



УТВЕРЖДЕНО
решением Совета директоров
Акционерного общества
«Санкт - Петербургская Валютная Биржа»
09 ноября 2017 г. (Протокол № 295)
01 февраля 2018 г. (Протокол № 297)

Управляющий
Акционерного общества
«Санкт - Петербургская Валютная Биржа»

А.Ю.Филаретов/



**Правила клиринга
Акционерного общества
«Санкт-Петербургская Валютная Биржа»
(новая редакция)**

Санкт-Петербург
2017 г.



Оглавление

1.	Общие положения	4
1.1.	Термины и определения	4
1.2.	Основные сведения о клиринговой деятельности СПВБ и раскрытие иной информации	5
1.3.	Список Расчетных организаций и Расчетных депозитариев	6
1.4.	Утверждение, изменение и дополнение настоящих Правил	6
1.5.	Конфиденциальность информации	7
2.	Договор об оказании клиринговых услуг	7
2.1.	Предмет Договора	7
2.2.	Заключение и расторжение Договора	7
2.3.	Ответственность СПВБ и Участника клиринга	8
2.4.	Порядок разрешения споров между СПВБ и Участником клиринга	8
3.	Требования к участникам клиринга	9
3.1.	Категории Участников клиринга	9
3.2.	Требования к лицу, намеревающемуся стать Участником клиринга.	9
3.3.	Порядок регистрации Участников клиринга и клиентов Участника клиринга	11
3.4.	Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	12
4.	Права и обязанности СПВБ и Участников клиринга	13
4.1.	Обязанности СПВБ	13
4.2.	Права СПВБ	14
4.3.	Обязанности Участника клиринга	14
4.4.	Права Участника клиринга	14
5.	Порядок проведения клиринга	15
5.1.	Порядок и условия допуска обязательств к клирингу. Взаимодействие с Расчетной организацией и Расчетным депозитарием	15
5.2.	Порядок и условия включения обязательств в клиринговый пул	16
5.3.	Порядок проведения клиринга. Расчет нетто-обязательств и нетто-требований	16
5.4.	Процедура контроля обеспечения	18
5.5.	Порядок и условия исключения обязательств из клирингового пула	19
5.6.	Порядок исполнения (прекращения) обязательств по итогам клиринга	21
5.7.	Порядок проведения сверки результатов расчетов	23
5.8.	Порядок действий в случае расхождения данных при сверке	23
5.9.	Порядок прекращения обязательств в связи с введением процедур банкротства Участника клиринга и определения размера денежного обязательства, возникающего в связи с таким прекращением	24
6.	Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу	26
6.1.	Индивидуальное клиринговое обеспечение	26
7.	Виды торговых и клиринговых счетов и порядок совершения операций по ним	27
7.1.	Виды торговых и клиринговых счетов	27
7.2.	Порядок проведения операций по торговым банковским счетам	29
7.3.	Порядок проведения операций по торговым счетам депо	31
7.4.	Порядок проведения операций по клиринговым счетам	32
8.	Клиринговые регистры и иные формы внутреннего учета, их назначение, порядок ведения	33
8.1.	Клиринговые регистры учета ценных бумаг	33
8.2.	Клиринговые регистры учета обязательств по ценным бумагам	34
8.3.	Клиринговые регистры учета денежных средств	35



8.4.	Клиринговые регистры по учету обязательств по денежным средствам.....	37
8.5.	Порядок ведения клиринговых регистров	38
8.6.	Реестры и иные формы внутреннего учета СПВБ	39
9.	Порядок представления Участникам клиринга отчетов по итогам клиринга	40
9.1.	Формы отчетов.....	40
9.2.	Порядок и сроки предоставления отчетов Участникам клиринга	41
10.	Меры, направленные на управление рисками при осуществлении клиринга	41
10.1.	Система управления рисками.....	41
10.2.	Документы СПВБ по управлению рисками	41
10.3.	Общие принципы управления рисками.....	42
10.4.	Порядок установления лимитов по допустимому объему сделок	42
10.5.	Определение чрезвычайных ситуаций и порядок взаимодействия с Участниками клиринга в чрезвычайных ситуациях	43
11.	Оплата клиринговых услуг СПВБ	43
12.	Взаимодействие с Организаторами торговли, Расчетными организациями и Расчетными депозитариями	44
12.1.	Порядок взаимодействия с Организатором торговли.....	44
12.2.	Порядок взаимодействия с Расчетными организациями	44
12.3.	Порядок взаимодействия с Расчетными депозитариями	45
Приложение №1		47
Приложение №2		48
Приложение №3		49
Приложение №4		50
Приложение №5		51
Приложение №6		52
Приложение №7		55



1. Общие положения

1.1. Термины и определения

- 1.1.1. СПВБ – Акционерное общество «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», клиринговая организация.
- 1.1.2. Биржевой инструмент – это финансовый инструмент, который торгуется и рассчитывается по правилам, установленным Организатором торговли. Биржевым инструментом может являться ценная бумага, иностранная валюта, депозитный договор, кредитный договор, договор РЕПО. Организатор торговли присваивает каждому Биржевому инструменту уникальный код (тикер).
- 1.1.3. Совет директоров СПВБ – Совет директоров Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».
- 1.1.4. Держатель – организация, осуществляющая на основании лицензии депозитарное обслуживание Участников клиринга, имеющая в Расчетном депозитарии торговые счета депо для проведения операций с ценными бумагами Участников клиринга и/или их клиентов по результатам заключенных Участниками клиринга сделок.
- 1.1.5. Специальная торговая сессия – торговая сессия по сделкам с иностранной валютой, в рамках которой производится заключение сделок Участниками клиринга, не исполнившими обязательства по поставке средств по заключенным сделкам с иностранной валютой, с целью исполнения обязательств по неисполненным сделкам.
- 1.1.6. 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.
- 1.1.7. Клиринговая сессия - период рабочего дня, в течение которого проводится клиринг по сделкам с Биржевыми инструментами, заключенным в ходе торговой сессии.
- 1.1.8. Организатор торговли – лицо, являющееся организатором торговли в соответствии с Федеральным законом «Об организованных торгах».
- 1.1.9. Расчетная организация, Расчетный депозитарий – лица, соответствующие требованиям к организации, осуществляющей денежные расчеты по итогам клиринга, и расчетному депозитарию, предъявляемым Федеральным законом «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и иными нормативными актами в сфере финансовых рынков, и информация о которых раскрыта СПВБ в соответствии с действующим законодательством.
- 1.1.10. РКС - комплекс программно-технических средств, с помощью которых обеспечивается проведение расчета обязательств и требований Участников клиринга, формирование итоговых документов.
- 1.1.11. Спецификация Биржевого инструмента (Спецификация) – утвержденный Правлением СПВБ документ, содержащий описание предмета биржевой торговли и стандартных условий (параметров) для заключения сделок с данным инструментом. Группа однотипных Биржевых инструментов может быть описана одной Спецификацией.



- 1.1.12. Уникальный код – уникальный код Участника клиринга, клиента Участника клиринга, присваиваемый указанным лицам СПВБ и соответствующий требованиям действующего законодательства Российской Федерации.
- 1.1.13. Участник клиринга – юридическое лицо, заключившее с СПВБ договор на оказание клиринговых услуг.
- 1.1.14. Правила – настоящие «Правила клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее также - настоящие Правила).
- 1.1.15. Инициатор торгов - Участник торгов у Организатора торговли, по инициативе которого Организатор торговли утверждает Спецификацию Биржевого инструмента с целью проведения торгов по данному инструменту, в ходе которых остальные Участники торгов могут подавать заявки, адресованные только ему, и заключать сделки только с ним.
- 1.1.16. Тарифы СПВБ – документ, утверждаемый Советом директоров, содержащий размер и порядок оплаты клиринговых услуг СПВБ, информация о котором раскрыта СПВБ в соответствии с действующим законодательством.
- 1.1.17. Генеральное соглашение – документ, утвержденный Инициатором торгов, содержащий условия для заключения более чем одного договора на торгах, проводимых СПВБ.
- 1.1.18. Иные термины и определения используются в соответствии с внутренними нормативными документами СПВБ, нормативными правовыми актами Российской Федерации или описаны ниже.

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

- 1.2.1. Клиринг в соответствии с настоящими Правилами осуществляется без участия центрального контрагента.
- 1.2.2. СПВБ осуществляет раскрытие информации в соответствии с действующим законодательством на сайте в сети «Интернет» по адресу www.spccx.ru (далее – сайт СПВБ).
- 1.2.3. СПВБ в соответствии с настоящими Правилами осуществляет клиринг сделок с ценными бумагами, сделок с иностранной валютой и сделок на денежном рынке, заключенных у Организатора торговли. Указанные сделки могут являться договорами следующих видов:
 - 1.2.3.1. Договор купли-продажи (в отношении сделок с ценными бумагами и с иностранной валютой);
 - 1.2.3.2. Договор РЕПО (в отношении сделок с ценными бумагами);
 - 1.2.3.3. Депозитный договор (в отношении сделок на денежном рынке);
 - 1.2.3.4. Кредитный договор (в отношении сделок на денежном рынке).
- 1.2.4. СПВБ осуществляет определение обязательств каждого из Участников клиринга и расчеты по сделкам с иностранной валютой и ценным бумагам по всем совершенным Участником клиринга сделкам клирингового пула.
- 1.2.5. СПВБ осуществляет определение обязательств каждого из Участников клиринга и расчеты по сделкам по предоставлению кредитов по каждой совершенной Участником клиринга сделке клирингового пула.
- 1.2.6. СПВБ осуществляет определение обязательств каждого из Участников клиринга и расчеты по сделкам по размещению депозитов в зависимости от условий, определенных спецификацией Биржевого инструмента.



- 1.2.7. СПВБ предоставляет Участникам клиринга на фондовом рынке право совершать сделки в пределах количества ценных бумаг и денежных средств, зачисленных на торговые счета либо приобретаемых в процессе торгов (клиринг с полным обеспечением) по сделкам с кодом расчетов T0.
- 1.2.8. СПВБ предоставляет Участникам клиринга на фондовом рынке право совершать сделки с частичным зачислением денежных средств и ценных бумаг (клиринг с частичным обеспечением) в отношении сделок с кодом расчетов Sn.
- 1.2.9. СПВБ предоставляет Участникам клиринга на валютном рынке право совершать сделки в пределах, определенных СПВБ лимитов допустимых объемов сделок (клиринг с частичным обеспечением) по сделкам с иностранной валютой.
- 1.2.10. СПВБ предоставляет Участникам клиринга на денежном рынке право совершать сделки в пределах, определенных СПВБ лимитов допустимых объемов сделок (клиринг с частичным обеспечением) в отношении кредитных сделок.
- 1.2.11. СПВБ предоставляет Участникам клиринга на денежном рынке право совершать сделки без предварительного зачисления денежных средств на торговые (клиринговые) банковские счета (клиринг без предварительного обеспечения) или в пределах денежных средств, зачисленных на торговые (клиринговые) банковские счета (клиринг с полным обеспечением), в отношении депозитных сделок в зависимости от условий, установленных Спецификацией Биржевого инструмента.
- 1.2.12. СПВБ оказывает клиринговые услуги и проводит клиринговые сессии с 08:00 до 18:00 по рабочим дням в соответствии с нормативными правовыми актами Российской Федерации. В случае необходимости продолжительность работы СПВБ может быть увеличена по решению Правления СПВБ.

1.3. Список Расчетных организаций и Расчетных депозитариев

- 1.3.1. Список Расчетных организаций и Расчетных депозитариев раскрывается на сайте СПВБ в сети «Интернет» по адресу www.spccx.ru.

1.4. Утверждение, изменение и дополнение настоящих Правил

- 1.4.1. Настоящие Правила, разработаны в соответствии с действующим законодательством Российской Федерации, Уставом СПВБ и внутренними нормативными документами СПВБ.
- 1.4.2. Настоящие Правила и изменения к ним утверждаются Советом директоров СПВБ и подлежат регистрации в Центральном банке Российской Федерации (далее - Банк России) в соответствии с действующими нормативными актами Российской Федерации.
- 1.4.3. Изменения в настоящие Правила вносятся СПВБ в одностороннем порядке.
- 1.4.4. Настоящие Правила и изменения к настоящим Правилам вступают в силу после выполнения следующих условий:
 - 1.4.4.1. Регистрация в Банке России;
 - 1.4.4.2. Раскрытие информации о Правилах или изменений к ним более чем за пять дней до даты вступления в силу, если нормативными актами Российской Федерации не установлен более длительный срок между



моментом раскрытия информации о Правилах и вступлением в силу Правил и изменений к ним;

1.4.4.3. Наступления даты вступления в силу, определенной Советом директоров СПВБ или по поручению Совета директоров СПВБ - Правлением СПВБ.

1.4.5. СПВБ раскрывает информацию о настоящих Правилах и изменениях путем размещения их на сайте СПВБ после регистрации Банком России.

1.5. Конфиденциальность информации

1.5.1. СПВБ обязана обеспечить конфиденциальность информации, о которой стало известно в связи с оказанием клиринговых услуг:

1.5.1.1. Информации, составляющей коммерческую, банковскую и иную охраняемую законом тайну;

1.5.1.2. Информации об обязательствах, в отношении которых проводится клиринг;

1.5.1.3. Информации о торговых банковских счетах и торговых счетах депо и информации об операциях по указанным счетам;

1.5.1.4. Информации о финансовом состоянии Участника клиринга;

1.5.1.5. Содержании документов, полученных от Участника клиринга.

1.5.2. СПВБ не имеет права передавать указанную выше информацию третьим лицам без письменного согласия Участника клиринга за исключением случаев, предусмотренных действующим законодательством РФ.

2. Договор об оказании клиринговых услуг

2.1. Предмет Договора

2.1.1. По Договору на оказание клиринговых услуг (далее по тексту – Договор) СПВБ обязуется оказывать Участникам клиринга клиринговые услуги, а Участники клиринга обязуются оплачивать указанные услуги, за исключением случаев, установленных федеральными законами.

2.2. Заключение и расторжение Договора

2.2.1. Участник клиринга присоединяется к условиям Договора, определенным Правилами. Для чего потенциальный Участник клиринга подписывает Договор по форме, приведенной в Приложении № 1 к настоящим Правилам, и выполняет иные требования, изложенные в разделе 3 настоящих Правил.

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

2.2.3. Договор может быть расторгнут до окончания срока его действия по письменному заявлению одной из сторон, направленному в адрес другой стороны. Договор утрачивает свою силу после урегулирования взаимных



обязательств, завершения всех взаимных расчетов и прекращения обязательств, допущенных к клирингу на основании Договора.

2.3. Ответственность СПВБ и Участника клиринга

- 2.3.1. СПВБ и Участники клиринга несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение Договора в соответствии с действующим законодательством Российской Федерации и настоящими Правилами.
- 2.3.2. СПВБ вправе отказаться от исполнения Договора с Участником клиринга в случае нарушения им требований, предъявляемых настоящими Правилами к Участникам клиринга. Исполнение Договора прекращается с момента завершения проведения клиринга и осуществления расчетов по сделкам Участника клиринга, совершенным до получения СПВБ информации о несоответствии Участника клиринга требованиям настоящих Правил. Прекращение исполнения Договора по основаниям, указанным в настоящем пункте не требует предварительного уведомления Участника клиринга. СПВБ не позднее рабочего дня, следующего за днем прекращения исполнения Договора, информирует Участника клиринга о данном факте. Информирование осуществляется способом, предусмотренным для направления отчетов. Дополнительно Участнику клиринга высылается уведомление по электронной почте или по факсу. Возмещение убытков Участнику клиринга, связанных с прекращением исполнения Договора в соответствии с настоящим пунктом не осуществляется.
- 2.3.3. СПВБ не несет ответственности за отсутствие расчетов по нетто-обязательствам и нетто-требованиям Участников в случае неисполнения Расчетными организациями и/или Расчетными депозитариями распоряжений СПВБ на проведение операций по торговым банковским счетам и/или торговым счетам депо; за действия Расчетных организаций и/или Расчетных депозитариев после направления им согласия на совершение операции по торговым банковским счетам и по торговым счетам депо, соответственно.
- 2.3.4. СПВБ не отвечает за убытки, понесенные Участником клиринга в результате неисполнения сделок по вине других Участников клиринга.

2.4. Порядок разрешения споров между СПВБ и Участником клиринга

- 2.4.1. Все споры и разногласия, вытекающие из Договора или в связи с ним, в том числе касающиеся его исполнения, нарушения или действительности, решаются СПВБ и Участником клиринга путем переговоров.
- 2.4.2. СПВБ и Участник клиринга обязаны соблюдать претензионный порядок урегулирования споров и разногласий, возникающих из Договора.
- 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, и доказательства, подтверждающие их, со ссылкой на соответствующие нормы материального права;
- 2.4.3.4. перечень прилагаемых к претензии документов и других доказательств;
- 2.4.3.5. иные сведения, необходимые для урегулирования спора.
- 2.4.4. Сторона, получившая претензию, рассматривает ее в срок, не превышающий 10 рабочих дней с даты получения претензии.
- 2.4.5. В случае, если сторонам не удалось разрешить спор путем переговоров, спор подлежит передаче в Арбитражный суд г. Санкт-Петербурга и Ленинградской области.

3. Требования к Участникам клиринга

3.1. Категории Участников клиринга

- 3.1.1. Участники клиринга делятся на пять категорий: категория «Ц», категория «Ф», категория «И», категория «Б», категория «В».
- 3.1.2. Участник клиринга принадлежит к категории «Ц», если он является Банком России.
- 3.1.3. Участник клиринга принадлежит к категории «Ф», если он является профессиональным участником рынка ценных бумаг и совершает сделки с ценными бумагами на организованных торгах у Организатора торговли.
- 3.1.4. Участник клиринга принадлежит к категории «Б», если он является кредитной организацией, созданной в соответствии с законодательством РФ, и совершает сделки с иностранной валютой на организованных торгах у Организатора торговли или сделки на денежном рынке.
- 3.1.5. Участник клиринга принадлежит к категории «И», если он выступает в качестве Инициатора торгов в соответствии с Правилами организованных торгов и внутренними нормативными документами СПВБ и использует для исполнения обязательств по итогам клиринга свой торговый банковский счет, открытый в Расчетной организации.
- 3.1.6. Участник клиринга принадлежит к категории «В», если он выступает в качестве Инициатора торгов в соответствии с Правилами организованных торгов и внутренними нормативными документами СПВБ и использует для исполнения обязательств по итогам клиринга средства, находящиеся на клиринговом счете СПВБ.
- 3.1.7. Один Участник клиринга может принадлежать одновременно к нескольким категориям Участников клиринга, если он удовлетворяет требованиям настоящих Правил, предъявляемым к таким Участникам клиринга.

3.2. Требования к лицу, намеревающемуся стать Участником клиринга.

- 3.2.1. Лицо, намеревающееся стать Участником клиринга (далее – Кандидат в Участники клиринга), обязано выполнить следующие требования:
 - 3.2.1.1. присоединиться к Договору, условия которого предусмотрены настоящими Правилами путем заполнения и подписания бланка Договора, содержащегося в Приложении №1;



- 3.2.1.2. предоставить СПВБ доверенность на передачу/получение документов, выданную ответственному лицу Участника клиринга по установленной форме (Приложение №5);
- 3.2.1.3. предоставить СПВБ заполненную анкету Участника клиринга (Приложение №4);
- 3.2.1.4. открыть торговые банковские счета в Расчетной организации (за исключением Кандидата в Участники клиринга категории «В»);
- 3.2.2. Кандидатам в Участники клиринга категории «Ф» и категории «Ц», необходимо дополнительно:
 - 3.2.2.1. открыть торговые счета депо в Расчетном депозитарии;
 - 3.2.2.2. выдать СПВБ Уведомление о взаимосвязи торгового счета депо и торгового банковского счета Участника клиринга (Приложение № 3).
- 3.2.3. Если Кандидат в Участники клиринга категории «Б» или категории «Ф», ранее предоставил СПВБ как Организатору торговли комплект документов для вступления в одну из секций СПВБ, содержащий документы, перечисленные ниже в подпунктах настоящего пункта, то он освобождается от предоставления указанных документов. В иных случаях Кандидат в Участники клиринга обязан предоставить следующие документы:
 - 3.2.3.1. Нотариально удостоверенные копии учредительных документов (со всеми изменениями и дополнениями);
 - 3.2.3.2. Нотариально удостоверенные копии документов, подтверждающих внесение записей в Единый государственный реестр юридических лиц о юридическом лице, о регистрации устава и изменений в устав;
 - 3.2.3.3. Нотариально удостоверенная копия документа о постановке на учет в налоговом органе;
 - 3.2.3.4. Нотариально удостоверенные копии лицензий профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской и/или дилерской деятельности, и/или деятельности по управлению ценными бумагами (для категории «Ф»);
 - 3.2.3.5. Нотариально удостоверенная копия лицензии Банка России на право совершения банковских операций (для категории «Б»);
 - 3.2.3.6. Нотариально удостоверенные копии действующих квалификационных аттестатов руководителя организации (единоличного исполнительного органа организации – для не кредитных организаций) и контролёра организации (начальника отдела внутреннего контроля) (для категории «Ф»);
 - 3.2.3.7. Заверенные Кандидатом в Участники клиринга копии оборотной ведомости по счетам бухгалтерского учета, отчета о финансовых результатах, расчёта собственных средств (капитала) за последний отчетный период, предшествующий дате подачи документов (для категории «Б»);
 - 3.2.3.8. Заверенные Кандидатом в Участники клиринга копии бухгалтерского баланса, отчёта о финансовых результатах, расчёта размера собственных средств (по форме, утвержденной Банком России) за последний отчетный период, предшествующий дате подачи документов (для категории «Ф»);
 - 3.2.3.9. Заверенные в установленном порядке копии документов, подтверждающих полномочия должностных лиц Кандидата в Участники клиринга на подписание от его имени документов;



- 3.2.3.10. Нотариально удостоверенная карточка с образцами оттиска печати и подписей лиц Кандидата в Участники клиринга, наделённых правом первой и второй подписи;
- 3.2.4. Кандидат в Участники клиринга категории «И» обязан предоставить документы, предусмотренные пп. 3.2.3.1–3.2.3.3, 3.2.3.9, 3.2.3.10, и дополнительно согласовать с СПВБ текст Генерального соглашения, на основании которого будут совершаться сделки.
- 3.2.5. Кандидат в Участники клиринга категории «Б» должен дополнительно оформить распоряжение на списание денежных средств с торгового банковского счета при совершении сделок в Секции межбанковского кредитного рынка (далее – Секция МКР) (Приложение № 2). Участник клиринга любой другой категории может оформить распоряжение по форме Приложения №2 в отношении всех свободных денежных средств на торговом банковском счете.

3.3. Порядок регистрации Участников клиринга и клиентов Участника клиринга

- 3.3.1. СПВБ на основании предоставленной Участниками клиринга информации осуществляет регистрацию Участников клиринга и присваивает каждому Участнику клиринга Уникальный код в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России.
- 3.3.2. СПВБ осуществляет регистрацию Участника клиринга не позднее следующего рабочего дня после получения анкеты.
- 3.3.3. В случае если Участник клиринга осуществляет доверительное управление, данному Участнику клиринга присваиваются Уникальные коды по количеству учредителей доверительного управления.
- 3.3.4. СПВБ осуществляет регистрацию клиентов Участника клиринга и кодов указанных лиц.
- 3.3.5. В случае, если Участники клиринга являются Участниками торгов на СПВБ, выступающей в качестве Организатора торговли, уникальные коды Участнику клиринга могут присваиваться на основании кодов, присвоенных этим лицам Организатором торговли, если это не противоречит действующим нормативным актам Банка России.
- 3.3.6. СПВБ проставляет присвоенный код в форме поручения на проведение клиринга, вносит его в «Реестр участников клиринга» или «Реестр клиентов участника клиринга» и информирует Участника клиринга о присвоенных кодах в порядке, установленном настоящими Правилами для предоставления отчетов. Дополнительно СПВБ может использовать сокращенный код, позволяющий идентифицировать Участника клиринга, но не содержащий всех необходимых элементов Уникального кода (код Участника клиринга).
- 3.3.7. В случае, если по требованию Клиента Участника клиринга, Участник клиринга открыл отдельный специальный торговый счет Участника клиринга для совершения операций с денежными средствами такого Клиента, СПВБ осуществляет клиринг обязательств, расчеты по которым проводятся за счет указанного Клиента Участника клиринга, после регистрации такого Клиента в клиринговой системе при выполнении условий, установленных п.3.3.8.
- 3.3.8. Для регистрации в клиринговой системе Клиента, указанного в п.3.3.7. необходимо открыть специальный торговый счет депо в Расчетном депозитарии для учета индивидуального клирингового обеспечения, которое будет



использоваться для исполнения обязательств такого Клиента Участника клиринга, и предоставить Уведомление (Приложение №3) о взаимосвязи указанного торгового счета депо со специальным торговым счетом, указанным в п.3.3.7.

3.4. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

- 3.4.1. СПВБ вправе прекратить или приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в отношении всех обязательств, допускаемых к клирингу, или прекратить или приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию отдельных видов обязательств, например, обязательств, вытекающих из сделок на определенном рынке (в определенной секции Организатора торговли).
- 3.4.2. Допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в отношении всех обязательств прекращается в случае отказа СПВБ от исполнения Договора в соответствии с п.2.3.2 настоящих Правил.
- 3.4.3. СПВБ прекращает доступ к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «Ф» в случае отзыва у него лицензий профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской, дилерской деятельности или деятельности по управлению ценными бумагами.
- 3.4.4. СПВБ прекращает доступ к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «Б» в случае отзыва у него лицензии на осуществление банковских операций.
- 3.4.5. В случае, если Участник клиринга принадлежит одновременно к категории «Б» и категории «Ф», то СПВБ прекращает допуск указанного Участника клиринга к клиринговому обслуживанию всех обязательств в случае отзыва у него лицензии на осуществление банковских операций. В случае отзыва у указанного Участника клиринга лицензий профессионального участника рынка ценных бумаг, СПВБ прекращает доступ к клиринговому обслуживанию этого Участника клиринга только в отношении обязательств, вытекающих из сделок, совершенных на фондовом рынке. СПВБ имеет право приостановить доступ к клиринговому обслуживанию указанного Участника клиринга в отношении всех иных обязательств.
- 3.4.6. СПВБ прекращает доступ к клиринговому обслуживанию Участника клиринга любой категории в случае введения в его отношении процедур банкротства. При этом СПВБ осуществляет все действия, установленные подразделом 5.9 настоящих Правил.
- 3.4.7. СПВБ прекращает доступ к клиринговому обслуживанию Участника клиринга любой категории в случае расторжения Договора в соответствии с подразделом 2.2 настоящих Правил.
- 3.4.8. СПВБ приостанавливает доступ Участника клиринга категории «Ф» к клиринговому обслуживанию обязательств по сделкам на фондовом рынке, в случае, если приостановлено действие его лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской или дилерской деятельности, или деятельности по управлению ценными бумагами.
- 3.4.9. СПВБ приостанавливает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в случае применения Банком России в отношении этого



Участника клиринга санкций (в том числе запрета на совершение определенных операций), делающих невозможным совершение сделок, обязательства по которым допускаются к клирингу.

- 3.4.10. СПВБ приостанавливает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в случае блокировки (приостановления совершения операций, ареста, закрытия) 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.
- 3.4.11. СПВБ имеет право приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в случае, если Участник клиринга не оплатил услуги СПВБ в порядке и сроки, установленные Тарифами СПВБ.
- 3.4.12. Допуск к клиринговому обслуживанию прекращается или приостанавливается с момента завершения проведения клиринга и осуществления расчетов по сделкам Участника клиринга, совершенным до получения СПВБ информации о наличии оснований для прекращения или приостановления допуска к клиринговому обслуживанию. Обязательства Участника клиринга по сделкам, совершенным после получения указанной информации, к клирингу не допускаются.
- 3.4.13. СПВБ не позднее рабочего дня, следующего за днем прекращения или приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, информирует Участника клиринга о данном факте. Информирование осуществляется способом, предусмотренным для направления отчетов.
- 3.4.14. В случае если допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию был приостановлен, допуск восстанавливается на следующий рабочий день, после прекращения действия оснований приостановления допуска, указанных в настоящих Правилах.
- 3.4.15. СПВБ информирует Участника клиринга о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию в порядке, установленном для направления Участнику клиринга отчетов.

4. Права и обязанности СПВБ и Участников клиринга

4.1. Обязанности СПВБ

- 4.1.1. Осуществлять определение обязательств Участников клиринга по сделкам клирингового пула в соответствии с Договором и настоящими Правилами.
- 4.1.2. Обеспечивать обособленный учет обязательств каждого Участника клиринга посредством ведения клиринговых регистров.
- 4.1.3. Осуществлять прием и обработку информации от Расчетного депозитария и Расчетной организации о размерах остатков ценных бумаг и денежных средств на торговых счетах Участников клиринга.
- 4.1.4. Осуществлять формирование и передачу в Расчетный депозитарий и Расчетную организацию распоряжений на проведение операций по торговым счетам Участников клиринга по итогам сделок, а также учет и хранение данных



распоряжений посредством ведения «Реестра распоряжений, направленных расчетному депозитарию» и «Реестра распоряжений, направленных расчетной организации».

- 4.1.5. Осуществлять контроль исполнения в Расчетном депозитарии и Расчетной организации распоряжений, содержащих нетто-обязательства и нетто-требования Участников клиринга, рассчитанные по результатам клиринга.
- 4.1.6. Осуществлять формирование отчетов по итогам клиринга для каждого Участника клиринга и каждого его клиента и их передачу Участникам клиринга в сроки, установленные настоящими Правилами.
- 4.1.7. Организовать систему мер по защите информации в соответствии с «Порядком хранения и защиты информации».
- 4.1.8. Осуществлять дублированное хранение информации о сделках, остатках на торговых и клиринговых счетах денежных средств и ценных бумаг, результатах клиринга, переданных в Расчетную организацию и Расчетный депозитарий распоряжений.
- 4.1.9. Организовать систему управления рисками при осуществлении клиринговой деятельности.
- 4.1.10. Для обеспечения исполнения обязательств организовать использование индивидуального клирингового обеспечения.
- 4.1.11. Вести аналитический учет средств Участников клиринга и клиентов Участников клиринга, находящихся на клиринговом счете СПВБ.

4.2. Права СПВБ

- 4.2.1. Расторгнуть Договор в одностороннем порядке, установленном подразделом 2.2 настоящих Правил, в случае неисполнения Участником клиринга своих обязанностей.

4.3. Обязанности Участника клиринга

- 4.3.1. Выполнять требования настоящих Правил к Участникам клиринга и незамедлительно информировать СПВБ о несоответствии указанным требованиям.
- 4.3.2. Оплачивать клиринговые услуги в соответствии с Тарифами СПВБ
- 4.3.3. В случае внесения изменений в документы, перечисленные в п.3.2.3, Участник клиринга обязан предоставить СПВБ новые редакции документов, заверенные в установленном п.3.2.3 порядке.
- 4.3.4. Взаимодействовать с СПВБ в порядке, определенном настоящими Правилами.
- 4.3.5. Исполнять положения настоящих Правил.

4.4. Права Участника клиринга

- 4.4.1. Получать клиринговые услуги надлежащего качества. Требовать от СПВБ предоставления клиринговых услуг в объеме и на условиях, установленных настоящими Правилами.



- 4.4.2. Расторгнуть Договор в порядке, установленном подразделом 2.2 настоящих Правил.
- 4.4.3. Принадлежать к одной из категорий Участников клиринга или к нескольким категориям одновременно, если это возможно в соответствии с настоящими Правилами.

5. Порядок проведения клиринга

5.1. Порядок и условия допуска обязательств к клирингу. Взаимодействие с Расчетной организацией и Расчетным депозитарием

- 5.1.1. К клирингу допускаются обязательства по сделкам с иностранной валютой, по сделкам с ценными бумагами (в том числе по сделкам РЕПО), по депозитным сделкам, по кредитным сделкам. К клирингу допускаются только обязательства по сделкам, совершенным у Организатора торговли.
- 5.1.2. При осуществлении клиринга с полным обеспечением обязательства допускаются к клирингу после процедуры контроля обеспечения (подраздел 5.4 настоящих Правил). Процедура контроля обеспечения проводится на основании информации, полученной от Расчетной организации и Расчетного депозитария. При осуществлении клиринга с частичным обеспечением обязательства допускаются к клирингу в случае их соответствия лимитам, рассчитанным согласно подразделу 10.4 Правил.
- 5.1.3. Порядок приема и обработки информации от Расчетной организации и Расчетного депозитария о размерах остатков на торговых счетах Участников клиринга и клиринговых счетах СПВБ определяется Правилами (подразделы 12.2 и 12.3) и договором СПВБ с Расчетными депозитариями и Расчетными организациями и предусматривает следующие основные условия:
 - 5.1.3.1. порядок доступа к информации и условия соблюдения конфиденциальности;
 - 5.1.3.2. виды и форматы принимаемых и передаваемых документов;
 - 5.1.3.3. сроки и порядок передачи документов;
 - 5.1.3.4. полномочия сотрудников СПВБ, Расчетной организации и Расчетного депозитария, осуществляющих указанные операции;
 - 5.1.3.5. порядок обработки и контроля полученной информации;
 - 5.1.3.6. условия дублирования и резервирования каналов передачи информации;
 - 5.1.3.7. условия и сроки хранения полученных документов.
- 5.1.4. Расчетные организации передают СПВБ документы по торговым банковским счетам Участников клиринга и клиринговым счетам СПВБ в формате, согласованном в договоре между Расчетной организацией и СПВБ.
- 5.1.5. Расчетные депозитарии передают СПВБ документы по торговым счетам депо Участников клиринга в формате, согласованном в договоре между Расчетным депозитарием и СПВБ.
- 5.1.6. Время и порядок обмена документами между СПВБ и Расчетными депозитариями и СПВБ и Расчетными организациями определяется договорами между СПВБ и Расчетными депозитариями и СПВБ и Расчетными организациями.



5.2. Порядок и условия включения обязательств в клиринговый пул

- 5.2.1. Отдельные клиринговые пулы формируются по сделкам следующих видов:
- 5.2.1.1. Сделки с иностранной валютой;
 - 5.2.1.2. Сделки РЕПО;
 - 5.2.1.3. Сделки с ценными бумагами, кроме сделок РЕПО;
 - 5.2.1.4. Депозитные сделки
 - 5.2.1.5. Кредитные сделки.
- 5.2.2. В клиринговый пул включаются обязательства по сделкам соответствующего вида, срок исполнения которых наступил.
- 5.2.3. Клиринговые пулы формируются в течение рабочего дня во время, установленное «Внутренним регламентом клиринговой организации» (далее – Внутренний регламент СПВБ).
- 5.2.4. Обязательства по сделкам, заключенным у Организатора торговли на различных рынках, торговых сегментах, в ходе различных торговых режимов и имеющие различные условия расчетов, включаются в отдельные клиринговые пулы.

5.3. Порядок проведения клиринга. Расчет нетто-обязательств и нетто-требований

- 5.3.1. На основании реестров сделок СПВБ определяет нетто-обязательства и нетто-требования Участников клиринга по ценным бумагам и денежным средствам (в том числе нетто-обязательства и нетто-требования, возникшие из сделок Участника клиринга, совершенных по поручению клиентов Участников клиринга).
- 5.3.2. Нетто-обязательства (нетто-требования) Участника клиринга (клиента Участника клиринга) рассчитывается по формуле:

$НО = СТ - СО$, где:

НО - нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по определенному торговому счету или в отношении аналитического счета для учета средств Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ;

СТ - сумма требований Участника клиринга по этому торговому или аналитическому счету, рассчитываемая по всем сделкам, обязательства по которым включаются в клиринговый пул.

СО - сумма обязательств Участника клиринга по этому торговому или аналитическому счету, рассчитываемая по всем сделкам, обязательства по которым включаются в клиринговый пул.

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

НО по торговому банковскому счету определяется в валюте соответствующего торгового банковского счета, по аналитическому счету в валюте соответствующего клирингового счета СПВБ.



НО по торговому счету депо определяется в разрезе каждого выпуска ценных бумаг.

- 5.3.3. Для сделок купли-продажи ценных бумаг, обязательство (требование) по ценным бумагам равно количеству ценных бумаг, проданных (купленных) в соответствии с заключенными сделками, срок исполнения которых наступил. Участник клиринга имеет обязательство (требование) по ценным бумагам, если выступает продавцом (покупателем) ценных бумаг соответственно.
- 5.3.4. Для сделок купли-продажи ценных бумаг, обязательство (требование) по денежным средствам равно стоимости ценных бумаг, купленных (проданных) в соответствии с заключенными сделками, срок исполнения которых наступил. Участник клиринга имеет обязательство (требование) по денежным средствам, если выступает покупателем (продавцом) ценных бумаг соответственно.
- 5.3.5. Для сделок РЕПО в день исполнения первых частей сделок, обязательство (требование) по ценным бумагам равно количеству ценных бумаг, проданных (купленных) в соответствии с заключенными сделками. Участник клиринга имеет обязательство (требование) по ценным бумагам, если выступает продавцом (покупателем) ценных бумаг по первой части сделки РЕПО соответственно.
- 5.3.6. Для сделок РЕПО в день исполнения вторых частей сделок, обязательство (требование) по ценным бумагам равно количеству ценных бумаг, подлежащих возврату в соответствии с условиями исполнения второй части сделки РЕПО. Участник клиринга имеет обязательство (требование) по ценным бумагам, если выступает продавцом (покупателем) ценных бумаг по второй части сделки РЕПО соответственно.
- 5.3.7. Для сделок РЕПО в день исполнения первых и вторых частей сделок РЕПО, обязательство (требование) по денежным средствам равно сумме РЕПО, рассчитанной на соответствующую дату. Участник клиринга имеет обязательство (требование) по денежным средствам в день исполнения первой и второй части сделки РЕПО, если выступает покупателем (продавцом) ценных бумаг по первой или второй части сделки РЕПО соответственно.
- 5.3.8. Для сделок с иностранной валютой, обязательство (требование) по иностранной валюте равно сумме иностранной валюты, проданной (купленной) в соответствии с заключенными сделками, срок исполнения которых наступил. Участник клиринга имеет обязательство (требование) по иностранной валюте, если выступает продавцом (покупателем) иностранной валюты соответственно.
- 5.3.9. Для сделок с иностранной валютой, обязательство (требование) по российским рублям равно стоимости иностранной валюты, купленной (проданной) в соответствии с заключенными сделками, срок исполнения которых наступил. Участник клиринга имеет обязательство (требование) по российским рублям, если выступает покупателем (продавцом) иностранной валюты соответственно.
- 5.3.10. Для сделок с кредитами и депозитами, обязательство (требование) по денежным средствам в день исполнения обязательства по предоставлению кредитов, размещению депозитов равно сумме кредитов, депозитов. Участник



клиринга имеет обязательство (требование) по денежным средствам, если размещает (привлекает) денежные средства соответственно.

- 5.3.11. Для сделок с кредитами и депозитами, обязательство (требование) по денежным средствам в день исполнения обязательств по возврату кредитов (депозитов) (либо их части), равно сумме (остатку суммы) выданных кредитов (размещенных депозитов) и процентов за их использование (за исключением случая, установленного п.5.3.12), подлежащих уплате на дату исполнения обязательств. Участник клиринга имеет обязательство по денежным средствам, если возвращает ранее привлеченные в кредит или депозит денежные средства. Участник клиринга имеет требование по денежным средствам, если ему причитаются возвращаемые денежные средства, размещенные ранее на депозитах или выданных в кредит.
- 5.3.12. Если документами, определяющими порядок расчетов по сделкам с определенными Биржевыми инструментами денежного рынка, установлено, что расчеты по некоторым обязательствам из сделки осуществляются без участия СПВБ, то обязательства Участников клиринга по денежным средствам рассчитываются без учета указанных обязательств.
- 5.3.13. Если документами, определяющими совершение сделок с определенным Биржевым инструментом, установлено, что комиссионное вознаграждение Организатора торговли по сделке включается в расчет обязательств, то обязательства по денежным средствам рассчитываются с учетом указанной комиссии.

5.4. Процедура контроля обеспечения

- 5.4.1. Обеспеченность ценными бумагами и денежными средствами всех сделок Участника клиринга, входящих в клиринговый пул, контролируется процедурами контроля обеспечения.
- 5.4.2. СПВБ проверяет обеспеченность сделок Участника клиринга ценными бумагами путем сравнения значений клиринговых регистров, перечисленных в подразделе 8.2, со значениями клиринговых регистров, перечисленных в подразделе 8.1 и содержащих информацию о значениях остатков на торговых счетах депо Участников клиринга после получения данных из Расчетного депозитария. Сравнение производится только для отрицательных значений регистров обязательств.
- 5.4.3. В том случае, когда модули значений нетто-обязательств Участников клиринга по ценным бумагам не превышают значения клиринговых регистров, содержащих информацию о начальных значениях остатков по ценным бумагам на торговых счетах депо Участников клиринга, сделки Участника клиринга считаются обеспеченными ценными бумагами.
- 5.4.4. СПВБ проверяет обеспеченность сделок Участника клиринга денежными средствами путем сравнения значений клиринговых регистров, перечисленных в подразделе 8.4, со значениями клиринговых регистров, перечисленных в пп.8.3.2, 8.3.5, 8.3.9, 8.3.10 и содержащих информацию о сумме денежных средств, свободных от обязательств, на торговых банковских счетах Участников клиринга или аналитических счетах для учета средств Участников клиринга на



клиринговых счетах СПВБ. Вычисление значений регистров, указанных в пп. 8.3.2, 8.3.5, 8.3.9, 8.3.10 производится на основании значений регистров, указанных в пп. 8.3.1, 8.3.3, 8.3.4, 8.3.6, 8.3.7, 8.3.8, 8.3.11, 8.3.12, 8.3.13, 8.3.14 после получения данных из Расчетной организации. Сравнение производится только для отрицательных значений регистров обязательств.

- 5.4.5. В том случае, когда модули значений нетто-обязательств Участников клиринга по денежным средствам не превышают значения клиринговых регистров, содержащих информацию о свободных денежных средствах на торговых банковских счетах Участников клиринга, сделки Участника клиринга считаются обеспеченными денежными средствами.

5.5. Порядок и условия исключения обязательств из клирингового пула

- 5.5.1. В случае, когда при проверке обеспеченности сделок модули значений нетто-обязательств Участников клиринга по денежным средствам превышают значения клиринговых регистров, содержащих информацию о свободных денежных средствах Участников клиринга, СПВБ не осуществляет неттинг по всем сделкам клирингового пула. СПВБ в этом случае осуществляет исключение обязательств по необеспеченным сделкам из клирингового пула. Исключению подлежат только обязательства по сделкам, относящимся к торговым банковским счетам (аналитическим счетам для учета средств на клиринговом счете), в отношении которых выявлен недостаток обеспечения.
- 5.5.2. СПВБ исключает обязательства из клирингового пула таким образом, чтобы в результате был исполнен максимально возможный объем обязательств всех Участников клиринга. В случае, если критерий максимальной исполнения обязательств не позволяет однозначно определить исключаемые обязательства (т.е. максимального исполнения можно добиться, исключая или одни, или другие обязательства) в первую очередь исключаются обязательства по сделкам, совершенным в более позднее время. Время совершения сделки определяется по данным Организатора торговли, в том числе по номеру сделки, присвоенному Организатором торговли. Изложенные в настоящем пункте критерии применяются для всех случаев, за исключением специально указанных в данном подразделе.
- 5.5.3. Обязательства по сделкам с ценными бумагами исключаются в следующем порядке:
- 5.5.3.1. обязательства по второй части сделки РЕПО;
 - 5.5.3.2. обязательства по исполнению сделок (в том числе первой части сделки РЕПО) с кодом расчетов “Sn”;
 - 5.5.3.3. обязательства по иным сделкам.
- 5.5.4. В случае, если Участник клиринга, по торговому счету которого выявлен недостаток обеспечения имеет обязательства по этому торговому счету по вторым частям сделок РЕПО, срок исполнения которых наступил, СПВБ исключает обязательства по второй части сделки РЕПО из клирингового пула и передает информацию о неисполненных сделках Организатору торговли для урегулирования в соответствии с Правилами торговли. Исключение указанных обязательств из клирингового пула производится в соответствии с п. 5.5.2.
- 5.5.5. В случае, если после исключения из клирингового пула обязательств по исполнению вторых частей сделок РЕПО Участник клиринга имеет



необеспеченные обязательства из клирингового пула исключаются обязательства по сделкам с кодом расчетов «Sn». При исключении из клирингового пула обязательств по сделкам с кодом расчетов «Sn», СПВБ включает в клиринговый пул обязательства Участника клиринга по уплате возмещения в соответствии с п.6.1.6 настоящих Правил. Исключение обязательств из клирингового пула производится в соответствии с п. 5.5.2.

5.5.6. В случае, если после исключения из клирингового пула необеспеченных обязательств по вторым частям сделок РЕПО и по исполнению обязательств по сделкам с кодом расчетов «Sn» обеспечения недостаточно для исполнения обязательств по иным сделкам, эти обязательства исключаются из клирингового пула.

5.5.7. В случае выявления недостатка обеспечения по кредитным сделкам у Участника клиринга, выступающего в качестве заемщика, из клирингового пула исключаются все обязательства данного Участника клиринга. Исполнение обязательств в этом случае осуществляется в соответствии с правилами, установленными Генеральными соглашениями для соответствующих сделок.

5.5.8. В случае недостатка обеспечения по депозитным сделкам у Участника клиринга категории «В», из клирингового пула исключаются все обязательства данного Участника клиринга в отношении тех Участников клиринга категории «Б», которые имеют нетто-требования (положительное значение НО, вычисленного в соответствии с п.5.3.2 настоящих Правил) в отношении указанного Участника клиринга категории «В».

5.5.9. В случае недостатка обеспечения по депозитным сделкам, заключенным с Участником клиринга категории «В» у Участника клиринга категории «Б», из клирингового пула исключаются все обязательства указанного Участника клиринга с Участником клиринга категории «В», в отношении которого выявлен недостаток обеспечения.

5.5.10. В случае недостатка обеспечения по сделкам в Секции МКР, кроме случаев, указанных в п.5.5.7, п.5.5.8 и п. 5.5.9, из клирингового пула исключаются обязательства в соответствии с п. 5.5.2.

5.5.11. В случае недостатка обеспечения Участника клиринга по сделкам с иностранной валютой из клирингового пула исключаются обязательства в соответствии с п. 5.5.2.

5.5.12. В случае исключения из клирингового пула сделок с иностранной валютой у Участника клиринга, допустившего отсутствие обеспечения на счете, возникают обязательства по заключению сделок на специальной торговой сессии, в соответствии с правилами проведения специальной торговой сессии, установленными Правилами организованных торгов СПВБ.

5.5.13. После проведения описанных в настоящем подразделе действий по исключению обязательств из клирингового пула СПВБ вновь формирует клиринговый пул и производит определение обязательств Участников клиринга.

5.5.14. Контроль результатов неттинга проводится в соответствии с алгоритмами и процедурами определения ошибок, допущенных в клиринговой системе при расчетах.

5.5.15. При проведении контроля значений клиринговых регистров СПВБ осуществляет сверку значений позиций Участников клиринга в системе торгов на момент формирования реестра сделок, по которым производится клиринг, с соответствующими значениями клиринговых регистров, содержащих



информацию о значениях остатков на торговых счетах Участников клиринга и аналитических счетах учета средств Участников клиринга на клиринговом счете СПВБ с учетом исполнения их нетто-обязательств и нетто-требований.

- 5.5.16. В том случае, когда при контроле результатов неттинга обнаружены ошибки, СПВБ осуществляет их поиск, устраняет найденные ошибки и повторно производит определение обязательств Участников клиринга.

5.6. Порядок исполнения (прекращения) обязательств по итогам клиринга

- 5.6.1. Расчеты по нетто-обязательствам и нетто-требованиям Участников клиринга по денежным средствам осуществляет Расчетная организация на основании договоров, заключенных с СПВБ и Участниками клиринга, в соответствии с Положениями Банка России и настоящими Правилами.
- 5.6.2. Расчеты по нетто-обязательствам и нетто-требованиям Участников клиринга по ценным бумагам осуществляет Расчетный депозитарий на основании договоров, заключенных с СПВБ и Участниками клиринга, в соответствии с условиями осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария и настоящими Правилами.
- 5.6.3. Все распоряжения на операции по итогам проведения расчетов создаются СПВБ на основании реестров сделок, формируемых по итогам торгов, без дополнительного подтверждения сделок со стороны Участников клиринга.
- 5.6.4. На основании значений клиринговых регистров, перечисленных в подразделах 8.2 и 8.4, СПВБ формирует и передает:
- 5.6.4.1. в Расчетный депозитарий - Распоряжение на проведение операций по разделам торговых счетов депо, которое является основанием для проведения операций по торговым счетам депо Участников клиринга;
- 5.6.4.2. в Расчетную организацию – Распоряжение на проведение операций по торговым банковским счетам, которое является основанием для проведения операций по торговым банковским счетам Участников клиринга и клиринговым счетам СПВБ.
- 5.6.5. Распоряжения, указанные в п.5.6.4, передаются в форме электронных документов. Реквизиты указанных документов, форматы и способы передачи перечисленных документов устанавливаются договорами СПВБ с Расчетными депозитариями и Расчетными организациями.
- 5.6.6. На основании полученных от СПВБ распоряжений Расчетный депозитарий и Расчетная организация осуществляют переводы ценных бумаг и денежных средств по торговым счетам Участников клиринга. Время осуществления операций определяется договорами СПВБ с Расчетной организацией и Расчетным депозитарием.
- 5.6.7. При проведении расчетов по сделкам Расчетная организация проводит списание денежных средств в рублях с торговых банковских счетов Участников клиринга (за исключением Участников клиринга категории «В») в размере их нетто-обязательств:
- 5.6.7.1. на клиринговый банковский счет СПВБ;
- 5.6.7.2. в случае присутствия в нетто-обязательствах сумм комиссионного вознаграждения СПВБ, последнее списывается на счет Расчетной организации, предназначенный для осуществления расчетов по уплате комиссионного вознаграждения Участниками клиринга по итогам торгов.



- 5.6.8. При проведении расчетов по сделкам Расчетная организация проводит зачисление денежных средств в рублях на торговые банковские счета Участников клиринга в размере их нетто-требований с клирингового банковского счета СПВБ (за исключением Участников клиринга категории «В»).
- 5.6.9. При проведении расчетов по сделкам с иностранной валютой СПВБ проводит списание денежных средств в валюте с торговых счетов Участников клиринга в размере их нетто-обязательств на клиринговый счет СПВБ и зачисления на торговые счета Участников клиринга в размере их нетто-требований с клирингового счета СПВБ.
- 5.6.10. При проведении расчетов по депозитным сделкам СПВБ в аналитическом учете по клиринговому счету проводит списание денежных средств Участников клиринга категории «В» в размере их нетто-обязательств и зачисление в размере их нетто-требований.
- 5.6.11. Расчетный депозитарий на основании Распоряжения на проведение операций по разделам торговых счетов депо осуществляет:
- 5.6.11.1. списание ценных бумаг с торговых счетов депо Участников клиринга, имеющих нетто-обязательства по ценным бумагам, и их зачисление на торговые счета депо Участников клиринга, имеющих нетто-требования по ценным бумагам по сделкам с кодом расчетов «Т0» в день Т;
- 5.6.11.2. списание ценных бумаг с торговых счетов депо Участников клиринга, имеющих нетто-обязательства по ценным бумагам, и их зачисление на торговые счета депо участников клиринга, имеющих нетто-требования по ценным бумагам по сделкам с кодом расчетов Sn и сделкам РЕПО в день исполнения обязательств.
- 5.6.12. Расчетный депозитарий осуществляет переводы по торговым счетам депо Участников клиринга в корреспонденции со специальным техническим счетом депо, не предназначенном для учета прав на ценные бумаги. Указанный специальный технический счет депо открывается в Расчетном депозитарии для технического обеспечения процедуры поставки ценных бумаг в соответствии с нетто-обязательствами и нетто-требованиями Участников клиринга. Операции по такому техническому счету производятся на основании распоряжения СПВБ как клиринговой организации. После исполнения обязательств по итогам клиринга остаток ценных бумаг на указанном счете не допускается. Наименование, обозначение и режим указанного счета депо определяется условиями депозитарной деятельности данного Расчетного депозитария в соответствии с действующим законодательством Российской Федерации.
- 5.6.13. Расчетная организация и Расчетный депозитарий передают СПВБ информацию о денежных средствах и ценных бумагах на торговых счетах Участников клиринга, сформированную по итогам обработки распоряжений, указанных в п.5.6.4, в виде отчета об остатках на торговых счетах Участников клиринга. Время и порядок обмена электронными документами определяется договорами между СПВБ и Расчетной организацией и СПВБ и Расчетным депозитарием.
- 5.6.14. Для депозитной сделки Генеральным соглашением может быть предусмотрена возможность для Инициатора торгов отказаться от исполнения сделки до проведения расчетов по размещению депозита. В этом случае, обязательства по указанной сделке могут быть прекращены путем расторжения договора, заключенного на условиях Генерального соглашения. При получении



СПВБ от Инициатора торгов уведомления о расторжении договора СПВБ, вносит в клиринговые регистры сведения о прекращении обязательств Участников клиринга по указанному договору.

5.7. Порядок проведения сверки результатов расчетов

- 5.7.1. СПВБ на основании полученных из Расчетного депозитария и Расчетной организации Отчета об остатках ценных бумаг на торговых счетах депо и Отчета об остатках денежных средств на торговых банковских счетах, сформированных по итогам обработки Распоряжения на проведение операций по разделам торговых счетов депо и Распоряжения на проведение операций по торговым банковским счетам, соответственно, присваивает значения клиринговым регистрам, перечисленным в пп.8.1.1 – 8.1.9, 8.3.1, 8.3.4, 8.3.7, 8.3.8, 8.3.13, 8.3.14 настоящих Правил.
- 5.7.2. В клиринговой системе проводится сверка значений соответствующих клиринговых регистров, указанных в п.5.7.1, с данными, полученными в результате расчетов клиринговой системы на основании предыдущих значений указанных регистров и регистров обязательств, по каждому Участнику клиринга.
- 5.7.3. При отсутствии расхождений СПВБ направляет:
- 5.7.3.1. в Расчетную организацию Уведомление о согласии на проведение операций по торговым банковским счетам Участников клиринга.
- 5.7.3.2. в Расчетный депозитарий Уведомление о согласии на проведение операций по разделам торговых счетов депо Участников клиринга.
- 5.7.4. После получения от СПВБ Уведомлений о согласии на проведение операций, Расчетная организация и Расчетный депозитарий прекращают блокировку операций по поручению Участника клиринга на торговых банковских счетах и проводят разблокировку ценных бумаг на торговых счетах депо Участников клиринга, соответственно.
- 5.7.5. С момента прекращения блокировки операций по поручению Участника клиринга на торговых счетах, расчеты по нетто-обязательствам и нетто-требованиям Участников клиринга считаются завершенными, обязательства Участников клиринга по сделкам клирингового пула считаются исполненными.
- 5.7.6. Порядок взаимодействия, время начала и сроки исполнения операций сверки определяются договорами СПВБ с Расчетной организацией и с Расчетным депозитарием.

5.8. Порядок действий в случае расхождения данных при сверке

- 5.8.1. В случае обнаружения расхождений при проведении сверки значений соответствующих клиринговых регистров с данными, полученными в результате собственных расчетов, по каждому Участнику клиринга СПВБ 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 СПВБ с Расчетной организацией и/или Расчетным депозитарием.
- 5.8.2. СПВБ, Расчетная организация и/или Расчетный депозитарий, руководствуясь собственными внутренними процедурами, предпринимают



действия, по поиску и выявлению причин, приведших к расхождению данных, и их устранению.

- 5.8.3. В зависимости от характера выявленных причин расхождения данных СПВБ, Расчетная организация или Расчетный депозитарий повторно, полностью или частично, выполняют действия, описанные в подразделе 5.6 Правил, после которых СПВБ повторно проводит сверку остатков на торговых счетах Участников клиринга в соответствии с п. 5.7 Правил.

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

- 5.9.1. В случае введения процедуры банкротства в отношении Участника клиринга или отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации все обязательства этого Участника клиринга, допущенные к клирингу, прекращаются в порядке, установленном настоящим подразделом. СПВБ рассчитывает денежные обязательства/требования, возникающие в связи с таким прекращением (далее в настоящем подразделе – ликвидационные нетто-обязательства/нетто-требования).
- 5.9.2. 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.
- 5.9.3. СПВБ рассчитывает ликвидационные нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, возникающие взамен прекращенных в соответствии с п.5.9.1, 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 сделкам:
- 5.9.3.1. заключенным Участником клиринга за свой счет,
 - 5.9.3.2. заключенным Участником клиринга за счет своих клиентов,
 - 5.9.3.3. заключенным Участником клиринга, за счет средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.
- 5.9.4. Ликвидационное нетто-обязательство/нетто-требование рассчитывается в рублях РФ и не включает в себя возмещения убытков в форме упущенной выгоды и взыскание неустоек (штрафов, пеней).
- 5.9.5. Ликвидационное нетто-обязательство / нетто-требование рассчитывается по следующей формуле:
- $$НО = \sum_i (RT_i - RO_i) + \sum_{m,j} (V_m T_j - V_m O_j) * K_m + \sum_{k,l} (S_k T_l - S_k O_l) * C_{kl},$$
- где НО – ликвидационное нетто-обязательство /нетто-требование в отношении соответствующего контрагента по сделкам соответствующего вида, указанного в п.5.9.3,



RT_i - денежное (в рублях) требование Участника клиринга по i -той сделке на дату признания Участника клиринга банкротом / отзыва лицензии на осуществление банковских операций;

RO_i - денежное (в рублях) обязательство Участника клиринга по i -той сделке 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 РФ, по сделкам соответствующего вида во всех секциях Организатора торговли и торговых сегментах; при наличии обязательств/требований по возврату средств по депозитным/кредитным сделкам или обязательств/требований по вторым частям сделок РЕПО при определении RT_i и RO_i учитывается фактический срок нахождения денежных средств у Участника клиринга или контрагента до даты признания Участника клиринга банкротом / даты отзыва лицензии (не включая указанные даты);

V_mT_j и V_mO_j - требование и обязательство в m -той валюте по j -той сделке с указанной валютой;

K_m - официальный курс m -той валюты, установленный Банком России на дату расчета ликвидационного нетто-обязательства;

S_kT_l и S_kO_l - требование и обязательство по k -той ценной бумаге по l -той сделке с этой ценной бумагой;

C_{kl} - цена k -той ценной бумаге по l -той сделке, принимаемая равной рыночной цене ценной бумаги на день предшествующий дню расчета ликвидационных нетто-обязательств. Если рыночная цена определялась более чем одним организатором торговли, используется рыночная цена определенная организатором торговли, у которого совершен наибольший объем сделок по указанной ценной бумаге. Если рыночная цена ценной бумаги не определялась значение C_{kl} принимается равным расчетной цене ценной бумаги, определенной в соответствии с Налоговым Кодексом Российской Федерации.

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

5.9.6. СПВБ направляет Участнику клиринга и его контрагентам уведомление о прекращении обязательств/требований по сделкам, допущенных к клирингу и рассчитанных в соответствии с п.5.9.5 размерах ликвидационных нетто-обязательств / нетто-требований в дату расчета.

5.9.7. Для исполнения нетто-обязательств Участника клиринга СПВБ использует денежные средства (в том числе иностранную валюту), переданные Участником клиринга для обеспечения обязательств данного Участника клиринга перед контрагентом. Для урегулирования нетто-обязательства Участника клиринга, СПВБ от имени Участника клиринга осуществляет продажу иностранной валюты не позднее рабочего дня, следующего за днем расчета нетто-обязательства.

5.9.8. В случае, установленном п.5.9.7, продажа иностранной валюты осуществляется на организованных торгах, проводимых Организатором торговли. Продажа осуществляется по цене спроса в момент времени, определенный решением Правления СПВБ. Продажа иностранной валюты осуществляется в порядке, установленном Правилами организованных торгов.



- 5.9.9. В случае, если денежных средств и иного имущества Участника клиринга недостаточно для погашения нетто-обязательств этого Участника клиринга перед контрагентом, СПВБ перечисляет контрагенту Участника клиринга средства, переданные Участником клиринга в качестве обеспечения исполнения обязательств перед указанным контрагентом, и уведомляет Участника клиринга и его контрагента об исполненной части обязательства и оставшихся неисполненными требованиях указанного контрагента.
- 5.9.10. Денежные средства и иное имущество Участника клиринга, находящиеся на торговых и клиринговых счетах после исполнения ликвидационных нетто-обязательств / нетто-требований, подлежат возврату Участнику клиринга, в том числе для включения в конкурсную массу. В этом случае СПВБ запрашивает у Участника клиринга реквизиты счетов для возврата денежных средств и иного имущества не позднее второго рабочего дня, следующего за днем расчета НО. Возврат денежных средств и иного имущества осуществляется в течение 3 (трех) рабочих дней с даты получения СПВБ от уполномоченного органа Участника клиринга письма с запрошенными реквизитами.
- 5.9.11. Денежные средства и иное имущество клиентов Участника клиринга, находящееся на специальных брокерских или специальных торговых счетах или счетах депо номинального держателя может быть передано клиентам Участника клиринга или другим Участникам клиринга в порядке, установленном законодательством Российской Федерации о банкротстве.

6. Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу

6.1. Индивидуальное клиринговое обеспечение

- 6.1.1. Индивидуальным клиринговым обеспечением является Гарантийное обеспечение. Условием формирования индивидуального клирингового обеспечения является совершение Участником клиринга сделок с Биржевыми инструментами, для которых Правлением СПВБ установлена ненулевая величина Гарантийного обеспечения.
- 6.1.2. Гарантийное обеспечение принимается только в виде денежных средств (в том числе иностранной валюты). Для сделок с ценными бумагами с полным обеспечением в Гарантийное обеспечение принимаются также ценные бумаги.
- 6.1.3. Гарантийное обеспечение учитывается на соответствующих торговых счетах Участника клиринга. Гарантийное обеспечение Участника клиринга категории «В» учитывается на клиринговом счете СПВБ, а в аналитическом учете СПВБ на аналитическом счете для учета Гарантийного обеспечения Участника клиринга, предоставившего Гарантийное обеспечение.
- 6.1.4. Порядок использования Гарантийного обеспечения регулируется настоящими Правилами. Подписание отдельного соглашения о Гарантийном обеспечении не требуется.
- 6.1.5. При совершении сделок Участником клиринга в клиринговые регистры, указанные в пп. 8.3.3, 8.3.6, 8.3.11, 8.3.12 вносятся сведения о суммах заблокированного Гарантийного обеспечения. Величина Гарантийного обеспечения устанавливается Правлением СПВБ для каждого Биржевого инструмента. В случае заключения сделок на основании Генерального



соглашения, величина Гарантийного обеспечения или порядок ее определения могут быть установлены Генеральным соглашением.

- 6.1.6. В случае, если сделка (кроме сделок с иностранной валютой) отменена из-за отсутствия денежных средств или ценных бумаг на день расчетов на торговых счетах одного из Участников клиринга при том, что Участник клиринга, являющийся другой стороной по сделке, полностью исполнил свои обязательства Участник клиринга, имеющий необеспеченные обязательства, выплачивает Участнику клиринга, являющемуся второй стороной по сделке, возмещение в размере Гарантийного обеспечения. Возмещение по сделке удерживается путем списания денежных средств с торгового счета Участника клиринга и зачисления этих денежных средств на торговый счет Участника клиринга – контрагента по этой сделке.
- 6.1.7. В случае, если сделка с иностранной валютой не исполнена из-за отсутствия денежных средств у Участника клиринга, то он заключает сделку в соответствии с п.5.5.12 настоящих Правил. Средства, полученные по вновь заключенной сделке, используются для покрытия обязательств по неисполненной сделке. В случае, если заключенная на Дополнительной торговой сессии сделка не полностью покрыла неисполненные обязательства, Гарантийное обеспечение, предоставленное указанным Участником клиринга, используется для исполнения непокрытых обязательств. Остаток Гарантийного обеспечения после исполнения обязательств переводится в состав свободных средств Участника клиринга.

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

7.1. Виды торговых и клиринговых счетов

- 7.1.1. В соответствие с договором, заключенным с Участником клиринга, Расчетная организация для учета денежных средств и проведения расчетов по результатам сделок с ценными бумагами 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).
- 7.1.2. Клиентам Участника клиринга могут быть открыты в Расчетной организации торговые банковские счета для учета собственных средств. В этом случае СПВБ осуществляет операции по таким счетам на основании обязательств Участника клиринга по сделкам, совершенным 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 оплаты вознаграждения СПВБ, Расчетной организации и Расчетному депозитарию, для исполнения обязательств и обеспечения исполнения обязательств по сделкам, заключенным Участником клиринга за свой счет.



- 7.1.4. На специальном брокерском счете учитываются средства клиентов Участника клиринга, предназначенные для оплаты вознаграждения СПВБ, Расчетной организации и Расчетному депозитарию, исполнения обязательств и обеспечения исполнения обязательств по сделкам, заключенным Участником клиринга за счет своих клиентов.
- 7.1.5. На специальном торговом счете учитываются средства клиентов Участника клиринга – кредитной организации, предназначенные для оплаты вознаграждения СПВБ, Расчетной организации и Расчетному депозитарию, исполнения обязательств и обеспечения исполнения обязательств по сделкам, заключенным Участником клиринга за счет своих клиентов.
- 7.1.6. 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 сделок открывает Участнику клиринга или Держателю торговые счета депо.
- 7.1.7. На торговых счетах депо учитываются ценные бумаги, предназначенные для исполнения обязательств, допущенных к клирингу.
- 7.1.8. Торговые счета депо подразделяются на:
- 7.1.8.1. торговый счет депо владельца, открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве;
 - 7.1.8.2. торговый счет депо номинального держателя, открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;
 - 7.1.8.3. торговый счет депо владельца с попечителем, открытый клиенту Участника клиринга, являющегося попечителем этого счета;
 - 7.1.8.4. торговый счет депо доверительного управляющего, открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве доверительного управления;
 - 7.1.8.5. торговый счет депо эмитента, открытый эмитенту для учета размещаемых или погашаемых ценных бумаг. Оператором указанного счета выступает Участник клиринга;
 - 7.1.8.6. казначейский торговый счет депо, открытый Эмитенту для приобретения или отчуждения ценных бумаг в процессе их обращения.
 - 7.1.8.7. торговый счет депо номинального держателя, открытый Держателю для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве;
 - 7.1.8.8. торговый счет депо номинального держателя, открытый Держателю для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;
 - 7.1.8.9. торговый счет депо, открытый Держателю для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве доверительного управления;
 - 7.1.8.10. торговый счет депо иностранного номинального держателя, открытый иностранному номинальному держателю для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;
 - 7.1.8.11. торговый счет депо иностранного уполномоченного держателя, открытый иностранному уполномоченному держателю, для учета ценных бумаг, переданных в управление иностранному уполномоченному держателю, обслуживаемому Участником клиринга.
- 7.1.9. В соответствии с договором между СПВБ и Расчетной организацией, последняя открывает СПВБ клиринговые счета для учета денежных средств (в



том числе в иностранной валюте), которые используются для исполнения обязательств, допущенных к клирингу.

7.2. Порядок проведения операций по торговым банковским счетам

- 7.2.1. Операции по торговым банковским счетам производятся согласно распоряжениям СПВБ в порядке, установленном подразделом 5.6 настоящих Правил или по распоряжению Участника клиринга с согласия СПВБ, в порядке, установленном настоящим подразделом.
- 7.2.2. Денежные средства на торговые банковские счета для исполнения обязательств и обеспечения исполнения обязательств зачисляются следующими способами:
- 7.2.2.1. по распоряжению Участника клиринга с банковского (корреспондентского) счета Участника клиринга;
 - 7.2.2.2. по распоряжению СПВБ с клирингового счета СПВБ, в порядке, установленном подразделом 5.6.
- 7.2.3. Денежные средства с торговых банковских счетов списываются следующими способами:
- 7.2.3.1. по распоряжению Участника клиринга с согласия СПВБ или по распоряжению СПВБ на основании распоряжения Участника клиринга на банковский (корреспондентский) счета Участника клиринга;
 - 7.2.3.2. по распоряжению СПВБ на клиринговый счет СПВБ или (для комиссионного вознаграждения) на счет Расчетной организации, в порядке, установленном подразделом 5.6.
- 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.
- 7.2.5. В период, проведения торговой сессии, зачисление на торговые банковские счета Участника клиринга производится на основании согласия СПВБ на зачисление, данного Расчетной организацией 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 СПВБ, получаемого Расчетной организацией в отношении каждой суммы по определенному торговому банковскому счету.
- 7.2.7. СПВБ после получения запроса на списание денежных средств с торгового банковского счета Участника клиринга осуществляет проверку достаточности денежных средств на этом счете. Сумма денежных средств на торговом банковском счете Участника клиринга, остающаяся после списания, должна обеспечивать исполнение обязательств Участника клиринга по сделкам, срок исполнения которых наступает в день получения запроса на списание после окончания текущей клиринговой сессии, и необходимый уровень Гарантийного обеспечения для сделок, срок исполнения которых не наступает в день получения запроса на списание, исполнение обязательств по которым



производится с использованием торгового банковского счета, указанного в запросе.

- 7.2.8. При успешной проверке достаточности денежных средств, СПВБ направляет Расчетной организации подтверждение, на основании которого Расчетная организация производит списание денежных средств. Если результат проверки отрицательный, СПВБ направляет Расчетной организации отказ в подтверждении, который служит основанием для отказа Расчетной организацией в исполнении платежного поручения Участника клиринга.
- 7.2.9. Списание денежных средств с торговых банковских счетов может производиться на основании Уведомления о согласии на проведение операций по торговым банковским счетам Участников клиринга, сформированного по окончании клиринговой сессии в отношении свободного остатка денежных средств на торговых банковских счетах, указанных в этом Уведомлении.
- 7.2.10. Списание денежных средств с торговых банковских счетов может производиться на основании Распоряжения на списание денежных средств (Приложение №2), предоставленном СПВБ Участником клиринга.
- 7.2.11. 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 5.6 настоящих Правил.
- 7.2.12. Участник клиринга, планирующий заключение сделок с иностранной валютой, должен зачислить на торговый банковский счет сумму денежных средств в рублях и (или) сумму денежных средств в валюте, необходимую для подачи заявок. Средства зачисляются на счет собственных средств для обеспечения сделок за свой счет или на специальный торговый счет для обеспечения сделок за счет клиентов.
- 7.2.13. Участник клиринга, имеющий нетто-обязательства по денежным средствам в рублях или в валюте по сделкам с иностранной валютой с текущей датой исполнения, заключенным за счет собственных средств, обязан зарезервировать сумму денежных средств в рублях или в валюте, необходимую для исполнения нетто-обязательств на соответствующем торговом банковском счете, с учетом зарезервированного ранее Гарантийного обеспечения. Участник клиринга, имеющий нетто-обязательства по денежным средствам в рублях или в валюте по сделкам с иностранной валютой с текущей датой исполнения, заключенным за счет средств клиентов, обязан зарезервировать сумму денежных средств в рублях или в валюте, необходимую для исполнения нетто-обязательств на соответствующем торговом банковском счете, с учетом зарезервированного ранее Гарантийного обеспечения.
- 7.2.14. Участник клиринга, планирующий заключение на текущих торгах сделок «Т0» по покупке ценных бумаг за счет собственных средств, должен зарезервировать в полном объеме сумму денежных средств, необходимую для обеспечения исполнения его обязательств по денежным средствам с текущей датой исполнения, на торговом банковском счете для учета собственных средств.
- 7.2.15. Участник клиринга, имеющий нетто-обязательства по денежным средствам по сделкам РЕПО с кодом расчетов «Sn», заключенным за счет собственных средств, с текущей датой исполнения обязан зарезервировать в полном объеме



сумму денежных средств, необходимую для исполнения обязательств на торговом банковском счете для учета собственных средств.

- 7.2.16. Участник клиринга, планирующий заключение на текущих торгах сделок «Т0» по покупке ценных бумаг в интересах клиентов, должен зарезервировать в полном объеме сумму денежных средств, необходимую для обеспечения исполнения обязательств по денежным средствам на специальном брокерском или специальном торговом счете.
- 7.2.17. Участник клиринга, имеющий нетто-обязательства по сделкам, заключенным на денежном рынке с текущей датой исполнения должен зарезервировать в полном объеме сумму денежных средств, необходимую для обеспечения исполнения обязательств на торговом банковском счете или на клиринговом счете СПВБ (для Участника клиринга категории «В») с учетом зарезервированного ранее Гарантийного обеспечения.

7.3. Порядок проведения операций по торговым счетам депо

- 7.3.1. Открытие и закрытие торгового счета депо, в отношении которого получено указание о проведении операций по распоряжению или с согласия СПВБ, производится Расчетным депозитарием с согласия СПВБ. Порядок получения согласия СПВБ на открытие торгового счета депо регулируется договором СПВБ с Расчетным депозитарием. Согласие СПВБ 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 по поручению Участника клиринга с согласия СПВБ, ценные бумаги на торговые счета депо зачисляются по поручению Участника клиринга, за исключением зачисления или списания ценных бумаг при расчетах по итогам клиринга.
- 7.3.3. 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 5.6 настоящих Правил.
- 7.3.4. Расчетный депозитарий блокирует списание ценных бумаг с торговых счетов депо по поручению Участника клиринга в течение периода времени, установленного договором с СПВБ.
- 7.3.5. После успешного проведения сверки по итогам расчетов (завершения расчетов по итогам клиринговой сессии) СПВБ направляет в Расчетный депозитарий Уведомление о согласии на проведение операций по разделам торговых счетов депо, которое означает согласие СПВБ на списание ценных бумаг с торговых счетов депо. После получения от СПВБ указанного Уведомления Расчетный депозитарий производит операции с ценными бумагами по торговым счетам депо по поручениям Участников клиринга без дополнительного согласия СПВБ до установленного договором времени блокировки.
- 7.3.6. Участник клиринга, планирующий заключение на текущих торгах сделок по продаже ценных бумаг с кодом расчетов «Т0», должен обеспечить наличие ценных бумаг в количестве, необходимом для обеспечения исполнения его обязательств по ценным бумагам на соответствующем торговом счете депо.



- 7.3.7. Участник клиринга, имеющий нетто-обязательство по ценным бумагам по сделкам РЕПО с кодом расчетов «Sn», должен обеспечить наличие ценных бумаг в количестве, необходимом для обеспечения исполнения его обязательств по ценным бумагам на соответствующем торговом счете депо.
- 7.3.8. Расчетный депозитарий информирует СПВБ о наложении ареста на ценные бумаги, учет прав на которые осуществляется на торговом счете депо. Уведомление должно быть направлено в день наложения ареста и содержать реквизиты торгового счета депо и ценных бумаг, учитываемых на этом счете, на которые наложен арест. Уведомление направляется по всем каналам связи, определенным договором между Расчетным депозитарием и СПВБ.

7.4. Порядок проведения операций по клиринговым счетам

- 7.4.1. СПВБ при осуществлении клиринговой деятельности использует клиринговые банковские счета в российских рублях и иностранной валюте. СПВБ может открывать в Расчетной организации несколько клиринговых счетов. СПВБ ведет аналитический учет средств Участников клиринга и средств клиентов Участников клиринга на клиринговом банковском счете.
- 7.4.2. Клиринговый банковский счет в рублях, открытый в Расчетной организации, используется для исполнения обязательств Участников клиринга по денежным средствам в рублях. Участники клиринга категории «В» зачисляют денежные средства на клиринговый банковский счет самостоятельно, в установленное регламентом Расчетной организации время.
- 7.4.3. В период проведения расчетов по итогам клиринга зачисление денежных средств на указанный счет осуществляется только по распоряжению СПВБ с торговых банковских счетов Участников клиринга или других клиринговых счетов СПВБ. Денежные средства зачисляются в размере нетто-обязательств Участников клиринга по сделкам, включенным в клиринговый пул, за вычетом включенной в нетто-обязательства комиссии СПВБ.
- 7.4.4. В период проведения расчетов по итогам клиринга списание денежных средств с указанного клирингового банковского счета, открытого в Расчетной организации, осуществляется по распоряжениям СПВБ в размере нетто-требований Участников клиринга по сделкам, включенным в клиринговый пул.
- 7.4.5. До начала проведения расчетов по итогам клиринга денежные средства на клиринговый банковский счет в рублях зачисляются с банковских (корреспондентских) счетов Участников клиринга категории «В».
- 7.4.6. После проведения расчетов по итогам клиринга денежные средства с клирингового банковского счета списываются на банковский (корреспондентский) счет Участника клиринга категории «В» на основании распоряжения Участника клиринга категории «В», направленного СПВБ, в размере, указанном в распоряжении, но не более остатка средств на аналитическом счете для учета средств Участника клиринга на клиринговом счете. Указанное распоряжение о списании средств должно содержать реквизиты счета Участника клиринга, на который должны быть переведены средства.
- 7.4.7. Клиринговый банковский счет в иностранной валюте используется для исполнения обязательств Участников клиринга по итогам клиринга.
- 7.4.8. В период проведения расчетов по итогам клиринга зачисление денежных средств на указанный счет осуществляется только по распоряжению СПВБ с



торговых банковских счетов Участников клиринга. Денежные средства в иностранной валюте зачисляются в размере нетто-обязательств Участников клиринга по сделкам, включенным в клиринговый пул.

- 7.4.9. В период проведения расчетов по итогам клиринга списание денежных средств в иностранной валюте с указанного клирингового банковского счета, открытого в Расчетной организации, осуществляется по распоряжениям СПВБ на торговые банковские счета Участников клиринга в размере нетто-требований Участников клиринга по сделкам, включенным в клиринговый пул.

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, зарезервированных им в Расчетном депозитарии.
- 8.1.2. Регистр «Ценные бумаги Участника клиринга – клиенты» – клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, зарезервированных ими в Расчетном депозитарии.
- 8.1.3. Регистр «Ценные бумаги клиента с попечителем Участником клиринга» – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг лица, имеющего попечителя счета депо – Участника клиринга, зарезервированных им в Расчетном депозитарии.
- 8.1.4. Регистр «Ценные бумаги Участника клиринга – ДУ» – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга, зарезервированных им в Расчетном депозитарии.
- 8.1.5. Регистр «Ценные бумаги эмитента, эмиссионный» - клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг эмитента, зарезервированных им под управлением Участника клиринга для размещения. Регистр соответствует торговому счету депо эмитента, открытому эмитенту в Расчетном депозитарии для предварительного депонирования ценных бумаг для размещения, а также для учета ценных бумаг в процессе погашения.
- 8.1.6. 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.
- 8.1.7. 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.
- 8.1.8. 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.
- 8.1.9. 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.



- 8.1.10. 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.
- 8.1.11. 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 сделок» - клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по ценным бумагам Участника клиринга, сформированных по результатам сделок, 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 сделок» - клиринговые регистры, предназначенные для учета совокупных обязательств по ценным бумагам клиентов Участника клиринга, сформированных по результатам сделок 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 сделок клиента с попечителем» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по ценным бумагам лица, имеющего попечителя - Участника клиринга, сформированных по результатам сделок с ценными бумагами, заключенных Участником клиринга по поручению указанного лица.
- 8.2.4. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга, сформированные по результатам сделок ДУ» - клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по ценным бумагам в доверительном управлении Участника клиринга, сформированных по результатам заключенных им сделок 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 эмитента – эмиссионный» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по ценным бумагам - эмитента, сформированных по результатам сделок с ценными бумагами, заключенных Участником клиринга по поручению эмитента при размещении и погашении ценных бумаг.
- 8.2.6. Регистр «Обязательства по ценным бумагам эмитента – казначейский» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по ценным



бумагам - эмитента, сформированных по результатам сделок 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 сделок 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 по сделкам на фондовом и денежном рынках. Регистр соответствует торговому банковскому счету собственных средств, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации или аналитическому счету для учета средств Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ.
- 8.3.2. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – свободные» - клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных денежных средств Участника клиринга свободных от обязательств по сделкам на фондовом и денежном рынках.



- 8.3.3. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – блокированные» - клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных денежных средств Участника клиринга блокированных под исполнение обязательств по сделкам на фондовом и денежном рынках.
- 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 брокерскому или специальному торговому счету, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации.
- 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 сделкам на фондовом рынке.
- 8.3.6. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга – блокированные» - клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств клиентов Участника клиринга блокированных под исполнение обязательств по сделкам на фондовом рынке.
- 8.3.7. Регистр «Денежные средства Участника клиринга, в рублях зарезервированные для обеспечения проведения расчетов» - клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных денежных средств Участника клиринга депонированных для заключения сделок с иностранной валютой. Регистр соответствует торговому банковскому счету собственных средств, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации для обеспечения расчетов по сделкам на валютном рынке.
- 8.3.8. Регистр «Денежные средства Участника клиринга, в иностранной валюте, зарезервированные для обеспечения проведения расчетов» – клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных денежных средств Участника клиринга в иностранной валюте. Регистр соответствует торговому банковскому счету собственных средств, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации для обеспечения расчетов по сделкам на валютном рынке.
- 8.3.9. Регистр «Денежные средства в рублях – свободные (валютный рынок)» – клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств в рублях на торговом банковском счете, свободных от исполнения обязательств по сделкам на валютном рынке. Открывается к каждому клиринговому регистру, указанному в п.8.3.7 и п.8.3.13.
- 8.3.10. Регистр «Денежные средства в валюте – свободные (валютный рынок)» – клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств в валюте, свободных от исполнения обязательств по сделкам на валютном рынке. Открывается к каждому клиринговому регистру, указанному в п.8.3.8 и п.8.3.14.
- 8.3.11. Регистр «Денежные средства в рублях – блокированные (валютный рынок)» – клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств в рублях, заблокированных в качестве гарантийного обеспечения для исполнения обязательств по сделкам на валютном рынке. Значение регистра храниться в РКС до дня исполнения этих сделок. Открывается к каждому клиринговому регистру, указанному в п.8.3.7 и п.8.3.13.
- 8.3.12. Регистр «Денежные средства в валюте – блокированные (валютный рынок)» – клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств в валюте, заблокированных в качестве гарантийного обеспечения для исполнения



обязательств по сделкам на валютном рынке. Значение регистра храниться в РКС до дня исполнения этих сделок. Открывается к каждому клиринговому регистру, указанному в п.8.3.8 и п.8.3.14.

- 8.3.13. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга, в рублях, зарезервированные для обеспечения проведения расчетов» - клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств клиентов Участника клиринга депонированных для заключения сделок с иностранной валютой. Регистр соответствует специальному торговому банковскому счету, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации для обеспечения расчетов по сделкам на валютном рынке.
- 8.3.14. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга, в иностранной валюте, зарезервированные для обеспечения проведения расчетов» – клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств клиентов Участника клиринга в иностранной валюте. Регистр соответствует специальному торговому банковскому счету, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации для обеспечения расчетов по сделкам на валютном рынке.

8.4. Клиринговые регистры по учету обязательств по денежным средствам

- 8.4.1. Регистр «Обязательства по денежным средствам, сформированные по результатам собственных сделок Участника клиринга» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным средствам Участника клиринга, сформированных по результатам собственных сделок, заключенных с ценными бумагами и инструментами денежного рынка.
- 8.4.2. Регистр «Обязательства по денежным средствам, сформированные по результатам сделок, заключенных Участником клиринга в интересах клиентов» – клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным средствам Участника клиринга, сформированных по результатам сделок, заключенных Участником клиринга с ценными бумагами в интересах клиентов.
- 8.4.3. Регистр «Обязательства по денежным средствам, сформированные по результатам собственных сделок Участника клиринга с иностранной валютой, в рублях» – клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга в рублях по собственным сделкам с иностранной валютой.
- 8.4.4. Регистр «Обязательства по денежным средствам, сформированные по результатам собственных сделок Участника клиринга с иностранной валютой, в валюте» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга в иностранной валюте по собственным сделкам с иностранной валютой.
- 8.4.5. Регистр «Обязательства по денежным средствам, торговая комиссия, в рублях» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным средствам Участника клиринга, сформированных по результатам расчета комиссионного вознаграждения организатору торгов.
- 8.4.6. Регистр «Обязательства по денежным средствам, клиринговая комиссия, в рублях» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным средствам Участника клиринга, сформированных по результатам расчета комиссионного вознаграждения клиринговой организации.
- 8.4.7. Регистр «Обязательства по денежным средствам, сформированные по результатам сделок Участника клиринга с иностранной валютой, заключенных в



интересах клиентов, в рублях» – клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга в рублях по сделкам с иностранной валютой, совершенным за счет клиентов Участника клиринга.

- 8.4.8. Регистр «Обязательства по денежным средствам, сформированные по результатам сделок Участника клиринга с иностранной валютой, заключенных в интересах клиента, в валюте» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга в иностранной валюте по сделкам с иностранной валютой, совершенным за счет клиентов 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, устанавливаются на основании информации, полученной от Расчетного депозитария в соответствии с договором СПВБ с Расчетным депозитарием.
- 8.5.2. Начальные значения клиринговых регистров учета ценных бумаг могут быть изменены 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 по запросу СПВБ.
- 8.5.3. СПВБ 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 СПВБ и Расчетным депозитарием при изменении клиринговых регистров 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 (подраздел 8.2) вносятся нетто-обязательства и нетто-требования по ценным бумагам, определяемые в соответствии с разделом 5 настоящих Правил. При этом нетто-обязательства вносятся в регистры с отрицательным знаком, а нетто-требования - с положительным.
- 8.5.6. Начальные значения клиринговых регистров денежных средств, указанных в п. 8.3.1 (кроме категории «В»), 8.3.4, 8.3.7, 8.3.8, 8.3.13, 8.3.14 устанавливаются равными величине денежных средств, находящихся на соответствующих торговых банковских счетах Участника клиринга в соответствии с данными, полученными СПВБ от Расчетной организации в порядке, установленном договором СПВБ с Расчетной организацией. Начальные значения клиринговых регистров денежных средств, указанных в п. 8.3.1 для Участников клиринга категории «В» устанавливаются равными величине денежных средств на аналитическом счете для учета средств Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ.
- 8.5.7. Начальные значения клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.3, 8.3.6, 8.3.11, 8.3.12, устанавливаются равными состоянию этих же регистров на конец предыдущего рабочего дня.
- 8.5.8. Значения клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.2, 8.3.5, 8.3.9, 8.3.10 (регистры для учета свободных средств) вычисляются как разница сумм,



учтенных на клиринговых регистрах, перечисленных в п.8.5.6 (регистры, отражающие текущее состояние торговых счетов), с суммами, учтенными на соответствующих клиринговых регистрах, перечисленных в п.8.5.7 (регистры, отражающие заблокированные средства).

- 8.5.9. Значения клиринговых регистров, указанных в п.8.5.6 изменяются каждый раз при получении от Расчетной организации новых данных о состоянии торговых банковских счетов. После чего пересчитываются значения клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.2, 8.3.5, 8.3.9, 8.3.10 в соответствие с правилом, установленным п.8.5.8.
- 8.5.10. Значения клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.3, 8.3.6, 8.3.11, 8.3.12, увеличиваются на сумму Гарантийного обеспечения по вновь заключенным сделкам после получения от Организатора торговли реестра сделок. Значения упомянутых клиринговых регистров уменьшаются на сумму Гарантийного обеспечения по сделкам, обязательства по которым исполнены. После каждого изменения указанных регистров пересчитываются значения клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.2, 8.3.5, 8.3.9, 8.3.10, в соответствие с правилом, установленным п.8.5.8.
- 8.5.11. В клиринговые регистры учета обязательств по денежным средствам (п. 8.4.1 - 8.4.4 и п. 8.4.7 – 8.4.8) вносятся нетто-обязательства и нетто-требования по денежным средствам, определяемые в соответствии с разделом 5 настоящих Правил. При этом нетто-обязательства вносятся в регистры с отрицательным знаком, а нетто-требования - с положительным.

8.6. Реестры и иные формы внутреннего учета СПВБ

- 8.6.1. «Реестр Участников клиринга». Данный реестр формируется на основании анкет Участников клиринга и содержит всю информацию по каждому Участнику клиринга, содержащуюся в анкете (Приложение №4). Записи в данный реестр производятся не позднее второго рабочего дня после передачи Участником клиринга СПВБ анкеты. Помимо данных, содержащихся в анкете Участника клиринга, в данный реестр вносится дата аккредитации в качестве Участника клиринга (дата подписания договора клирингового обслуживания) и информация о принятых СПВБ дисциплинарных мерах по приостановлению и прекращению клирингового обслуживания Участника клиринга.
- 8.6.2. «Реестр клиентов Участника клиринга». Записи в данный реестр производятся в день внесения Участником клиринга информации (изменения информации) о своих клиентах.
- 8.6.3. «Реестр остатков ценных бумаг» и «Реестр остатков денежных средств». Записи в данные реестры производятся на основании документов, предоставляемых СПВБ Расчетными депозитариями и Расчетными организациями каждый раз после получения данных отчетов.
- 8.6.4. «Журнал регистрации договоров на оказание клиринговых услуг». Реестр содержит информацию о номере договора, датах начала и окончания действия договора, коде и наименовании Участника клиринга. Записи в данный реестр вносятся в день подписания сторонами договора на оказание клиринговых услуг.
- 8.6.5. «Реестр сделок, допущенных к клирингу». Реестр содержит информацию о дате, времени и номере реестра сделок, сформированного по итогам торгов



Организатором торговли в отношении сделок, клиринг которых осуществляет СПВБ.

- 8.6.6. «Реестр сделок, прошедших процедуру контроля обеспечения». Данный реестр содержит информацию обо всех сделках, прошедших процедуру контроля обеспечения. Записи в реестр производятся на основании реестров сделок, результатов проверки обеспеченности и получении отчетов от Расчетной организации и Расчетного депозитария каждый раз после проведения расчетов.
- 8.6.7. «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 Распоряжениях 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.
- 8.6.8. «Реестр отправленных отчетов». Записи в данный реестр производятся после завершения расчетов и содержат информацию, содержащуюся в предоставленных Участнику клиринга и(или) его клиенту отчетах.
- 8.6.9. Все реестры СПВБ ведет в электронном виде.
- 8.6.10. СПВБ ведет Журнал регистрации входящих документов и Журнал регистрации исходящих документов в которых фиксируется предоставление Участниками клиринга и отправка для них документов на бумажном носителе.
- 8.6.11. Реквизиты реестров и журналов, указанных в настоящем подразделе, определены в Приложении № 7 к настоящим Правилам.

9. Порядок представления Участникам клиринга отчетов по итогам клиринга

9.1. Формы отчетов

- 9.1.1. СПВБ 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 СПВБ для исполнения или обеспечения исполнения обязательств по итогам клиринга. Реквизиты отчетов приведены в Приложении № 6 к Правилам.
- 9.1.2. СПВБ может формировать различные формы клиринговых отчетов для сделок, включенных в различные клиринговые пулы.
- 9.1.3. СПВБ формирует следующие отчетные документы:
- 9.1.3.1. Отчет о денежных средствах Участника клиринга, находящихся на аналитическом счете для учета средств Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ
 - 9.1.3.2. Отчет по обязательствам/требованиям Участника клиринга
 - 9.1.3.3. Отчет об обязательствах, допущенных к клирингу
 - 9.1.3.4. Отчет об исполненных/неисполненных обязательствах
 - 9.1.3.5. Отчет об использовании индивидуального клирингового обеспечения



9.2. Порядок и сроки предоставления отчетов Участникам клиринга

- 9.2.1. Отчеты Участнику клиринга предоставляются уполномоченным представителям Участников клиринга не позднее 10:00 мск следующего рабочего дня за датой составления отчета.
- 9.2.2. Отчеты для клиентов Участника клиринга формируются СПВБ в электронном виде. Отчет для клиента Участника клиринга в бумажной форме, подписанный уполномоченным сотрудником СПВБ, предоставляется по отдельному запросу Участника клиринга его уполномоченным представителям.
- 9.2.3. По соглашению сторон формы (форматы) информации (документов и сообщений), а также способы ее передачи, определяются отдельным соглашением (отдельными соглашениями) между СПВБ и Участником клиринга.
- 9.2.4. Отчеты клиентам Участника клиринга и иные отчеты за предыдущие даты предоставляются по письменному запросу не позднее 3 рабочего дня от даты получения запроса.

10. Меры, направленные на управление рисками при осуществлении клиринга

10.1. Система управления рисками

- 10.1.1. СПВБ рассматривает управление рисками как один из важнейших элементов стратегического планирования и внутреннего контроля. В процессе управления рисками СПВБ регулярно выявляет, оценивает и контролирует угрозы и возможности, адаптирует свою деятельность с целью уменьшения вероятности и потенциальных последствий угроз и с целью реализации возможностей.
- 10.1.2. Организационная структура системы управления рисками СПВБ включает в себя:
 - 10.1.2.1. Совет директоров СПВБ
 - 10.1.2.2. Комитет Совета директоров СПВБ по рискам и аудиту
 - 10.1.2.3. Управляющего СПВБ
 - 10.1.2.4. Правление СПВБ
 - 10.1.2.5. Риск-менеджера
- 10.1.3. В целях эффективного контроля со стороны Совета директоров СПВБ за системой управления рисками создан Комитет Совета директоров СПВБ по рискам и аудиту, действующий на постоянной основе. Не менее половины членов Комитета составляют представители Участников клиринга.
- 10.1.4. Статус, компетенция, права и обязанности Комитета Совета директоров СПВБ по рискам и аудиту, и его членов, состав Комитета Совета директоров СПВБ по рискам и аудиту, порядок его формирования, работы и взаимодействия с иными органами управления СПВБ определены в документе «Положение о Комитете Совета директоров СПВБ по рискам и аудиту».
- 10.1.5. Управляющий СПВБ назначает должностное лицо, ответственное за организацию системы управления рисками СПВБ (риск-менеджера), при условии, что для риск-менеджера СПВБ является основным местом работы.

10.2. Документы СПВБ по управлению рисками



- 10.2.1. Управление рисками основывается на документе «Правила организации системы управления рисками, связанными с осуществлением деятельности организатора торговли и клиринговой деятельности»
- 10.2.2. При управления рисками СПВБ в случае чрезвычайных ситуаций также используется План обеспечения непрерывности и восстановления деятельности СПВБ (План ОНВД).

10.3. Общие принципы управления рисками

- 10.3.1. Система управления рисками предполагает минимизацию затрат Участников клиринга при максимально возможном снижении рисков и ответственность всех Участников клиринга за последствия, которые могут быть вызваны их действиями.
- 10.3.2. Для снижения уровня кредитных рисков (рисков неисполнения обязательств), связанных с отказом Участника клиринга от платежа, а также рисков, связанных с обстоятельствами, делающими невозможным осуществление платежа, СПВБ устанавливает лимиты по допустимому объему сделок каждому Участнику клиринга, а также проводит клиринг только по обеспеченным ценными бумагами и денежными средствами сделкам, соблюдая принцип поставки против платежа.
- 10.3.3. Подробный порядок действий и мер СПВБ для снижения рисков устанавливается документами, указанными в подразделе 10.2 настоящих Правил.

10.4. Порядок установления лимитов по допустимому объему сделок

- 10.4.1. СПВБ устанавливает для Участников клиринга лимиты по допустимому объему сделок и передает их Организатору торговли перед началом торговой сессии и при каждом изменении состояния торговых счетов Участников клиринга.
- 10.4.2. Лимит по сделкам с ценными бумагами устанавливается как по денежным средствам, так и по ценным бумагам. Допустимый объем сделок с ценными бумагами (за исключением сделок, указанных в п. 10.4.6) устанавливается равным остатку денежных средств и ценных бумаг на соответствующих торговых счетах.
- 10.4.3. Лимит по сделкам с иностранной валютой устанавливается на основании величины Гарантийного обеспечения по следующей формуле (на основании параметров, определенных Спецификацией).

$$\text{Lim A} * K = \sum (\text{Bal M}_j * K_j) / \text{НГО} , \text{ где:}$$

K - расчетный курс иностранной валюты к рублю РФ;

Bal M_j — средства Гарантийного обеспечения на торговых счетах Участника клиринга (в т.ч. в рублях РФ);

K_j — расчетный курс валюты гарантийного обеспечения к рублю РФ;

НГО — норма гарантийного обеспечения.



- 10.4.4. Значение лимита, рассчитанное в соответствии порядком, определенным настоящим разделом Правил, не может превышать максимального лимита по сделкам и иностранной валютой.
- 10.4.5. Значение максимального лимита по сделкам с иностранной валютой определяется СПВБ отдельно для каждого Участника клиринга на основании финансовой отчетности кредитной организации.
- 10.4.6. СПВБ может устанавливать максимальный лимит по заключению сделок РЕПО. СПВБ устанавливает максимальный лимит по заключению сделок РЕПО между двумя Участниками клиринга, если Участник клиринга категории «Ц» передал СПВБ информацию о необходимости установления такого лимита и его величине или порядке расчета указанной величины. Возможность получения от Участника клиринга распоряжения на установление лимитов на совершение сделок РЕПО с другими Участниками клиринга регулируется Генеральным соглашением.
- 10.4.7. Лимит по депозитным сделкам устанавливается на основании условий Генерального соглашения и спецификаций депозитных сделок, предоставленных Участниками клиринга категории «И» или категории «В».

10.5. Определение чрезвычайных ситуаций и порядок взаимодействия с Участниками клиринга в чрезвычайных ситуациях

- 10.5.1. 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.
- 10.5.2. В случае чрезвычайных ситуаций СПВБ действует в порядке, установленном документом, указанным в п.10.2.2. настоящих Правил.
- 10.5.3. 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, факс) или выдана в бумажном виде в помещении СПВБ.
- 10.5.4. В случае, если в результате чрезвычайной ситуации остановлена система РКС – СПВБ информирует о прекращении работы и невозможности исполнения обязательств по итогам клиринга до начала следующей клиринговой сессии, используя все возможные каналы связи (в том числе телеграф, телефон, факс) или личное посещение сотрудниками СПВБ.
- 10.5.5. О возобновлении деятельности РКС Участники клиринга информируются способом, предусмотренном для направления отчетов. Дополнительное информирование производится по электронной почте, факсу или телефону.

11. Оплата клиринговых услуг СПВБ

- 11.1. Оплата услуг СПВБ, оказываемых в соответствии с настоящими Правилами, осуществляется на основании Тарифов СПВБ, информация о которых



раскрывается СПВБ на сайте в информационно-телекоммуникационной сети интернет по адресу www.spceex.ru. Тарифы СПВБ за услуги, оказываемые на основании лицензии на осуществление клиринговой деятельности, утверждаются Советом директоров.

- 11.2. Участник клиринга оплачивает стоимость услуг по действующим на дату оказания услуги Тарифам СПВБ.
- 11.3. Тарифы, утвержденные Советом директоров, раскрываются на сайте СПВБ не позднее чем за пять дней до даты их вступления в силу, если нормативными актами не установлен более длительный срок.
- 11.4. В случае если Участник клиринга не согласен с изменением Тарифов СПВБ, он обязан расторгнуть Договор с СПВБ в порядке, установленном настоящими Правилами. Если на момент вступления в силу новых Тарифов СПВБ, СПВБ не завершила оказание услуг такому Участнику клиринга – указанные услуги оплачиваются в соответствии с предыдущей редакцией Тарифов СПВБ.
- 11.5. В случае нарушения Участником клиринга условий оплаты счетов за оказанные клиринговые услуги СПВБ имеет право приостановить оказание клиринговых услуг Участнику клиринга до момента погашения задолженности.
- 11.6. В случае нарушения Участником клиринга сроков оплаты, установленных Тарифами СПВБ, СПВБ имеет право взыскать с Участника клиринга пени в размере 0,1% от суммы задолженности за каждый день просрочки, но не более 20% от суммы задолженности.

12. Взаимодействие с Организаторами торговли, Расчетными организациями и Расчетными депозитариями

12.1. Порядок взаимодействия с Организатором торговли

- 12.1.1. Перед началом торговой сессии СПВБ передает Организатору торговли сведения о торговых счетах, по которым могут совершаться сделки и лимиты допустимого объема сделок по каждому торговому счету (аналитическому счету по учету средств на клиринговом счете СПВБ), установленные в соответствии с подразделом 10.4 настоящих Правил. Сведения передаются в виде ведомостей остатков денежных средств и ценных бумаг, учитываемых в клиринговых регистрах. Реквизиты документов установлены Внутренним регламентом СПВБ.
- 12.1.2. В случае совмещения СПВБ клиринговой деятельности с деятельностью Организатора торговли положения об обмене данными между СПВБ и Организатором торговли означают обмен данными между отдельными структурными подразделениями СПВБ занимающимися осуществлением клиринговой деятельностью и деятельностью по организации торговли.
- 12.1.3. СПВБ передает Организатору торговли лимиты допустимого объема сделок всякий раз при их изменении.
- 12.1.4. Организатор торговли передает СПВБ реестр сделок. Реквизиты реестра сделок устанавливаются Внутренним регламентом СПВБ.
- 12.1.5. Иные случаи взаимодействия с Организатором торговли установлены в соответствующих разделах настоящих Правил.

12.2. Порядок взаимодействия с Расчетными организациями



- 12.2.1. Для возможности открытия торговых банковских счетов, СПВБ передает Расчетной организации уведомление о регистрации нового Участника клиринга. Указанное уведомление является основанием для открытия Расчетной организацией (в соответствии с установленным Расчетной организацией порядком) торгового банковского счета Участнику клиринга с указанием СПВБ в качестве клиринговой организации, с согласия или по поручению которой совершаются операции по торговому счету.
- 12.2.2. Расчетная организация информирует СПВБ об открытии торгового банковского счета в порядке, установленном для обмена информацией о состоянии торговых счетов (п.12.2.4).
- 12.2.3. Расчетная организация открывает СПВБ клиринговый счет после заключения с СПВБ соответствующего договора. Расчетная организация информирует СПВБ об открытии клирингового счета в письменном виде.
- 12.2.4. Порядок взаимодействия с Расчетными организациями при обмене информацией о состоянии торговых и клиринговых счетов, установлен подразделом 5.1 настоящих Правил.
- 12.2.5. Порядок взаимодействия с Расчетными организациями при совершении операций по торговым и клиринговым счетам установлен подразделами 5.6, 7.2 и 7.4 настоящих Правил.
- 12.2.6. Порядок взаимодействия с Расчетными организациями при проведении сверки расчетов установлен подразделами 5.7 и 5.8 настоящих Правил.
- 12.2.7. В случае приостановки или прекращения клирингового обслуживания Участника клиринга, расторжения Договора с Участником клиринга, СПВБ уведомляет об этом Расчетную организацию в письменной форме. Дополнительно уведомление может быть направлено по электронной почте или факсу.
- 12.2.8. После получения уведомления, указанного в п.12.2.7 Расчетная организация исключает сведения о торговых счетах Участника клиринга, обслуживание которого приостановлено или прекращено, из информации о состоянии торговых счетов, предоставляемой СПВБ согласно подразделу 5.1. В указанном случае Расчетная организация не производит зачисления средств на торговые счета этого Участника клиринга, открытые с указанием СПВБ в качестве клиринговой организации. Списание средств с упомянутых торговых счетов производится в общем порядке с согласия СПВБ.
- 12.2.9. В случае получения от СПВБ уведомления о прекращении клирингового обслуживания или о расторжении Договора, Расчетная организация имеет право закрыть торговые счета, открытые с указанием СПВБ в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам, без дополнительного согласия СПВБ.

12.3. Порядок взаимодействия с Расчетными депозитариями

- 12.3.1. Для возможности открытия торговых счетов депо с указанием клиринговой организации – СПВБ, СПВБ передает в Расчетный депозитарий уведомление о регистрации нового Участника клиринга. Указанное уведомление является основанием для открытия Расчетным депозитарием торгового счета депо с указанием СПВБ в качестве клиринговой организации, с согласия или по поручению которой совершаются операции по торговому счету. Открытие



торгового счета депо производится в соответствии с Условиями осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария. Расчетный депозитарий информирует СПВБ об открытии торгового счета депо в порядке, установленном для обмена информацией о состоянии торговых счетов.

- 12.3.2. Порядок взаимодействия с Расчетными депозитариями при обмене информацией о состоянии торговых счетов депо, установлен подразделами 5.1 и 8.5 настоящих Правил.
- 12.3.3. Порядок взаимодействия с Расчетными депозитариями при совершении операций по торговым счетам депо установлен подразделом 5.6, 7.3 настоящих Правил.
- 12.3.4. Порядок взаимодействия с Расчетными депозитариями при проведении сверки расчетов установлен подразделами 5.7 и 5.8 настоящих Правил.
- 12.3.5. В случае приостановки или прекращения клирингового обслуживания Участника клиринга, расторжения Договора с Участником клиринга, СПВБ уведомляет об этом Расчетный депозитарий в письменной форме. Дополнительно уведомление может быть направлено по электронной почте или факсу.
- 12.3.6. После получения уведомления, указанного в п.12.3.5, Расчетный депозитарий исключает сведения о торговых счетах депо Участника клиринга, обслуживание которого приостановлено или прекращено, из информации о состоянии торговых счетов, предоставляемой СПВБ согласно подразделу 5.1. В указанном случае Расчетный депозитарий не производит зачисления ценных бумаг на торговые счета депо этого Участника клиринга, открытые с указанием СПВБ в качестве клиринговой организации. Списание ценных бумаг с упомянутых торговых счетов производится в общем порядке с согласия СПВБ.
- 12.3.7. Расчетный депозитарий имеет право закрыть торговые счета депо, открытые с указанием СПВБ в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам, только после получения от СПВБ согласия на закрытие указанных торговых счетов депо. Получение согласия не требуется, если СПВБ уведомило Расчетный депозитарий о расторжении Договора с Участником клиринга, торговые счета которого закрываются.



Договор № _____
на оказание клиринговых услуг

г.Санкт-Петербург

«___»_____20__ г.

Акционерное общество «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», действующее в качестве клиринговой организации на основании лицензии № 040-00005-000010 от «20» декабря 2012 г., выданной Федеральной службой по финансовым рынкам, именуемое в дальнейшем АО **СПВБ**, в лице _____ действующего на основании _____, с _____ одной стороны, и _____, именуемое в дальнейшем **Участник клиринга**, в лице _____, действующего на основании _____, с другой стороны, заключили настоящий Договор о нижеследующем:

1. АО **СПВБ** обязуется оказывать **Участнику клиринга** услуги по проведению клиринга, а **Участник клиринга** оплачивать указанные услуги. Условия предоставления указанных услуг определяются Правилами клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее по тексту Правила клиринга).

2. Подписывая настоящий Договор, Участник клиринга принимает условия Правил клиринга в целом и обязуется надлежащим образом исполнять все установленные в них обязательства и требования.

3. Настоящий Договор вступает в силу с момента его подписания обеими Сторонами.

4. Реквизиты и подписи сторон:

АО СПВБ

Участник клиринга



Приложение №2

Распоряжение на списание денежных средств по итогам клиринга
Акционерное общество «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

РАСПОРЯЖЕНИЕ НА СПИСАНИЕ №

от “__” _____ 20__ г.

Участник клиринга: _____

Код Участника клиринга: _____

ИНН Участника клиринга: _____

Срок действия поручения:

постоянно действующее

Сумма к списанию:



в размере свободного остатка по окончании клиринговой сессии

Счет списания: торговый банковский счет № _____,

открытый в _____

(наименование Расчётной организации)

Счет зачисления: корреспондентский счёт № _____,

открытый в _____

(наименование Расчётной организации)

Все операции производятся на основании документов АО СПВБ, без дополнительных подтверждений от Участника клиринга.

Основание поручения:

Договор на оказание клиринговых услуг № _____ от “__” “__” _____ 20__ г.

Руководитель Участника клиринга _____

(подпись)

(Ф.И.О.)

М.П.

Отметки АО СПВБ:

Регистрационный номер: _____

Дата и время приема поручения: _____

Подпись сотрудника, клирингового отдела АО СПВБ _____



Приложение №3

г. _____

«__» _____ 20__ г.

УВЕДОМЛЕНИЕ

(полное фирменное наименование Участника клиринга)

в лице _____, действующего на
основании _____, уведомляет Акционерное общество «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» о взаимосвязи между торговыми счетами депо и торговыми банковскими счетами, в соответствии со следующими данными:

№ п/п	Раздел торгового счета депо	Наименование Расчётного депозитария	Номер торгового банковского счета	Наименование Расчётной организации

Руководитель Участника клиринга _____

М.П.

(подпись)

(Ф.И.О.)



Приложение №4

Анкета Участника клиринга		
1. Данные для заполнения организацией:		
1.	Полное наименование	
2.	Сокращенное наименование	
3.	Адрес местонахождения (в соответствии с Уставом)	
4.	Почтовый адрес	
5.	Номер телефона, факса, адрес электронной почты	
6.	Данные свидетельства о регистрации (номер, кем и когда выдано)	
7.	Данные свидетельства о регистрации (ОГРН, дата внесения записи в ЕГРЮЛ)	
8.	Сведения о лицензии на осуществление банковских операций (для кредитной организации) номер, кем и когда выдана, срок действия	
9.	Сведения о лицензиях профессионального участника рынка ценных бумаг номера, кем и когда выданы, срок их действия с указанием видов деятельности	
10.	Коды: ИНН КПП ОКПО, ОКВЭД	
11.	Фамилия, имя, отчество, должность руководителя организации	
12.	Дата заполнения анкеты	

Руководитель Участника клиринга _____ / _____ /
(Должность) (подпись) (Ф.И.О.)

М.П.

2. Данные для заполнения сотрудником АО СПВБ:	
Дата и время приема Анкеты	
Должность, фамилия, имя, отчество сотрудника АО СПВБ, принявшего Анкету	



Приложение №5

На бланке Участника клиринга

г. _____

“ ____ ” _____ 20__ г.

ДОВЕРЕННОСТЬ № _____

Участник клиринга: _____
(организационно-правовая форма и полное фирменное наименование юридического лица)

уполномочивает

(Фамилия, Имя, Отчество)

проживающего(ую) по адресу:

документ _____ серия _____ № _____ выдан " ____ " _____ г.

(место выдачи)

передавать на АО СПВБ документы и поручения и получать отчеты по итогам клиринга по сделкам, заключенным на АО СПВБ.

Настоящая Доверенность составлена

(дата прописью)

и действует до

(дата прописью)

Подпись _____ удостоверяю

Должность лица,
выдавшего доверенность

Ф.И.О.

М. П.

Подпись лица, выдавшего доверенность



Реквизиты документов, направляемых Участникам клиринга

А. Отчет о денежных средствах Участника клиринга, находящихся на аналитическом счете для учета средств Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ

Реквизиты	Порядок заполнения
Клиринговая организация	Полное наименование СПВБ
Участник клиринга	Код и наименование Участника клиринга
Наименование отчета	Отчет о денежных средствах Участника клиринга, находящихся на аналитическом счете для учета средств Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ
Дата	Дата, на которую сформирован отчет
Время	Время, на которое сформирован отчет
Содержание отчета	Номер клирингового счета СПВБ, код аналитического счета для учета средств Участника клиринга, сумма средств на аналитическом счете, сумма средств на аналитическом счете, свободная от обязательств, сумма средств на аналитическом счете заблокированная для исполнения или обеспечения исполнения обязательств, изменение сумм средств на аналитическом счете, исходящий остаток средств и иные дополнительные сведения по сделке по усмотрению СПВБ
Подпись сотрудника СПВБ	Подпись сотрудника клирингового отдела СПВБ

В. Отчет по обязательствам/требованиям Участника клиринга

Реквизиты	Порядок заполнения
Клиринговая организация	Полное наименование СПВБ
Участник клиринга	Код и наименование Участника клиринга
Наименование отчета	Отчет по обязательствам/требованиям Участника клиринга
Дата	Дата, на которую сформирован отчет
Время	Время, на которое сформирован отчет
Содержание отчета	Код ценной бумаги/иностранной валюты*, дата исполнения обязательств, торговый счет в рублях, нетто-обязательство/требование по денежным средствам в рублях, торговый счет по ценным бумагам/иностранной валюте, нетто-обязательство/требование по ценным бумагам/иностранной валюте*, и иные дополнительные сведения по усмотрению СПВБ *) Указываются сведения относящиеся либо к ценным бумагам либо к иностранной валюте в зависимости от вида сделки, допущенной к клирингу.



Подпись сотрудника СПВБ

Подпись сотрудника клирингового отдела СПВБ

С. Отчет об исполненных/неисполненных обязательствах

Реквизиты	Порядок заполнения
Клиринговая организация	Полное наименование СПВБ
Участник клиринга	Код и наименование Участника клиринга
Наименование отчета	Отчет об исполненных сделках
Дата	Дата проведения расчетов
Время	Время, на которое сформирован отчет
Содержание отчета	Дата возникновения обязательства, дата исполнения обязательства, суммы обязательств/требований, номера торговых счетов (счетов аналитического учета – для средств на клиринговом счете СПВБ), статус обязательств (исполнено, прекращено, ожидает исполнения, неисполнено), иные сведения по обязательствам или сделкам, на основании которых возникли обязательства, по усмотрению СПВБ
Подпись сотрудника СПВБ	Подпись сотрудника клирингового отдела СПВБ

Д. Отчет об обязательствах, допущенных к клирингу

Реквизиты	Порядок заполнения
Клиринговая организация	Полное наименование СПВБ
Участник клиринга	Код и наименование Участника клиринга
Наименование отчета	Отчет об обязательствах, допущенных к клирингу
Дата	Дата, на которую сформирован отчет
Время	Время, на которое сформирован отчет
Содержание отчета	№ п/п, код Биржевого инструмента, номер сделки, вид сделки, дата заключения, дата исполнения сделки, сумма сделки, сумма обязательств, и иные дополнительные сведения по сделке по усмотрению СПВБ
Подпись сотрудника СПВБ	Подпись сотрудника клирингового отдела СПВБ

Е. Отчет об использовании индивидуального клирингового обеспечения

Реквизиты	Порядок заполнения
Клиринговая организация	Полное наименование СПВБ
Участник клиринга	Код и наименование Участника клиринга
Наименование отчета	Отчет об использовании индивидуального клирингового обеспечения
Дата	Дата проведения расчетов



Время	Время проведения расчетов
Содержание отчета	Сумма индивидуального клирингового обеспечения, сумма использованного индивидуального клирингового обеспечения; вид использования (при исполнении обязательств, допущенных к клирингу, в случае неисполнения обязательств)
Подпись сотрудника СПВБ	Подпись сотрудника клирингового отдела СПВБ



Реквизиты реестров и журналов

А. Реестр Участников клиринга

Содержание реестра	Дата регистрации, полное наименование юридического лица (фамилия, имя, отчество (при наличии) физического лица), код Участника клиринга, место нахождения (место жительства) Участника клиринга, контактная информация Участника клиринга, ИНН, Ф.И.О. (при наличии), и должность единоличного исполнительного органа Участника клиринга (для Участников клиринга - юридических лиц), дата регистрации в качестве Участника клиринга, информация об исключении Участника клиринга из реестра Участников клиринга
--------------------	--

В. Реестр клиентов Участника клиринга

Содержание реестра	Дата регистрации, полное наименование юридического лица (фамилия, имя, отчество (при наличии) физического лица), Код Участника клиринга, Код клиента Участника клиринга, информация об исключении клиента Участника клиринга из реестра клиентов Участников клиринга
--------------------	--

С. Реестр остатков ценных бумаг

Содержание реестра	Наименование расчетного депозитария, порядковый номер отчета, дата, время, номер торгового раздела счета депо, код ЦБ, количество ЦБ
--------------------	--

Д. Реестр остатков денежных средств

Содержание реестра	Наименование расчетной организации, порядковый номер отчета, дата, время, код валюты, номер торгового счета, остаток денежных средств
--------------------	---

Е. Реестр сделок допущенных к клирингу

Содержание реестра	Наименование организатора торгов, дата заключения сделки, номер сделки, время заключения сделки, код биржевого инструмента, коды и наименования Участников клиринга - сторон по сделке, сумма сделки, комиссия ОТ
--------------------	---

Ф. Реестр сделок, прошедших процедуру контроля обеспечения

Содержание реестра	Дата, номер сделки, время клиринга по сделке, вид сделки (к/ п), биржевой инструмент, цена сделки, сумма сделки, продавец-Участник клиринга (клиент), покупатель-Участник клиринга, (клиент), результат клиринга, номер реестра сделок, фамилия, имя, отчество сотрудника клирингового отдела, проводившего расчеты
--------------------	---

Г. Реестр распоряжений, направленных расчетному депозитарию

Содержание	Номер распоряжения, дата распоряжения, время формирования, номер
------------	--



реестра	торгового раздела, код ЦБ, количество ЦБ, направление операции (списание/зачисление)
---------	--

Н. Реестр распоряжений, направленных расчетной организации

Содержание реестра	Номер распоряжения, дата распоряжения, время формирования, номер торгового банковского счета, код валюты, сумма денежных средств, направление операции (дебет/кредит)
--------------------	---

И. Реестр отправленных отчетов

Содержание реестра	дата отправки отчета, Наименование Участника клиринга, код Участника клиринга, время формирования, наименование отчета, количество листов
--------------------	---

Ж. Журнал регистрации входящих документов

Содержание журнала	Номер записи (сквозной), дата и время регистрации документа, наименование документа, номер и дата составления документа, полное наименование юридического лица (фамилия, имя, отчество (при наличии) физического лица)), от которого документ поступил в клиринговую организацию
--------------------	--

К. Журнал регистрации исходящих документов

Содержание журнала	Номер записи (сквозной), дата и время регистрации документа, наименование документа, номер и дата составления документа, полное наименование юридического лица (фамилия, имя, отчество (при наличии) физического лица)), которому документ направлен от клиринговой организации, количество экземпляров
--------------------	---

Л. Журнал регистрации договоров на оказание клиринговых услуг

Содержание журнала	Номер записи (сквозной), дата и время регистрации документа, наименование документа, номер и дата составления документа, полное наименование юридического лица (фамилия, имя, отчество (при наличии) физического лица)), от которого документ поступил в клиринговую организацию, количество экземпляров
--------------------	--