

УТВЕРЖДЕНЫ
решением Совета директоров
Акционерного общества
«Санкт-Петербургская
Валютная Биржа»
(протокол от 30.08.2023 г. № 396)

**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	11
1.4.	Утверждение, изменение и дополнение Правил клиринга	11
1.5.	Конфиденциальность информации	11
1.6.	Порядок документооборота при осуществлении клиринга	12
2.	Договор об оказании клиринговых услуг	13
2.1.	Предмет Договора	13
2.2.	Заключение и расторжение Договора	13
2.3.	Ответственность Клиринговой организации и Участника клиринга ..	15
2.4.	Порядок разрешения споров между Клиринговой организацией и Участником клиринга	15
3.	Требования к Участникам клиринга	16
3.1.	Категории Участников клиринга	16
3.2.	Требования к кандидатам в Участники клиринга	17
3.3.	Допуск к клиринговому обслуживанию	18
3.4.	Порядок регистрации Участников клиринга и клиентов Участника клиринга.....	19
3.5.	Порядок приостановления, возобновления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию.....	20
4.	Права и обязанности Клиринговой организации и Участников клиринга	22
4.1.	Обязанности Клиринговой организации.....	22
4.2.	Права Клиринговой организации.....	23
4.3.	Обязанности Участника клиринга	23
4.4.	Права Участника клиринга	25
5.	Порядок проведения клиринга	25
5.1.	Порядок и условия допуска обязательств к клирингу.	25
5.2.	Порядок и условия включения обязательств в клиринговый пул (исключения обязательств из клирингового пула)	25
5.3.	Порядок проведения клиринга (кроме клиринга Договоров поставки товара).....	27
5.4.	Процедура контроля обеспечения.....	29
5.5.	Порядок исполнения (прекращения) обязательств по итогам клиринга (кроме обязательств из Договоров поставки товара)	30
5.6.	Порядок проведения сверки результатов расчетов.....	33
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	34
5.9.	Порядок проведения клиринга и исполнения обязательств по Договорам поставки товара.....	36

6. Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу	
39	
6.1. Индивидуальное клиринговое обеспечение	39
7. Виды торговых и клиринговых счетов и порядок совершения операций по ним.....	41
7.1. Виды торговых и клиринговых счетов.....	41
7.2. Порядок проведения операций по торговым банковским счетам.....	43
7.3. Порядок проведения операций по торговым счетам депо и Специальному техническому счету	44
7.4. Порядок проведения операций по клиринговым счетам	45
8. Клиринговые регистры и иные формы внутреннего учета, их назначение, порядок ведения	47
8.1. Клиринговые регистры учета ценных бумаг	47
8.2. Клиринговые регистры учета обязательств по ценным бумагам	48
8.3. Клиринговые регистры учета денежных средств	50
8.4. Клиринговые регистры по учету обязательств по денежным средствам	51
8.5. Порядок ведения клиринговых регистров	52
8.6. Реестры и иные формы внутреннего учета АО СПВБ	55
8.7. Торгово-клиринговые регистры	56
9. Порядок представления Участникам клиринга отчетов по итогам клиринга	60
9.1. Формы отчетов	60
9.2. Порядок и сроки предоставления отчетов Участникам клиринга	61
10. Меры, направленные на управление рисками при осуществлении клиринга	61
10.1. Система управления рисками	61
10.2. Документы АО СПВБ по управлению рисками.....	63
10.3. Общие принципы управления рисками	63
10.4. Порядок установления лимитов по допустимому объему договоров	64
11. Определение чрезвычайных ситуаций и порядок взаимодействия с Участниками клиринга в чрезвычайных ситуациях	64
12. Оплата клиринговых услуг	65
13. Взаимодействие с Биржами, Расчетной организацией и Расчетным депозитарием	66
13.1. Порядок взаимодействия с Биржами	66
13.2. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией	67
13.3. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием.	67

1. Общие положения

1.1. Термины и определения

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

Биржа – АО СПВБ, осуществляющее деятельность организатора торговли, или Акционерное общество «Биржа «Санкт-Петербург» (АО «Биржа «Санкт-Петербург»), заключившее договор о взаимодействии с Клиринговой организацией АО СПВБ.

Биржевой инструмент – тип депозитных договоров, кредитных договоров, договор РЕПО либо иных договоров, заключаемых на Бирже на условиях одной Спецификации. Биржа присваивает каждому Биржевому инструменту уникальный код (тикер).

Биржевой товар (товар) – товар, допущенный АО «Биржа «Санкт - Петербург» к организованным торгам в порядке, установленном Правилами организованных торгов АО «Биржа «Санкт - Петербург».

Внутренние документы Биржи – Правила организованных торгов Биржи, Спецификации Биржевых инструментов, Спецификации Биржевых товаров, а также иные внутренние документы Биржи, регламентирующие деятельность по организации 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», «Операционный регламент клиринговой организации Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» по клирингу договоров поставки товара, заключенных на торгах, проводимых Акционерным обществом «Биржа «Санкт-Петербург», « Порядок присвоения регистрационных кодов АО СПВБ»», 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 Банк России.

Генеральное соглашение (единый договор) – документ, содержащий отдельные условия для заключения более чем одного договора на организованных торгах, проводимых Биржей.

Дата завершения поставки (дата завершения поставки) – дата, определяемая внутренними документами Биржи как последний день периода поставки по Договору поставки товара.

Дата обеспечения (дата обеспечения) – дата, определяемая внутренними документами Биржи, в которую должно быть полностью обеспечено исполнение денежных обязательств Покупателя по Договору поставки товара в порядке, предусмотренном Договором поставки товара и Правилами клиринга.

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

Договор поставки товара – зарегистрированный Биржей договор купли-продажи Биржевого товара, условиями которого предусматривается проведение клиринга Клиринговой организацией в соответствии с Правилами клиринга.

Клиринговая организация – АО СПбБ.

Клиринговый пул (клиринговый пул) – совокупность обязательств, 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), в размере, необходимом для исполнения обязательств по такому договору в полном объеме.

Клиринг с частичным обеспечением (клиринг с частичным обеспечением) – клиринг обязательств из договора, условием заключения которого является наличие Гарантийного обеспечения в пределах лимитов по допустимому объему договоров, определенных Клиринговой организацией в соответствии с настоящими Правилами клиринга.

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

Клиринговая сессия (клиринговая сессия) – период рабочего дня, в течение которого Клиринговой организацией проводится клиринг обязательств.

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.

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 Vn (код расчетов Vn) – 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.

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

Нетто-обязательство (нетто-обязательство) Участника клиринга – обязательство Участника клиринга, определенное в ходе проведения клиринговой сессии в соответствии с настоящими Правилами клиринга.

Нетто-требование (нетто-требование) Участника клиринга – требование Участника клиринга, определенное в ходе проведения клиринговой сессии в соответствии с настоящими Правилами клиринга.

Неустойка по Договору поставки товара (Неустойка) – сумма денежных средств, подлежащая уплате Участником клиринга своему контрагенту в случае неисполнения (ненадлежащего исполнения) им своих обязательств по Договору поставки товара.

Обособленный клиент Участника клиринга (обособленный клиент) – клиент Участника клиринга, для учета обеспечения которого Участником клиринга открыт Отдельный специальный торговый счет.

Обязательства клиента (обязательства клиента) – обязательства Участника клиринга, исполнение которых осуществляется за счет зарегистрированного Клиринговой организацией Обособленного клиента Участника клиринга.

Операционный регламент – внутренний документ Клиринговой организации «Операционный регламент клиринговой организации Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» по клирингу договоров поставки товара, заключенных на торгах, проводимых Акционерным обществом «Биржа «Санкт-Петербург».

Основная клиринговая сессия в Секции МКР – клиринговая сессия, осуществляемая с особенностями, установленными пунктами 5.4.6 и 5.5.17 настоящих Правил клиринга.

Отдельный специальный торговый счет – специальный торговый банковский счет Участника клиринга, открытый им в Расчетной организации, предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения, которое будет использоваться только для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу и возникших из договоров, заключенных за счет такого клиента.

Отдельный специальный торговый счет депо – торговый счет депо в Расчетном депозитарии для учета индивидуального клирингового обеспечения Участника клиринга, выступающего попечителем этого счета, которое будет использоваться только для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу и возникших из договоров, заключенных за счет такого клиента.

Сайт Биржи (Сайт Клиринговой организации) – официальный сайт АО СПВБ в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» по адресу <https://www.spvb.ru>, или (применительно только к Сайту Биржи) официальный сайт АО «Биржа «Санкт-Петербург» в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» по адресу <http://www.spbex.ru>.

Покупатель – Участник клиринга, являющийся стороной договора купли-продажи ценных бумаг или стороной Договора поставки товара, имеющий требования по поставке ценных бумаг или Биржевого товара.

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

Поручение (поручение) – документ, содержащий инструкции Расчетному депозитарию и служащий основанием для выполнения депозитарной операции или группы связанных депозитарных операций.

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

Продавец (Поставщик) – Участник клиринга, являющийся стороной договора купли-продажи ценных бумаг или стороной Договора поставки товара и имеющий обязательства по поставке ценных бумаг или Биржевого товара.

Промежуточная клиринговая сессия в Секции МКР – клиринговая сессия, осуществляемая с особенностями, установленными пунктом 5.4.5 настоящих Правил клиринга.

Раздел «к размещению/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.

Режим использования разделов «к размещению»/ «к выкупу» определен п. 5.5.11 настоящих Правил клиринга.

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 Биржей. Наименование Расчетной организации указывается в Спецификации Биржевого инструмента, а также раскрывается на Сайте Биржи.

Расчетный депозитарий – депозитарий, имеющий лицензию Банка России на право осуществления депозитарной деятельности, осуществляющий операции, связанные с исполнением обязательств по передаче ценных бумаг по итогам клиринга обязательств из договоров, заключенных на Бирже. Наименование Расчетного депозитария указывается в Спецификации Биржевого инструмента, а также раскрывается на Сайте Биржи в соответствии с действующим законодательством.

Свободные денежные средства – денежные средства, учтенные на клиринговых регистрах, за вычетом суммы денежных средств в размере обеспечения, необходимого для исполнения обязательств из договоров, допущенных к клирингу.

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

Секция межбанковского кредитного рынка (Секция МКР) – торговая (биржевая) секция АО СПВБ, в которой проводятся организованные торги по привлечению / размещению денежных средств в соответствии с Правилами проведения организованных торгов в Секции межбанковского кредитного рынка Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

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

Спецификация Биржевого инструмента (Спецификация) – внутренний документ Биржи, содержащий стандартные условия (параметры) заключения договоров, в том числе депозитных договоров, кредитных договоров, договоров РЕПО или иных договоров, заключаемых на организованных торгах. Группа однотипных Биржевых инструментов может быть описана одной Спецификацией.

Спецификация Биржевого товара (Спецификация) – документ АО «Биржа «Санкт - Петербург», определяющий условия Договора поставки товара или порядок их определения.

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 СВПБ. В зависимости от типа ТКР, в рамках каждого ТКР открываются клиринговые регистры в соответствии с разделом 8 Правил клиринга. Для учета информации о Гарантийном обеспечении Участника клиринга и/или обязательств из договоров, заключенных на торгах АО «Биржа «Санкт-Петербург» Торгово-клиринговые регистры не используются.

Транзитный счет – Клиринговый банковский счет Клиринговой организации, открытый в Расчетной организации, на котором учитываются денежные средства, которые используются для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу в ходе 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 настоящих Правилах клиринга, используются в значениях, установленных Правилами организованных торгов Биржи, 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 настоящими 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 настоящими 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 МКР;
- 1.2.3.3. кредитных договоров, заключенных в Секции МКР;
- 1.2.3.4. договоров поставки товара, заключенных на организованных торгах АО «Биржа «Санкт - Петербург».

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 совершенным 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 совершенным 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 и организует расчеты по кредитным договорам в отношении каждого заключенного от имени Участника клиринга кредитного договора. Клиринговая организация осуществляет определение обязательств каждого из Участников клиринга и организует расчеты по договорам поставки товара в отношении каждого заключенного от имени Участника клиринга договора поставки товара.

1.2.7. Клиринговая организация осуществляет в отношении договоров с кодом расчетов «Т0» клиринг с полным обеспечением.

1.2.8. Клиринговая организация осуществляет в отношении договоров с кодом расчетов «Вп» клиринг без предварительного обеспечения.

1.2.9. Клиринговая организация допускает к клирингу Договоры поставки товара в пределах определенных АО СПВБ лимитов допустимых объемов договоров. По Договорам поставки товара Клиринговая организация осуществляет клиринг с частичным обеспечением.

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 о раскрытии информации.

1.3.2. Участники клиринга не менее чем за 1 (один) месяц уведомляются о предполагаемых изменениях в списке Расчетных организаций и Расчетных депозитариев путем размещения информации об этом событии на Сайте Клиринговой организации.

1.4. Утверждение, изменение и дополнение Правил клиринга

1.4.1. Настоящие Правила клиринга разработаны в соответствии с законодательством Российской Федерации, требованиями нормативных актов Банка России и Уставом АО СПВБ.

1.4.2. Настоящие 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 настоящие Правила клиринга вносятся Клиринговой организацией в одностороннем порядке, за исключением внесения изменений в настоящие Правила клиринга, затрагивающие проведение расчетов по операциям размещения облигаций федерального займа и/или облигаций Банка России. В последнем случае планируемые изменения в настоящие Правила клиринга подлежат предварительному согласованию с Участником клиринга категории «Ц».

1.4.4. Настоящие Правила клиринга и изменения к настоящим 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 настоящих Правилах клиринга и изменениях к ним путем их размещения на Сайте Клиринговой организации после регистрации Банком России.

1.5. Конфиденциальность информации

1.5.1. Клиринговая организация и Участник клиринга обязуются рассматривать содержание Договора об оказании клиринговых услуг, условия заключенных договоров, как конфиденциальную информацию и не будут раскрывать ее третьим лицам, за исключением аудиторов Участника клиринга и Клиринговой организации, уполномоченных государственных органов, а также случаев раскрытия информации в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации, если иное специально не согласовано Участником клиринга и Клиринговой организацией.

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

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

1.5.3.1. информации, составляющей коммерческую, банковскую и иную охраняемую законом тайну;

1.5.3.2. информации об обязательствах, в отношении которых проводится клиринг;

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

1.5.3.4. информации о финансовом состоянии Участника клиринга;

1.5.3.5. содержания документов, полученных от Участника клиринга, согласно требованиям п.3.2 настоящих Правил клиринга.

1.5.4. Клиринговая организация не имеет права передавать указанную выше информацию третьим лицам без письменного согласия Участника клиринга за исключением случаев, предусмотренных законодательством Российской Федерации и/или требованиями нормативных актов Банка России.

1.5.5. Участники клиринга подтверждают, что все персональные данные, передаваемые Участником клиринга/юридическим лицом и Клиринговой организацией друг другу в соответствии с настоящими 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.

1.6. Порядок документооборота при осуществлении клиринга

1.6.1. Форматы и способы обмена электронными документами Участников клиринга с Клиринговой организацией установлены Положением о формах и форматах документов Клиринговой организации, а для Участников клиринга, являющихся Участниками торгов АО «Биржа «Санкт-Петербург» - также Операционным регламентом.

2. Договор об оказании клиринговых услуг

2.1. Предмет Договора

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 настоящими Правилами клиринга.

2.2. Заключение и расторжение Договора

2.2.1. В целях присоединения к условиям Договора об оказании клиринговых услуг, определенным настоящими Правилами клиринга, кандидат в Участники клиринга подает в Клиринговую организацию заявление (оферту) по форме, приведенной в Положении о формах и форматах документов Клиринговой организации, а также выполняет иные требования, изложенные в разделе 3.2 настоящих 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.

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 принятии на клиринговое обслуживание кандидата в Участники клиринга и заключении с ним 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, приведенной в Положении о формах и форматах документов Клиринговой организации. 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 (расторгнуть Договор 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 (расторгнуть Договор об оказании клиринговых услуг) в случае нарушения им требований, предъявляемых Правилами клиринга к Участникам клиринга в порядке, установленном пунктом 2.2.10 настоящих Правил клиринга. При этом возмещение убытков, связанных с таким отказом, Клиринговой организацией Участнику клиринга не осуществляется.

2.2.10. В случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию в порядке, предусмотренном разделом 3.5 настоящих Правил клиринга, Клиринговая организация расторгает Договор об оказании клиринговых услуг в одностороннем порядке, 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 по основаниям, указанным в настоящем пункте, 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 электронного уведомления.

2.2.12. В случае прекращения Договора об оказании клиринговых услуг Участнику клиринга возвращаются имущество, являющееся индивидуальным клиринговым обеспечением. 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. Обязательство Клиринговой организации по возврату денежных средств считается исполненным с момента формирования и передачи в Расчетную организацию Распоряжения Клиринговой организации на возврат денежных средств Участнику клиринга с использованием банковских реквизитов, указанных в Анкете данного Участника клиринга, предоставляемой в соответствии с разделом 3.2.3.2. настоящих 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 настоящими Правилами клиринга.

2.3.2. Клиринговая организация в договорах с Расчетными депозитариями и Расчетными организациями предусматривает ответственность за:

2.3.2.1. неисполнение Расчетной организацией и/или Расчетным депозитарием распоряжений Клиринговой организации на проведение операций по торговым банковским счетам, клиринговым банковским счетам и/или по торговым счетам депо и Специальному техническому счету, произошедшее по их вине;

2.3.2.2. последствия действий или бездействия Расчетной организации и/или Расчетного депозитария после получения ими согласия на совершение операции по торговым банковским счетам и по торговым счетам депо, соответственно, в случае наличия их вины;

2.3.2.3. последствия неисполнения Расчетной организацией и/или Расчетным депозитарием по их вине своих обязательств по обеспечению правильности, своевременности и достоверности информации, передаваемой в Клиринговую организацию.

2.3.3. Клиринговая организация не несет ответственности:

2.3.3.1. по обязательствам Участника клиринга перед третьими лицами;

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

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

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 в письменном виде и должна быть подписана уполномоченным представителем стороны. Претензия должна содержать:

- 2.4.3.1. изложение требований заявителя;
- 2.4.3.2. указание суммы претензии и ее расчет (если претензия подлежит денежной оценке);
- 2.4.3.3. изложение обстоятельств, на которых основываются требования заявителя;
- 2.4.3.4. доказательства, подтверждающие их, со ссылкой на соответствующие нормы материального права;
- 2.4.3.5. перечень прилагаемых к претензии документов и других доказательств;
- 2.4.3.6. 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 настоящих Правил клиринга.

2.4.5. Сторона, получившая претензию, обязана рассмотреть ее в срок, не превышающий 10 (десять) рабочих дней с даты получения претензии, и предоставить отправителю претензии мотивированный отказ либо согласие на удовлетворение претензионных требований.

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

3. Требования к Участникам клиринга

3.1. Категории Участников клиринга

3.1.1. Клиринговая организация в соответствии с настоящими 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 МКР;
- 3.1.1.4. категории «Т», «К» присваиваются в целях осуществления клиринга обязательств из Договоров поставки товара, заключаемых на торгах АО «Биржа «Санкт-Петербург».

3.1.2. Участнику клиринга может быть присвоена категория «Ф», если он является профессиональным участником рынка ценных бумаг и предварительно допущен / допущен к торгам в Фондовой секции.

3.1.3. Участнику клиринга может быть присвоена категория «Б», если он является кредитной организацией, созданной в соответствии с законодательством Российской Федерации, и предварительно допущен / допущен к торгам в Секции МКР.

3.1.4. Участнику клиринга может быть присвоена категория «И», если он предварительно допущен / допущен к торгам в Секции МКР с категорией «Инициатор торгов» в соответствии с Внутренними документами Биржи. Участники клиринга категории «И» используют для исполнения обязательств 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 МКР с категорией «Инициатор торгов» в соответствии с Внутренними документами Биржи. Участники клиринга категории «В» используют для исполнения обязательств Клиринговый банковский счет АО СПВБ.

3.1.6. Участнику клиринга может быть присвоена категория «Т», если он является Участником торгов на товарном рынке в соответствии с Внутренними документами Биржи.

3.1.7. Участник клиринга может быть присвоена категория «К», если он является участником торгов на товарном рынке и является Контролером поставки по Биржевому товару в соответствии с Внутренними документами Биржи. Требования, права и обязанности Участников клиринга категории «К», указанные в Правилах клиринга в отношении таких Участников клиринга, в том числе требования по обеспечению исполнения обязательств, допущенных к клирингу, отличаются от требований к Участникам клиринга категории «Т» только в случаях клирингового обслуживания по Договорам поставки товара, по которым Участник клиринга категории «К» выполняет функции Контролера поставки в соответствии с Внутренними документами Биржи.

3.1.8. 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. Участником клиринга могут стать индивидуальные предприниматели и юридические лица, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации, в том числе кредитная организация, Банк России, государственная корпорация, банк-нерезидент или международная организация.

3.2.2. Кандидат в Участники клиринга должен быть предварительно допущен к торгам АО СПВБ (кандидат в Участники клиринга с категориями «Ф», «Б», «И», «В») или являться Участником торгов АО «Биржа «Санкт-Петербург» (Кандидат в Участники клиринга с категориями «Т», «К»).

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 настоящими Правилами клиринга, путем подписания Заявления по форме, предусмотренной Положением о формах и форматах документов Клиринговой организации;

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

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 Расчетной организации, либо использовать Клиринговый банковский счет АО СПВБ;
- открыть торговые счета депо в Расчетном депозитарии;
- предоставить Клиринговой организации Уведомление о взаимосвязи торгового счета депо и торгового банковского счета Участника клиринга / клирингового регистра, предназначенного для учета средств, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ по форме, предусмотренной Положением о формах и форматах документов Клиринговой организации. При этом Участником клиринга должна быть установлена взаимосвязь между торговым банковским счетом / клиринговым регистром, предназначенным для учета средств, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ и торговым счетом депо, предназначенными для учета собственных средств Участника клиринга, либо между торговым банковским счетом и торговым счетом депо, предназначенными для учета клиентских средств Участника клиринга.

3.3.1.2. Для получения категорий «И» – открыть торговый банковский счет в Расчетной организации.

3.3.1.3. Для получения категории «К» – внести на Клиринговый банковский счет АО СПВБ Гарантийное обеспечение в размере 1 000 000 (одного миллиона) рублей Российской Федерации.

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, приведенной в Положении о формах и форматах документов Клиринговой организации.

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 АО СПВБ.

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, приведенной в Порядке присвоения регистрационных кодов АО СПВБ.

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, приведенной в Порядке присвоения регистрационных кодов АО СПВБ. Клиринговая организация вправе использовать сокращенный код, позволяющий идентифицировать Участника клиринга, не содержащий всех необходимых элементов регистрационного кода (код Участника клиринга).

3.4.5. Для регистрации Обособленного клиента Участника клиринга, Участник клиринга должен указать в Поручении на регистрацию клиентов номер Отдельного специального торгового счета и Отдельного специального торгового счета депо, открытых для учета индивидуального клирингового обеспечения и/или исполнения обязательств этого клиента

3.4.6. В случае необходимости отдельного учета индивидуального клирингового обеспечения клиента Участника клиринга, планирующего размещение ценных бумаг такого клиента, Участник клиринга может открыть отдельный торговый банковский счет для совершения операций с денежными средствами такого клиента, для учета размещаемых ценных бумаг такого клиента используется Раздел «к размещению».

3.4.7. В случае необходимости отдельного учета обеспечения клиента Участника клиринга категории «Т» Клиринговая организация по заявлению Участника клиринга открывает регистр внутреннего учета денежных средств на Клиринговом банковском счете АО СПВБ для учета обеспечения, которое будет использоваться для исполнения обязательств Участника клиринга, действующего в интересах такого клиента. Заявление Участника клиринга категории «Т» на

регистрацию обособленного клиента и Анкета такого клиента оформляются по форме, приведенной в Порядке присвоения регистрационных кодов АО СПбБ.

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

3.5.1. Клиринговая организация вправе приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в отношении всех обязательств, допускаемых к клирингу, или приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию с определенной категорией.

3.5.2. Клиринговая организация приостанавливает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по следующим основаниям:

3.5.2.1. если в отношении Участника клиринга, имеющего категорию «Ф», приостановлено действие лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской или дилерской деятельности, или деятельности по управлению ценными бумагами;

3.5.2.2. если у Участника клиринга, имеющего категорию «Ф», закрыты все торговые счета депо;

3.5.2.3. применение Банком России в отношении Участника клиринга санкций (в том числе запрет на совершение определенных операций), делающих невозможным заключение договоров, обязательства из которых допускаются к клирингу;

3.5.2.4. введение в отношении Участника клиринга процедуры наблюдения;

3.5.2.5. 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;

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

3.5.2.7. неоднократное и систематическое неисполнение Участником клиринга обязательств по Договорам поставки товара. При этом неоднократность или систематическое нарушение определяются в соответствии с Внутренними документами Биржи;

3.5.2.8. неуплата Участником клиринга категории «К» Неустойки по Договору поставки товара в соответствии с требованием Клиринговой организации в соответствии с настоящими Правилами клиринга;

3.5.2.9. неоднократная и систематическая неоплата Участником клиринга услуг Клиринговой организации в порядке и сроки, установленные Тарифами АО СПВБ;

3.5.2.10. неоднократное непредоставление Анкеты в целях проведения Клиринговой организацией процедуры идентификации в соответствии с п. 4.3.1.4 настоящих Правил клиринга.

3.5.3. Допуск к клиринговому обслуживанию приостанавливается с момента получения Клиринговой организацией информации о наличии оснований для приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию. Обязательства Участника клиринга по договорам, заключенным после получения указанной информации, к клирингу не допускаются, допуск обязательств возобновляется после возобновления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию.

3.5.4. 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, приведенной в Положении о формах и форматах документов Клиринговой организации.

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

3.5.6. 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, приведенной в Положении о формах и форматах документов Клиринговой организации.

3.5.7. Клиринговая организация вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в отношении всех обязательств, допускаемых к клирингу, или прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию с определенной категорией.

3.5.8. Клиринговая организация прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по следующим основаниям:

3.5.8.1. прекращение Договора об оказании клиринговых услуг, в том числе в связи с ликвидацией Участника клиринга как юридического лица, или как индивидуального предпринимателя;

3.5.8.2. введение в отношении Участника клиринга любой из процедур банкротства (за исключением процедуры наблюдения), при этом Клиринговая организация осуществляет все действия, установленные подразделом 5.8 настоящих Правил клиринга;

3.5.8.3. отзыв у Участника клиринга категории «Ф» лицензий профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской, дилерской деятельности или деятельности по управлению ценными бумагами;

3.5.8.4. отзыв у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций;

3.5.8.5. получение от Биржи информации о прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах;

3.5.8.6. отзыв лицензий профессионального участника рынка ценных бумаг у Участника клиринга, имеющего одновременно категории «Б» и «Ф», при этом Клиринговая организация прекращает допуск к клиринговому обслуживанию только в отношении обязательств из договоров с ценными бумагами.

3.5.9. Клиринговая организация вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию с определенной категорией, в случае получения информации о прекращении его допуска к торгам в одной или нескольких Секциях АО СПбБ.

3.5.10. Допуск к клиринговому обслуживанию прекращается с момента получения Клиринговой организацией информации о наличии оснований для прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию. Обязательства Участника клиринга по договорам, заключенным после получения указанной информации, к клирингу не допускаются.

3.5.11. 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, приведенной в Положении о формах и форматах документов Клиринговой организации.

3.5.12. При отсутствии у Участника клиринга категории «К» на момент начала торговой сессии Гарантийного обеспечения в размере 1 000 000 (одного миллиона) рублей Российской Федерации Клиринговая организация прекращает допуск такого Участника к клиринговому обслуживанию с категорией «К» и осуществляет клиринговое обслуживание такого Участника клиринга с категорией «Т».

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 настоящих Правил клиринга, законодательства Российской Федерации и требованиями нормативных актов Банка России.

4.1.1.2. Уведомлять Участников клиринга об изменениях и дополнениях, внесенных в настоящие 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 настоящими 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 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 для каждого Участника клиринга, в том числе в отношении обязательств из договоров, заключенных в интересах каждого зарегистрированного в порядке согласно п.3.4. настоящих Правил клиринга клиента и их передачу Участникам клиринга в сроки, установленные разделом 9 настоящих 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 и клиринговых счетах 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 настоящие Правила клиринга, с учетом ограничений, установленных п.1.4.3. настоящих Правил клиринга.

4.2.1.2. Приостановить, возобновить или прекратить доступ Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, в порядке, определенном п.3.5. настоящих Правил клиринга.

4.2.1.3. Отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг в порядке, определенном п.2.2.9 настоящих Правил клиринга.

4.2.1.4. Расторгнуть Договор об оказании клиринговых услуг в порядке, установленном п. 2.2.10 настоящих Правил клиринга, в случае неисполнения Участником клиринга своих обязанностей.

4.3. Обязанности Участника клиринга

4.3.1. Участник клиринга обязан:

4.3.1.1. Выполнять требования настоящих 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 5 (пяти) 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 до 01.07 представлять Клиринговой организации Анкету Участника клиринга. Указанное требование не распространяется на Банк России, Федеральное казначейство, Фонд пенсионного и социального страхования Российской Федерации, федеральные органы исполнительной власти, исполнительные органы государственной власти субъектов Российской Федерации.

4.3.1.5. Участник клиринга, имеющий обязательства по денежным средствам с текущей датой исполнения, должен обеспечить наличие денежных средств на торговом банковском счете в Расчетной организации или на Клиринговом банковском счете АО СПВБ в размере, необходимом для обеспечения 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 обеспечения исполнения его обязательств по ценным бумагам на соответствующем торговом счете депо и/или на счете депо номинального держателя Расчетного депозитария для зачисления на раздел «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.

4.4. Права Участника клиринга

4.4.1. Участник клиринга имеет право:

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

4.4.1.2. Расторгнуть Договор об оказании клиринговых услуг в порядке, установленном разделом 2.2 настоящих 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 Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

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 надлежащим 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.

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 Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

5.2.3. Клиринговая организация формирует следующие клиринговые пулы:

5.2.3.1. неисполненные обязательства из депозитных договоров с кодом расчетов Т0 с текущей датой исполнения первой части договора (размещение денежных средств);

- 5.2.3.2. неисполненные обязательства из депозитных договоров с кодом расчетов Вп с текущей датой исполнения первой части договора (размещение денежных средств);
- 5.2.3.3. неисполненные обязательства из депозитных договоров с кодом расчетов Вп с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств);
- 5.2.3.4. неисполненные обязательства из кредитных договоров с кодом расчетов Т0 с текущей датой исполнения первой части договора (привлечение денежных средств);
- 5.2.3.5. неисполненные обязательства из кредитных договоров с кодом расчетов Вп с текущей датой исполнения первой части договора (привлечение денежных средств);
- 5.2.3.6. неисполненные обязательства из кредитных договоров с кодом расчетов Вп с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств);
- 5.2.3.7. неисполненные обязательства из договоров купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Т0;
- 5.2.3.8. неисполненные обязательства из договоров купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Вп с текущей датой исполнения;
- 5.2.3.9. неисполненные обязательства из договоров поставки товара с текущей датой исполнения.

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

5.2.5. Клиринговая организация исключает из Клирингового пула 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 МКР, не установлено иное, обязательства по уплате процентов за использование денежных средств по депозитным договорам или по кредитным договорам Клиринговой организацией не определяются и в Клиринговые пулы не включаются.

5.2.8. Срок исполнения / частичного исполнения обязательств из депозитных договоров, заключенных на условиях «до востребования», устанавливается Клиринговой организацией на основании уведомления Участника клиринга с категорией «И» или «В» по форме, приведенной в Положении о формах и форматах Клиринговой организации.

5.3. Порядок проведения клиринга (кроме клиринга Договоров поставки товара).

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. исполнение обязательств (организация расчетов);
- 5.3.2.9. прекращение обязательств.

5.3.3. Обязательства (Требования) Участника клиринга рассчитываются в отношении каждого торгово-клирингового регистра Участника. 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 определяется в валюте расчетов, установленной внутренними документами Биржи для соответствующего Биржевого инструмента / ценной бумаги / Биржевого товара.

5.3.5. Обязательства по ценным бумагам определяются в разрезе каждого выпуска ценных бумаг.

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. Если Участник клиринга выступает Продавцом (Покупателем) ценных бумаг, то у него появляется обязательство (требование) по ценным бумагам соответственно.

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

5.3.7.1. Для акций

$$O = K * N * P, \text{ где}$$

O - обязательство (требование);

К - количество ценных бумаг в договоре;

N - номинал ценной бумаги;

P - цена одной ценной бумаги.

5.3.7.2. Для облигаций

$O = K * (N * P + ACI)$, где

O - обязательство (требование);

K - количество ценных бумаг в договоре;

N - номинал ценной бумаги;

P - цена одной ценной бумаги;

ACI – накопленный купонный доход.

Если Участник клиринга выступает Покупателем (Продавцом) ценных бумаг, то у него появляется обязательство (требование) по денежным средствам, соответственно.

5.3.8. Для кредитных договоров и депозитных договоров, обязательство (требование) по денежным средствам в день исполнения обязательств по предоставлению 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 кредитов (размещенных депозитов). Если Участник клиринга возвращает ранее привлеченные в кредит или депозит денежные средства, то у него возникает обязательство по денежным средствам; если Участнику клиринга причитаются возвращаемые денежные средства, размещенные ранее на депозитах или выданные в кредит, то у него возникает требование по денежным средствам.

5.3.10. Если документами, устанавливающими порядок расчетов по договорам с отдельными Биржевыми инструментами в Секции МКР, 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 Клиринговой организации.

5.3.11. 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 настоящих Правил клиринга, со значениями Клиринговых регистров, перечисленных в подразделе 8.1 настоящих Правил клиринга и содержащих информацию о значениях остатков на торговых счетах депо Участников клиринга, на разделе «к размещению»/«к выкупу» после получения данных 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 (кроме договоров поставки Биржевых товаров) путем сравнения значений Клиринговых регистров, перечисленных в подразделе 8.4 настоящих Правил клиринга, со значениями Клиринговых регистров, перечисленных в пп. 8.3.2, 8.3.5 настоящих Правил клиринга и содержащих информацию о сумме денежных средств, свободных от Обязательств, на торговых банковских счетах Участников клиринга или регистрах внутреннего учета средств Участников клиринга на Клиринговых счетах АО СПВБ. Вычисление значений регистров, указанных в пп. 8.3.2, 8.3.5 настоящих Правил клиринга, производится на основании значений регистров, указанных в пп. 8.3.1., 8.3.3, 8.3.4, 8.3.6 настоящих 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 МКР Клиринговая организация проверяет обеспеченность обязательств из депозитных

договоров с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств) денежными средствами путем сравнения обязательств из каждого депозитного договора со значениями Клиринговых регистров, перечисленных в п. 8.3.3 настоящих 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 Клиринговой организации.

5.4.6. В ходе Основной клиринговой сессии в Секции МКР Клиринговая организация вначале проверяет обеспеченность обязательств из депозитных договоров с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств) денежными средствами путем сравнения обязательств из каждого депозитного договора со значениями Клиринговых регистров, перечисленных в п. 8.3.3 настоящих 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 пунктом 5.4.4 настоящих Правил клиринга.

5.4.7. В том случае, когда модули отрицательных значений обязательств Участников клиринга по денежным средствам не превышают значения Клиринговых регистров, содержащих информацию о свободных денежных средствах на торговых банковских счетах Участников клиринга, все договоры Участника клиринга считаются обеспеченными денежными средствами.

5.4.8. Для договора поставки товара Клиринговая организация проверяет обеспеченность договора денежными средствами путем сравнения раздела регистра, указанного в п. 8.3.9 настоящих Правил клиринга (для собственных договоров Участника клиринга) или в п.8.3.10 настоящих Правил клиринга (для договоров, заключенных за счет клиентов Участника клиринга), для обеспечения конкретного Договора поставки товара с разделом регистра учета обязательств по указанному конкретному Договору поставки товара. Договор считается обеспеченным, когда сумма на разделе для учета обеспечения по Договору поставки товара равна обязательству (или больше обязательства) по этому Договору поставки товара.

5.5. Порядок исполнения (прекращения) обязательств по итогам клиринга (кроме обязательств из Договоров поставки товара)

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 настоящих 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 Участников клиринга, 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 счетам АО СПВБ.

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, 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 счета АО СПВБ в размере отрицательного сальдо их обязательств на Транзитный счет АО СПВБ.

5.5.7. При проведении расчетов по итогам клиринга Расчетная организация проводит зачисление денежных средств на торговые банковские счета Участников клиринга / Клиринговый банковский счет АО СПВБ в размере положительного сальдо их обязательств с Транзитного счета АО СПВБ (за исключением Участников клиринга категории «В»).

5.5.8. При проведении расчетов по депозитным договорам Клиринговая организация во внутреннем учете по Клиринговым регистрам для учета денежных средств на Клиринговом банковском счете АО СПВБ проводит списание денежных средств Участников клиринга категории «В» в размере их обязательств и зачисление в размере их требований.

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

5.5.10. Расчетный депозитарий осуществляет переводы по торговым счетам депо Участников клиринга в корреспонденции со Специальным техническим счетом, не предназначенным для учета прав на ценные бумаги. Указанный Специальный технический счет используется Расчетным депозитарием для обеспечения процедуры поставки ценных бумаг в соответствии с Распоряжением

Клиринговой организации, содержащим обязательства Участников клиринга. 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 в соответствии с законодательством Российской Федерации, договором между Клиринговой организацией и Расчетным депозитарием и иными внутренними документами Клиринговой организации.

5.5.11. В течение одного дня возможно проведение нескольких размещений ценных бумаг. При проведении размещения ценных бумаг Расчетный депозитарий на основании Поручения Клиринговой организации на зачисление размещаемых ценных бумаг и получения необходимых отчетов от вышестоящего депозитария зачисляет размещаемые ценные бумаги на раздел «к размещению». Далее Расчетный депозитарий на основании Распоряжения на проведение операций по разделу «к размещению» осуществляет списание ценных бумаг в размере сальдо обязательств с раздела «к размещению» и их зачисление на торговые счета депо Участников клиринга, имеющих положительное сальдо-требований по ценным бумагам по договорам с кодом расчетов «Вп» 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 Поручения Клиринговой организации на списание неразмещенных ценных бумаг с раздела «к размещению», подает в вышестоящий депозитарий Поручение на списание неразмещенных ценных бумаг со своего счета депо номинального держателя на эмиссионный счет эмитента. Эмитент подает встречное Поручение на зачисление неразмещенных ценных бумаг на свой эмиссионный счет. После исполнения вышестоящим депозитарием операции по зачислению ценных бумаг на эмиссионный счет эмитента Расчетный депозитарий передает Клиринговой организации Отчет об исполнении поручения на списание неразмещенных ценных бумаг с раздела «к размещению». Не допускается наличие остатка ценных бумаг на разделе «к размещению» после проведения всех операций.

5.5.12. При проведении выкупа ценных бумаг эмитентом Расчетный депозитарий, на основании Распоряжения Клиринговой организации, осуществляет списание ценных бумаг в размере отрицательного сальдо-обязательств с торговых счетов депо Участников клиринга и их зачисление на Раздел «к выкупу», по договорам с кодом расчетов «Вп» в день исполнения обязательств по выкупу ценных бумаг. После исполнения вышеуказанного Распоряжения Расчетный депозитарий, на основании Поручения Клиринговой организации на списание выкупленных ценных бумаг с раздела «к выкупу» подает Поручение в вышестоящий депозитарий на списание выкупленного количества ценных бумаг со своего счета депо номинального держателя на казначейский счет эмитента. Эмитент подает встречное Поручение на зачисление выкупленных ценных бумаг на свой казначейский счет. После исполнения вышестоящим депозитарием операции списания Расчетный депозитарий передает Клиринговой организации Отчет об исполнении

Поручения на списание выкупленных ценных бумаг с раздела «к выкупу». После проведения всех операций остаток 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 Участников клиринга, на разделах «к размещению»/ «к выкупу», сформированную по итогам обработки Распоряжений, указанных в п.5.5.4 настоящих Правил клиринга, в виде Отчета об остатках на торговых счетах Участников клиринга, 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 Генеральным соглашением 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. В этом случае Обязательства по указанному договору могут быть прекращены путем расторжения договора, заключенного на условиях Генерального соглашения. 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. По окончании проведения расчетов все исполненные обязательства прекращаются в Клиринговом пуле.

5.5.16. В ходе Основной клиринговой сессии в Секции МКР обязательства, не прошедшие контроль обеспечения в соответствии с разделом 5.4 настоящих 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 Отчета об остатках ценных бумаг на торговых счетах депо, на разделах «к размещению»/ «к выкупу» и Отчета об остатках денежных средств на торговых 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, соответственно, присваивает значения Клиринговым регистрам, перечисленным в пп.8.1.1 – 8.1.11, 8.3.1, 8.3.4 настоящих Правил клиринга.

5.6.2. В Клиринговой системе проводится сверка значений соответствующих Клиринговых регистров, указанных в п.5.6.1 настоящих Правил клиринга, с данными, полученными в результате расчетов Клиринговой системы на основании предыдущих значений указанных Регистров и Регистров 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, 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 определяется 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 повторно выполняют действия, описанные в подразделе 5.5 настоящих 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 настоящих 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 Участником клиринга за свой счет,

5.8.3.2. заключенным Участником клиринга за счет своих клиентов,

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

5.8.4. Ликвидационное Нетто-обязательство / Нетто-требование рассчитывается в рублях Российской Федерации 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 настоящих Правил клиринга,

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

RO_i - денежное (в 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 Обязательства, выраженные в рублях Российской Федерации, по договорам соответствующего вида во всех секциях Биржи;

при наличии Обязательств/Требований 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);

при наличии Обязательств/Требований по Договорам поставки товара при определении RT_i и RO_i учитываются Обязательства и требования по i -тому Договору поставки товара в размере стоимости фактически поставленного объема товара, при расчете стоимости поставленного товара используется цена товара, указанная в соответствующем Договоре поставки товара;

$S_k T_1$ и $S_k O_1$ - Требование и Обязательство по k-той ценной бумаге по 1-тому договору с этой ценной бумагой;

S_{k1} – цена k-той ценной бумаге по 1-тому договору, равная расчетной цене k-ой ценной бумаги, определенной Биржей в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке 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.

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 настоящих Правил клиринга размерах ликвидационных Нетто-обязательств / Нетто-требований в дату расчета.

5.8.7. Денежные средства и иное имущество Участника клиринга, находящиеся на торговых и Клиринговых счетах после расчета ликвидационных 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.

5.9. Порядок проведения клиринга и исполнения обязательств по Договорам поставки товара

5.9.1. В день получения Реестра договоров от Биржи в отношении Договоров поставки товара Клиринговая организация открывает во внутреннем учете разделы регистра, указанного в п.8.3.9 или п.8.3.10 настоящих Правил клиринга, для учета обеспечения по каждому Договору поставки товара и зачисляет на указанный раздел сумму в размере Гарантийного обеспечения Договора поставки товара в соответствии с разделом 6 настоящих Правил клиринга.

5.9.2. На следующий рабочий день после получения Реестра договоров от Биржи в отношении Договоров поставки товара Клиринговая организация включает Обязательства по указанным договорам в Клиринговый пул и проводит контроль обеспечения согласно п.5.4.8 настоящих Правил клиринга.

5.9.3. В отношении Договоров поставки товара, прошедших контроль обеспечения денежными средствами, Клиринговая организация направляет Участнику клиринга – Поставщику Запрос о готовности товара к поставке, если в соответствии с Внутренними документами Биржи установлена обязанность Покупателя совершить действия, необходимые для поставки Биржевого товара

(предоставление реквизитных заявок, маршрутных телеграмм, оплата транспортных расходов и т.п.) или если Участник клиринга – Поставщик принадлежит к категории «К».

5.9.4. В случае получения от Участника клиринга категории «К» Уведомления о готовности к поставке по Договору поставки товара, Клиринговая организация списывает денежные средства в размере Обязательства по Договору поставки товара с раздела Регистра Участника клиринга – Покупателя, открытого для обеспечения исполнения указанного Договора поставки товара зачисляет на Регистр свободных от обязательств средств Участника клиринга категории «К», являющегося Поставщиком по данному Договору поставки товара, и списывает с Клирингового счета указанные средства в пользу Поставщика, используя для перечисления банковские реквизиты, указанные в его Анкете Участника клиринга.

5.9.5. Участник клиринга категории «К», денежные обязательства по Договору поставки товара перед которым исполнены, обязан в течение 4 (четырёх) рабочих дней с Даты завершения поставки предоставить Клиринговой организации Отчет о завершении поставки (при необходимости с уведомлением о стороне, из-за действия (бездействия) которой поставка не была завершена в Дату завершения поставки).

5.9.6. Участник клиринга категории «Т», являющийся Поставщиком, обязан до Даты завершения поставки предоставить подтверждение готовности к поставке в соответствии с Запросом, определенном п.5.9.3 настоящих Правил клиринга, или уведомить Клиринговую организацию о неготовности к поставке на Дату завершения поставки. В последнем случае Клиринговая организация исключает обязательства из договора из Клирингового пула и ожидает от Поставщика и Покупателя действий согласно п.5.9.17 и п.5.9.18 настоящих Правил клиринга или разрешения спора по договору в судебном порядке.

5.9.7. Участник клиринга категории «Т», являющийся Поставщиком, в течение 4 (четырёх) рабочих дней с Даты завершения поставки обязан предоставить документы, свидетельствующие об осуществлении поставки (акт), а Участник клиринга, являющийся Покупателем, в течение 2 (двух) рабочих дней с момента получения документов (акта), должен подтвердить отсутствие возражений по предоставленным документам. При получении подтверждения поставки в соответствии с настоящим пунктом, Клиринговая организация списывает денежные средства в размере Обязательства по Договору поставки товара с раздела регистра Участника клиринга – Покупателя, открытого для обеспечения исполнения указанного Договора поставки товара, зачисляет на регистр свободных от обязательств средств Участника клиринга категории «Т», являющегося Поставщиком по данному Договору поставки товара. Для получения денежных средств на свой счет в банке Участник клиринга категории «Т», являющийся Поставщиком, передает Клиринговой организации Распоряжение на отзыв денежных средств.

5.9.8. После получения документов, определенных п.5.9.5 или п.5.9.7 настоящих Правил клиринга, Клиринговая организация вносит в Клиринговые регистры информацию об исполнении обязательств по Договору поставки товара.

5.9.9. В случае если на Дату обеспечения Договор поставки товара не прошел контроль обеспечения, Клиринговая организация списывает Неустойку по Договору поставки товара в размере суммы Гарантийного обеспечения, зачисленного в дату заключения договора, на Регистр, предназначенный для учета обеспечения по такому Договору поставки товара не прошедшего контроль обеспечения, открытого Участнику клиринга – Покупателю, и зачисляет Неустойку по этому Договору поставки товара на Регистр свободных денежных средств Участника клиринга – Поставщика.

5.9.10. В случае нарушения Участником клиринга категории «К» обязанностей, предусмотренных п.5.9.5 настоящих Правил клиринга, или получения в соответствии с п.5.9.5 настоящих Правил клиринга Уведомления о нарушении Участником клиринга категории «К» Обязательств по поставке Биржевого товара Клиринговая организация направляет Уведомление о необходимости возврата суммы оплаты по Договору поставки товара. При этом Клиринговая организация перечисляет в оплату Неустойки по Договору поставки денежные средства в размере, определенном в соответствии со Спецификацией биржевого товара, с регистра учета Гарантийного обеспечения Участника клиринга категории «К» на регистр «Денежные средства Участника клиринга – свободные» Покупателя по договору поставки. Участник клиринга категории «К» обязан зачислить на Клиринговый банковский счет АО СПВБ денежные средства в размере полученной оплаты по указанному Договору поставки товара в соответствии с условиями Договора поставки товара в течение календарного месяца. Не позднее следующего рабочего дня со дня зачисления указанных денежных средств Клиринговая организация перечисляет поступившие средства контрагенту Участника клиринга категории «К» на регистр «Денежные средства Участника клиринга – свободные» по Договору поставки товара.

5.9.11. В случае недостатка денежных средств, учитываемых на регистре учета Гарантийного обеспечения Участника клиринга категории «К», для полной оплаты Неустойки, Клиринговая организация направляет такому Участнику клиринга Уведомление о необходимости оплаты Неустойки. Участник клиринга категории «К» обязан зачислить на Клиринговый счет АО СПВБ денежные средства в размере требования по оплате Неустойки и в срок, указанные в Уведомлении о необходимости оплаты Неустойки.

5.9.12. В случае невозврата суммы оплаты по Договору поставки товара в установленный срок и/ или неоплаты Неустойки Клиринговая организация прекращает допуск такого Участника к клиринговому обслуживанию с категорией «К» и осуществляет клиринговое обслуживание такого Участника клиринга с категорией «Т».

5.9.13. В случае использования Гарантийного обеспечения Участника клиринга категории «К» в оплату Неустойки, такой Участник клиринга обязан пополнить свое Гарантийное обеспечение до суммы, указанной в пункте 3.2.4.3 до начала следующей торговой сессии.

5.9.14. В случае нарушения Участником клиринга категории «Т», являющемся Поставщиком, требований установленных п.5.9.7 настоящих Правил

клиринга, при условии, что указанный Участник клиринга уведомлял Клиринговую организацию о готовности к поставке по Договору поставки товара, Клиринговая организация списывает Неустойку по Договору поставки товара в размере, определенном в соответствии со Спецификацией биржевого товара, с раздела Регистра для учета обеспечения по Договору поставки товара, в отношении которого нарушены требования п.5.9.7 настоящих Правил клиринга, и зачисляет их на Регистр свободных денежных средств Участника клиринга – Покупателя.

5.9.15. Оплата Неустойки по Договору поставки товара в соответствии с настоящим подразделом Правил клиринга прекращает обязательства по Договору поставки товара, учитываемые Клиринговой организацией. После оплаты Неустойки по Договору поставки товара Клиринговая организация вносит в Клиринговые регистры информацию о прекращении Обязательств из Договора поставки товара способом отличным от исполнения (путем уплаты Неустойки).

5.9.16. Участники клиринга, выступающие Продавцом и Покупателем по Договору поставки товара, могут проинформировать Клиринговую организацию о внесении изменений в существенные условия Договора поставки товара путем направления в Клиринговую организацию от обеих сторон Договора поставки товара Уведомления об изменении существенных условий договора. В этом случае Клиринговая организация вносит изменения в Клиринговые регистры, если изменились Дата обеспечения или Дата поставки товара или размер обязательств, и осуществляет клиринг в соответствии с новыми параметрами Договора поставки товара.

5.9.17. Продавец и Покупатель информируют Клиринговую организацию о прекращении обязательств по Договору поставки товара по соглашению сторон путем направления в Клиринговую организацию Уведомления о прекращении обязательств по соглашению Сторон. Информация о прекращении обязательств из Договора поставки товара в обязательном порядке должна включать указание, какой из сторон перечисляется с Клирингового банковского счета АО СПВБ Гарантийное обеспечение, заблокированное для обеспечения исполнения Обязательств, по указанному Договору поставки товара на счете внутреннего учета Продавца и на счете внутреннего учета Покупателя. Клиринговая организация вносит в Клиринговые регистры информацию о прекращении Обязательств из Договора поставки товара способом отличным от исполнения и перечисляет денежные средства, которые были заблокированы для обеспечения исполнения или исполнения указанного Договора поставки товара, Участникам клиринга в соответствии с полученным указанием. Прекращение Обязательств по соглашению сторон невозможно в случае получения такого соглашения после штатного исполнения обязательств по Договору поставки товара или после прекращения обязательств по этому Договору поставки путем уплаты Неустойки.

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. Для Договоров поставки товара Гарантийное обеспечение принимается только в российских рублях.

6.1.3. Гарантийное обеспечение Участника клиринга категорий «В», «Т» и «К» учитывается на Клиринговом банковском счете АО СПВБ, во внутреннем учете Клиринговой организацией на регистре учета Гарантийного обеспечения Участника клиринга, предоставившего Гарантийное обеспечение.

6.1.4. Гарантийное обеспечение Участника клиринга категорий «Ф», и «Б» может учитываться на торговых счетах Участника клиринга и/ или Клиринговом банковском счете АО СПВБ.

6.1.5. Гарантийное обеспечение Участника клиринга категории «И» учитывается на торговых счетах Участника клиринга.

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

6.1.7. При заключении договоров (кроме Договоров поставки товара) Участником клиринга в Клиринговые регистры, указанные в пп. 8.3.3, 8.3.6 настоящих Правил клиринга, вносятся сведения о суммах заблокированного Гарантийного обеспечения. При заключении Договоров поставки товара на Клиринговых регистрах, указанных в п.8.3.9, 8.3.10 настоящих Правил клиринга, открываются разделы для отдельного учета Гарантийного обеспечения по каждому Договору поставки товара, заключенного Участником клиринга, куда вносятся сведения о заблокированных суммах Гарантийного обеспечения. Величина Гарантийного обеспечения Договоров поставки товара определяется в соответствии с п.6.1.8 настоящих Правил клиринга.

6.1.8. В случае если по Договору поставки товара требуется уплатить Неустойку по Договору поставки товара согласно подразделу 5.9 настоящих Правил клиринга, для уплаты используются только средства Гарантийного обеспечения, учтенные на разделе регистра Участника клиринга, нарушившего обязательства, предназначенном для учета Гарантийного обеспечения по конкретному Договору поставки товара.

6.1.9. Величина Гарантийного обеспечения (Гарантийного обеспечения необходимого на дату заключения Договора поставки товара) для обеспечения Договора поставки товара определяется в соответствии со Спецификацией биржевого товара. Величина Гарантийного обеспечения на Дату обеспечения и позже устанавливается равной сумме Договора поставки товара.

6.1.10. Гарантийное обеспечение, заблокированное для обеспечения исполнения Договора поставки товара со стороны Участника клиринга – Покупателя, используется для исполнения обязательств по этому Договору поставки товара.

6.1.11. Гарантийное обеспечение, заблокированное для обеспечения исполнения Договора поставки товара со стороны Участника клиринга – Поставщика, разблокируется после внесения в Клиринговые регистры информации о прекращении обязательств по указанному Договору поставки товара и переводится на регистр «Денежные средства ГО Участника клиринга - товарный рынок - свободные», соответствующий раздел регистра «Денежные средства Участника клиринга - товарный рынок - заблокированные для исполнения» закрывается.

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. счет собственных средств;
- 7.1.1.2. специальный брокерский счет (Участнику клиринга – профессиональному участнику рынка ценных бумаг);
- 7.1.1.3. специальный торговый счет (Участнику клиринга – кредитной организации);
- 7.1.1.4. отдельный специальный торговый счет (Участнику клиринга – для учета обеспечения клиента, зарегистрированного в клиринговой организации).

7.1.2. Участникам клиринга могут быть открыты в Расчетной организации торговые банковские счета для учета средств клиентов. В этом случае Клиринговая организация осуществляет операции 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 клиента Участника клиринга.

7.1.3. На счете собственных средств учитываются средства Участника клиринга, предназначенные для исполнения обязательств и обеспечения исполнения Обязательств по договорам, заключенным Участником клиринга за свой счет.

7.1.4. На специальном брокерском счете учитываются средства клиентов Участника клиринга, предназначенные для исполнения обязательств и обеспечения исполнения обязательств по договорам, заключенным Участником клиринга за счет своих клиентов.

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 Участником клиринга за счет своих клиентов.

7.1.6. В соответствии с договором, заключенным с Клиринговой организацией, Расчетный депозитарий для учета ценных бумаг и проведения операций с ценными бумагами по результатам договоров, заключенных при

размещении ценных бумаг, использует специальный технический счет и его разделы «к размещению».

7.1.7. В соответствии с договором, заключенным с Участником клиринга или Держателем, Расчетный депозитарий для учета ценных бумаг и проведения операций с ценными бумагами по результатам заключенных договоров открывает Участнику клиринга или Держателю торговые счета депо.

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

7.1.9. Торговые счета депо подразделяются на:

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

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

7.1.9.3. торговый счет депо владельца с попечителем, открытый клиенту Участника клиринга, являющегося попечителем этого счета;

7.1.9.4. торговый счет депо номинального держателя с попечителем, открытый для учета ценных бумаг клиентов номинального держателя, обслуживаемого Участником клиринга, являющегося попечителем этого счета;

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

7.1.9.6. торговый счет депо доверительного управляющего с попечителем, открытый для учета ценных бумаг, находящихся в доверительном управлении у доверительного управляющего, обслуживаемого Участником клиринга, являющегося попечителем этого счета;

7.1.9.7. казначейский торговый счет депо, открытый эмитенту для приобретения или отчуждения ценных бумаг в процессе их обращения;

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

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

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

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

7.1.9.12. торговый счет депо иностранного уполномоченного держателя, открытый иностранному уполномоченному держателю, для учета ценных бумаг, переданных в управление иностранному уполномоченному держателю, обслуживаемому Участником клиринга.

7.1.10. В соответствии с договором между Клиринговой организацией и Расчетной организацией последняя открывает Клиринговой организации

Клиринговые счета для учета денежных средств, которые используются для обеспечения и исполнения обязательств, допущенных к Клирингу, в том числе Транзитный счет АО СПВБ.

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 настоящих Правил клиринга, или по распоряжению 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 в следующем порядке:

7.2.2.1. по распоряжению Участника клиринга с банковского (корреспондентского) счета Участника клиринга с обязательным указанием назначения платежа по форме, установленной Положением о формах и форматах Клиринговой организации;

7.2.2.2. с любого счета в любом банке с обязательным указанием назначения платежа по форме, установленной Положением о формах и форматах Клиринговой организации;

7.2.2.3. по распоряжению АО СПВБ с Клирингового счета АО СПВБ, в порядке, установленном подразделом 5.5 настоящих Правил клиринга.

7.2.3. Денежные средства с торговых банковских счетов списываются в следующем порядке:

7.2.3.1. по распоряжению Клиринговой организации по итогам клиринга, по распоряжению Участника клиринга с согласия Клиринговой организации;

7.2.3.2. по распоряжению АО СПВБ на Клиринговый банковский счет АО СПВБ в порядке, установленном подразделом 5.5 настоящих Правил клиринга.

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

7.2.5. В период проведения Торговой сессии зачисление на торговые банковские счета Участника клиринга производится на основании согласия Клиринговой организации на зачисление, данного Расчетной организации в отношении всех торговых банковских счетов или группы торговых банковских счетов.

7.2.6. Списание денежных средств с торговых банковских счетов по Распоряжению Участника клиринга производится с согласия Клиринговой

организации, получаемого Расчетной организацией в отношении каждой суммы по определенному торговому банковскому счету.

7.2.7. Клиринговая организация после получения запроса 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.

7.2.8. 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 договоров с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств), поступивших с указанием номера такого договора в назначении платежа.

7.2.9. 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.

7.2.10. Списание денежных средств с торговых банковских счетов может производиться на основании Уведомления о согласии на проведение операций по торговым банковским счетам, сформированного по окончании Клиринговой сессии.

7.2.11. Списание денежных средств с торговых банковских счетов может производиться на основании Распоряжения на списание денежных средств, предоставленного Клиринговой организации Участником клиринга. Для этого Участник клиринга может оформить соответствующее Распоряжение по форме, предусмотренной Положением о формах и форматах документов Клиринговой организации.

7.2.12. 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 настоящих Правил клиринга.

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

7.3.1. Открытие и закрытие торгового счета депо, в отношении которого получено указание о проведении операций по распоряжению или с согласия Клиринговой организации, 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 Участника клиринга 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. Сумма списания ценных бумаг с торгового счета депо Участника клиринга в период проведения Торговой сессии должна быть меньше или равна сумме остатка 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 настоящих 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 счетов. Клиринговая организация ведет отдельный внутренний учет средств Участников клиринга и средств клиентов Участников клиринга на Клиринговом банковском счете АО СПВБ.

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

7.4.3. В период проведения расчетов по итогам клиринга зачисление денежных средств на указанный счет осуществляется только по распоряжению Клиринговой организации с торговых банковских счетов Участников клиринга или других Клиринговых банковских счетов АО СПВБ. Денежные средства зачисляются

в размере отрицательных 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 АО СПВБ, открытого в Расчетной организации, осуществляется по распоряжениям Клиринговой организации в размере положительных сальдо обязательств Участников клиринга по договорам, включенным в Клиринговый пул.

7.4.5. До начала проведения расчетов по итогам клиринга денежные средства на Клиринговый банковский счет АО СПВБ в рублях Российской Федерации зачисляются с банковских (корреспондентских) счетов Участников клиринга.

7.4.6. Денежные средства Участника клиринга списываются с Клирингового банковского счета АО СПВБ 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 Клиринговой организации. Поручение на списание средств должно содержать реквизиты счета Участника клиринга, на который должны быть переведены средства.

7.4.7. Клиринговая организация после получения Поручения на списание денежных средств с Клирингового банковского счета АО СПВБ осуществляет проверку достаточности денежных средств на этом счете, в том числе с учетом необходимости обеспечения обязательств из договоров, заключенных в ходе текущей Торговой сессии.

7.4.8. При списании денежных средств в период проведения Торговой сессии, сумма списания денежных средств Участника клиринга с Клирингового банковского счета АО СПВБ должна быть меньше или равна сумме остатка на клиринговом регистре учета денежных средств Участника клиринга на Клиринговом банковском счете АО СПВБ 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 договоров с текущей датой исполнения второй части договора (возврат денежных средств), поступивших с указанием номера такого договора в назначении платежа.

7.4.9. Денежные средства Участников клиринга категории «К» списываются с Клирингового банковского счета АО СПВБ на банковские счета таких Участников клиринга по итогам клиринга по Договорам поставки товара, в размере остатка денежных средств на клиринговом регистре, предназначенном для учета денежных средств на Клиринговом банковском счете АО СПВБ, полученных по итогам исполнения обязательств по Договорам поставки товара. По каждому оплаченному Договору поставки товара сумма оплаты перечисляется с Клирингового банковского счета АО СПВБ отдельным платежом.

7.4.10. В период проведения расчетов по итогам клиринга зачисление денежных средств на Клиринговый банковский счет АО СПВБ осуществляется

только по распоряжению Клиринговой организации с торговых банковских счетов Участников клиринга.

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 – свои» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных ценных бумаг Участника клиринга, на торговом счете депо в Расчетном депозитарии.

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

8.1.3. Регистр «Ценные бумаги клиента с попечителем Участником клиринга» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг на торговом счете лица, имеющего попечителя этого счета – Участника клиринга, в Расчетном депозитарии.

8.1.4. Регистр «Ценные бумаги номинального держателя с попечителем Участником клиринга - клиенты» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг клиентов номинального держателя на торговом счете лица, имеющего попечителя этого счета – Участника клиринга, в Расчетном депозитарии.

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

8.1.6. Регистр «Ценные бумаги доверительного управляющего с попечителем Участником клиринга» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг, находящихся в доверительном управлении у доверительного управляющего, на торговом счете лица, имеющего попечителя этого счета – Участника клиринга, в Расчетном депозитарии.

8.1.7. 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.

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

8.1.9. 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.

8.1.10. 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.

8.1.11. 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.

8.1.12. 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.

8.1.13. 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, сформированные по результатам собственных договоров» – Клиринговые регистры, предназначенные для учета Обязательств по ценным бумагам Участника клиринга, сформированных по результатам договоров, заключенных с ценными бумагами. 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, сформированные по результатам клиентских договоров» – Клиринговые регистры, предназначенные для учета совокупных Обязательств по ценным бумагам клиентов Участника клиринга, сформированных по результатам договоров с ценными бумагами, заключенных по поручению клиентов Участников 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. Регистр «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга, сформированные по результатам договоров Участника клиринга, заключенных от имени своего клиента, по счету депо, которого он выступает попечителем» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета Обязательств по ценным бумагам лица, имеющего попечителя – Участника клиринга, сформированных по результатам договоров с ценными бумагами, заключенных Участником клиринга по поручению указанного лица.

8.2.4. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга, сформированные по результатам договоров ДУ» – Клиринговые регистры, предназначенные для учета Обязательств по ценным бумагам, находящимся в доверительном управлении Участника клиринга, сформированных по результатам

заключенных им 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.

8.2.5. Регистр «Обязательства по ценным бумагам для размещения/выкупа» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета Обязательств по ценным бумагам при их размещении/выкупе, сформированных по результатам договоров с ценными бумагами, заключенных Участником клиринга в процессе их размещения/выкупе с использованием Раздела «к размещению/выкупу».

8.2.6. Регистр «Обязательства по ценным бумагам эмитента – казначейский» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета Обязательств по ценным бумагам эмитента, сформированных по результатам договоров с ценными бумагами, заключенных Участником клиринга по поручению эмитента при приобретении или отчуждении ценных бумаг в процессе их обращения.

8.2.7. 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.

8.2.8. 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.

8.2.9. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга – ДУ у Держателя» – Клиринговые регистры, предназначенные для учета Обязательств по ценным бумагам в доверительном управлении Участника клиринга, сформированных по результатам заключенных им 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.

8.2.10. 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.

8.2.11. 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, зарезервированные на торги» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга, зарезервированных для участия в торгах в Фондовой секции и Секции МКР. Регистр соответствует торговому банковскому счету собственных средств, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации, или счету внутреннего учета средств Участника клиринга на Клиринговом банковском счете АО СПВБ. 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 по договорам в Фондовой секции и договорам в Секции МКР.

8.3.3. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – заблокированные» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных денежных средств Участника клиринга заблокированных под исполнение Обязательств по договорам в Фондовой секции и договорам в Секции МКР.

8.3.4. Регистр «Денежные средства Участника клиринга, зарезервированные на торги – клиенты» – Клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств клиентов Участника клиринга. Регистр соответствует специальному торговому счету, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации. 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 совокупного учета денежных средств клиентов Участника клиринга, свободных от обязательств по договорам с ценными бумагами.

8.3.6. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга – заблокированные» – Клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств клиентов Участника клиринга заблокированных под исполнение Обязательств по договорам с ценными бумагами.

8.3.7. Регистр «Денежные средства ГО Участника клиринга – товарный рынок – свободные» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ для обеспечения исполнения обязательств из договоров, заключенных на торгах АО «Биржа «Санкт-Петербург» от имени и за счет Участника клиринга, и не обремененных обязательствами по заключенным договорам.

8.3.8. Регистр «Денежные средства ГО клиентов Участника клиринга – товарный рынок – свободные» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ для обеспечения исполнения обязательств из договоров, заключенных на торгах АО «Биржа «Санкт-Петербург» от имени Участника клиринга за счет его клиентов, и не обремененных обязательствами по заключенным договорам.

8.3.9. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – товарный рынок – блокированные для исполнения» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга на Клиринговом банковском счете АО СПВБ, заблокированных в качестве Гарантийного обеспечения Договоров поставки товара, заключенных от имени и за счет Участника клиринга. На указанном регистре открываются разделы для отдельного учета заблокированного Гарантийного обеспечения по каждому Договору поставки товара.

8.3.10. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга – товарный рынок – блокированные для исполнения» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга на Клиринговом банковском счете АО СПВБ, заблокированных в качестве Гарантийного обеспечения Договоров поставки товара, заключенных от имени Участника клиринга за счет его клиентов. На указанном регистре открываются разделы для отдельного учета заблокированного Гарантийного обеспечения по каждому Договору поставки товара.

8.3.11. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – товарный рынок – блокированные на торги» - Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга на соответствующем счете внутреннего учета, зарегистрированном на Клиринговом банковском счете АО СПВБ, для обеспечения торгового лимита по Договорам поставки товара, заключаемым от имени и за счет Участника клиринга.

8.3.12. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга – товарный рынок – блокированные на торги» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств клиентов Участника клиринга на соответствующем счете внутреннего учета, зарегистрированном на Клиринговом банковском счете АО СПВБ, для обеспечения торгового лимита по Договорам поставки товара, заключаемыми от имени Участника клиринга за счет его клиентов.

8.4. Клиринговые регистры по учету обязательств по денежным средствам

8.4.1. Регистр «Обязательства по денежным средствам, сформированные по результатам собственных договоров Участника клиринга» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным средствам Участника клиринга, сформированных по результатам договоров в Фондовой секции и договоров в Секции МКР, заключенных за счет Участника клиринга.

8.4.2. Регистр «Обязательства по денежным средствам, сформированные по результатам договоров, заключенных Участником клиринга в интересах клиентов» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным

средствам Участника клиринга, сформированных по результатам договоров в Фондовой секции, заключенных Участником клиринга в интересах клиентов.

8.4.3. Регистр «Обязательства по денежным средствам Участника клиринга, сформированные по результатам договоров Участника клиринга на товарном рынке» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга, по Договорам поставки товара, заключенным от имени и за счет Участника клиринга.

8.4.4. Регистр «Обязательства по денежным средствам клиентов Участника клиринга, сформированные по результатам договоров Участника клиринга на товарном рынке заключенных от имени Участника клиринга за счет его клиентов» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга, по Договорам поставки товара, заключенных от имени Участника клиринга, за счет его клиентов.

8.4.5. Регистр «Обязательства по поставке товара Участником клиринга» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга, по Договорам поставки товара, заключенных от имени и за счет Участника клиринга.

8.4.6. Регистр «Обязательства по поставке товара клиентом Участником клиринга» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга, по Договорам поставки товара, заключенных от имени Участника клиринга, но за счет и по поручению клиента Участника клиринга.

8.5. Порядок ведения клиринговых регистров

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

8.5.2. Начальные значения Клиринговых регистров учета ценных бумаг изменяются после получения повторного Отчета от Расчетного депозитария только в следующих случаях:

8.5.2.1. Расчетный депозитарий направил информацию повторно для исправления ошибок или дополнения первоначального Отчета;

8.5.2.2. После получения повторного Отчета от Расчетного депозитария по запросу Клиринговой организации;

8.5.2.3. После получения Отчета от Расчетного депозитария при изменении остатков ценных бумаг.

8.5.3. Клиринговая организация производит изменение значений Клиринговых регистров учета ценных бумаг в соответствии с Отчетами, вновь полученными от Расчетного депозитария, в течение 30 минут после получения Отчетов.

8.5.4. 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.

8.5.5. В Клиринговые регистры учета обязательств по ценным бумагам, указанные в подразделе 8.2 настоящих Правил клиринга вносятся обязательства и требования по ценным бумагам, определяемые с учетом сальдо обязательств в соответствии с разделом 5 настоящих Правил клиринга. При этом обязательства вносятся в регистры с отрицательным знаком, а требования - с положительным.

8.5.6. Начальные значения Клиринговых регистров денежных средств, указанных в п. 8.3.1 настоящих Правил клиринга, п. 8.3.4 настоящих Правил клиринга, устанавливаются равными величине денежных средств, находящихся на соответствующих торговых банковских счетах Участника клиринга/ клиринговых регистрах, предназначенных для учета денежных средств на Клиринговых счетах, в соответствии с данными, полученными Клиринговой организацией от Расчетной организации в порядке, установленном договором Клиринговой организации с Расчетной организацией.

8.5.7. Начальные значения Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.3, п. 8.3.6, п. 8.3.9, п. 8.3.10 настоящих Правил клиринга устанавливаются равными состоянию этих же регистров на конец предыдущего рабочего дня.

8.5.8. Значения Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.2, п. 8.3.5 настоящих Правил клиринга (регистры для учета свободных средств) вычисляются как разница сумм, учтенных на Клиринговых регистрах, перечисленных в п. 8.5.6 настоящих Правил клиринга (регистры, отражающие текущее состояние торговых счетов), с суммами, учтенными на соответствующих Клиринговых регистрах, перечисленных в п. 8.5.7 настоящих Правил клиринга (регистры, отражающие заблокированные средства).

8.5.9. Начальные значения Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.7, п. 8.3.8 настоящих Правил клиринга устанавливаются равными величине денежных средств на клиринговом регистре, предназначенном для учета средств Участника клиринга на Клиринговом банковском счете АО СПВБ за вычетом средств, находящихся на регистрах, указанных в п. 8.3.9, п. 8.3.10 настоящих Правил клиринга. Начальные значения Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.11, п. 8.3.12 настоящих Правил клиринга, устанавливаются равными нулю. Значения Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.11, п. 8.3.12 настоящих Правил клиринга, увеличиваются на суммы, указанные в Распоряжении Участника клиринга, но не более чем на значение Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.7, п. 8.3.8 настоящих Правил клиринга соответственно. Одновременно с увеличением значений Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.11, п. 8.3.12 настоящих Правил клиринга, на соответствующие суммы уменьшаются значения Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.7, п. 8.3.8 настоящих Правил клиринга.

8.5.10. Значения Клиринговых регистров, указанных в п. 8.5.6 настоящих Правил клиринга, изменяются каждый раз при получении от Расчетной организации новых данных о состоянии торговых банковских счетов или Клиринговых счетов АО СПВБ. После чего пересчитываются значения

Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.2, п. 8.3.5 настоящих Правил клиринга, в соответствии с правилом, установленным п. 8.5.8 настоящих Правил клиринга.

8.5.11. Значения Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.3, п. 8.3.9, п. 8.3.10 настоящих 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 настоящих Правил клиринга, в соответствии с правилом, установленным п. 8.5.8 настоящих Правил клиринга.

8.5.12. По регистрам, указанным в п. 8.3.9, п. 8.3.10 настоящих Правил клиринга, ведется отдельный учет по каждому Договору поставки товара (на регистрах открывается раздел для отдельного учета средств, заблокированных по каждому Договору поставки товара).

8.5.13. В Клиринговые регистры учета обязательств по денежным средствам пп. 8.4.1 - 8.4.2 настоящих Правил клиринга вносятся обязательства и требования по денежным средствам, определяемые с учетом сальдо обязательств в соответствии с разделом 5 настоящих Правил клиринга. При этом обязательства вносятся в регистры с отрицательным знаком, а требования – с положительным.

8.5.14. В Клиринговые регистры учета обязательств, указанные в п.8.4.4, п.8.4.5 настоящих Правил клиринга, вносятся обязательства и требования по денежным средствам по каждому Договору поставки товара отдельно.

8.5.15. В Клиринговые регистры учета обязательств, указанные в п.8.4.6, п.8.4.7 настоящих Правил клиринга, вносятся обязательства и требования по поставке Биржевого товара по каждому Договору поставки товара отдельно. Учет обязательства ведется с точностью, определенной Внутренними документами Биржи.

8.5.16. Клиринговые регистры, указанные в п.8.3.11, п.8.3.12 настоящих Правил клиринга, обнуляются после проведения операций по итогам торгов на Бирже, при этом средства, оставшиеся на указанных регистрах, после блокировок Гарантийного обеспечения по заключенным Договорам поставки товара возвращаются на Клиринговые регистры, указанные в п.8.3.7, п.8.3.8 настоящих Правил клиринга.

8.5.17. На основании Уведомления о взаимосвязи торгового счета депо и торгового банковского счета Участника клиринга, предоставляемого Участником клиринга в соответствии с п.3.3.1.1 настоящих Правил клиринга, Клиринговая организация присваивает Участнику клиринга ТКР, однозначно определяющий взаимосвязь торгового счета депо и торгового банковского счета Участника клиринга/ клирингового регистра, предназначенного для учета денежных средств на Клиринговом банковском счете АО СПВБ, указанных в Уведомлении.

8.6. Реестры и иные формы внутреннего учета АО СПВБ

8.6.1. «Реестр Участников клиринга». Данный реестр формируется на основании данных, содержащихся в Анкетах Участников клиринга по форме предусмотренной в Положении о формах и форматах документов Клиринговой организации и содержит информацию по каждому Участнику клиринга, необходимую для ведения 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 соответствующих Отчетов.

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 подписания сторонами Договора об оказании клиринговых услуг, так и в дату расторжения.

8.6.5. «Реестр договоров, допущенных к клирингу». 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 договоров, прошедших процедуру контроля обеспечения». Данный Реестр содержит информацию обо всех договорах, прошедших процедуру контроля обеспечения. Записи в Реестр производятся на основании Реестров договоров, результатов проверки обеспеченности и получения Отчетов от Расчетной организации и Расчетного депозитария каждый раз после проведения расчетов.

8.6.7. «Реестр договоров, 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 счетам, направленных в Расчетную организацию и Распоряжения на проведение операций по разделам, направленных в Расчетный депозитарий. Записи в данные Реестры производятся каждый раз после отправки Распоряжений в Расчетную организацию и Расчетный депозитарий и получения от них Отчетов 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 и (или) его клиенту 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».

8.7.2. Для каждого Торгово-клирингового регистра устанавливается соответствие такого Торгово-клирингового регистра и торгового банковского счета Участника клиринга, или Клирингового банковского счета АО СПВБ (клирингового регистра, предназначенного для учета средств, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ). Один Торгово-клиринговый регистр Участника клиринга может соответствовать только одному торговому банковскому счету Участника клиринга или одному клиринговому регистру, предназначенному для учета средств, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ.

8.7.3. Дополнительно для Торгово-клирингового регистра может быть установлено соответствие такого Торгово-клирингового регистра и торгового счета депо Участника клиринга, 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 из договоров, заключенных в Секции МКР, соответствующий торговому банковскому счету, при совпадении следующих условий:

- Клиринговая организация получила от Расчетной организации уведомление об открытии нового торгового банковского счета Участника клиринга;
- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Уведомление о взаимосвязи торгового счета депо и нового торгового банковского счета без указания торгового счета депо.

8.7.5.2. Участнику клиринга открывается Торгово-клиринговый регистр для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных в Секции МКР, соответствующий Клиринговому банковскому счету (клиринговому регистру, предназначенному для учета средств, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ), при совпадении следующих условий:

- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Уведомление о взаимосвязи торгового счета депо и клирингового банковского счета (клирингового регистра, предназначенного для учета средств, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ) без указания торгового счета депо.

8.7.5.3. Участнику клиринга открывается Торгово-клиринговый регистр для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных в Фондовой секции и в Секции МКР, соответствующий торговому банковскому счету и торговому счету депо, при совпадении следующих условий:

- Клиринговая организация получила от Расчетной организации уведомление об открытии нового торгового банковского счета Участника клиринга;
- Клиринговая организация получила от Расчетного депозитария уведомление об открытии нового торгового счета депо Участника клиринга или раздела «к размещению»/ «к выкупу»;

- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Уведомление о взаимосвязи нового торгового счета депо и нового торгового банковского счета / раздела «к размещению»/ «к выкупу».

8.7.5.4. Участнику клиринга открывается Торгово-клиринговый регистр для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных в Фондовой секции и в Секции МКР, соответствующий Клиринговому банковскому счету АО СПВБ (клиринговому регистру, предназначенному для учета средств, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ) и торговому счету депо, при совпадении следующих условий:

- Клиринговая организация получила от Расчетного депозитария уведомление об открытии нового торгового счета депо Участника клиринга или раздела «к размещению»/ «к выкупу»;
- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Уведомление о взаимосвязи нового торгового счета депо и Клирингового банковского счета АО СПВБ (клирингового регистра, предназначенного для учета средств, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ).

8.7.5.5. Участнику клиринга открывается Торгово-клиринговый регистр для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных за счет клиентов в Фондовой секции и в Секции МКР, соответствующий торговому банковскому счету и торговому счету депо, при совпадении следующих условий:

- Клиринговая организация получила от Расчетной организации уведомление об открытии нового торгового банковского счета Участника клиринга;
- Клиринговая организация получила от Расчетного депозитария уведомление об открытии нового торгового счета депо Участника клиринга;
- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Уведомление о взаимосвязи нового торгового счета депо и нового торгового банковского счета.

8.7.5.6. Участнику клиринга открывается Торгово-клиринговый регистр для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных за счет клиентов в Фондовой секции и в Секции МКР, соответствующий Клиринговому счету АО СПВБ (клиринговому регистру, предназначенному для учета средств, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ) и торговому счету депо, при совпадении следующих условий:

- Клиринговая организация получила от Расчетного депозитария уведомление об открытии нового торгового счета депо Участника клиринга;

- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Уведомление о взаимосвязи нового торгового счета депо и Клирингового банковского счета АО СПВБ (клирингового регистра, предназначенного для учета средств, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ).

8.7.5.7. Участнику клиринга открывается Торгово-клиринговый регистр для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных за счет обособленного клиента Участника клиринга в Фондовой секции и в Секции МКР, соответствующий Клиринговому счету АО СПВБ (клиринговому регистру, предназначенному для учета средств, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ) и торговому счету депо, при совпадении следующих условий:

- Клиринговая организация получила от Расчетного депозитария уведомление об открытии нового торгового счета депо Участника клиринга или раздела «к размещению»/ «к выкупу»;
- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Поручение на регистрацию клиента по форме, приведенной в Порядке присвоения регистрационных кодов АО СПВБ с указанием нового торгового счета депо и Клирингового банковского счета АО СПВБ (клирингового регистра, предназначенного для учета средств, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ).

8.7.5.8. Участнику клиринга открывается Торгово-клиринговый регистр для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных за счет обособленного клиента Участника клиринга в Фондовой секции и в Секции МКР, соответствующий торговому банковскому счету и торговому счету депо, при совпадении следующих условий:

- Клиринговая организация получила от Расчетной организации уведомление об открытии нового торгового банковского счета Участника клиринга;
- Клиринговая организация получила от Расчетного депозитария уведомление об открытии нового торгового счета депо Участника клиринга или раздела «к размещению/ выкупу»;
- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Поручение на регистрацию клиента по форме, приведенной в Порядке присвоения регистрационных кодов АО СПВБ с указанием нового торгового банковского счета и нового торгового счета депо.

8.7.5.9. Участнику клиринга открывается Торгово-клиринговый регистр для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных Участником клиринга в качестве Доверительного управляющего в Фондовой секции и в Секции МКР, соответствующий Клиринговому счету АО СПВБ (клиринговому регистру, предназначенному для учета средств, зачисленных на Клиринговый

банковский счет АО СПВБ) и торговому счету депо, при совпадении следующих условий:

- Клиринговая организация получила от Расчетного депозитария уведомление об открытии нового торгового счета депо Участника клиринга или раздела «к размещению»/ «к выкупу»;
- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Поручение на регистрацию объектов ДУ по форме, приведенной в Порядке присвоения регистрационных кодов АО СПВБ с указанием нового торгового счета депо и Клирингового счета АО СПВБ (клирингового регистра, предназначенного для учета средств, зачисленных на Клиринговый банковский счет АО СПВБ).

8.7.5.10. Участнику клиринга открывается Торгово-клиринговый регистр для учета гарантийного обеспечения и обязательств из договоров, заключенных Участником клиринга в качестве Доверительного управляющего в Фондовой секции и в Секции МКР, соответствующий торговому банковскому счету АО СПВБ и торговому счету депо, при совпадении следующих условий:

- Клиринговая организация получила от Расчетной организации уведомление об открытии нового торгового банковского счета Участника клиринга;
- Клиринговая организация получила от Расчетного депозитария уведомление об открытии нового торгового счета депо Участника клиринга или раздела «к размещению»/ «к выкупу»;
- Участник клиринга предоставил в Клиринговую организацию Поручение на регистрацию объектов ДУ по форме, приведенной в Порядке присвоения регистрационных кодов АО СПВБ с указанием нового торгового банковского счета и нового торгового счета депо.

8.7.6. Клиринговые регистры учета ценных бумаг, клиринговые регистры учета обязательств по ценным бумагам, клиринговые регистры учета денежных средств и клиринговые регистры по учету 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 Клиринговой организации 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 в регистрах внутреннего учета, 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 Клиринговой организации.

9.2. Порядок и сроки предоставления отчетов Участникам клиринга

9.2.1. 9.2.1. Отчеты для Участников клиринга формируются Клиринговой организацией в электронном виде и направляются способом, предусмотренным в Положении о формах и форматах документов Клиринговой организации во время, установленное в Расписании предоставления клиринговых услуг, утверждаемом 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 или направляются почтовым отправлением по адресу, указанному в указанной в Анкете Участника клиринга с уведомлением о вручении. Запрос на получение бумажных отчетов оформляется по форме, приведенной в Положении о формах и форматах документов Клиринговой организации.

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. Риск-менеджера (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. Председатель Правления АО СПВБ назначает должностное лицо, ответственное за организацию системы управления рисками Клиринговой

организации (риск-менеджера), в соответствии с требованиями действующего законодательства.

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 по каждому Участнику клиринга и их передача Участникам клиринга;

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

10.3.3.5. исполнение обязательств по договорам на условиях «полного обеспечения»;

10.3.3.6. 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. Для снижения уровня рисков Участников клиринга, связанных с отказом Участника клиринга от платежа, а также рисков, связанных с обстоятельствами, делающими невозможным осуществление платежа, Клиринговая организация устанавливает лимиты по допустимому объему договоров каждому Участнику клиринга, а также проводит клиринг только по обеспеченным ценными

бумагами и денежными средствами договорам, соблюдая принцип «поставки против платежа».

10.3.5. Подробный порядок действий и мер Клиринговой организации для снижения рисков устанавливается документами, указанными в подразделе 10.2 настоящих 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 и передает их Бирже перед началом Торговой сессии и при каждом изменении состояния торговых счетов Участников клиринга и/ или регистров учета денежных средств Участника клиринга на Клиринговом банковском счете АО СПВБ.

10.4.2. Лимит по договорам с ценными бумагами с кодом расчетов «Т0» устанавливается как по денежным средствам, так и по ценным бумагам. Допустимый объем договоров с ценными бумагами устанавливается равным остатку денежных средств на торговых счетах регистров учета денежных средств Участника клиринга на Клиринговом счете АО СПВБ и остатку ценных бумаг на соответствующих торговых счетах депо / разделах «к размещению»/ «к выкупу» .

10.4.3. Лимит по Договорам поставки товара для Участников клиринга категории «Т» устанавливается равным размеру Гарантийного обеспечения Договоров поставки товара, находящемуся на Клиринговых регистрах, указанных в п. 8.3.11, п. 8.3.12 настоящих Правил клиринга, умноженному на 100% и деленному на установленную п. 6.1.9 настоящих Правил клиринга величину начального Гарантийного обеспечения в процентах.

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. настоящих Правил клиринга.

11.2. В случае чрезвычайных ситуаций Клиринговая организация действует в порядке, установленном документом, указанным в п. 10.2.2. настоящих 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 Клиринговая система – 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 настоящими Правилами клиринга, осуществляется на основании Тарифов АО СПВБ.

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

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 способом, предусмотренным Разделом 9 настоящих Правил 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 по указанному для этих целей адресу электронной почты в Анкете Участника клиринга.

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 настоящими 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 Биржами, Расчетной организацией и Расчетным депозитарием

13.1. Порядок взаимодействия с Биржами

13.1.1. Порядок взаимодействия Клиринговой организации с Биржами определяется Внутренним регламентом Клиринговой организации, если Биржа и Клиринговая организация совпадают в одном лице, или договором о взаимодействии между Биржей и Клиринговой организацией.

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

13.1.3. В случае совмещения АО СПВБ клиринговой деятельности с деятельностью Биржи положения об обмене данными между Клиринговой организацией и Биржей означают обмен данными между отдельными структурными подразделениями АО СПВБ, занимающимися осуществлением клиринговой деятельностью и деятельностью по организации торговли.

13.1.4. Клиринговая организация передает АО СПВБ лимиты допустимого объема договоров всякий раз при их изменении. Клиринговая организация передает АО «Биржа «Санкт-Петербург» лимиты допустимого объема договоров в соответствии с расписанием, установленным договором между Биржей и Клиринговой организацией.

13.1.5. Биржа передает Клиринговой организации Реестр договоров. Реквизиты Реестра договоров устанавливаются внутренним регламентом Клиринговой организации или договором между Биржей и Клиринговой организацией.

13.1.6. Клиринговая организация направляет Бирже информацию об Участниках клиринга и получает от Биржи информацию об Участниках торгов в объеме и порядке, установленном договором между Биржей и Клиринговая организацией или внутренним регламентом Клиринговой организации.

13.1.7. Иные случаи взаимодействия с Биржей установлены в соответствующих разделах настоящих 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 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 АО СПВБ после заключения с Клиринговой организацией соответствующего договора. Расчетная организация информирует Клиринговую организацию об открытии Клирингового банковского счета АО СПВБ.

13.2.5. Порядок взаимодействия с Расчетными организациями при обмене информацией о состоянии торговых и клиринговых счетов установлен подразделом 5.1 настоящих Правил.

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 настоящих Правил клиринга.

13.2.7. Порядок взаимодействия с Расчетными организациями при проведении сверки расчетов установлен подразделами 5.6 и 5.7 настоящих 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 подразделами 5.1 и 5.5 настоящих 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 настоящих Правил клиринга.

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

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

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.