств (указанные в п. 8.3.2, п. 8.3.5, п. 8.3.8 Правил клиринга) вычисляются как разница сумм, учтенных на клиринговых регистрах, отражающих текущее состояние торговых счетов (указанных в п. 8.5.5 Правил клиринга), с суммами, учтенными на соответствующих клиринговых регистрах, отражающих заблокированные средства (указанных в п. 8.3.3, п. 8.3.6 и п. 8.3.9 Правил клиринга).

8.5.7. Значения клиринговых регистров, указанных в п. 8.5.5 Правил клиринга, изменяются каждый раз при получении от Расчетной организации информации о состоянии торговых банковских счетов или Клиринговых банковских счетов. После чего пересчитываются значения клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.2, п. 8.3.5, п. 8.3.8 Правил клиринга, в соответствии с правилом, установленным п. 8.5.6 Правил клиринга.

8.5.8. Значения клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.3, п. 8.3.6, п. 8.3.9, Правил клиринга, увеличиваются на сумму Гарантийного обеспечения по вновь заключенным договорам после получения от Биржи реестра договоров. Значения упомянутых в настоящем пункте клиринговых регистров уменьшаются на сумму Гарантийного обеспечения по договорам, обязательства по которым исполнены. После каждого изменения указанных регистров пересчитываются значения клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.2, п. 8.3.5, п. 8.3.8 Правил клиринга, в соответствии с правилом, установленным п. 8.5.6 и п. 8.5.7 Правил клиринга.

8.5.9. В клиринговые регистры учета обязательств по денежным средствам пп. 8.4.1-8.4.3 Правил клиринга вносятся обязательства и требования по денежным средствам, определяемые с учетом сальдо обязательств в соответствии с разделом 5 Правил клиринга. При этом обязательства вносятся в регистры с отрицательным знаком, а требования – с положительным.

8.5.10. На основании Уведомления о взаимосвязи ТКР и счетов Участника клиринга, предоставляемого Участником клиринга в соответствии с подп. 3.3.1.1 Правил клиринга, Клиринговая организация присваивает Участнику клиринга ТКР, однозначно определяющий взаимосвязь торгового счета депо и/или раздела «к размещению» / «к выкупу» и торгового банковского счета / Клирингового регистра КБС, указанных в Уведомлении.

## **8.6. Реестры и иные формы внутреннего учета Клиринговой организации**

8.6.1. «Реестр Участников клиринга». Данный реестр формируется на основании данных, содержащихся в Анкетах Участников клиринга по форме, предусмотренной во внутренних документах Клиринговой организации, и содержит информацию по каждому Участнику клиринга, необходимую для ведения данного реестра.

8.6.2. «Реестр клиентов Участника клиринга». Данный реестр содержит информацию по каждому клиенту Участника клиринга.

8.6.3. «Реестр остатков ценных бумаг» и «Реестр остатков денежных средств». Записи в данные реестры производятся на основании документов, предоставляемых Клиринговой организации Расчетными депозитариями и Расчетными организациями каждый раз после получения соответствующей информации.

8.6.4. «Журнал регистрации договоров об оказании клиринговых услуг». Журнал содержит информацию о номере договора, датах начала и окончания действия договора, коде и наименовании Участника клиринга. Записи в данный реестр вносятся как в день заключения Договора об оказании клиринговых услуг, так и в дату расторжения.

8.6.5. «Реестр обязательств, допущенных к клирингу». Данный реестр содержит информацию о дате, времени и номере реестра договоров, сформированного по итогам торгов Биржи в отношении договоров, клиринг которых осуществляет Клиринговая организация.

8.6.6. «Реестр обязательств, прошедших процедуру контроля обеспечения». Данный реестр содержит информацию обо всех договорах, прошедших процедуру контроля обеспечения. Записи в данный реестр производятся на основании реестров договоров, результатов проверки обеспеченности и получении информации от Расчетной организации и Расчетного депозитария каждый раз после проведения расчетов.

8.6.7. «Реестр обязательств, исключенных из клирингового пула». Данный реестр содержит информацию о договорах, не прошедших процедуру контроля обеспечения по состоянию на конец операционного дня.

8.6.8. «Реестр распоряжений, направленных Расчетной организации» и «Реестр распоряжений, направленных Расчетному депозитарию». Данные реестры содержат информацию о распоряжениях на проведение операций по торговым банковским счетам, направленных в Расчетную организацию, и распоряжениях на проведение операций, направленных в Расчетный депозитарий. Записи в данные реестры производятся каждый раз после отправки распоряжений в Расчетную организацию и Расчетный депозитарий и получения от них информации об исполнении этих распоряжений.

8.6.9. «Журнал учета отправленных отчетов». Записи в данный журнал производятся после завершения расчетов и содержат информацию, содержащуюся в предоставленных Участнику клиринга отчетах.

8.6.10. Все реестры Клиринговая организация ведет в электронном виде.

8.6.11. Клиринговая организация ведет Журнал регистрации входящих документов и Журнал регистрации исходящих документов, в которых фиксируется предоставление Участниками клиринга и отправка для них документов, а также предоставление и отправка документов между Клиринговой организацией и Расчетным депозитарием, Клиринговой организацией и Расчетной организацией.

## **8.7. Торгово-клиринговые регистры**

8.7.1. Участнику клиринга могут быть открыты Торгово-клиринговые регистры следующих типов:

8.7.1.1. для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных за счет Участника клиринга;

8.7.1.2. для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных за счет клиентов Участника клиринга;

8.7.1.3. для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных за счет Обособленного клиента Участника клиринга;

8.7.1.4. для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных Участником клиринга в качестве доверительного управляющего;

8.7.1.5. для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных за счет Участника клиринга – нерезидента, расчеты по которым осуществляются с использованием торговых счетов типа «С»;

8.7.1.6. для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных за счет клиентов Участника клиринга – нерезидентов, расчеты по которым осуществляются с использованием торговых счетов типа «С»;

8.7.1.7. для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных за счет Обособленного клиента – нерезидента Участника клиринга, расчеты по которым осуществляются с использованием торговых счетов типа «С»;

8.7.1.8. для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных при размещении/выкупе ценных бумаг.

8.7.2. Для каждого Торгово-клирингового регистра устанавливается уникальное соответствие такого Торгово-клирингового регистра и торгового банковского счета Участника клиринга или Клирингового регистра КБС:

8.7.2.1. одному Торгово-клиринговому регистру Участника клиринга может соответствовать только один торговый банковский счет Участника клиринга в российских рублях или один Клиринговый регистр КБС в российских рублях. Один торговый банковский счет Участника клиринга в российских рублях может соответствовать только одному Торгово-клиринговому регистру Участника клиринга. Один Клиринговый регистр КБС в российских рублях может соответствовать только одному Торгово-клиринговому регистру Участника клиринга;

8.7.2.2. одному Торгово-клиринговому регистру Участника клиринга может соответствовать только один торговый банковский счет Участника клиринга в отдельной иностранной валюте или один Клиринговый регистр КБС в отдельной иностранной валюте. Один торговый банковский счет Участника клиринга в отдельной иностранной валюте может соответствовать только одному Торгово-клиринговому регистру Участника клиринга. Один Клиринговый регистр КБС в отдельной иностранной валюте может соответствовать только одному Торгово-клиринговому регистру Участника клиринга. Количество торговых банковских счетов или Клиринговых регистров КБС в разных иностранных валютах, соответствующих одному Торгово-клиринговому регистру, не ограничено. Одному Торгово-клиринговому регистру могут одновременно соответствовать торговые банковские счета Участника клиринга и Клиринговые регистры КБС в разных иностранных валютах.

8.7.3. Дополнительно для Торгово-клирингового регистра Участника клиринга может быть установлено соответствие такого Торгово-клирингового регистра и торгового счета депо или раздела «к размещению» / «к выкупу». Один торговый счет депо / раздел «к размещению» / «к выкупу» может соответствовать только одному Торгово-клиринговому регистру Участника клиринга.

8.7.4. Для Торгово-клирингового регистра, предназначенного для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных за счет Участника клиринга – нерезидента, или клиентов Участника клиринга – нерезидентов может быть установлено соответствие только с торговыми счетами типа «С».

8.7.5. Торгово-клиринговые регистры открываются в следующем порядке:

8.7.5.1. Участнику клиринга открывается Торгово-клиринговый регистр для учета гарантийного обеспечения и обязательств при совпадении следующих условий:

- Клиринговая организация получила от Расчетной организации уведомление об открытии нового торгового банковского счета Участника клиринга в российских рублях (в случае открытия торгового банковского счета Участником клиринга в Расчетной организации);
- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Уведомление о взаимосвязи ТКР и счетов Участника клиринга, устанавливающего взаимосвязь между торговым банковским счетом Участника клиринга в российских рублях (в случае открытия торгового банковского счета Участником клиринга в Расчетной организации) или Клиринговым регистром КБС в российских рублях и Торгово-клиринговым регистром.

8.7.5.2. Установление соответствия Торгово-клирингового регистра и торгового счета депо или раздела «к размещению» / «к выкупу» осуществляется при совпадении следующих условий:

- Клиринговая организация получила от Расчетного депозитария уведомление об открытии нового торгового счета депо или раздела «к размещению» / «к выкупу»;
- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Уведомление о взаимосвязи ТКР и счетов Участника клиринга с указанием параметров ранее открытого Торгово-клирингового регистра и торгового счета депо или раздела «к размещению» / «к выкупу» в соответствии с требованиями, установленными п. 8.7.3 Правил клиринга,

или

- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Уведомление о взаимосвязи ТКР и счетов Участника клиринга с обязательным указанием торгового банковского счета / Клирингового регистра КБС в российских рублях, торгового счета депо или раздела «к размещению» / «к выкупу» в соответствии с требованиями, установленными п. 8.7.3 Правил клиринга.

8.7.5.3. Установление соответствия Торгово-клирингового регистра и торговых банковских счетов / Клиринговых регистров КБС в иностранной валюте осуществляется при совпадении следующих условий:

- Клиринговая организация получила от Расчетной организации уведомление об открытии нового торгового банковского счета Участника клиринга в иностранной валюте (в случае открытия торгового банковского счета Участником клиринга в Расчетной организации);
- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Уведомление о взаимосвязи ТКР и счетов Участника клиринга с указанием параметров ранее открытого Торгово-клирингового регистра и торгового банковского счета / Клирингового регистра КБС в иностранной валюте в соответствии с требованиями, установленными подп. 8.7.2.2 Правил клиринга,

или

- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Уведомление о взаимосвязи ТКР и счетов Участника клиринга с обязательным указанием торгового банковского счета / Клирингового регистра КБС в российских рублях и торгового банковского счета / Клирингового регистра КБС в иностранной валюте в соответствии с требованиями, установленными подп. 8.7.2.2 Правил клиринга.

8.7.5.4. Участнику клиринга открывается Торгово-клиринговый регистр для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных за счет Обособленного клиента / клиентов Участника клиринга, в соответствии с указанным в п. 8.7.5.1 – 8.7.5.3 Правил клиринга порядком и при указании в Уведомлении о взаимосвязи ТКР и счетов Участника клиринга торговых счетов / Клиринговых регистров КБС для учета средств Обособленного клиента / клиентов Участника клиринга, а также предоставлении в Клиринговую организацию Поручения на регистрацию клиентов по форме, приведенной в Порядке присвоения регистрационных кодов.

8.7.5.5. Клиринговая организация открывает Торгово-клиринговый регистр и/или устанавливает соответствие между ранее открытым Торгово-клиринговым регистром и торговыми счетами / Клиринговыми регистрами КБС, указанными в Уведомлении о взаимосвязи ТКР и счетов Участника клиринга, не позднее следующего рабочего дня после выполнения условий открытия Торгово-клирингового регистра, предусмотренных подп. 8.7.5.1 – 8.7.5.4 Правил клиринга. Клиринговая организация направляет Участнику клиринга соответствующее уведомление по форме и в порядке, приведенными в Положении о формах и форматах документов в отношении Торгово-клирингового регистра Участника клиринга и в Порядке присвоения регистрационных кодов в отношении Торгово-клирингового регистра клиента Участника клиринга.

8.7.6. Клиринговые регистры учета ценных бумаг, клиринговые регистры учета обязательств по ценным бумагам, клиринговые регистры учета денежных средств и клиринговые регистры учета обязательств по денежным средствам открываются Участнику клиринга в рамках каждого Торгово-клирингового регистра.

8.7.7. Торгово-клиринговые регистры могут быть закрыты Клиринговой организацией при предоставлении Участником клиринга соответствующего заявления по форме, приведенной в Положении о формах и форматах документов в случае отсутствия учтенных на таких регистрах гарантийного обеспечения и обязательств.

## **9. Порядок представления Участникам клиринга отчетов по итогам клиринга**

### **9.1. Формы отчетов**

9.1.1. Клиринговая организация формирует отчетные документы для Участников клиринга, содержащие информацию об итогах проведения клиринга и расчетов, об обязательствах, допущенных к клирингу, об обязательствах, исключенных из Клирингового пула, об обязательствах, определенных по итогам клиринга, об использовании индивидуального клирингового обеспечения, об изменении суммы денежных средств на торговых банковских счетах и Клиринговых регистрах КБС, на которых учитываются денежные средства, право распоряжения которыми предоставлено Клиринговой организации для исполнения или обеспечения исполнения обязательств по итогам клиринга.

9.1.2. Клиринговая организация может формировать различные формы клиринговых отчетов для обязательств, включенных в различные Клиринговые пулы.

9.1.3. Формы отчетных документов, предоставляемых Участникам клиринга, приведены в Положении о формах и форматах документов.

### **9.2. Порядок и сроки предоставления отчетов Участникам клиринга**

9.2.1. Отчеты для Участников клиринга формируются Клиринговой организацией в электронном виде и направляются способом, предусмотренным в Положении о формах и форматах документов во время, установленное в Расписании предоставления клиринговых услуг, утвержденном Клиринговой организацией и раскрываемом на Сайте Клиринговой

организации, но не позднее следующего рабочего дня после дня внесения соответствующей записи по клиринговым регистрам.

9.2.2. Бумажные формы отчетов предоставляются по запросу Участников клиринга уполномоченным представителям Участников клиринга. Запрос на получение бумажных отчетов оформляется по форме, приведенной в Положении о формах и форматах документов.

9.2.3. По соглашению сторон дополнительные формы (форматы) информации (документов и сообщений), а также способы ее передачи, определяются отдельным соглашением (отдельными соглашениями) между Клиринговой организацией и Участником клиринга.

9.2.4. Отчеты Участника клиринга за предыдущие даты предоставляются по письменному запросу не позднее 3 (третьего) рабочего дня с даты получения запроса.

## **10. Меры, направленные на управление рисками при осуществлении клиринга**

### **10.1. Система управления рисками**

10.1.1. Клиринговая организация рассматривает управление рисками при осуществлении клиринговой деятельности как один из важнейших элементов общей системы управления рисками Клиринговой организации. В процессе управления рисками Клиринговая организация регулярно выявляет, оценивает и контролирует угрозы и возможности, адаптирует свою деятельность с целью уменьшения вероятности и потенциальных последствий угроз.

10.1.2. Организационная структура системы управления рисками Клиринговой организации включает в себя:

10.1.2.1. Совет директоров АО СПВБ;

10.1.2.2. Комитет по рискам АО СПВБ при осуществлении клиринговой деятельности;

10.1.2.3. Комитет по рискам и аудиту при Совете директоров АО СПВБ;

10.1.2.4. Комитет по стратегии при Совете директоров АО СПВБ;

10.1.2.5. Председателя Правления АО СПВБ;

10.1.2.6. Правление АО СПВБ;

10.1.2.7. Службу рисков;

10.1.2.8. Службу внутреннего контроля;

10.1.2.9. Службу внутреннего аудита;

10.1.2.10. Руководителей структурных подразделений Клиринговой организации, отвечающих за непосредственное управление рисками и реализацию мероприятий в соответствии с Планом управления рисками.

10.1.3. Основной задачей деятельности Комитета по рискам АО СПВБ при осуществлении клиринговой деятельности является предварительное одобрение документов, указанных в подпункте 9.1 пункта 2 статьи 19 Федерального закона от 07.02.2011 № 7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте».

10.1.4. Функции, порядок формирования Комитета по рискам АО СПВБ при осуществлении клиринговой деятельности, его компетенция, требования к членам комитета, их права и обязанности, порядок принятия решений по вопросам, отнесенным к

его компетенции, определены в документе «Положение о Комитете по рискам АО СПВБ при осуществлении клиринговой деятельности». При этом не менее половины состава комитета должны составлять представители Участников клиринга.

10.1.5. Целью деятельности Комитета по рискам и аудиту при Совете директоров АО СПВБ является содействие эффективному выполнению функций Совета директоров Биржи в части контроля за финансово-хозяйственной деятельностью Биржи и управления рисками Биржи.

10.1.6. Порядок формирования, полномочия Комитета по рискам и аудиту при Совете директоров АО СПВБ, сроки и порядок его созыва, а также порядок проведения заседаний комитета и принятия им решений определены в документе «Положение о Комитете по рискам и аудиту при Совете директоров АО СПВБ».

10.1.7. Клиринговая организация формирует отдельное структурное подразделение, ответственное за организацию системы управления рисками Клиринговой организации, в соответствии с требованиями действующего законодательства Российской Федерации.

## **10.2. Документы АО СПВБ по управлению рисками**

10.2.1. Управление рисками осуществляется в соответствии с «Правилами организации системы управления рисками, связанными с осуществлением деятельности организатора торговли и клиринговой деятельности Акционерным обществом «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»».

10.2.2. Меры, принимаемые в чрезвычайных ситуациях и направленные на обеспечение непрерывности деятельности, определены в документе «План обеспечения непрерывности и восстановления деятельности Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»».

## **10.3. Общие принципы управления рисками**

10.3.1. Система управления рисками обеспечивает основу и организационную структуру для разработки, внедрения, мониторинга, пересмотра и постоянного улучшения риск-менеджмента в масштабе Клиринговой организации.

10.3.2. Политика Клиринговой организации в области управления рисками определяется характером и масштабом операций и исходит из принципа разумной достаточности.

10.3.3. Клиринговая организация разработала комплекс мероприятий, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга, который включает следующие меры (но не ограничивается ими):

10.3.3.1. осуществление клиринговой деятельности самостоятельным обособленным структурным подразделением, в исключительные функции которого входит осуществление клиринговой деятельности;

10.3.3.2. обеспечение обособленного учета обязательств каждого Участника клиринга посредством ведения клиринговых регистров;

10.3.3.3. формирование отчетов по итогам клиринга по договорам клирингового пула и их передача Участникам клиринга;

10.3.3.4. установление первоначальных требований к Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга;

10.3.3.5. исполнение обязательств по договорам только после проверки и удостоверения (подтверждения) наличия на указанных торговых счетах

достаточного количества ценных бумаг и денежных средств, предназначенных для исполнения обязательств по договорам.

10.3.4. Подробный порядок действий и мер Клиринговой организации для снижения рисков устанавливается документами, указанными в подразделе 10.2 Правил клиринга.

#### **10.4. Порядок установления лимитов по допустимому объему договоров**

10.4.1. Клиринговая организация устанавливает для Участников клиринга (кроме Участников клиринга, перечисленных в п. 5 ст. 23 Федерального закона от 07.02.2011 №7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте») лимиты по допустимому объему договоров (далее – лимиты) в отношении каждого Торгово-клирингового регистра Участника клиринга и передает их Бирже перед началом Торговой сессии и при каждом изменении состояния торговых счетов Участников клиринга и/или Клиринговых регистров КБС в ходе Торговой сессии.

10.4.2. Лимиты по договорам с кодом расчетов Т0 устанавливаются как по денежным средствам в отношении каждой валюты, так и по ценным бумагам. Лимит устанавливается равным остатку денежных средств на торговом банковском счете Участника клиринга / Клиринговом регистре КБС в соответствующей валюте или остатку ценных бумаг на соответствующем торговом счете депо / разделе «к размещению» / «к выкупу».

### **11. Определение чрезвычайных ситуаций и порядок взаимодействия с Участниками клиринга в чрезвычайных ситуациях**

11.1. Чрезвычайная ситуация – это обстановка на определенной территории, сложившаяся в результате аварии, опасного природного явления, катастрофы, стихийного или иного бедствия, которые могут повлечь или повлекли за собой человеческие жертвы, ущерб здоровью людей, или окружающей среде, значительные материальные потери и нарушение условий жизнедеятельности людей. Развернутый перечень чрезвычайных ситуаций содержится в документе, указанном в п. 10.2.2 Правил клиринга.

11.2. В случае чрезвычайных ситуаций Клиринговая организация действует в порядке, установленном документом, указанным в п. 10.2.2 Правил клиринга.

11.3. В случае, если в результате чрезвычайной ситуации невозможно передать отчеты Участнику клиринга через установленные каналы связи, отчетность Участнику клиринга может быть отправлена через резервные или иные каналы связи (электронную почту) или выдана в бумажном виде в помещении Клиринговой организации.

11.4. В случае, если в результате чрезвычайной ситуации остановлена деятельность Клиринговой системы – Клиринговая организация информирует о прекращении работы и невозможности исполнения обязательств по итогам клиринга до начала следующей Клиринговой сессии, используя все возможные каналы связи (в том числе Сайт Клиринговой организации, электронную почту, телефон).

11.5. О возобновлении деятельности Клиринговой системы Участники клиринга информируются путем размещения соответствующей информации на Сайте Клиринговой организации.

### **12. Оплата клиринговых услуг**

12.1. Оплата услуг Клиринговой организации, оказываемых в соответствии с Правилами клиринга, осуществляется на основании Тарифов АО СПбБ.

12.2. Участник клиринга оплачивает стоимость услуг по действующим на дату оказания услуги Тарифам АО СПбБ.

12.3. Тарифы, утвержденные Советом директоров АО СПВБ, раскрываются на Сайте Клиринговой организации не позднее чем за 5 (пять) рабочих дней до даты их вступления в силу, если нормативными актами Банка России не установлен более длительный срок.

12.4. Оплата Участником клиринга Клиринговых услуг осуществляется по факту оказания услуг на основании счета, выставяемого Клиринговой организацией.

12.5. Выставленные Клиринговой организацией счета и акты оказанных услуг передаются Участнику клиринга в электронном виде способом, предусмотренным разделом 9 Правил клиринга, или направляются на адрес электронной почты, указанной в Анкете Участника клиринга.

12.6. Условия оплаты по факту оказания услуг:

12.6.1. Клиринговая организация не позднее 5 (пятого) рабочего дня месяца, следующего за расчетным, выставяет Участнику клиринга счет за услуги, оказанные в течение расчетного месяца.

12.6.2. Участник клиринга обязан оплатить выставленный счет, путем перечисления денежных средств в установленном порядке на счет Клиринговой организации в размере суммы платежа, указанной в счете, в течение 10 (десяти) календарных дней с момента направления счета. При этом счет считается полученным Участником клиринга в день направления ему Клиринговой организацией счета в виде электронного документа указанным в подразделе 12.5 Правил клиринга способом.

12.7. В случае, если Участник клиринга не согласен с изменением Тарифов АО СПВБ, он может расторгнуть Договор об оказании клиринговых услуг с Клиринговой организацией в порядке, установленном Правилами клиринга.

12.8. Если на момент вступления в силу новых Тарифов АО СПВБ Клиринговая организация не завершила оказание Клиринговых услуг такому Участнику клиринга – указанные услуги оплачиваются в соответствии с предыдущей редакцией Тарифов АО СПВБ.

12.9. В случае нарушения Участником клиринга условий оплаты счетов за оказанные клиринговые услуги Клиринговая организация имеет право приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию до момента погашения задолженности.

12.10. В случае нарушения Участником клиринга сроков оплаты, установленных Тарифами АО СПВБ, Клиринговая организация вправе взыскать с Участника клиринга пени в размере 0,1% (одна десятая процента) от суммы задолженности за каждый день просрочки, но не более 20% (двадцати процентов) от суммы задолженности.

12.11. Размер и порядок оплаты комиссионного вознаграждения Клиринговой организации для Банка России по операциям размещения ценных бумаг регулируется договором и предусматривает уплату такого вознаграждения на основании счетов, выставяемых Банку России и передаваемых через Личный кабинет участника информационного обмена с Банком России.

### **13. Взаимодействие с Биржей, Расчетной организацией и Расчетным депозитарием**

#### **13.1. Порядок взаимодействия с Биржей**

13.1.1. Порядок взаимодействия Клиринговой организации с Биржей означает обмен данными между отдельными структурными подразделениями АО СПВБ, занимающимися

осуществлением клиринговой деятельности и деятельности по организации торговли, и определяется внутренним регламентом Клиринговой организации.

13.1.2. Перед началом торговой сессии Клиринговая организация передает Бирже лимиты допустимого объема договоров, установленные в соответствии с подразделом 10.4 Правил клиринга. Реквизиты документов установлены внутренним регламентом Клиринговой организации.

13.1.3. Клиринговая организация передает Бирже лимиты допустимого объема договоров всякий раз при их изменении.

13.1.4. Биржа передает Клиринговой организации реестр договоров. Реквизиты реестра договоров устанавливаются внутренним регламентом Клиринговой организации.

13.1.5. Клиринговая организация направляет Бирже информацию об Участниках клиринга и получает от Биржи информацию об Участниках торгов в объеме и порядке, установленном внутренним регламентом Клиринговой организации.

13.1.6. Иные случаи взаимодействия с Биржей установлены в соответствующих разделах Правил клиринга.

### **13.2. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией**

13.2.1. Порядок взаимодействия Клиринговой организации с Расчетной организацией, реквизиты документов, которыми обмениваются Клиринговая организация и Расчетная организация, форматы и способы передачи документов, а также время осуществления операций по проведению расчетов, устанавливаются договором АО СПВБ с Расчетной организацией.

13.2.2. Клиринговая организация передает Расчетной организации Уведомление о регистрации нового Участника клиринга. Указанное Уведомление является условием для открытия торгового банковского счета и проведения операций, согласно распоряжению, направляемому в Расчетную организацию Клиринговой организацией после проведения клиринга.

13.2.3. Расчетная организация информирует Клиринговую организацию об открытии торгового банковского счета в порядке, установленном договором о взаимодействии.

13.2.4. Расчетная организация открывает Клиринговой организации Клиринговый банковский счет после заключения с Клиринговой организацией соответствующего договора. Расчетная организация информирует Клиринговую организацию об открытии Клирингового банковского счета.

13.2.5. Порядок взаимодействия с Расчетными организациями при обмене информацией о состоянии торговых и клиринговых счетов установлен разделом 5 Правил клиринга.

13.2.6. Порядок взаимодействия с Расчетными организациями при совершении операций по торговым и клиринговым счетам установлен подразделами 5.5, 7.2 и 7.4 Правил клиринга.

13.2.7. Порядок взаимодействия с Расчетными организациями при проведении сверки расчетов установлен подразделами 5.6 и 5.7 Правил клиринга.

13.2.8. В случае прекращения Клирингового обслуживания Участника клиринга, расторжения Договора с Участником клиринга Клиринговая организация уведомляет об этом Расчетную организацию. Дополнительно уведомление может быть направлено по электронной почте.

### **13.3. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием**

13.3.1. Порядок взаимодействия Клиринговой организации с Расчетным депозитарием, реквизиты документов, которыми обмениваются Клиринговая организация и Расчетный депозитарий, форматы и способы передачи документов, а также время осуществления операций по проведению расчетов, устанавливаются договором Клиринговой организации с Расчетным депозитарием.

13.3.2. Открытие торгового счета депо производится в соответствии с Условиями осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария с согласия Клиринговой организации. Расчетный депозитарий информирует Клиринговую организацию об открытии торгового счета депо в порядке, установленном для обмена информацией о состоянии торговых счетов.

13.3.3. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием при обмене информацией о состоянии торговых счетов депо, разделов «к размещению» / «к выкупу» на Специальном техническом счете, установлен разделом 5 Правил клиринга.

13.3.4. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием при совершении операций по торговым счетам депо, разделам «к размещению» / «к выкупу» на Специальном техническом счете установлен подразделами 5.5 и 7.3 Правил клиринга.

13.3.5. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием при проведении сверки расчетов установлен подразделами 5.6 и 5.7 Правил клиринга.

13.3.6. В случае прекращения Клирингового обслуживания Участника клиринга, расторжения Договора с Участником клиринга Клиринговая организация уведомляет об этом Расчетный депозитарий в порядке, определенном договором Клиринговой организации с Расчетным депозитарием.

13.3.7. Расчетный депозитарий имеет право закрыть торговые счета депо, открытые с указанием Клиринговой организации в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам, только после получения от Клиринговой организации согласия на закрытие указанных торговых счетов депо. Получение согласия не требуется, если Клиринговая организация уведомила Расчетный депозитарий о расторжении Договора с Участником клиринга, торговые счета которого закрываются.