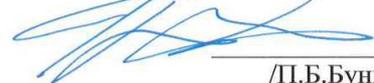


УТВЕРЖДЕНО
решением Совета директоров
Акционерного общества
«Санкт - Петербургская Валютная Биржа»
29 апреля 2020 г. (Протокол №339)

Управляющий
Акционерного общества
«Санкт - Петербургская Валютная Биржа»



/П.Б.Бунин/



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

Санкт-Петербург
2020г.



Оглавление

1.	Общие положения	4
1.1.	Термины и определения	4
1.2.	Основные сведения о клиринговой деятельности СПВБ и раскрытие иной информации	7
1.3.	Список Расчетных организаций и Расчетных депозитариев	9
1.4.	Утверждение, изменение и дополнение настоящих Правил	9
1.5.	Конфиденциальность информации	10
2.	Договор об оказании клиринговых услуг	10
2.1.	Предмет Договора	10
2.2.	Заключение и расторжение Договора	10
2.3.	Ответственность СПВБ и Участника клиринга	11
2.4.	Порядок разрешения споров между СПВБ и Участником клиринга	12
3.	Требования к Участникам клиринга	13
3.1.	Категории Участников клиринга	13
3.2.	Требования к лицу, намеревающемуся стать Участником клиринга.	14
3.3.	Порядок регистрации Участников клиринга и клиентов Участника клиринга	16
3.4.	Порядок приостановления, возобновления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	17
4.	Права и обязанности СПВБ и Участников клиринга	20
4.1.	Обязанности СПВБ	20
4.2.	Права СПВБ	21
4.3.	Обязанности Участника клиринга	21
4.4.	Права Участника клиринга	22
5.	Порядок проведения клиринга	22
5.1.	Порядок и условия допуска обязательств к клирингу. Взаимодействие с Расчетной организацией и Расчетным депозитарием	22
5.2.	Порядок проведения клиринга (кроме клиринга Договоров поставки товара). Расчет нетто-обязательств и нетто-требований	23
5.3.	Процедура контроля обеспечения	26
5.4.	Порядок и условия исключения обязательств из клирингового пула	27
5.5.	Порядок исполнения (прекращения) обязательств по итогам клиринга (кроме обязательств из Договоров поставки товара)	29
5.6.	Порядок проведения сверки результатов расчетов	32
5.7.	Порядок действий в случае расхождения данных при сверке	33
5.8.	Порядок прекращения обязательств в связи с введением процедур банкротства Участника клиринга и определения размера денежного обязательства, возникающего в связи с таким прекращением	33
5.9.	Порядок проведения клиринга и исполнения обязательств по сделкам с Биржевым товаром (Договорам поставки товара)	35
6.	Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу	38
6.1.	Индивидуальное клиринговое обеспечение	38
7.	Виды торговых и клиринговых счетов и порядок совершения операций по ним	40
7.1.	Виды торговых и клиринговых счетов	40
7.2.	Порядок проведения операций по торговым банковским счетам	42
7.3.	Порядок проведения операций по торговым счетам депо и специальному техническому счету	44
7.4.	Порядок проведения операций по клиринговым счетам	46
8.	Клиринговые регистры и иные формы внутреннего учета, их назначение, порядок ведения	47



8.1.	Клиринговые регистры учета ценных бумаг	47
8.2.	Клиринговые регистры учета обязательств по ценным бумагам	48
8.3.	Клиринговые регистры учета денежных средств	50
8.4.	Клиринговые регистры по учету обязательств по денежным средствам.....	52
8.5.	Порядок ведения клиринговых регистров	53
8.6.	Реестры и иные формы внутреннего учета СПВБ	55
9.	Порядок представления Участникам клиринга отчетов по итогам клиринга	57
9.1.	Формы отчетов.....	57
9.2.	Порядок и сроки предоставления отчетов Участникам клиринга.....	57
10.	Меры, направленные на управление рисками при осуществлении клиринга	58
10.1.	Система управления рисками.....	58
10.2.	Документы СПВБ по управлению рисками	58
10.3.	Общие принципы управления рисками.....	59
10.4.	Порядок установления лимитов по допустимому объему сделок.....	59
10.5.	Определение чрезвычайных ситуаций и порядок взаимодействия с Участниками клиринга в чрезвычайных ситуациях	60
11.	Оплата клиринговых услуг СПВБ	61
12.	Взаимодействие с Биржами, Расчетной организацией и Расчетным депозитарием	61
12.1.	Порядок взаимодействия с Биржами	61
12.2.	Порядок взаимодействия с Расчетной организацией.....	62
12.3.	Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием.	63
Приложение №1 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».....		65
Приложение №2 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».....		66
Приложение №3 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».....		67
Приложение №4 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».....		68
Приложение №4(1) к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».....		70
Приложение №4(2) к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».....		72
Приложение №5 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».....		73
Приложение №6 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».....		74
Приложение №7 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».....		75



1. Общие положения

1.1. Термины и определения

- 1.1.1. СПВБ – Акционерное общество «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», клиринговая организация.
- 1.1.2. Биржа – Организатор торговли, действующий на основании лицензии биржи. В целях настоящих Правил под Биржей понимается СПВБ, совмещающая деятельность организатора торговли с клиринговой деятельностью, или Акционерное общество «Биржа «Санкт – Петербург» (АО "Биржа "Санкт - Петербург").
- 1.1.3. Биржевой инструмент – это финансовый инструмент, который торгуется и рассчитывается по правилам, установленным Биржей. Биржевым инструментом может являться ценная бумага, депозитный договор, кредитный договор, договор РЕПО. Биржа присваивает каждому Биржевому инструменту уникальный код (тикер).
- 1.1.4. Биржевой товар (товар) - товар, допущенный Биржей к организованным торгам в товарной секции в порядке, установленном Внутренними документами Биржи.
- 1.1.5. Блокировка торгового счета – приостановление исполнения поручений Участника клиринга в отношении торгового счета в Расчетной организации и/или в Расчетном депозитарии.
- 1.1.6. Внутренние документы Биржи – Правила организованных торгов, включая, документы, являющиеся неотъемлемой частью Правил организованных торгов, Спецификации Биржевых инструментов и Спецификации Биржевых товаров, утвержденные Биржей в установленном порядке.
- 1.1.7. Гарантийное обеспечение - сумма денежных средств, внесенных на Торговый банковский счет и/или на Клиринговый счет, ценные бумаги, зачисленные на торговые счета депо, раздел «к размещению/выкупу» специального технического счета в соответствии с настоящими Правилами клиринга в целях обеспечения исполнения обязательств по заключаемым Участником клиринга сделкам. Требование внесения гарантийного обеспечения не распространяется на Банк России
- 1.1.8. Генеральное соглашение – документ, утвержденный Инициатором торгов, содержащий условия для заключения более чем одного договора на торгах, проводимых СПВБ.
- 1.1.9. Дата завершения поставки - Дата, определяемая Внутренними документами Биржи как последний день периода поставки по Договору поставки товара.
- 1.1.10. Дата обеспечения – дата, определяемая Внутренними документами Биржи, в которую должно быть полностью обеспечено исполнение денежных обязательств Покупателя по Договору поставки товара в



- порядке, предусмотренном Договором поставки товара и Правилами клиринга.
- 1.1.11. Держатель – организация, осуществляющая на основании лицензии на осуществление депозитарной деятельности депозитарное обслуживание Участников клиринга, имеющая торговые счета депо в Расчетном депозитарии для проведения операций с ценными бумагами Участников клиринга и/или их клиентов по результатам заключенных Участниками клиринга сделок.
- 1.1.12. Договор поставки товара – зарегистрированная Биржей сделка с Биржевым товаром, условиями которой предусматривается проведение клиринга клиринговой организацией в соответствии с Правилами клиринга.
- 1.1.13. Инициатор торгов - участник торгов на Бирже, по инициативе которого Биржа 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.
- 1.1.14. 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.
- 1.1.15. Клиринговая сессия - период рабочего дня, в течение которого проводится клиринг обязательств по сделкам с Биржевыми инструментами, Биржевыми товарами, заключенным в ходе торговой сессии.
- 1.1.16. Код расчетов T0 – код расчетов по сделке, в том числе по сделке с ценными бумагами, определяющий, что при подаче заявки проводится контроль обеспечения обязательств, подлежащих исполнению, а датой исполнения обязательств по сделке является дата заключения сделки.
- 1.1.17. Код расчетов Vn - код расчетов по сделке, в том числе по сделке с ценными бумагами, определяющий, что при подаче заявки проводится контроль обеспечения только в части обязательств по уплате комиссионного вознаграждения Биржи, а датой исполнения обязательств по сделке является дата, определяемая как T+n, где T – дата заключения сделки, а n – число календарных дней.
- 1.1.18. Код расчетов Sn - код расчетов по сделке РЕПО, определяющий, что при подаче заявки по сделке РЕПО проводится контроль обеспечения только в части обязательств по уплате комиссионного вознаграждения Биржи. Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО является дата, определяемая как T+n, где T – дата заключения сделки РЕПО, а n – число расчетных дней, а Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО является дата, определяемая как T+n+k, где



- T+n - Дата исполнения первой части РЕПО, а k – срок сделки РЕПО, промежуток времени, выраженный в календарных днях.
- 1.1.19. Код расчетов Rb - код расчетов по сделке РЕПО, определяющий, что при подаче заявки проводится контроль обеспечения обязательств, по сделке, подлежащих исполнению. Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО является дата заключения сделки, а Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО является дата, определяемая как T+k, где T – дата заключения сделки РЕПО, а k – срок сделки РЕПО.
- 1.1.20. Контролер поставки – категория участника клиринга, присвоенная участнику торгов Биржевыми товарами в соответствии с Внутренними документами Биржи.
- 1.1.21. Неустойка по Договору поставки товара – сумма денежных средств, подлежащая уплате Участником клиринга в случае неисполнения (ненадлежащего исполнения) им своих обязательств своему контрагенту по Договору поставки товара.
- 1.1.22. Обязательства Клиента – обязательства, расчеты по которым проводятся за счет зарегистрированного клиринговой организацией Клиента Участника клиринга.
- 1.1.23. Отдельный специальный торговый счет - торговый счет Участника клиринга, открытый им в Расчетной организации, для учета обеспечения Клиента, зарегистрированного в клиринговой организации в порядке, установленном п.3.3.7,3.3.8.
- 1.1.24. Покупатель – Участник клиринга, являющийся стороной по сделке с ценными бумагами или стороной Договора поставки товара и имеющий требования по поставке ценных бумаг или Биржевого товара.
- 1.1.25. Правила – настоящие «Правила клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее также - настоящие Правила).
- 1.1.26. Продавец (Поставщик) – Участник клиринга, являющийся стороной по сделке с ценными бумагами или стороной Договора поставки товара и имеющий обязательства по оплате ценных бумаг или поставке Биржевого товара.
- 1.1.27. Раздел «к размещению/выкупу» - отдельный раздел, открытый Расчетным депозитарием на специальном техническом счете, не предназначенном для учета прав на ценные бумаги, используемый для проведения операций при размещении/выкупе ценных бумаг. Режим использования раздела «к размещению/выкупу» специального технического счета определен п.5.5.13 Правил.
- 1.1.28. Расчетная организация, Расчетный депозитарий – лица, соответствующие требованиям к организации, осуществляющей расчеты по итогам клиринга, предъявляемым Федеральным законом о клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте и иными нормативно-правовыми актами, регулирующими клиринговую



деятельность и заключившие договоры о взаимодействии с СПВБ. Список таких лиц раскрывается СПВБ в соответствии с действующим законодательством.

- 1.1.29. РКС - комплекс программно-технических средств, с помощью которых обеспечивается осуществление клиринга.
- 1.1.30. Свободные денежные средства – денежные средства на торговом денежном счете, на клиринговых регистрах, предназначенных для учета средств на клиринговом счете, свободные от исполнения обязательств по сделкам, заключенным у Организатора торговли и оплаты комиссионного вознаграждения Биржи.
- 1.1.31. Совет директоров СПВБ – Совет директоров Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».
- 1.1.32. Специальный торговый счет – торговый счет Участника клиринга, открытый им в Расчетной организации, для учета обеспечения его клиентов.
- 1.1.33. 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.
- 1.1.34. Спецификация биржевого товара (Спецификация) – документ Биржи, определяющий условия Договора поставки товара или порядок их определения.
- 1.1.35. Тарифы СПВБ – документ, утверждаемый Советом директоров СПВБ, содержащий размер и порядок оплаты клиринговых услуг СПВБ, который раскрывается СПВБ в соответствии с действующим законодательством.
- 1.1.36. Уникальный код – уникальный код Участника клиринга, клиента Участника клиринга, присваиваемый указанным лицам СПВБ и соответствующий требованиям действующего законодательства Российской Федерации.
- 1.1.37. Участник клиринга – лицо, заключившее с СПВБ договор на оказание клиринговых услуг.
- 1.1.38. ЭДО СПВБ – система электронного документооборота, организованная СПВБ.
- 1.1.39. Иные термины и определения используются в соответствии с внутренними 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.spsex.ru (далее – сайт СПВБ).
- 1.2.3. СПВБ в соответствии с настоящими Правилами осуществляет клиринг зарегистрированных на Биржах сделок с ценными бумагами, на денежном и товарном рынках. Указанные сделки могут являться договорами следующих видов:
 - 1.2.3.1. Договор купли-продажи (в отношении сделок с ценными бумагами);
 - 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);
 - 1.2.3.5. Договор поставки товара (в отношении сделок на товарном рынке).
- 1.2.4. СПВБ осуществляет определение обязательств каждого из Участников клиринга и организует расчеты по сделкам с ценными бумагами по всем совершенным Участником клиринга сделкам клирингового пула.
- 1.2.5. СПВБ осуществляет определение обязательств каждого из Участников клиринга и организует 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 организует расчеты по сделкам по размещению депозитов в зависимости от условий, определенных спецификацией Биржевого инструмента.
- 1.2.7. СПВБ осуществляет определение обязательств каждого из Участников клиринга и организует расчеты по сделкам с товарами по каждой совершенной Участником клиринга сделке клирингового пула.
- 1.2.8. СПВБ осуществляет клиринг сделок с ценными бумагами, заключенных 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 Т0.
- 1.2.9. СПВБ осуществляет клиринг сделок с ценными бумагами, с частичным зачислением денежных средств и ценных бумаг (клиринг с частичным обеспечением) в отношении сделок с кодом расчетов Sni Bn.
- 1.2.10. СПВБ осуществляет клиринг сделок, заключенных на денежном рынке в пределах, определенных СПВБ лимитов допустимых объемов сделок (клиринг с частичным обеспечением) в отношении сделок на денежном рынке.
- 1.2.11. СПВБ допускает к клирингу сделки с Биржевым товаром в пределах, определенных СПВБ лимитов допустимых объемов сделок (клиринг с частичным обеспечением).
- 1.2.12. Участник клиринга не имеет права на получение процентов на сумму долга согласно ст.317.1 Гражданского кодекса Российской Федерации в отношении средств, переданных на клиринговый счет СПВБ.



- 1.2.13. В случае использования Участником клиринга при документообороте с СПВБ ЭДО СПВБ идентификация и использование аналогов собственноручной подписи, подтверждающих, что документ исходит от уполномоченного лица проводится в соответствии с правилами ЭДО СПВБ.
- 1.2.14. 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 опубликован на официальном сайте СПВБ в сети «Интернет» по адресу www.spsex.ru
- 1.3.2. Участники клиринга не менее чем за месяц уведомляются о предполагаемых изменениях в списке Расчетных организаций и Расчетных депозитариев путем направления в их адрес письменного уведомления о намерении СПВБ расторгнуть договорные отношения с Расчетным депозитарием/Расчетной организацией и размещением информации об этом событии на сайте СПВБ в сети «Интернет» по адресу www.spsex.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 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, за исключением внесения изменений в Правила, затрагивающие операции участника клиринга категории «Ц». В последнем случае планируемые изменения в Правила подлежат согласованию с участником клиринга категории «Ц».
- 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, торговых счетах депо, разделах «к размещению/выкупу», клиринговых счетах (регистрах внутреннего учета средств на клиринговом счете) 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, согласно требованиям п.3.2.
- 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. В этом случае, Договор утрачивает свою силу после урегулирования взаимных обязательств, завершения всех взаимных расчетов и прекращения обязательств, допущенных к клирингу на основании Договора.
- 2.2.4. Договор может быть расторгнут также по инициативе АО СПВБ до окончания срока его действия в порядке, установленном пунктом 2.3.2.

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. В случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию в порядке, предусмотренном разделом 3.4 настоящих Правил, СПВБ расторгает договор в одностороннем порядке. При этом:
- при отсутствии на дату принятия решения об отказе от Договора обязательств Участника клиринга, Договор прекращается в день, следующий за днем принятия указанного решения,
 - при наличии денежных обязательств Участника клиринга, возникших до принятия СПВБ решения об отказе от Договора, Договор прекращается в день, следующий за днем завершения проведения клиринга и осуществления расчетов по сделкам Участника клиринга.
- Прекращение Договора по основаниям, указанным в настоящем пункте не требует предварительного уведомления Участника клиринга. СПВБ не позднее рабочего дня, следующего за днем принятия решения об отказе от Договора в одностороннем порядке, информирует Участника клиринга о принятом решении. Информирование осуществляется способом, предусмотренным для направления отчетов. Дополнительно Участнику клиринга направляется уведомление по электронной почте или по факсу. Возмещение убытков Участнику клиринга, связанных с прекращением исполнения Договора по основаниям, указанным в настоящем пункте не осуществляется.
- 2.3.3. СПВБ в договорах с Расчетными депозитариями и Расчетными организациями предусматривает ответственность за:
- 2.3.3.1. неисполнение Расчетной организацией и/или Расчетным депозитарием распоряжений СПВБ на проведение операций по торговым, клиринговым банковским счетам и/или по торговым



счетам депо и специальному техническому счету, произошедшее по их вине;

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

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

Ответственность СПВБ перед Участниками клиринга в случае реализации рисков, предусмотренных п.п. 2.3.3.1-2.3.3.3, не может превышать ответственности виновной стороны, предусмотренной для этого случая в соответствующем договоре СПВБ.

2.3.4. СПВБ не несет ответственности за:

2.3.4.1. неисполнение или ненадлежащее исполнение Участником клиринга своих обязанностей в соответствии с настоящими Правилами клиринга, вызванное действием или бездействием Участника клиринга, в результате которого СПВБ не могла выполнить свои обязанности;

2.3.4.2. неисполнение Биржей, Участником клиринга, являющимся Контролером поставки, своих обязательств по обеспечению правильности, своевременности и достоверности информации, передаваемой в СПВБ;

2.3.4.3. неисполнение Участником клиринга - Контролером поставки своих обязательств перед Участником клиринга - Покупателем.

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, обязана рассмотреть ее в срок, не превышающий 10 рабочих дней с даты получения претензии, и предоставить отправителю претензии мотивированный отказ либо согласие на удовлетворение претензионных требований.
- 2.4.5. В случае, если сторонам не удалось разрешить спор путем переговоров, спор подлежит передаче для разрешения 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 следующие категории: категория «Ц», категория «Ф», категория «И», категория «Б», категория «В», категория «Т», категория «К».
- 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, проводимых Биржей.
- 3.1.4. Участник клиринга принадлежит к категории «Б», если он является кредитной организацией, созданной в соответствии с законодательством РФ, и совершает сделки на денежном рынке на Бирже.
- 3.1.5. Участник клиринга принадлежит к категории «И», если он выступает в качестве Инициатора торгов в соответствии с Внутренними документами Биржи 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 Внутренними документами Биржи и использует для исполнения обязательств по итогам клиринга средства, учитываемые на клиринговых регистрах, предназначенных для учета средств зачисленных на клиринговый счет.
- 3.1.7. Участник клиринга принадлежит к категории «Т», если он является Участником торгов на товарном рынке в соответствии с Внутренними документами Биржи и использует для исполнения обязательств по итогам клиринга средства, на счете внутреннего учета, зарегистрированном для Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ.
- 3.1.8. Участник клиринга принадлежит к категории «К», если он является участником торгов на товарном рынке, является Контролером поставки и



использует для исполнения обязательств по итогам клиринга средства, на счете внутреннего учета, зарегистрированном для Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ.

- 3.1.9. 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 надлежащего заполнения бланка Договора (Приложение №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 для проведения денежных расчетов по сделкам, которые он планирует в дальнейшем заключать на Бирже (за исключением Кандидатов в Участники клиринга категории «В», «Т», «К»);
- 3.2.2. Кандидатам в Участники клиринга категории «Ф», необходимо дополнительно:
- 3.2.2.1. открыть торговые счета депо в Расчетном депозитарии для проведения расчетов в ценных бумагах по сделкам, которые он планирует в дальнейшем заключать на Бирже;
 - 3.2.2.2. выдать СПВБ Уведомление о взаимосвязи торгового счета депо и торгового банковского счета Участника клиринга (Приложение № 3).
- 3.2.3. Индивидуальным предпринимателям - кандидатам в Участники клиринга категории «Т», необходимо дополнительно предоставить:
- 3.2.3.1. Нотариально заверенную копию или копию, заверенную уполномоченным сотрудником СПВБ (при представлении оригинала), паспорта
 - 3.2.3.2. Нотариально заверенную копию свидетельства о постановке на учет в налоговом органе
 - 3.2.3.3. Нотариально заверенную копию свидетельства о регистрации предпринимателя
 - 3.2.3.4. В случае необходимости, предоставить подтверждение допуска Участника клиринга к заключению Договоров поставки с тем или иным товаром от Контролера поставки.



- 3.2.4. Иностранным юридическим лицам - кандидатам в Участники клиринга категории «Г», необходимо дополнительно предоставить документы с нотариально заверенным переводом на русский язык:
- 3.2.4.1. Нотариально заверенную копию легализованных в надлежащем порядке документов, подтверждающих правовой статус юридического лица по законодательству страны, где создано это юридическое лицо, в частности учредительные документы и документы, подтверждающие государственную регистрацию юридического лица
- 3.2.4.2. Нотариально заверенную копию легализованного в надлежащем порядке документа, подтверждающего избрание единоличного исполнительного органа
- 3.2.4.3. Нотариально заверенную копию свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (о присвоении ИНН) или свидетельства об учете в налоговом органе (о присвоении КИО).
- 3.2.4.4. Нотариально заверенную копию справки об учете в ЕГРПО (если нерезидент подлежит постановке на учет) (при наличии)
- 3.2.5. Если Кандидат в Участники клиринга категории «Б» или категории «Ф», ранее предоставил СПВБ как Бирже 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:
- 3.2.5.1. Нотариально удостоверенные копии учредительных документов (со всеми изменениями и дополнениями);
- 3.2.5.2. Нотариально удостоверенная копия документа о постановке на учет в налоговом органе;
- 3.2.5.3. 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»);
- 3.2.5.4. Нотариально удостоверенная копия лицензии Банка России на право совершения банковских операций (для категории «Б»);
- 3.2.5.5. 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»);
- 3.2.5.6. 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»);



- 3.2.5.7. Заверенные в установленном порядке копии документов, подтверждающих полномочия должностных лиц Кандидата в Участники клиринга на подписание от его имени документов;
- 3.2.5.8. Нотариально удостоверенная карточка с образцами оттиска печати и подписей лиц Кандидата в Участники клиринга, наделённых правом первой и второй подписи (для категорий - «В», «Т», «К»);
- 3.2.6. Требование п.3.2.2.1., 3.2.5.1., 3.2.5.2., 3.2.5.5.,3.2.5.6. не распространяется на Участника клиринга категории «Ц»
- 3.2.7. Кандидат в Участники клиринга категории «И», планирующий размещать денежные средства на кредитном рынке обязан предоставить документы, предусмотренные пп. 3.2.5.1–3.2.5.2, 3.2.5.7, 3.2.5.8, и дополнительно согласовать с СПВБ текст Генерального соглашения, на основании которого будут совершаться сделки.
- 3.2.8. 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 свободных денежных средств на торговом банковском счете
- 3.2.9. Кандидат в Участники клиринга категории «Т» или «К» обязан присоединиться к ЭДО СПВБ.
- 3.2.10. Кандидат в Участники клиринга должен быть Участником торгов на Бирже или Участником торгов в АО «Биржа «Санкт – Петербург».

3.3. Порядок регистрации Участников клиринга и клиентов Участника клиринга

- 3.3.1. СПВБ на основании предоставленной Участниками клиринга информации осуществляет регистрацию Участников клиринга с присвоением каждому Участнику клиринга регистрационного кода в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России.
- 3.3.2. СПВБ осуществляет регистрацию Участника клиринга согласно Регламенту осуществления допуска, приостановления, возобновления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», утвержденного решением Правления СПВБ.
- 3.3.3. В случае, если Участник клиринга осуществляет доверительное управление, данному Участнику клиринга присваиваются регистрационные коды с уникальной последовательностью символов, однозначно указывающих на то, что этот код присвоен лицу, действующему в качестве доверительного управляющего.
- 3.3.4. СПВБ осуществляет регистрацию клиентов Участника клиринга с присвоением регистрационных кодов указанным лицам.



- 3.3.5. В случае, если Участники клиринга являются участниками торгов на Бирже, регистрационные коды Участнику клиринга могут присваиваться на основании кодов, присвоенных этим лицам Биржей, если это не противоречит действующим нормативным актам Банка России.
- 3.3.6. СПВБ при регистрации участников клиринга и клиентов участника клиринга вносит присвоенный код в «Реестр участников клиринга» или «Реестр клиентов участника клиринга» и информирует Участника клиринга о присвоенных регистрационных 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., Клиенту необходимо открыть торговый счет депо в Расчетном депозитарии под управлением Участника клиринга, для учета индивидуального клирингового обеспечения, которое будет использоваться только для исполнения обязательств такого Клиента, и предоставить Уведомление (Приложение №3) о взаимосвязи между торговыми счетами.
- 3.3.9. В случае, необходимости отдельного учета индивидуального клирингового обеспечения Клиента Участника клиринга, планирующего размещение ценных бумаг такого Клиента, Участник клиринга может открыть отдельный торговый счет для совершения операций с денежными средствами такого Клиента, для учета размещаемых ценных бумаг такого Клиента используется раздел «к размещению/выкупу» на специальном техническом счете в Расчетном депозитарии.
- 3.3.10. В случае, необходимости отдельного учета обеспечения Клиента Участника клиринга категории «Т», СПВБ по требованию Участника клиринга открывает счет внутреннего учета на клиринговом счете СПВБ для учета обеспечения, которое будет использоваться для исполнения обязательств участника клиринга, действующего в интересах такого Клиента.

3.4. Порядок приостановления, возобновления 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 в отношении отдельных видов обязательств, например, обязательств, вытекающих из сделок на определенном рынке (в определенной биржевой секции). Допуск к клиринговому обслуживанию прекращается или приостанавливается с момента получения СПВБ информации о наличии оснований для прекращения или приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию. Обязательства Участника клиринга по сделкам, совершенным после получения указанной информации, к клирингу не допускаются, допуск обязательств возобновляется после возобновления допуска к клиринговому обслуживанию.
- 3.4.2. 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.
- 3.4.3. В случае если допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию был приостановлен, допуск восстанавливается на следующий рабочий день, после установления факта прекращения действия оснований приостановления допуска, указанных в настоящих Правилах.
- 3.4.4. СПВБ информирует Участника клиринга о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию в порядке, установленном для направления Участнику клиринга отчетов.
- 3.4.5. СПВБ прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в случае:
- 3.4.5.1. прекращения Договора, в том числе в связи с ликвидацией Участника, как юридического лица;
 - 3.4.5.2. введения в отношении Участника клиринга любой из процедур банкротства, при этом СПВБ осуществляет все действия, установленные подразделом 5.8 настоящих Правил;
 - 3.4.5.3. отзыва у Участника клиринга категории «Ф» лицензий профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской, дилерской деятельности или деятельности по управлению ценными бумагами;
 - 3.4.5.4. отзыва у Участника клиринга категории «Б» лицензии на осуществление банковских операций;
 - 3.4.5.5. получения от организатора торговли информации о прекращении допуска к участию в торгах;
 - 3.4.5.6. отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга, имеющего одновременно категории «Б» и «Ф».



- 3.4.5.7. в случае отзыва лицензий профессионального участника рынка ценных бумаг у Участника клиринга, имеющего одновременно категории «Б» и «Ф», СПВБ прекращает доступ к клиринговому обслуживанию только в отношении обязательств, вытекающих из сделок с ценными бумагами.
- 3.4.6. СПВБ вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию частично в одной или нескольких биржевых секциях СПВБ в зависимости от принадлежности к категории, в случае получения информации об исключении его из участников торгов в одной или нескольких секциях СПВБ.
- 3.4.7. СПВБ вправе приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в случае:
- 3.4.7.1. если в отношении Участника клиринга, участвующего в сделках с ценными бумагами и имеющего категорию «Ф», приостановлено действие лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской или дилерской деятельности, или деятельности по управлению ценными бумагами;
- 3.4.7.2. применения Банком России в отношении Участника клиринга санкций (в том числе запрета на совершение определенных операций), делающих невозможным совершение сделок, обязательства по которым допускаются к клирингу;
- 3.4.7.3. 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;
- 3.4.7.4. не уведомления СПВБ Участником клиринга об изменении реквизитов его банковского счета согласно п.4.3.6 настоящих Правил в результате чего денежные средства перечисляемые Участнику клиринга в соответствии с настоящими Правилами были возвращены на клиринговый счет СПВБ;
- 3.4.7.5. неоднократного и систематического неисполнения Участником клиринга обязательств по Договорам поставки товара. При этом неоднократность или систематическое нарушение определяются в соответствии с Внутренними документами Биржи;
- 3.4.7.6. неуплаты Участником клиринга категории «К» Неустойки по Договору поставки товара в соответствии с требованием СПВБ, выставленным в соответствии с настоящими Правилами;
- 3.4.7.7. неоплаты Участником клиринга услуг СПВБ в порядке и сроки, установленные Тарифами СПВБ.



4. Права и обязанности СПВБ и Участников клиринга

4.1. Обязанности СПВБ

- 4.1.1. Осуществлять клиринговое обслуживание Участников клиринга в соответствии с требованиями настоящих Правил и иных нормативных актов Российской Федерации.
- 4.1.2. Уведомлять Участников клиринга об изменениях и дополнениях, внесенных в настоящие Правила путем размещения информации об их регистрации и дате вступления в силу на официальном сайте в сети интернет.
- 4.1.3. Осуществлять определение обязательств Участников клиринга по сделкам клирингового пула в соответствии с Договором и настоящими Правилами.
- 4.1.4. Обеспечивать обособленный учет обязательств каждого Участника клиринга посредством ведения клиринговых регистров.
- 4.1.5. Осуществлять прием и обработку информации от Расчетного депозитария, в том числе при проведении операций по размещению ценных бумаг: об остатках ценных бумаг на торговых счетах депо Участников клиринга, на разделе специального технического счета «к размещению/выкупу», а также иную информацию, касающуюся проведения операций по торговым счетам депо Участников клиринга в Расчетном депозитарии, от Расчетной организации о размерах денежных средств на торговых счетах Участников клиринга,
- 4.1.6. Осуществлять формирование и передачу в Расчетный депозитарий - распорядителей на проведение операций по торговым счетам Участников клиринга, разделу специального технического счета «к размещению/выкупу», в Расчетную организацию - распорядителей на проведение операций по торговым счетам Участников клиринга по итогам сделок, а также учет и хранение данных распорядителей посредством ведения «Реестра распорядителей, направленных расчетному депозитарию» и «Реестра распорядителей, направленных расчетной организации».
- 4.1.7. Осуществлять контроль исполнения в Расчетном депозитарии и Расчетной организации распорядителей, содержащих нетто-обязательства и нетто-требования Участников клиринга, рассчитанные по результатам клиринга.
- 4.1.8. Осуществлять формирование отчетов по итогам клиринга для каждого Участника клиринга, каждого зарегистрированного в порядке согласно п.3.3.7., 3.3.8., Клиента и их передачу Участникам клиринга в сроки, установленные настоящими Правилами.



- 4.1.9. Организовать систему мер по защите информации в соответствии с «Порядком хранения и защиты информации».
- 4.1.10. 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 распоряжениях.
- 4.1.11. Организовать систему управления рисками при осуществлении клиринговой деятельности.
- 4.1.12. Для обеспечения исполнения обязательств организовать использование индивидуального клирингового обеспечения.
- 4.1.13. Предоставить Участникам клиринга категории «Т» и категории «К» доступ к ЭДО СПВБ
- 4.1.14. Вести внутренний учет средств Участников клиринга и клиентов Участников клиринга, находящихся на клиринговом счете СПВБ.

4.2. Права СПВБ

- 4.2.1. В одностороннем порядке вносить изменения и дополнения в настоящие Правила, с учетом ограничений, установленных п.1.4.3. настоящих Правил.
- 4.2.2. Приостановить, возобновить или прекратить доступ Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, в порядке, определенном п.3.4. настоящих Правил.
- 4.2.3. Отказаться от исполнения Договора в порядке, определенном п.2.3.2 настоящих Правил.
- 4.2.4. 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, Участник клиринга обязан предоставить СПВБ новые редакции документов, заверенные в установленном п.3.2. порядке.
- 4.3.4. Взаимодействовать с СПВБ в порядке, определенном настоящими Правилами.
- 4.3.5. Исполнять положения настоящих Правил.
- 4.3.6. Уведомлять СПВБ об изменении платежных реквизитов путем предоставления новой Анкеты Участника клиринга.



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. Допуск обязательств к клирингу осуществляется СПВБ внесением записей в соответствующие регистры после получения информации о заключенных сделках.
- 5.1.2. В клиринговые пулы включаются обязательства по следующим видам сделок:
- 5.1.3. Сделки РЕПО;
- 5.1.4. Сделки с ценными бумагами, кроме сделок РЕПО;
- 5.1.5. Депозитные сделки;
- 5.1.6. Сделки с Биржевым товаром (Договоры поставки товара), совершенные на АО «Биржа Санкт-Петербург».
- 5.1.7. Клиринговый пул формируется по сделкам, срок исполнения обязательств по которым наступил.
- 5.1.8. Обязательства по сделкам, заключенным в различных биржевых секциях, а также обязательства, имеющие различные условия (в том числе временные) расчетов, включаются в отдельные клиринговые пулы. Клиринговые пулы формируются в течение рабочего дня во время, установленное «Внутренним регламентом клиринговой организации» (далее – Внутренний регламент СПВБ)
- 5.1.9. К клирингу допускаются обязательства, по сделкам с ценными бумагами (в том числе по сделкам РЕПО), по депозитным сделкам, по кредитным сделкам, совершенным на Бирже, по сделкам с Биржевым товаром (Договорам поставки товара), совершенным на АО «Биржа Санкт-Петербург».
- 5.1.10. При проведении клиринга СПВБ осуществляет процедуру контроля обеспеченности обязательств, включаемых в клиринговый пул (подраздел 5.3 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, установленным согласно подразделу 10.4 Правил.
- 5.1.11. Порядок приема и обработки информации от Расчетной организации и Расчетного депозитария о размерах остатков на торговых счетах Участников клиринга, на разделе «к размещению/выкупу» 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:
- 5.1.11.1. порядок доступа к информации и условия соблюдения конфиденциальности;
 - 5.1.11.2. виды и форматы принимаемых и передаваемых документов;
 - 5.1.11.3. сроки и порядок передачи документов;
 - 5.1.11.4. полномочия сотрудников СПВБ, Расчетной организации и Расчетного депозитария, осуществляющих указанные операции;
 - 5.1.11.5. порядок обработки и контроля полученной информации;
 - 5.1.11.6. условия дублирования и резервирования каналов передачи информации;
 - 5.1.11.7. условия и сроки хранения полученных документов.
- 5.1.12. Расчетная организация передает СПВБ документы по торговым банковским счетам Участников клиринга и клиринговым счетам СПВБ в формате, согласованном в договоре между Расчетной организацией и СПВБ.
- 5.1.13. Расчетный депозитарий передает СПВБ документы по торговым счетам депо Участников клиринга и по разделу «к размещению/выкупу» специального технического счета в формате, согласованном в договоре между Расчетным депозитарием и СПВБ.
- 5.1.14. Время и порядок обмена документами между СПВБ и Расчетным депозитарием и СПВБ и Расчетной организацией определяется договорами между СПВБ и Расчетным депозитарием и СПВБ и Расчетной организацией.

5.2. Порядок проведения клиринга (кроме клиринга Договоров поставки товара). Расчет нетто-обязательств и нетто-требований

- 5.2.1. 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 зарегистрированных в клиринговой организации Клиентов Участников клиринга) по обязательствам Участников клиринга, включенным в клиринговый пул.
- 5.2.2. Нетто-обязательства (нетто-требования) Участника клиринга по обязательствам Участника клиринга, включенным в клиринговый пул, определенных из реестра сделок, полученного от Биржи, рассчитываются



в отношении торговых счетов, разделов «к размещению/выкупу» или в отношении счетов внутреннего учета средств Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ по формуле:

$НО = СТ - СО$, где:

НО - нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга.

СТ - сумма требований Участника клиринга по обязательствам, включенным в клиринговый пул.

СО - сумма обязательств Участника клиринга по обязательствам, включенным в клиринговый пул.

Отрицательное значение НО означает нетто-обязательство Участника клиринга, положительное значение НО - нетто-требование Участника клиринга по ценным бумагам и/или денежным средствам в отношении других участников клиринга.

НО по торговому банковскому счету определяется в валюте соответствующего торгового банковского счета.

НО по счету внутреннего учета на клиринговом счете СПВБ определяется в валюте соответствующего клирингового счета СПВБ.

НО по торговому счету депо, по счету депо внутреннего учета, по разделу «к размещению/выкупу» определяется в разрезе каждого выпуска ценных бумаг.

- 5.2.3. Для сделок купли-продажи ценных бумаг, обязательство (требование) по ценным бумагам равно количеству ценных бумаг, проданных (купленных) в соответствии с заключенными сделками, включенными в клиринговый пул. Участник клиринга имеет обязательство (требование) по ценным бумагам, если он выступает продавцом (покупателем) ценных бумаг соответственно.
- 5.2.4. Для сделок купли-продажи ценных бумаг, обязательство (требование) по денежным средствам равно сумме обязательств по сделкам покупки (продажи) ценных бумаг. Участник клиринга имеет обязательство (требование) по денежным средствам, если выступает покупателем (продавцом) ценных бумаг соответственно.
- 5.2.5. 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.
- 5.2.6. 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.

- 5.2.7. Для сделок РЕПО в день исполнения первых и вторых частей сделок РЕПО, обязательство (требование) по денежным средствам равно сумме сделки 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.
- 5.2.8. Для сделок с кредитами и депозитами, обязательство (требование) по денежным средствам в день исполнения обязательств по предоставлению кредитов, размещению депозитов равно сумме кредитных и депозитных договоров. Участник клиринга имеет обязательство (требование) по денежным средствам, если размещает (привлекает) денежные средства соответственно.
- 5.2.9. 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.5.2.10), 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.
- 5.2.10. Если документами, определяющими порядок расчетов по сделкам с определенными Биржевыми инструментами денежного рынка, установлено, что расчеты по отдельным видам обязательств по сделкам осуществляются без участия СПВБ, то обязательства Участников клиринга по денежным средствам рассчитываются без учета указанных обязательств.
- 5.2.11. Если документами, определяющими совершение сделок с определенным Биржевым инструментом, установлено, что комиссионное вознаграждение Биржи по сделке подлежит оплате с использованием счетов в Расчетной организации, то распоряжение на оплату комиссионного вознаграждения передаются Клиринговой организацией в Расчетную организацию в дату исполнения обязательств по уплате комиссионного вознаграждения.



5.3. Процедура контроля обеспечения

- 5.3.1. При формировании клирингового пула СПВБ проверяет обеспеченность ценными бумагами и денежными средствами всех обязательств Участника клиринга, включенных в клиринговый пул.
- 5.3.2. СПВБ проверяет обеспеченность всех сделок клирингового пула 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, на разделе «к размещению/выкупу» после получения данных из Расчетного депозитария. Сравнение производится только для отрицательных значений регистров обязательств.
- 5.3.3. 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, на разделе «к размещению/выкупу» все сделки Участника клиринга считаются обеспеченными ценными бумагами.
- 5.3.4. СПВБ проверяет обеспеченность всех сделок клирингового пула денежными средствами (кроме сделок с Биржевым товаром) путем сравнения значений клиринговых регистров, перечисленных в подразделе 8.4, со значениями клиринговых регистров, перечисленных в пп.8.3.2, 8.3.5 и содержащих информацию о сумме денежных средств, свободных от обязательств, на торговых банковских счетах Участников клиринга или счетах внутреннего учета средств Участников клиринга на клиринговых счетах СПВБ. Вычисление значений регистров, указанных в пп. 8.3.2, 8.3.5 производится на основании значений регистров, указанных в пп.8.3.1, 8.3.3, 8.3.4, 8.3.6 после получения данных из Расчетной организации. Сравнение производится только для отрицательных значений регистров обязательств.
- 5.3.5. 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, все сделки Участника клиринга считаются обеспеченными денежными средствами.
- 5.3.6. Для сделки с Биржевым товаром СПВБ проверяет обеспеченность сделки денежными средствами путем сравнения раздела регистра, указанного в п.8.3.9 (для собственных сделок Участника клиринга) или в п.8.3.10 (для сделок, заключенных за счет клиентов Участника клиринга), для обеспечения конкретного Договора поставки товара с разделом регистра учета обязательств по указанному конкретному Договору поставки товара. Сделка считается обеспеченной, когда сумма на разделе для учета обеспечения по Договору поставки товара равна обязательству (или больше обязательства) по этому Договору поставки товара.



5.4. Порядок и условия исключения обязательств из клирингового пула

- 5.4.1. В том случае, когда при проверке обеспеченности обязательств (кроме обязательств с Биржевым товаром), включенных в клиринговый пул модули значений нетто-обязательств Участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам превышают значения клиринговых регистров, содержащих информацию о свободных денежных средствах и ценных бумагах Участников клиринга, СПВБ осуществляет исключение необеспеченных обязательств из клирингового пула.
- 5.4.2. 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 исполнимости обязательств не позволяет однозначно определить исключаемые обязательства (т.е. максимальной исполнимости 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 Биржи, в том числе по номеру сделки, присвоенному Биржей. Изложенные в настоящем пункте критерии применяются для всех случаев, за исключением специально указанных в данном подразделе.
- 5.4.3. Обязательства по сделкам с ценными бумагами исключаются в следующем порядке:
- 5.4.3.1. обязательства по первой части сделки РЕПО;
 - 5.4.3.2. обязательства по второй части сделки РЕПО;
 - 5.4.3.3. обязательства по прочим сделкам с ценными бумагами.
- 5.4.4. 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 Бирже для урегулирования в соответствии с Правилами торговли. Исключение указанных обязательств из клирингового пула производится в соответствии с п.5.4.2.
- 5.4.5. В случае, если после исключения из клирингового пула обязательств по исполнению вторых частей сделок РЕПО Участник клиринга имеет необеспеченные обязательства по сделкам с кодом расчетов «Sn», такие обязательства прекращаются в клиринговом пуле выплатой неустойки. 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. 5.4.2.
- 5.4.6. 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.

- 5.4.7. 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.
- 5.4.8. В случае недостатка обеспечения по депозитным сделкам у Участника клиринга категории «В», из клирингового пула исключаются все обязательства по сделкам данного Участника клиринга в отношении тех Участников клиринга категории «Б», которые имеют нетто-требования (положительное значение НО, вычисленного в соответствии с п.5.2.2 настоящих Правил) в отношении указанного Участника клиринга категории «В».
- 5.4.9. В случае недостатка обеспечения по депозитным сделкам у Участника клиринга категории «Б», из клирингового пула исключаются все обязательства по сделкам указанного Участника клиринга с Участником клиринга категории «В», в отношении которого выявлен недостаток обеспечения.
- 5.4.10. В случае недостатка обеспечения по сделкам в Секции МКР, кроме случаев, указанных в п.5.4.7, п.5.4.8 и п. 5.4.9, из клирингового пула исключаются обязательства в соответствии с п. 5.4.2.
- 5.4.11. После проведения описанных в настоящем подразделе действий по исключению обязательств из клирингового пула, СПВБ направляет распоряжения в Расчетную организацию и расчетный депозитарий для проведения расчетов, после чего необеспеченные обязательства включаются в следующий клиринговый пул, окончание проведения таких действий определяется регламентом проведения расчетов.
- 5.4.12. При проведении контроля значений клиринговых регистров СПВБ осуществляет сверку значений торговых 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 счетах внутреннего учета средств Участников клиринга на клиринговом счете СПВБ с учетом исполнения их нетто-обязательств и нетто-требований.
- 5.4.13. В том случае, если в результате сверки обнаружены расхождения, СПВБ выполняет действия по согласованию результатов расчетов согласно п.5.7.
- 5.4.14. Если денежные средства для обеспечения исполнения по определенному Договору поставки товара не поступили в полном объеме (с учетом заблокированного ранее начального Гарантийного обеспечения, определенного п.6.1.9) на клиринговый счет СПВБ, СПВБ фиксирует



недостаток обеспечения по указанному Договору поставки товара и исключает указанный Договор поставки товара из клирингового пула.

- 5.4.15. Если по Договору поставки товара, исключенному из клирингового пула, не наступила Дата обеспечения, указанный Договор поставки товара включается в клиринговый пул, формируемый в следующей клиринговой сессии. Неттинг по Договорам поставки товара не проводится.

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

- 5.5.1. Расчеты по нетто-обязательствам и нетто-требованиям Участников клиринга по денежным средствам осуществляет Расчетная организация на основании Распоряжений на проведение операций, полученных от СПВБ.
- 5.5.2. Расчеты по нетто-обязательствам и нетто-требованиям Участников клиринга по ценным бумагам осуществляет Расчетный депозитарий на основании Распоряжений на проведение операций, полученных от СПВБ.
- 5.5.3. Все распоряжения на операции по итогам проведения клиринга формируются СПВБ на основании полученных от Биржи реестров сделок по итогам торгов, без дополнительного подтверждения сделок со стороны Участников клиринга.
- 5.5.4. На основании значений клиринговых регистров, перечисленных в подразделах 8.2 и 8.4, СПВБ формирует и передает:
- 5.5.4.1. в Расчетный депозитарий - Распоряжения на проведение операций по торговым счетам депо, по разделу «к размещению/выкупу», являющиеся основаниями для проведения операций по торговым счетам депо Участников клиринга, по разделу «к размещению/выкупу». Распоряжения передаются в Расчетный депозитарий, в котором открыты торговые счета, раздел «к размещению/выкупу» на специальном техническом счете для учета ценных бумаг;
- 5.5.4.2. в Расчетную организацию – Распоряжение на проведение операций по торговым банковским счетам, являющееся основанием для проведения операций по торговым банковским счетам Участников клиринга и клиринговым счетам СПВБ. Распоряжение передается в Расчетную организацию, в которой открыты торговые счета, для учета денежных средств.
- 5.5.5. Распоряжения, указанные в п.5.5.4, 5.5.13 и 5.5.14, передаются в форме электронных документов. Реквизиты указанных документов, форматы и способы передачи перечисленных документов устанавливаются договорами СПВБ с Расчетным депозитарием и Расчетной организацией.
- 5.5.6. На основании полученных от СПВБ распоряжений Расчетный депозитарий и Расчетная организация осуществляют переводы ценных



бумаг и денежных средств по торговым счетам Участников клиринга, по разделу «к размещению/выкупу». Время осуществления операций определяется договорами СПВБ с Расчетной организацией и Расчетным депозитарием.

- 5.5.7. 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 на клиринговый банковский счет СПВБ:
- 5.5.8. Сумма комиссионного вознаграждения организатора торговли, взимаемая с участников торгов на СПВБ списывается на счет СПВБ в Расчетной организации, предназначенный для осуществления расчетов по уплате комиссионного вознаграждения Участниками клиринга.
- 5.5.9. Размер и порядок оплаты комиссионного вознаграждения организатора торговли для Банка России и Минфина по операциям размещения ценных бумаг регулируется договором и предусматривает уплату такого вознаграждения на основании счетов, выставляемых на Банк России и передаваемых через Личный кабинет.
- 5.5.10. 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»).
- 5.5.11. При проведении расчетов по депозитным сделкам СПВБ во внутреннем учете по клиринговому счету проводит списание денежных средств Участников клиринга категории «В» в размере их нетто-обязательств и зачисление в размере их нетто-требований.
- 5.5.12. Расчетный депозитарий на основании Распоряжения на проведение операций по разделам торговых счетов депо осуществляет 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 в день исполнения обязательств.
- 5.5.13. Расчетный депозитарий осуществляет переводы по торговым счетам депо Участников клиринга в корреспонденции со специальным техническим счетом, не предназначенным для учета прав на ценные бумаги. Указанный специальный технический счет используется Расчетным депозитарием для обеспечения процедуры поставки ценных бумаг в соответствии с распоряжением СПВБ, содержащим нетто-обязательства и нетто-требования 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



определяется Условиями осуществления депозитарной деятельности данного Расчетного депозитария в соответствии с действующим законодательством Российской Федерации, договором между СПВБ и Расчетным депозитарием и иными внутренними документами СПВБ.

5.5.14. В течении одного дня возможно проведение нескольких размещений ценных бумаг. При проведении размещения ценных бумаг Расчетный депозитарий на основании поручения СПВБ на зачисление размещаемых ценных бумаг и получения необходимых отчетов от вышестоящего депозитария зачисляет размещаемые ценные бумаги на раздел «к размещению/выкупу» специального технического счета. Далее Расчетный депозитарий на основании Распоряжения на проведение операций по разделу «к размещению/выкупу» осуществляет списание ценных бумаг в размере нетто-обязательств с раздела «к размещению/выкупу» и их зачисление на торговые счета депо Участников клиринга, имеющих нетто-требования по ценным бумагам по сделкам с кодом расчетов «Вп» в день исполнения обязательств по размещению ценных бумаг. Если после исполнения вышеуказанного распоряжения на разделе «к размещению/выкупу» остались неразмещенные ценные бумаги, то Расчетный депозитарий, на основании поручения СПВБ на списание неразмещенных ценных бумаг с раздела «к размещению/выкупу» подает в вышестоящий депозитарий поручение на списание неразмещенных ценных бумаг со своего счета депо номинального держателя на эмиссионный счет Эмитента. Эмитент подает встречное поручение на зачисление неразмещенных ценных бумаг на свой эмиссионный счет. После исполнения вышестоящим депозитарием операции по зачислению ценных бумаг на эмиссионный счет Эмитента, Расчетный депозитарий передает клиринговой организации СПВБ отчет об исполнении поручения на списание неразмещенных ценных бумаг с раздела «к размещению/выкупу». После проведения всех операций остаток на разделе «к размещению/выкупу» не допускается.

5.5.15. При проведении выкупа ценных бумаг Эмитентом Расчетный депозитарий, на основании распоряжения СПВБ, осуществляет списание ценных бумаг в размере нетто-обязательств с торговых счетов депо Участников клиринга и их зачисление на раздел «к размещению/выкупу» специального технического счета, по сделкам с кодом расчетов «Вп» в день исполнения обязательств по выкупу ценных бумаг. После исполнения вышеуказанного распоряжения Расчетный депозитарий, на основании поручения СПВБ на списание выкупленных ценных бумаг с раздела «к размещению/выкупу» подает поручение в вышестоящий депозитарий на списание выкупленного количества ценных бумаг со своего счета депо номинального держателя на казначейский счет Эмитента. Эмитент подает встречное поручение на зачисление выкупленных ценных бумаг на свой казначейский счет. После исполнения вышестоящим депозитарием операции списания Расчетный



депозитарий передает клиринговой организации СПВБ отчет об исполнении поручения на списание выкупленных ценных бумаг с раздела «к размещению/выкупу». После проведения всех операций остаток на разделе «к размещению/выкупу» не допускается.

- 5.5.16. Расчетная организация и Расчетный депозитарий передают СПВБ информацию о денежных средствах и ценных бумагах на торговых счетах Участников клиринга, на разделе «к размещению/выкупу», сформированную по итогам обработки распоряжений, указанных в п.5.5.4, в виде отчета об остатках на торговых счетах Участников клиринга, остатка на разделе «к размещению/выкупу». Время и порядок обмена электронными документами определяется договорами между СПВБ и Расчетной организацией и СПВБ и Расчетным депозитарием.
- 5.5.17. 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.

5.6. Порядок проведения сверки результатов расчетов

- 5.6.1. СПВБ на основании полученных из Расчетного депозитария и Расчетной организации Отчета об остатках ценных бумаг на торговых счетах депо, на разделе «к размещению/выкупу» и Отчета об остатках денежных средств на торговых банковских счетах, сформированных по итогам обработки Распоряжения на проведение операций по разделам торговых счетов депо, по разделу «к размещению/выкупу» и Распоряжения на проведение операций по торговым банковским счетам, соответственно, присваивает значения клиринговым регистрам, перечисленным в пп.8.1.1 – 8.1.11, 8.3.1, 8.3.4, настоящих Правил.
- 5.6.2. В клиринговой системе проводится сверка значений соответствующих клиринговых регистров, указанных в п.5.6.1, с данными, полученными в результате расчетов клиринговой системы на основании предыдущих значений указанных регистров и регистров обязательств, по каждому Участнику клиринга.
- 5.6.3. При отсутствии расхождений СПВБ направляет в Расчетную организацию, в Расчетный депозитарий уведомления о завершении расчетов
- 5.6.4. После получения от СПВБ уведомлений о согласии на проведение операций, Расчетная организация и Расчетный депозитарий исполняют



поручения Участника клиринга по торговым банковским счетам и торговым счетам депо Участников клиринга, соответственно.

5.6.5. С момента направления уведомлений о завершении расчетов, расчеты по нетто-обязательствам и нетто-требованиям Участников клиринга считаются завершенными, обязательства Участников клиринга по сделкам клирингового пула считаются исполненными.

5.6.6. Порядок взаимодействия, время начала и сроки исполнения операций сверки определяются договорами СПВБ с Расчетной организацией и с Расчетным депозитарием.

5.7. Порядок действий в случае расхождения данных при сверке

5.7.1. В случае обнаружения расхождений при проведении сверки 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.

5.7.2. 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.

5.7.3. В зависимости от характера выявленных причин расхождения данных СПВБ, Расчетная организация или Расчетный депозитарий повторно выполняют действия, описанные в подразделе 5.5 Правил и Договорах о взаимодействии между СПВБ и Расчетной организацией, между СПВБ и Расчетным депозитарием.

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

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

5.8.2. Обязательства/требования Участника клиринга – кредитной организации прекращаются возникновением ликвидационных нетто-



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

5.8.3. СПВБ рассчитывает ликвидационные нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, возникающие взамен прекращенных в соответствии с п.5.8.1, 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:

5.8.3.1. заключенным Участником клиринга за свой счет,

5.8.3.2. заключенным Участником клиринга за счет своих клиентов,

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

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

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

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

где НО – ликвидационное нетто-обязательство /нетто-требование в отношении соответствующего контрагента по сделкам соответствующего вида, указанного в п.5.8.3,

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 Биржи и торговых сегментах; при наличии обязательств/требований по возврату средств по депозитным/кредитным сделкам у Участника клиринга или контрагента до даты признания Участника клиринга банкротом / даты отзыва лицензии (не включая указанные даты); при наличии обязательств/требований по вторым частям сделок РЕПО RT_i и RO_i определяется как сумма денежных средств, уплаченных (полученных) Участником клиринга по первой части сделок РЕПО, увеличенная на сумму начисленных по ставке РЕПО процентов за каждый день с даты исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО до даты признания Участника клиринга банкротом / даты отзыва лицензии (не включая указанные даты);



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

S_{kT_1} и S_{kO_1} - требование и обязательство по k -той ценной бумаге по l -той сделке с этой ценной бумагой;

S_{kl} – цена k -той ценной бумаге по l -той сделке, принимаемая равной рыночной цене ценной бумаги на день предшествующий дню расчета ликвидационных нетто-обязательств. Рыночная цена определяется согласно «Правилам организованных торгов Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа». Если рыночная цена ценной бумаги не определялась значение S_{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.

5.8.6. СПВБ направляет Участнику клиринга и его контрагентам уведомление о прекращении обязательств/требований по сделкам, допущенным к клирингу и рассчитанных в соответствии с п.5.8.5 размерах ликвидационных нетто-обязательств / нетто-требований в дату расчета.

5.8.7. Денежные средства и иное имущество Участника клиринга, находящиеся на торговых и клиринговых счетах после расчета ликвидационных нетто-обязательств / нетто-требований, подлежат возврату Участнику клиринга, в том числе для включения в конкурсную массу. В этом случае СПВБ запрашивает у Участника клиринга, либо его правопреемника (представителя) реквизиты счетов для перечисления денежных средств и иного имущества не позднее рабочего дня, следующего за днем расчета ликвидационных нетто-обязательств. Возврат денежных средств и иного имущества осуществляется в течение 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения договора на оказание клиринговых услуг.

5.8.8. Денежные средства и иное имущество клиентов Участника клиринга, зарегистрированных в клиринговой системе могут быть переданы клиентам Участника клиринга или другим Участникам клиринга в порядке, установленном законодательством Российской Федерации.

5.9. Порядок проведения клиринга и исполнения обязательств по сделкам с Биржевым товаром (Договорам поставки товара)

5.9.1. В день получения реестра сделок от Биржи в отношении сделок с Биржевым товаром СПВБ открывает во внутреннем учете разделы



- регистра (п.8.3.9 или 8.3.10) для учета обеспечения по каждому Договору поставки товара и зачисляет на указанный раздел сумму в размере Гарантийного обеспечения Договора поставки товара в соответствии с разделом 6 Правил.
- 5.9.2. На следующий рабочий день после получения реестра сделок от Биржи в отношении сделок с Биржевым товаром СПВБ включает обязательства по указанным сделкам в клиринговый пул и проводит контроль обеспечения согласно п.5.3.6 настоящих Правил.
- 5.9.3. В отношении Договоров поставки товара, прошедших контроль обеспечения денежными средствами, СПВБ через систему ЭДО запрашивает Участника клиринга – Поставщика о готовности товара к поставке, если в соответствии с Внутренними документами Биржи установлена обязанность Покупателя совершить действия, необходимые для поставки Биржевого товара (предоставление реквизитных заявок, маршрутных телеграмм, оплата транспортных расходов и т.п.) или если Участник клиринга – Поставщик принадлежит к категории «К».
- 5.9.4. В случае получения от Участника клиринга категории «К» уведомления о готовности к поставке по Договору поставки товара, СПВБ списывает денежные средства в размере обязательства по Договору поставки товара с открытого для обеспечения исполнения указанного Договора поставки товара раздела регистра Участника клиринга – Покупателя, зачисляет на регистр свободных от обязательств средств Участника клиринга категории «К», являющегося Поставщиком по данному Договору поставки товара и списывает с клирингового счета указанные средства в пользу Поставщика, используя для перечисления банковские реквизиты, указанные в его Анкете Участника клиринга.
- 5.9.5. Участник клиринга категории «К», денежные обязательства по Договору поставки товара перед которым исполнены, обязан в течение 4 рабочих дней с Даты завершения поставки предоставить СПВБ отчет о завершении поставки (при необходимости с уведомлением о стороне, из-за действия (бездействия) которой поставка не была завершена в Дату завершения поставки).
- 5.9.6. Участник клиринга категории «Т», являющийся Поставщиком, обязан до Даты завершения поставки предоставить через ЭДО СПВБ подтверждение готовности к поставке в соответствии с запросом, определенном п.5.9.3 или уведомить СПВБ о неготовности к поставке на Дату завершения поставки. В последнем случае СПВБ исключает сделку из клирингового пула и ожидает от Поставщика и Покупателя действий согласно п.5.9.13 и п.5.9.14 настоящих Правил или разрешения спора по сделке в судебном порядке.
- 5.9.7. Участник клиринга категории «Т», являющийся Поставщиком, в течение 4 рабочих дней с Даты завершения поставки обязан предоставить через ЭДО СПВБ документы об осуществлении поставки (акт), а Участник клиринга, являющийся Покупателем в течение двух рабочих



дней с момента получения документов (акта), должен подтвердить через ЭДО СПВБ отсутствие возражений по предоставленным документам. При получении подтверждения поставки в соответствии с настоящим пунктом, СПВБ списывает денежные средства в размере обязательства по Договору поставки товара с открытого для обеспечения исполнения указанного Договора поставки товара раздела регистра Участника клиринга – Покупателя, зачисляет на регистр свободных от обязательств средств Участника клиринга категории «Т», являющегося Поставщиком по данному Договору поставки товара. Для получения денежных средств на свой счет в банке Участник клиринга категории «Т», являющийся Поставщиком, передает СПВБ поручение на отзыв средств.

- 5.9.8. После получения документов, определенных п.5.9.5 или п.5.9.6 СПВБ вносит в клиринговые регистры информацию о прекращении исполнением обязательств по Договору поставки товара.
- 5.9.9. В случае если на Дату обеспечения Договор поставки товара не прошел контроль обеспечения и исключен из клирингового пула, СПВБ списывает Неустойку по Договору поставки товара в размере суммы Гарантийного обеспечения, зачисленной в дату заключения сделки, на регистр, предназначенный для учета обеспечения по такому Договору поставки товара не прошедшего контроль обеспечения, открытого Участнику клиринга – Покупателю, и зачисляет Неустойку по этому Договору поставки товара на регистр свободных денежных средств Участника клиринга – Поставщика.
- 5.9.10. В случае нарушения Участником клиринга категории «К» обязанностей предусмотренных п.5.9.5 или получения в соответствии с п.5.9.5 уведомления о нарушении Участником клиринга категории «К» обязательств по поставке Биржевого товара СПВБ направляет уведомление о необходимости возврата суммы оплаты по Договору поставки товара и оплаты Неустойки по Договору поставки товара в размере, определенном в соответствии со Спецификацией биржевого товара, указанному Участнику клиринга. Участник клиринга категории «К» обязан зачислить на клиринговый счет СПВБ денежные средства в размере полученной оплаты по указанному Договору поставки товара и Неустойки по Договору поставки товара в соответствии с условиями Договора поставки товара. Не позднее следующего рабочего дня со дня зачисления указанных денежных средств СПВБ перечисляет поступившие средства контрагенту Участника клиринга категории «К» по Договору поставки товара. В случае невозврата суммы оплаты и (или) неоплаты Неустойки по Договору поставки товара в установленный срок, СПВБ имеет право приостановить клиринговое обслуживание Участника клиринга категории «К» в соответствии с п.3.4.7.6.
- 5.9.11. В случае нарушения Участником клиринга категории «Т», являющимся Поставщиком, требований п.5.9.7 при условии, что указанный Участник клиринга уведомлял СПВБ о готовности к поставке



по Договору поставки товара, СПВБ списывает Неустойку по Договору поставки товара в размере, определенном в соответствии со Спецификацией биржевого товара, с раздела регистра для учета обеспечения по Договору поставки товара, в отношении которого нарушены требования п.5.9.7, и зачисляет их на регистр свободных денежных средств Участника клиринга – Покупателя.

5.9.12. Оплата Неустойки по Договору поставки товара в соответствии с настоящим подразделом Правил прекращает обязательства по Договору поставки товара, учитываемые СПВБ. После оплаты Неустойки по Договору поставки товара СПВБ вносит в клиринговые регистры информацию о прекращении обязательств из Договора поставки товара способом отличным от исполнения (путем уплаты неустойки).

5.9.13. Участники клиринга, выступающие Продавцом и Покупателем по Договору поставки товара, могут проинформировать СПВБ о внесении изменений в существенные условия Договора поставки товара. Информация должна поступить по ЭДО СПВБ от обеих сторон Договора поставки товара. В этом случае СПВБ вносит изменения в клиринговые регистры, если изменились Дата обеспечения или Дата поставки товара или размер обязательств и осуществляет клиринг в соответствии с новыми параметрами Договора поставки товара.

5.9.14. Продавец и Покупатель информируют СПВБ о прекращении обязательств по Договору поставки товара по соглашению сторон в порядке, установленном п.5.9.13, Информация о прекращении обязательств из Договора поставки товара в обязательном порядке должна включать указание какой из сторон перечисляется с клирингового счета СПВБ Гарантийное обеспечение, заблокированное для обеспечения исполнения обязательств, по указанному Договору поставки товара на счете внутреннего учета Продавца и на счете внутреннего учета Покупателя. СПВБ вносит в клиринговые регистры информацию о прекращении обязательств из Договора поставки товара способом отличным от исполнения и перечисляет денежные средства, которые были заблокированы для обеспечения исполнения или исполнения указанного Договора поставки товара, Участникам клиринга в соответствии с полученным указанием. Прекращение обязательств по соглашению сторон не возможно в случае получения такого соглашения после штатного исполнения обязательств по Договору поставки товара или после прекращения обязательств по этому Договору поставки путем уплаты неустойки.

6. Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу

6.1. Индивидуальное клиринговое обеспечение

6.1.1. Индивидуальным клиринговым обеспечением является Гарантийное обеспечение.



- 6.1.2. Гарантийное обеспечение принимается в виде денежных средств и/или ценных бумаг. Для сделок с Биржевым товаром Гарантийное обеспечение принимается только в российских рублях.
- 6.1.3. Гарантийное обеспечение учитывается на соответствующих торговых счетах Участника клиринга, на разделе «к размещению/выкупу», Гарантийное обеспечение Участника клиринга категорий «В», «Т» и «К» учитывается на клиринговом счете СПВБ, во внутреннем учете СПВБ на 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 (кроме сделок с Биржевым товаром) Участником клиринга в клиринговые регистры, указанные в пп. 8.3.3, 8.3.6. вносятся сведения о суммах заблокированного Гарантийного обеспечения. При совершении сделок с Биржевым товаром на клиринговых регистрах, указанных в п.8.3.9, 8.3.10 открываются разделы для отдельного учета Гарантийного обеспечения по каждому Договору поставки товара, заключенного Участником клиринга, куда вносятся сведения о заблокированных суммах гарантийного обеспечения. Величина Гарантийного обеспечения для Биржевых инструментов устанавливается Спецификацией Биржевого инструмента. В случае заключения сделок на основании Генерального соглашения, величина Гарантийного обеспечения или порядок ее определения могут быть установлены Генеральным соглашением. Величина Гарантийного обеспечения сделок с Биржевыми товарами определяется в соответствии с п.6.1.9 настоящих Правил.
- 6.1.6. В случае, если на дату проведения расчетов обеспечение по сделке недостаточно (кроме сделок с Биржевым товаром, сделок, заключенных при размещении ОФЗ и/или ОБР), из-за отсутствия денежных средств или ценных бумаг на торговых счетах одного из Участников клиринга при том, что Участник клиринга, являющийся другой стороной по сделке, полностью исполнил свои обязательства, обязательства прекращаются путем уплаты неустойки в размере Гарантийного обеспечения Участником клиринга, имеющего необеспеченные обязательства, Участнику клиринга, выступающему второй стороной по сделке.
- 6.1.7. В случае, если по Договору поставки товара требуется уплатить Неустойку по Договору поставки товара согласно подразделу 5.9 настоящих Правил для уплаты используются только средства Гарантийного обеспечения, учтенные на разделе регистра Участника клиринга, нарушившего обязательства, предназначенном для учета Гарантийного обеспечения по конкретному Договору поставки товара.
- 6.1.8. Величина Гарантийного обеспечения (Гарантийного обеспечения необходимого на дату совершения сделки с Биржевым товаром) для



обеспечения Договора поставки товара устанавливается исходя из обязательств СПВБ по списанию Неустойки по Договору поставки товара, определенной в соответствии со Спецификацией биржевого товара. Величина Гарантийного обеспечения на Дату обеспечения и позже устанавливается равной сумме Договора поставки товара.

- 6.1.9. Гарантийное обеспечение, заблокированное для обеспечения исполнения Договора поставки товара со стороны Участника клиринга – Покупателя, используется для исполнения обязательств по этому Договору поставки товара.
- 6.1.10. Гарантийное обеспечение, заблокированное для обеспечения исполнения Договора поставки товара со стороны Участника клиринга – Поставщика разблокируется после внесения в клиринговые регистры информации о прекращении обязательств по указанному Договору поставки товара переводится на регистр «Денежные средства ГО Участника клиринга - товарный рынок - свободные», регистр «Денежные средства Участника клиринга - товарный рынок - заблокированные для исполнения» закрывается.

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

7.1. Виды торговых и клиринговых счетов

- 7.1.1. В соответствии с договором, заключенным с Участником клиринга, Расчетная организация для учета денежных средств и проведения расчетов по 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);
 - 7.1.1.4. отдельный специальный торговый счет (Участнику клиринга – для учета обеспечения Клиента, зарегистрированного в клиринговой 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 СПВБ, Расчетный депозитарий для учета ценных бумаг и проведения операций с ценными бумагами по результатам сделок, заключенных при размещении ценных бумаг, использует раздел специального технического счета «для размещения/выкупа».
- 7.1.7. В соответствии с договором, заключенным с Участником клиринга или Держателем, Расчетный депозитарий для учета ценных бумаг и проведения операций с ценными бумагами по результатам заключенных сделок открывает Участнику клиринга или Держателю торговые счета депо.
- 7.1.8. На торговых счетах депо учитываются ценные бумаги, используемые в качестве клирингового обеспечения.
- 7.1.9. Торговые счета депо подразделяются на:
- 7.1.9.1. торговый счет депо владельца, открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве;
 - 7.1.9.2. торговый счет депо номинального держателя, открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;
 - 7.1.9.3. торговый счет депо владельца с попечителем, открытый клиенту Участника клиринга, являющегося попечителем этого счета;
 - 7.1.9.4. торговый счет депо доверительного управляющего, открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг, находящихся у Участника клиринга в доверительном управлении;
 - 7.1.9.5. казначейский торговый счет депо, открытый Эмитенту для приобретения или отчуждения ценных бумаг в процессе их обращения.



- 7.1.9.6. торговый счет депо номинального держателя, открытый Держателю для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве;
 - 7.1.9.7. торговый счет депо номинального держателя, открытый Держателю для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;
 - 7.1.9.8. торговый счет депо, открытый Держателю для учета ценных бумаг, находящихся у Участника клиринга в доверительном управлении;
 - 7.1.9.9. торговый счет депо иностранного номинального держателя, открытый иностранному номинальному держателю для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;
 - 7.1.9.10. торговый счет депо иностранного уполномоченного держателя, открытый иностранному уполномоченному держателю, для учета ценных бумаг, переданных в управление иностранному уполномоченному держателю, обслуживаемому Участником клиринга.
- 7.1.10. В соответствии с договором между СПВБ и Расчетной организацией, последняя открывает СПВБ клиринговые счета для учета денежных средств, которые используются для обеспечения и 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 -5.5 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 в следующем порядке:
 - 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 5.5.
- 7.2.3. Денежные средства с торговых банковских счетов списываются в следующем порядке:
 - 7.2.3.1. по распоряжению СПВБ, 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 СПВБ в Расчетной организации, в порядке, установленном подразделом 5.5.



- 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 организации в отношении всех торговых банковских счетов или группы торговых банковских счетов.
- 7.2.6. Списание денежных средств с торговых банковских счетов по распоряжению Участника клиринга производится с согласия 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.
- 7.2.8. 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.
- 7.2.9. 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.
- 7.2.10. Списание денежных средств с торговых банковских счетов может производиться на основании уведомления о согласии на проведение операций по торговым банковским счетам, сформированного по окончании клиринговой сессии в отношении свободного остатка денежных средств на торговых банковских счетах.
- 7.2.11. Списание денежных средств с торговых банковских счетов может производиться на основании Распоряжения на списание денежных средств (Приложение №2), предоставленном СПВБ Участником клиринга.



- 7.2.12. Зачисление средств на торговые банковские счета и списание средств с торговых банковских счетов при исполнении обязательств по итогам клиринга производится на основании Распоряжения на проведение операций по торговым банковским счетам в порядке, установленном подразделом 5.5 настоящих Правил.
- 7.2.13. Участник клиринга, планирующий заключение на текущих торгах сделок «Т0» по покупке ценных бумаг за счет собственных средств, должен внести 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.
- 7.2.14. 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.
- 7.2.15. 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
- 7.2.16. Участник клиринга, имеющий нетто-обязательства по сделкам, заключенным на денежном рынке с текущей датой исполнения должен обеспечить наличие денежных средств на торговом банковском счете в Расчетной организации или на клиринговом счете СПВБ (для Участника клиринга категории «В») в количестве, необходимом для обеспечения исполнения его обязательств, в срок не позднее времени начала формирования клирингового пула по таким сделкам.
- 7.2.17. Участник клиринга, имеющий нетто-обязательства по денежным средствам по сделкам с кодом расчетов «Vn», должен обеспечить наличие денежных средств на торговом банковском счете в Расчетной организации в количестве, необходимом для обеспечения исполнения его обязательств, в срок не позднее времени начала формирования клирингового пула по данным ценным бумагам.

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

- 7.3.1. Открытие и закрытие торгового счета депо, в отношении которого получено указание о проведении операций по распоряжению или с согласия 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 или зачисляются по поручению Участника клиринга с согласия СПВБ, 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 5.5 настоящих Правил с использованием специального технического счета. При размещении ценных бумаг зачисление размещенных ценных бумаг на торговые счета депо производится на основании Распоряжений СПВБ с раздела «к размещению/выкупу» специального технического счета. При выкупе ценных бумаг списание ценных бумаг с торговых счетов депо производится на основании Распоряжений СПВБ на раздел «к размещению/выкупу» специального технического счета.
- 7.3.4. Расчетный депозитарий исполняет поручения Участника клиринга по торговым счетам депо после получения согласия СПВБ на проведение этих операций.
- 7.3.5. 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.
- 7.3.6. Участник клиринга, имеющий нетто-обязательство по ценным бумагам по сделкам РЕПО с кодом расчетов «Sn», по ценным бумагам по сделкам с кодом расчетов «Vn», 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 с кодом расчетов «Vn», заключенным при размещении ценных бумаг, должен обеспечить наличие размещаемых ценных бумаг в количестве, необходимом для обеспечения исполнения его обязательств по ценным бумагам, в Расчетном депозитарии (на счете депо номинального держателя Расчетного депозитария) для зачисления на раздел «к размещению/выкупу» специального технического счета в соответствии с пунктом 5.5.13 настоящих Правил
- 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.

- 7.3.9. СПВБ перечисляет арестованные ценные бумаги с регистра «Блокировано на торги» на регистр «Арестованные ценные бумаги» и информирует Биржу о необходимости уменьшения торговых позиций Участников торгов по указанным в Уведомлении ценным бумагам.

7.4. Порядок проведения операций по клиринговым счетам

- 7.4.1. СПВБ при осуществлении клиринговой деятельности использует клиринговые банковские счета в российских рублях. СПВБ может открывать в Расчетной организации несколько клиринговых счетов. СПВБ ведет внутренний учет средств Участников клиринга и средств клиентов Участников клиринга на клиринговом банковском счете.
- 7.4.2. Денежные средства на клиринговом банковском счете, открытом в Расчетной организации, используются для обеспечения исполнения обязательств Участников клиринга по денежным средствам. Участники клиринга категорий «В», «Т» и «К» 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. Комиссионное вознаграждение в расчет нетто-обязательства не включается.
- 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 категорий «В», «Т» и «К».
- 7.4.6. После проведения расчетов по итогам клиринга свободные денежные средства Участника клиринга категории «В» списываются с клирингового банковского счета на банковский (корреспондентский) счет Участника клиринга категории «В» на основании распоряжения Участника клиринга категории «В». Распоряжение на списание средств должно содержать реквизиты счета Участника клиринга, на который должны быть переведены средства. Сумма денежных средств в распоряжении не должна превышать суммы денежных средств на счете внутреннего учета



средств Участника клиринга на клиринговом счете, в случае превышения этой суммы, Участнику клиринга направляется отказ в исполнении распоряжения.

7.4.7. Денежные средства Участников клиринга категорий «Т» и «К» списываются с клирингового счета на банковские счета Участников клиринга указанных категорий после проведения операций по счетам внутреннего учета по итогам клиринга сделок с Биржевыми товарами, в размере остатка денежных средств на счете внутреннего учета, полученных по итогам исполнения обязательств по Договорам поставки товара. По каждому оплаченному Договору поставки товара сумма оплаты перечисляется с клирингового счета СПВБ отдельным платежом. Иные средства Участника клиринга, находящиеся на клиринговом счете СПВБ перечисляются Участнику клиринга по его распоряжению. В последнем случае сумма денежных средств в размере не более свободного остатка списывается с клирингового счета СПВБ на банковский счет Участника клиринга после получения по ЭДО СПВБ распоряжения об отзыве средств.

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.

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

8.1. Клиринговые регистры учета ценных бумаг

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

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

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

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

8.1.5. Регистр «Ценные бумаги для размещения/выкупа» - клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг для размещения/выкупа. Регистр соответствует разделу «к



размещению/выкупу», выделенному на специальном техническом счете, не предназначенном для учета прав на ценные бумаги, который используется для проведения операций при размещении/выкупе ценных бумаг.

- 8.1.6. 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 на торговом казначейском счете депо эмитента (лица, обязанного по ценным бумагам).
- 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.
- 8.1.12. Регистр «Арестованные ценные бумаги» – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг в отношении которых получено уведомление о наложении ареста. Регистр открывается к каждому из вышеперечисленных регистров учета ценных бумаг.

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 Участника клиринга, заключенных от имени своего клиента, по счету депо, которого он выступает попечителем» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по ценным бумагам лица, имеющего попечителя - Участника клиринга, сформированных по результатам 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 для размещения/выкупа» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по ценным бумагам при их размещении/выкупе, сформированных по результатам сделок с ценными бумагами, заключенных Участником клиринга в процессе их размещения/выкупе с использованием раздела «к размещению/выкупу».
- 8.2.6. Регистр «Обязательства по ценным бумагам эмитента – казначейский» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по ценным бумагам - эмитента, сформированных по результатам 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 с ценными бумагами и сделкам на денежном рынке. Регистр соответствует торговому банковскому счету собственных средств, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации или счету внутреннего учета средств Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ. На регистре учитывается суммарное значение денежных средств, учтенных на Регистре «Денежные средства Участника клиринга –



- свободные» и Регистре «Денежные средства Участника клиринга – заблокированные»
- 8.3.2. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – свободные» - клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных денежных средств Участника клиринга свободных от обязательств по сделкам с ценными бумагами и сделкам на денежном рынке.
- 8.3.3. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – заблокированные» - клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных денежных средств Участника клиринга заблокированных под исполнение обязательств по сделкам с ценными бумагами и сделкам на денежном рынке.
- 8.3.4. Регистр «Денежные средства Участника клиринга, зарезервированные на торги – клиенты» - клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств клиентов Участника клиринга. Регистр соответствует специальному торговому счету, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации.
- 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 с ценными бумагами.
- 8.3.6. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга – заблокированные» - клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств клиентов Участника клиринга заблокированных под исполнение обязательств по сделкам с ценными бумагами.
- 8.3.7. Регистр «Денежные средства ГО Участника клиринга - товарный рынок - свободные» - клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга, зачисленных на клиринговый счет СПВБ для участия в торгах по сделкам на товарном рынке, заключенных от имени и за счет Участника клиринга, и не обремененных обязательствами по совершенным сделкам.
- 8.3.8. Регистр «Денежные средства ГО клиентов Участника клиринга - товарный рынок - свободные» - клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга, зачисленных на клиринговый счет СПВБ для участия в торгах по сделкам на товарном рынке, заключенных от имени Участника клиринга за счет его клиентов, и не обремененных обязательствами по совершенным сделкам.
- 8.3.9. Регистр «Денежные средства Участника клиринга - товарный рынок - заблокированные для исполнения» - клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ, заблокированных в качестве Гарантийного обеспечения Договоров поставки товара, заключенных от имени и за счет Участника клиринга. На указанном регистре открываются разделы для



отдельного учета заблокированного Гарантийного обеспечения по каждому Договору поставки товара.

- 8.3.10. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга - товарный рынок - заблокированные для исполнения» - клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ, заблокированных в качестве Гарантийного обеспечения Договоров поставки товара, заключенных от имени Участника клиринга за счет его клиентов. На указанном регистре открываются разделы для отдельного учета заблокированного Гарантийного обеспечения по каждому Договору поставки товара.
- 8.3.11. Регистр «Денежные средства Участника клиринга - товарный рынок - заблокированные на торги» - клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга на соответствующем счете внутреннего учета, зарегистрированном на клиринговом счете, для обеспечения торгового лимита по сделкам с Биржевыми товарами, заключаемыми от имени и за счет Участника клиринга.
- 8.3.12. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга - товарный рынок - заблокированные на торги» - клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств клиентов Участника клиринга на соответствующем счете внутреннего учета, зарегистрированном на клиринговом счете, для обеспечения торгового лимита по сделкам с Биржевыми товарами, заключаемыми от имени Участника клиринга за счет его клиентов.

8.4. Клиринговые регистры по учету обязательств по денежным средствам

- 8.4.1. Регистр «Обязательства по денежным средствам, сформированные по результатам собственных 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, клиринговая комиссия, в рублях» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным средствам Участника клиринга, сформированных по результатам расчета комиссионного вознаграждения клиринговой организации.



- 8.4.4. Регистр «Обязательства по денежным средствам Участника клиринга, сформированные по результатам сделок Участника клиринга на товарном рынке» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга, по сделкам с Биржевым товаром, заключенных от имени и за счет Участника клиринга.
- 8.4.5. Регистр «Обязательства по денежным средствам клиентов Участника клиринга, сформированные по результатам сделок Участника клиринга на товарном рынке заключенных от имени Участника клиринга за счет его клиентов» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга, по сделкам с Биржевым товаром, заключенных от имени Участника клиринга, за счет его клиентов.
- 8.4.6. Регистр «Обязательства по поставке товара Участником клиринга» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга, по сделкам с Биржевым товаром, заключенных от имени и за счет Участника клиринга.
- 8.4.7. Регистр «Обязательства по поставке товара Клиентом Участником клиринга» - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга, по сделкам с Биржевым товаром, заключенных от имени Участника клиринга, но за счет и по поручению Клиента Участника клиринга.

8.5. Порядок ведения клиринговых регистров

- 8.5.1. Начальные значения клиринговых регистров учета ценных бумаг, описанных в подразделе 8.1 настоящих Правил, 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 изменяются после получения повторного отчета от Расчетного депозитария только в следующих случаях:
- 8.5.2.1. Расчетный депозитарий направил информацию повторно для исправления ошибок или дополнения первоначального отчета;
 - 8.5.2.2. После получения повторного отчета от Расчетного депозитария по запросу СПВБ;
 - 8.5.2.3. После получения отчета от Расчетного депозитария при изменении остатков ценных бумаг.
- 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 остатков ценных бумаг на торговых счетах депо, на разделе «к размещению/выкупу» осуществляется в том же порядке, что и при первоначальном установлении значений клиринговых регистров в клиринговой системе.



- 8.5.5. В клиринговые регистры учета обязательств по ценным бумагам (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 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 счете внутреннего учета средств Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ.
- 8.5.7. Начальные значения клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.3, 8.3.6, 8.3.9, 8.3.10 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 (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. Начальные значения клиринговых регистров, указанных в п.8.3.7, п.8.3.8 устанавливаются равными величине денежных средств на счете внутреннего учета средств Участника клиринга на клиринговом счете СПВБ за вычетом средств, находящихся на регистрах, указанных в п. 8.3.9, 8.3.10. Начальные значения клиринговых регистров, указанных в п.8.3.11, п.8.3.12 устанавливаются равными нулю. Значения клиринговых регистров, указанных в п.8.3.11, п.8.3.12 увеличиваются на суммы, указанные в поручении Участника клиринга, полученном через систему ЭДО, но не более чем на значение клиринговых регистров, указанных в п.8.3.7, п.8.3.8 соответственно. Одновременно с увеличением значений клиринговых регистров, указанных в п.8.3.11, п.8.3.12, на соответствующие суммы уменьшаются значения клиринговых регистров, указанных в п.8.3.7, п.8.3.8,
- 8.5.10. 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 в соответствии с правилом, установленным п.8.5.8.
- 8.5.11. Значения клиринговых регистров, указанных в п.8.3.3, 8.3.9, 8.3.10 увеличиваются на сумму Гарантийного обеспечения по вновь



- заключенным сделкам после получения от Биржи 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, в соответствии с правилом, установленным п.8.5.8.
- 8.5.12. По регистрам, указанным в п. 8.3.9, 8.3.10 ведется отдельный учет по каждому Договору поставки товара (на регистрах открывается раздел для отдельного учета средств, заблокированных по каждому Договору поставки товара).
- 8.5.13. В клиринговые регистры учета обязательств по денежным средствам п. 8.4.1 - 8.4.2 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.
- 8.5.14. В клиринговые регистры учета обязательств, указанные в п.8.4.4, 8.4.5 вносятся обязательства и требования по денежным средствам по каждому Договору поставки товара отдельно. Учет обязательства ведется в метрических тоннах с точностью, определенной Внутренними документами Биржи.
- 8.5.15. В клиринговые регистры учета обязательств, указанные в п.8.4.6, 8.4.7 вносятся обязательства и требования по поставке Биржевого товара по каждому Договору поставки товара отдельно. Учет обязательства ведется в метрических тоннах с точностью, определенной Внутренними документами Биржи.
- 8.5.16. Клиринговые регистры, указанных в п.8.3.11, п.8.3.12, обнуляются после проведения операций по итогам торгов на Бирже, при этом средства, оставшиеся на указанных регистрах, после блокировок Гарантийного обеспечения по заключенным Договорам поставки товара возвращаются на клиринговые регистры, указанные в п.8.3.7, п.8.3.8.

8.6. Реестры и иные формы внутреннего учета СПВБ

- 8.6.1. «Реестр Участников клиринга». Данный реестр формируется на основании анкет Участников клиринга (Приложение №4) и содержит информацию по каждому Участнику клиринга, необходимую для ведения реестра. Записи в данный реестр производятся согласно Регламенту осуществления допуска, приостановления, возобновления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».
- 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



приостановлении/возобновлении и прекращении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга.

- 8.6.2. «Реестр клиентов Участника клиринга». Записи в данный реестр производятся согласно Регламенту осуществления допуска, приостановления, возобновления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».
- 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 как в день подписания сторонами договора на оказание клиринговых услуг, так и в дату расторжения.
- 8.6.5. «Реестр сделок, допущенных к клирингу». Реестр содержит информацию о дате, времени и номере реестра сделок, сформированного по итогам торгов Биржи 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 сделок, исключенных из клирингового пула». Данный реестр содержит информацию о сделках, не прошедших процедуру контроля обеспечения.
- 8.6.8. «Реестр распоряжений, направленных расчетной организации» и «Реестр распоряжений, направленных расчетному депозитарию». Данные реестры содержат информацию о Распоряжениях на проведение операций по Торговым счетам, направленных в Расчетную организацию и 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.
- 8.6.9. «Реестр отправленных отчетов». Записи в данный реестр производятся после завершения расчетов и содержат информацию, содержащуюся в предоставленных Участнику клиринга и (или) его клиенту отчетах.
- 8.6.10. Все реестры СПВБ ведет в электронном виде.
- 8.6.11. 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.

8.6.12. 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.

9.2. Порядок и сроки предоставления отчетов Участникам клиринга

9.2.1. Отчеты для Участников клиринга формируются СПВБ в электронном виде и направляются по электронной почте, не позднее пятнадцати минут после завершения расчетов.

9.2.2. Бумажные формы отчетов предоставляются уполномоченным представителям Участников клиринга или направляются почтовым отправлением с уведомлением о вручении.

9.2.3. 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.

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

9.2.5. 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 при осуществлении клиринговой деятельности как один из важнейших элементов общей системы управления рисками СПВБ. 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 СПВБ по рискам и аудиту
 - 10.1.2.3. Управляющего СПВБ
 - 10.1.2.4. Правление СПВБ
 - 10.1.2.5. Риск-менеджера
 - 10.1.2.6. Контролера
 - 10.1.2.7. Службу внутреннего аудита
 - 10.1.2.8. Руководителей структурных подразделений, отвечающих за непосредственное управление рисками и реализацию мероприятий в соответствии с Планом управления рисками.
- 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 АО 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 Акционерным обществом «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»».

10.2.2. При управлении рисками СПВБ в случае чрезвычайных ситуаций также используется «План обеспечения непрерывности и восстановления деятельности Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»».

10.3. Общие принципы управления рисками

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

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

10.3.3. 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.

10.3.4. 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 (кроме Участников клиринга, перечисленных в п.5 ст.23 Федерального закона от 07.02.2011г. №7-ФЗ) лимиты по допустимому объему сделок и передает их Бирже перед началом торговой сессии и при каждом изменении состояния торговых счетов Участников клиринга.

10.4.2. Лимит по сделкам с ценными бумагами с кодом расчетов Т0 устанавливается как по денежным средствам, так и по ценным бумагам. Допустимый объем сделок с ценными бумагами (за исключением сделок, указанных в п. 10.4.3) устанавливается равным остатку денежных средств на торговых счетах (счетах внутреннего учета) и остатку ценных бумаг на соответствующих торговых счетах депо (разделах счетов депо на клиринговом счете депо).

10.4.3. 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.
- 10.4.4. Лимит по сделкам с ценными бумагами с кодом расчетов Sn и Vn устанавливается равным остатку денежных средств на соответствующих торговых счетах (счетах внутреннего учета), умноженному на 100% и деленному на установленную п.6.1.5 настоящих Правил величину Гарантийного обеспечения в процентах - для денежных средств, и остатку ценных бумаг на соответствующих торговых счетах и счетах депо внутреннего учета - для ценных бумаг.
- 10.4.5. Лимит по депозитным сделкам устанавливается на основании условий Генерального соглашения и Спецификаций депозитных сделок, предоставленных Участниками клиринга категории «И» или категории «В».
- 10.4.6. Лимит по сделкам с Биржевым товаром для Участников клиринга категории «Т» устанавливается равным размеру Гарантийного обеспечения сделок с Биржевым товаром, находящемуся на клиринговых регистрах, указанных в п.8.3.11, п.8.3.12, умноженному на 100% и деленному на установленную п.6.1.9 настоящих Правил величину начального Гарантийного обеспечения в процентах.

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.spceх.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 Биржами, Расчетной организацией и Расчетным депозитарием

12.1. Порядок взаимодействия с Биржами



- 12.1.1. Перед началом торговой сессии СПВБ передает Бирже сведения о торговых счетах, по которым могут совершаться сделки, и лимиты допустимого объема сделок по каждому торговому счету (счету внутреннего учета 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 или договором между Биржей и СПВБ.
- 12.1.2. В случае совмещения СПВБ клиринговой деятельности с деятельностью Биржи положения об обмене данными между СПВБ и Биржей означают обмен данными между отдельными структурными подразделениями СПВБ, занимающимися осуществлением клиринговой деятельностью и деятельностью по организации торговли.
- 12.1.3. СПВБ передает Бирже лимиты допустимого объема сделок всякий раз при их изменении.
- 12.1.4. Биржа передает СПВБ реестр сделок. Реквизиты реестра сделок устанавливаются Внутренним регламентом СПВБ или договором между Биржей и СПВБ.
- 12.1.5. СПВБ направляет Бирже информацию об Участниках клиринга и получает от Биржи информацию об участниках торгов в объеме и порядке, установленном договором между Биржей и СПВБ. Указанный договор должен включать порядок обмена информацией о приостановлении или прекращении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга или приостановлении, или прекращении допуска торгам участника торгов.
- 12.1.6. Иные случаи взаимодействия с Биржей установлены в соответствующих разделах настоящих Правил.

12.2. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией.

- 12.2.1. СПВБ передает Расчетной организации уведомление о регистрации нового Участника клиринга. Указанное уведомление является условием для проведения операций, согласно Распоряжению, направляемому в Расчетную организацию СПВБ после проведения клиринга.
- 12.2.2. Расчетная организация информирует СПВБ об открытии торгового банковского счета в порядке, установленном договором.
- 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 5.5, 7.2 и 7.4 настоящих Правил.
- 12.2.6. Порядок взаимодействия с Расчетными организациями при проведении сверки расчетов установлен подразделами 5.6 и 5.7 настоящих Правил.
- 12.2.7. В случае 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.

12.3. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием.

- 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 условием 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 Расчетным депозитарием при обмене информацией о состоянии торговых счетов депо, раздела «к размещению/выкупу» установлен подразделами 5.1 и 5.5 настоящих Правил.
- 12.3.3. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием при совершении операций по торговым счетам депо, разделу «к размещению/выкупу» установлен подразделом 5.5, 7.3 настоящих Правил.
- 12.3.4. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием при проведении сверки расчетов установлен подразделами 5.6 и 5.7 настоящих Правил.
- 12.3.5. В случае 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. 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.



Приложение №1 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

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 к Правилам
клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

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 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская
Валютная Биржа»

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/раздел «к размещению/выкупу»	Наименование Расчётного депозитария	Номер торгового банковского счета	Наименование Расчётной организации

Руководитель Участника клиринга _____

М.П.

(подпись)

(Ф.И.О.)



Приложение №4 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

Анкета Участника клиринга (российского юридического лица)		
1. Данные для заполнения организацией:		
1.	Полное наименование	
2.	Сокращенное наименование	
3.	Адрес местонахождения (в соответствии с Уставом)	
4.	Почтовый адрес для направления корреспонденции (с указанием индекса)	
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.	Банковские реквизиты для перечисления денежных средств	
12.	Фамилия, имя, отчество, должность руководителя организации	
13.	Дата заполнения анкеты	

Настоящим Участник клиринга гарантирует и подтверждает, что им получены на законных основаниях согласия на обработку АО СПВБ персональных данных всех субъектов персональных данных, персональные данные которых предоставляются им в АО СПВБ, а также что все такие субъекты персональных данных проинформированы об обработке их персональных данных АО СПВБ.

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

М.П.



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



Приложение №4(1) к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

Анкета Участника клиринга (индивидуального предпринимателя)		
1. Данные для заполнения индивидуальным предпринимателем:		
14.	ФИО полностью	
15.	Адрес регистрации	
16.	Почтовый адрес для направления корреспонденции (с указанием индекса)	
17.	Номер телефона, факса, адрес электронной почты	
18.	ФИО контактного лица полностью	
19.	Документ, удостоверяющий личность (паспорт, удостоверение личности, иное)	
20.	Регистрирующий орган	
21.	Код подразделения	
22.	Дата выдачи документа	
23.	ИНН (при наличии)	
24.	КПП (для ИП)	
25.	Код ОКВЭД	
26.	Данные свидетельства о регистрации (номер, кем и когда выдано)	
27.	Банковские реквизиты для перечисления денежных средств	
28.	Дата заполнения анкеты	

В соответствии с Федеральным законом от 27.07.2006 № 152-ФЗ «О персональных данных» я даю согласие Акционерному обществу «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», место нахождения: Российская Федерация, 191023, г. Санкт-Петербург, ул. Садовая, д.12/23(далее – АО СПВБ) на осуществление любых действий: на проверку и обработку, включая сбор, запись, систематизацию, накопление, хранение, уточнение (обновление, изменение), извлечение, использование, передачу (распространение, предоставление, доступ), обезличивание, блокирование, удаление, уничтожение персональных данных, указанных в настоящей анкете, предоставляемых в АО СПВБ иным способом или полученных АО СПВБ в процессе исполнения договора, с использованием средств автоматизации и/или без использования таких средств, в целях исполнения договорных обязательств, соблюдения законодательства, в целях информирования меня о продуктах и услугах, разработанных АО СПВБ, а также в целях раскрытия на сайте АО СПВБ ряда данных, относящихся к моей личности, раскрытие которых от АО СПВБ требуется действующим законодательством (далее – «Персональные данные»). АО СПВБ вправе проверить достоверность предоставленных мною персональных данных, в том числе, с использованием услуг других операторов, а также использовать информацию о неисполнении и/или ненадлежащем исполнении договорных обязательств при рассмотрении вопросов о предоставлении других услуг и заключении новых договоров. Согласие дается мною для целей заключения между мной и АО СПВБ любых договоров и их дальнейшего исполнения, проверки АО СПВБ корректности предоставленных сведений, принятия решений или совершения иных действий, порождающих юридические последствия в отношении меня, осуществления возложенных на АО СПВБ законодательством Российской Федерации функций, предоставления мне информации об оказываемых АО СПВБ услугах, предоставления АО СПВБ услуг без заключения договора в рамках, разрешенных действующим законодательством Российской Федерации.



Настоящее согласие дается мною на весь срок действия договоров, заключенных между АО СПВБ и мною, и дополнительно на пять лет после окончания срока действия всех договоров и/или истечения пяти лет с даты предоставления АО СПВБ услуг без заключения договора. По истечении указанного срока действие настоящего согласия считается продленным на каждые следующие пять лет при отсутствии у АО СПВБ сведений о его отзыве. Согласие предоставляется с момента подписания настоящего документа. Субъект персональных данных вправе отозвать настоящее согласие, письменно уведомив об этом АО СПВБ.

Настоящим Участник клиринга гарантирует и подтверждает, что им получены согласия на обработку АО СПВБ персональных данных всех субъектов персональных данных, персональные данные которых предоставляются им в АО СПВБ, а также что все такие субъекты персональных данных проинформированы об обработке их персональных данных АО СПВБ.

Участник клиринга _____ / _____ /
(подпись) (Ф.И.О.)

М.П.

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



Приложение №4(2) к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

Анкета Участника клиринга (иностранного юридического лица)		
1. Данные для заполнения организацией:		
29.	Полное наименование	
30.	Сокращенное наименование	
31.	Юрисдикция	
32.	Код иностранной организации (КИО)	
33.	Наименование документа о регистрации юридического лица (номер, дата выдачи документа)	
34.	Регистрирующий орган	
35.	Местонахождения (в соответствии с Уставом)	
36.	Почтовый адрес (с указанием индекса)	
37.	Адрес для направления корреспонденции (с указанием индекса)	
38.	Номер телефона, факса, адрес электронной почты	
39.	Банковские реквизиты для перечисления денежных средств	
40.	Контактное лицо	
41.	Дата заполнения анкеты	

Настоящим Участник клиринга гарантирует и подтверждает, что им получены на законных основаниях согласия на обработку АО СПВБ персональных данных всех субъектов персональных данных, персональные данные которых предоставляются им в АО СПВБ, а также что все такие субъекты персональных данных проинформированы об обработке их персональных данных АО СПВБ.

Участник клиринга _____ / _____ /
(Должность уполномоченного _____ (подпись) _____ (Ф.И.О.)
Лица организации)

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 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская
Валютная Биржа»

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



Приложение №6 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»
Реквизиты документов, направляемых Участникам клиринга

А. Отчет о денежных средствах на счете внутреннего учета (клиринговом регистре) Участника клиринга

Реквизиты	Порядок заполнения
Клиринговая организация	Полное наименование СПВБ
Участник клиринга	Код и наименование Участника клиринга
Наименование отчета	Отчет о денежных средствах на счете внутреннего учета (клиринговом регистре) Участника клиринга
Дата	Дата, на которую сформирован отчет
Время	Время, на которое сформирован отчет
Содержание отчета	№ счета внутреннего учета (код клирингового регистра) Участника клиринга, входящий остаток, изменение суммы средств на счете внутреннего учета (клиринговом регистре), исходящий остаток средств и иные дополнительные сведения по сделке по усмотрению СПВБ
Подпись сотрудника СПВБ	Подпись сотрудника клирингового отдела СПВБ

В. Отчет об обязательствах/требованиях Участника клиринга

Реквизиты	Порядок заполнения
Клиринговая организация	Полное наименование СПВБ
Наименование отчета	Отчет об обязательствах допущенным к клирингу по сделкам, заключенным на СПВБ/АО «Биржа «Санкт-Петербург»
Наименование Участника клиринга	Наименование Участника клиринга
Код Участника клиринга	Краткий код Участника клиринга
Торговый счет/раздел «к размещению/выкупу» в Расчетном депозитарии /номер торгового банковского счета	Идентификатор торгового счета в Расчетном депозитарии для отчета по обязательствам и требованиям по ценным бумагам Номер торгового банковского счета для отчета по обязательствам и требованиям по денежным средствам для отчета по сделкам, заключенным на СПВБ
Номер клиринговой сессии	Номер клиринговой сессии
Дата	Дата, на которую сформирован отчет
Время	Время, на которое сформирован отчет
Содержание отчета	код Биржевого инструмента/номер торгового банковского счета, нетто-обязательство/требование по ценным бумагам/ денежным средствам, статус обязательств и иные дополнительные сведения по усмотрению СПВБ
Подпись сотрудника СПВБ	Подпись сотрудника клирингового отдела СПВБ



Приложение №7 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

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 раздела «к размещению/выкупу», код ЦБ, количество ЦБ
--------------------	---

Д. Реестр остатков денежных средств

Содержание реестра	Наименование расчетной организации, порядковый номер отчета, дата, время, код валюты, номер торгового /клирингового счета, остаток денежных средств, номер счета внутреннего учета СПВБ, сумма заблокированных средств, сумма свободных денежных средств.
--------------------	---

Е. Реестр сделок допущенных к клирингу

Содержание реестра	Наименование Биржи, дата заключения сделки, номер сделки, время заключения сделки, код биржевого инструмента / товара, коды и наименования Участников клиринга - сторон по сделке, сумма сделки, комиссия Биржи
--------------------	---

Ф. Реестр сделок, прошедших процедуру контроля обеспечения

Содержание реестра	Дата, номер сделки, время клиринга по сделке, вид сделки (к/ п), биржевой инструмент/товар, 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 сделок, не прошедших процедуру контроля обеспечения

Содержание реестра	Дата, номер сделки, время клиринга по сделке, вид сделки (к/ п), биржевой инструмент / товар, 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
--------------------	---

Н. Реестр распоряжений, направленных расчетному депозитарию

Содержание реестра	Номер распоряжения, дата распоряжения, время формирования, номер торгового раздела, код раздела «к размещению/выкупу», код ЦБ, количество ЦБ, направление операции (списание/зачисление)
--------------------	--

И. 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)
--------------------	---

Ж. Реестр отправленных отчетов

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

К. 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
--------------------	--

Л. 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
--------------------	---

М. 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
--------------------	--

В настоящем документе прошито,
пронумеровано и скреплено печатью АО СПББ

Ирина Владимировна Мухоморова
(подпись)

Управляющий АО СПББ

Бунин П.Б.

Ирина Владимировна Мухоморова
20/08/2012

