

УТВЕРЖДЕНО

Советом Директоров РДК (ЗАО)

Протокол № СД-9/2011 от «12» сентября 2011 года

Председатель Совета Директоров

В.В. Таций

СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ 01. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Статья 01.01. Термины и определения 01

Статья 01.02. Общие положения 02

Статья 01.03. Порядок внесения изменений в Правила 03

Статья 01.04. Порядок исполнения 04

РАЗДЕЛ 02. КЛИРИНГОВАЯ ДЕЯТЕЛЬНОСТЬ КЛИЕНТОВ

Статья 02.01. Принципы осуществления клиринговой деятельности 05

Статья 02.02. Требования к участникам клиринговой деятельности 06

Статья 02.03. Порядок доступа к клиринговому оборудованию, программному обеспечению, информации 07

Статья 02.04. Порядок осуществления клиринговой деятельности участниками 08

Статья 02.05. Ответственность за нарушение клиринговых правил 09

Статья 02.06. Гарантийный фонд клиринговой деятельности 10

РАЗДЕЛ 03. СИСТЕМА ЛИМИТОВ

Статья 03.01. Система лимитов 11

Статья 03.02. Лимит изменения цены 12

Статья 03.03. Лимит на долю рынка 13

Статья 03.04. Торговый лимит, Максимальный торговый лимит 14

Статья 03.05. Особенности контроля лимитов в ходе торгов в режиме автоматического контроля 15

Статья 03.06. Особенности контроля лимитов в ходе торгового периода «Специальная торговая сессия» 16

РАЗДЕЛ 04. СВЕРКА СДЕЛОК И УЧЕТ ПОЗИЦИЙ

Статья 04.01. Сверка сделок 17

Статья 04.02. Организация учета 18

Статья 04.03. Устранение разночтений 19

Статья 04.04. Принудительная ликвидация позиций участников клиринга и Клиентов, осуществляемая Клиринговой организацией 20

Статья 04.05. Принудительная ликвидация позиций Клиентов, осуществляемая Общественным клиринговым учреждением 21

РАЗДЕЛ 05. ПОРЯДОК ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГА

Статья 05.01. Клиринговая сессия 22

Статья 05.02. Вариационная маржа 23

Статья 05.03. Клиринговый сбор 24

**ПРАВИЛА ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ
КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ
ЗАКРЫТОГО АКЦИОНЕРНОГО ОБЩЕСТВА
«РАСЧЕТНО-ДЕПОЗИТАРНАЯ КОМПАНИЯ»
НА СРОЧНОМ РЫНКЕ ЗАО «СПБМТСБ»**

Москва, 2011

СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ 01. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	5
Статья 01.01. Термины и определения	5
Статья 01.02. Общие положения	15
Статья 01.03. Порядок внесения изменений и дополнений в Правила	15
Статья 01.04. Порядок оповещения Участников клиринга	16
РАЗДЕЛ 02. КЛИРИНГОВОЕ ОБСЛУЖИВАНИЕ УЧАСТНИКОВ	17
Статья 02.01. Принципы клирингового обслуживания	17
Статья 02.02. Требования, предъявляемые к Участникам клиринга	19
Статья 02.03. Порядок организации клирингового обслуживания. Требования к документам Участников клиринга	22
Статья 02.04. Допуск Участников клиринга к клиринговому обслуживанию	25
Статья 02.05. Изменение категории клирингового участия	27
Статья 02.06. Присвоение статуса Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя	27
РАЗДЕЛ 03. ОБСЛУЖИВАНИЕ КЛИЕНТОВ	29
Статья 03.01. Условия и порядок обслуживания Клиентов	29
Статья 03.02. Защита интересов Клиентов	30
РАЗДЕЛ 04. ОБЕСПЕЧЕНИЕ	31
Статья 04.01. Депозитная маржа	31
Статья 04.02. Коллективный гарантийный фонд	34
Статья 04.03. Поставочная маржа	36
Статья 04.05. Гарантийный фонд Клиринговой организации	38
РАЗДЕЛ 05. СИСТЕМА ЛИМИТОВ	40
Статья 05.01. Система лимитов	40
Статья 05.02. Лимит изменения цены	40
Статья 05.03. Лимит на долю рынка	41
Статья 05.04. Торговый лимит, Максимальный торговый лимит	42
Статья 05.05. Особенности контроля лимитов в ходе торгов в режиме запроса котировок	43
Статья 05.06. Особенности контроля лимитов в ходе торгового периода «Специальная торговая сессия»	43
РАЗДЕЛ 06. СВЕРКА СДЕЛОК И УЧЕТ ПОЗИЦИЙ	45
Статья 06.01. Сверка Сделок	45
Статья 06.02. Организация учета позиций	45
Статья 06.03. Управление позициями	46
Статья 06.04. Принудительная ликвидация позиций Участника клиринга и Клиентов, осуществляемая Клиринговой организацией	47
Статья 06.05. Принудительная ликвидация позиций Клиентов, осуществляемая Общим клиринговым участником	50
РАЗДЕЛ 07. ПОРЯДОК ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГА	51
Статья 07.01. Клиринговая сессия	51
Статья 07.02. Вариационная маржа	51
Статья 07.03. Клиринговый сбор	52

<i>Правила осуществления клиринговой деятельности РДК (ЗАО) на срочном рынке ЗАО «СПбМТСБ»</i>	<i>стр.3</i>
Статья 07.04. Поставочный сбор	53
Статья 07.05. Списание/зачисление вариационной маржи	54
Статья 07.06. Задолженность по депозитной марже	54
Статья 07.07. Несостоятельность Участника клиринга	55
Статья 07.08. Порядок предоставления Участникам Клиринга отчетов по итогам клиринга	58
Статья 07.09. Возражения Участника клиринга по результатам клиринговой сессии	59
РАЗДЕЛ 08. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ПОСТАВКЕ БАЗОВОГО АКТИВА И РАСЧЕТОВ ПО ПОСТАВКЕ ПО ПОСТАВОЧНЫМ СРОЧНЫМ КОНТРАКТАМ	60
<hr/>	
Статья 08.01. Порядок исполнения обязательств по поставке базового актива и расчетов по поставке по поставочному фьючерсному контракту на дизельное топливо	60
РАЗДЕЛ 09. ЧРЕЗВЫЧАЙНЫЕ СИТУАЦИИ	70
<hr/>	
Статья 09.01. Определение чрезвычайных ситуаций	70
Статья 09.02. Урегулирование чрезвычайных ситуаций	71
РАЗДЕЛ 10. ПОРЯДОК РАЗРЕШЕНИЯ СПОРОВ	74

СПИСОК ПРИЛОЖЕНИЙ

- Приложение 01. Образец договора о клиринговом обслуживании.
- Приложение 02. Форма Анкеты Участника клиринга - юридического лица (резидент).
- Приложение 03. Форма Анкеты Участника клиринга - юридического лица (нерезидент).
- Приложение 04. Требования к финансовому состоянию Участников клиринга.
- Приложение 05. Дополнительное соглашение об изменении категории клирингового участия к договору о клиринговом обслуживании.
- Приложение 06. Заявление о присвоении статуса Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя.

РАЗДЕЛ 01. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Статья 01.01. Термины и определения

1.1. В целях настоящих Правил осуществления клиринговой деятельности Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» на срочном рынке ЗАО «СПбМТСБ» (далее – Правила клиринга) применяются следующие термины и определения:

Базовый (базисный) актив предмет срочного контракта.

Вариационная маржа сумма денежных средств, размер которой зависит от изменения цен на базовый актив или значений базового актива, уплачиваемая/получаемая Участником клиринга в связи с изменением денежного обязательства по одной позиции в результате ее корректировки по рынку в соответствии с изменением расчетной (котировальной) цены, рассчитанная по единым правилам для срочных контрактов, заключенных на условиях одной Спецификации, в соответствии с порядком, установленным Спецификацией.

Взаимозачет позиций одновременное закрытие равного количества позиций противоположной направленности по одной серии срочных контрактов.

Внутренние документы Организатора торговли документы Организатора торговли, регламентирующие деятельность на срочном рынке.

Внутренние документы Клиринговой организации документы Клиринговой организации, регламентирующие порядок проведения операций, связанных с осуществлением клиринга на срочном рынке.

Гарантирующий поставщик / Гарантирующий покупатель организация, которой присвоен статус Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя в соответствии со Статьей 02.06 Правил.

День исполнения срочного контракта (период) устанавливаемый в соответствии со Спецификацией соответствующего срочного контракта день (период), в который (в течение которого) производится:
- для расчетных срочных контрактов - прекращение всех обязательств (закрытие всех позиций) по

	<p>данной серии срочных контрактов по окончательной расчетной цене, установленной для данной серии срочных контрактов;</p> <p>- для поставочных срочных контрактов – поставка базового актива и оплата поставки, и прекращение всех обязательств (закрытие всех позиций) по данной серии срочных контрактов.</p>
Денежный торговый регистр Участника клиринга	<p>Регистр внутреннего учета в Клиринговой организации, предназначенный для отражения информации о денежных средствах, внесенных Участником клиринга на Счет Клиринговой организации в состав депозитной маржи Участника клиринга.</p>
Денежный регистр учета поставочной маржи Участника клиринга	<p>Регистр внутреннего учета в Клиринговой организации, предназначенный для отражения информации о денежных средствах, внесенных Участником клиринга на Счет Клиринговой организации в состав поставочной маржи Участника клиринга.</p>
Денежный регистр учета вноса Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд	<p>Регистр внутреннего учета в Клиринговой организации, предназначенный для отражения информации о денежных средствах, внесенных Участником клиринга на Счет Клиринговой организации в состав вноса Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд.</p>
Денежный регистр учета оплаты поставки Участника клиринга	<p>Регистр внутреннего учета в Клиринговой организации, предназначенный для отражения информации о денежных средствах Участника клиринга, внесенных на Счет Клиринговой организации в качестве оплаты поставки базового актива.</p>
Депозитная маржа, Начальная маржа	<p>специальный возвратный взнос, производимый каждым Участником клиринга для обеспечения исполнения его обязательств в случаях и порядке, определяемых Правилами.</p>
Договор о клиринговом обслуживании	<p>Договор об осуществлении клирингового обслуживания на срочном рынке, заключаемый Участником клиринга с Клиринговой организацией по форме, установленной в Приложении 01 к Правилам.</p>
Закрытие позиции	<p>прекращение совокупности прав и обязанностей у Участника клиринга и Клиринговой организации, определяющих данную позицию.</p>
Идентификатор	<p>Уникальный код, присваиваемый Участнику клиринга</p>

Участника клиринга	при его регистрации в Системе клиринга.
Исполнение срочного контракта	выплата вариационной маржи, начисленной по позициям, открытым по данному срочному контракту, со дня открытия данных позиций до дня исполнения данного срочного контракта включительно и, для поставочного срочного контракта – также заключение Участниками поставки сделок предпоставочного периода на условиях и в порядке, установленном Спецификацией соответствующего срочного контракта и иными внутренними документами Биржи.
Клиент	юридическое или физическое лицо, зарегистрированное в Клиринговой организации в качестве Клиента Участника клиринга.
Клиринговая организация	Закрытое акционерное общество «Расчетно-депозитарная компания», РДК (ЗАО).
Клиринговая сессия	период операционного дня, в течение которого осуществляется обработка результатов торговой сессии, управление позициями и определение обязательств Участников клиринга в соответствии с Правилами.
Клиринговый сбор	сумма денежных средств, уплачиваемая Участниками клиринга за услуги Клиринговой организации в соответствии с Правилами.
Корректировка по рынку	процедура переоценки позиций, в результате которой текущая цена каждой позиции приравнивается к расчетной цене, определенной для серии срочных контрактов, по которой открыта данная позиция.
Ликвидант	Участник клиринга, позиции которого подлежат принудительной ликвидации в соответствии с Правилами.
Лимит изменения цены	максимально допустимое отклонение цен сделок, которые могут заключаться по заявке в отношении определенной серии срочных контрактов, от расчетной цены, установленной для данной серии срочных контрактов в предыдущий торговый день.
Лимит на долю рынка	максимально допустимая доля чистых позиций по серии срочных контрактов, определенных по всем позиционным регистрам, открытым Участнику клиринга для учета позиций одного Участника клиринга, либо одного из клиентов Участника

	клиринга, в суммарном количестве чистых позиций одной направленности на всех позиционных регистрах всех Участников клиринга по данной серии срочных контрактов.
Максимальный Торговый лимит	максимально допустимое значение суммы требований к размеру депозитной маржи по всем портфелям Участника клиринга.
Направленность позиции	признак позиции, указывающий, является она длинной или короткой. Длинная и короткая позиции по отношению друг к другу являются позициями противоположной направленности.
Несостоятельность Участника клиринга	недостаточность суммы депозитной маржи на всех денежных торговых регистрах Участника клиринга для погашения суммы нетто-обязательств по вариационной марже по всем портфелям позиций данного Участника клиринга.
Обеспечение	депозитная маржа, поставочная маржа и другие средства Участника клиринга, а также средства гарантийных фондов, предназначенные для обеспечения исполнения обязательств по итогам торгов, в случаях и порядке, определяемых Правилами.
Ограничение допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию	исключение возможности выполнения Участником клиринга операций, результат которых может привести к увеличению обязательств данного Участника клиринга по одному или нескольким его позиционным регистрам.
Оператор Участника клиринга	физическое лицо, уполномоченное в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации Участником клиринга на проведение операций в Системе клиринга от имени Участника клиринга.
Операционный Регламент	Внутренний документ Клиринговой организации, утверждаемый Генеральным директором Клиринговой организации и устанавливающий расписание операционного дня Клиринговой организации (включая время проведения операций, осуществляемых в соответствии с настоящими Правилами), правила присвоения кодов клиринговым регистрам, а также реквизиты (формы/форматы) входящих от Участников клиринга документов (поручений) и отчетных документов Клиринговой организации.

Операционный день	Дата, в которую Клиринговой организацией проводится Клиринговая сессия и/или расчеты.
Организатор торговли	Организация, имеющая лицензию на организацию биржевой торговли, выданную в установленном порядке уполномоченным федеральным органом исполнительной власти и заключившая с Клиринговой организацией договор о взаимодействии при осуществлении клиринга на срочном рынке.
Организатор Системы электронного документооборота, Организатор СЭД	РДК (ЗАО).
Открытие позиции	возникновение совокупности прав и обязанностей у Участника клиринга по одному срочному контракту.
Отмена регистрации Клиента в Системе клиринга	прекращение доступа Участника клиринга к совершению операций в Системе клиринга по позиционным регистрам, на которых учитываются позиции, открытые Участником клиринга от своего имени и за счет своего Клиента.
Отмена регистрации Участника клиринга в Системе клиринга	прекращение доступа Участника клиринга к совершению операций в Системе клиринга.
Перевод позиции	закрытие позиции Участника клиринга на позиционном регистре, открытом для учета позиций данного Участника клиринга, с которого производится перевод, и открытие ее на позиционном регистре, открытом для учета позиций данного Участника клиринга, на который производится перевод; либо закрытие позиции на позиционном регистре, открытом для учета позиций Клиента, с которого производится перевод, и открытие ее на позиционном регистре, открытом для учета позиций данного Клиента, на который производится перевод.
Позиции чистые	остаток позиций по определенной серии срочных контрактов, который будет образован в случае взаимозачета максимального количества позиций противоположной направленности по данной серии

	срочных контрактов.
Позиции чистые на позиционном регистре	чистые позиции, определенные исходя из позиций, учитываемых на позиционном регистре.
Позиционный регистр	регистр внутреннего учета Клиринговой организацией позиций Участника клиринга.
Позиция, открытая позиция	совокупность прав и обязанностей Участника клиринга, возникших в результате заключения одного срочного контракта данной серии. Позиция по своей направленности может быть длинной или короткой.
Позиция длинная	совокупность прав и обязанностей Участника клиринга, возникших в результате заключения одного срочного контракта со стороны покупателя.
Позиция короткая	совокупность прав и обязанностей Участника клиринга, возникших в результате заключения одного срочного контракта со стороны продавца.
Позиция поставочная	Позиция по серии срочных контрактов, по которой наступил день (период) исполнения.
Позиция Участника клиринга	Позиция, возникшая в результате сделки от имени и за счет Участника клиринга.
Позиция Клиента	Позиция, возникшая в результате сделки от имени Общего клирингового участника за счет Клиента.
Портфель позиций	совокупность позиций, учитываемых на позиционных регистрах, входящих в один портфель позиционных регистров.
Портфель позиционных регистров	группа позиционных регистров, расчеты по обязательствам, возникающим в результате открытия позиций на данных позиционных регистрах и учет обеспечения (депозитной маржи) данных обязательств, осуществляются с использованием одного денежного торгового регистра Участника клиринга в соответствии с указанием данного Участника клиринга.
Поставочная маржа	специальный возвратный взнос Клирингового Участника, служащий обеспечением исполнения обязательств по поставке базового актива/оплате поставки и расчетов по поставке по поставочным срочным контрактам в случаях и порядке, определяемых Правилами.

Поставочный сбор	обязательный сбор, взимаемый Клиринговой организацией за осуществление клирингового обслуживания в ходе исполнения обязательств Участников Клиринга по поставке базового актива/оплате поставки и расчетов по поставке по поставочным срочным контрактам.
Правила	настоящий документ.
Прекращение допуска к клиринговому обслуживанию	исключение возможности выполнения Участником клиринга операций, результат которых может привести к изменению обязательств данного Участника клиринга по одному или нескольким его позиционным регистрам.
Принудительная ликвидация позиций	комплекс процедур, предусмотренных Правилами, обеспечивающих закрытие позиций Участника клиринга.
Приостановка проведения операций	временное прекращение процедур и действий, установленных Правилами.
Расчетная организация	Кредитная организация, проводящая расчеты по итогам торгов на основании соответствующих поручений Клиринговой организации к счету Клиринговой организации и в соответствии с договором, заключенным с Клиринговой организацией. Уполномоченными Расчетными организациями являются ОАО «АЛЬФА-БАНК», Банк ВТБ (ОАО), ГПБ (ОАО), Сбербанк России ОАО и ОАО «ВБРР».
Расчетная цена, котировальная цена	цена срочных контрактов определенной серии в данный торговый день, порядок расчета которой определен Внутренними документами Организатора торговли.
Расчетная цена текущая	цена срочных контрактов определенной серии в определенный момент времени в ходе торгов, рассчитываемая по алгоритму, установленному для определения расчетной цены.
Расчетная цена окончательная	цена, определенная в соответствии со Спецификацией данного срочного контракта: – для расчетных срочных контрактов – в день (период) исполнения срочных контрактов; – для поставочных срочных контрактов – в последний торговый день срочными контрактами.

Регистрация в Системе клиринга Участника клиринга (Клиента Участника клиринга)	ввод в Систему клиринга информации об Участнике клиринга (Клиенте Участника клиринга), необходимой для его клирингового обслуживания.
Сделка	срочный контракт в соответствии с Внутренними документами Организатора торговли.
Сделка предпоставочного периода	договор купли-продажи (поставки) базового актива, заключаемый в ходе предпоставочной торговой сессии в соответствии со Спецификацией.
Серия срочных контрактов	совокупность срочных контрактов определенного типа, все параметры, характеристики и условия которых совпадают, за исключением цен, которые могут различаться. Серии срочных контрактов одного типа отличаются друг от друга днем исполнения срочных контрактов.
Система клиринга	Совокупность программно-технических средств, баз данных, телекоммуникационных средств, иного оборудования и программного обеспечения Клиринговой организации, предназначенных для осуществления клиринга в соответствии с настоящими Правилами.
Спецификация срочного контракта	Внутренний документ Организатора торговли, определяющий стандартные условия срочных контрактов определенного типа, а также особенности торгов данным типом срочных контрактов.
Срочный контракт	фьючерсный договор (контракт) или опционный договор (контракт) или своп договор (контракт) в соответствии с нормативными правовыми актами Российской Федерации.
Срочный контракт поставочный	срочный контракт, исполняемый с поставкой базового актива.
Срочный контракт расчетный	срочный контракт, исполняемый без поставки базового актива.
Счет Клиринговой организации	счет в одной из Расчетных организаций, на котором учитывается обеспечение Участников клиринга.
Тарифы Клиринговой	Внутренний документ Клиринговой организации, утверждаемый Советом директоров Клиринговой организации и устанавливающий ставки

организации	комиссионного вознаграждения за услуги Клиринговой организации.
Торговый лимит	максимально допустимое значение требования к размеру депозитной маржи, определенному по портфелю позиций.
Текущая цена позиции	а) для позиции до ее первой корректировки по рынку - цена заключения сделки, по которой открыта данная позиция; б) для позиции после ее корректировки по рынку - расчетная цена, определенная при последней корректировке по рынку данной позиции.
Тип срочных контрактов	совокупность срочных контрактов, параметры и характеристики которых определены одной Спецификацией.
Торги	подача заявок и совершение сделок в соответствии с Внутренними документами Организатора торговли.
Торговая сессия	период торгового дня, в течение которого в соответствии с Внутренними документами Организатора торговли осуществляется подача заявок и заключение сделок.
Торговые дни	дни, в которые проводятся торги срочными контрактами в соответствии с Внутренними документами Организатора торговли.
Требование к размеру Депозитной маржи	Сумма денежных средств, определяемая Клиринговой организацией в соответствии с Внутренними документами Клиринговой организации, необходимая для обеспечения исполнения обязательств по портфелю позиций Участника клиринга, в том числе с учетом активных заявок.
Уполномоченный федеральный орган исполнительной власти	федеральный орган исполнительной власти области финансовых рынков.
Участник клиринга	Организация, заключившая с Клиринговой организацией Договор о клиринговом обслуживании.
Участник поставки	Участник клиринга, на позиционном регистре, открытом для учета позиций которого учитывается его поставочная позиция, или клиент Участника клиринга, поставочные позиции которого учитываются на позиционных регистрах, открытых

для учета позиций таких клиентов у Участника клиринга.

Участник поставки - продавец Участник поставки, на позиционном регистре, открытом для учета позиций которого учитывается короткая поставочная позиция.

Участник поставки - покупатель Участник поставки, на позиционном регистре, открытом для учета позиций которого учитывается длинная поставочная позиция.

1.2. Термины, специально не определенные в настоящих Правилах клиринга, используются в значениях, установленных законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

Статья 01.02. Общие положения

1. Правила приняты в соответствии с Уставом Клиринговой организации, Федеральными законами, нормативными правовыми актами уполномоченного федерального органа исполнительной власти и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.
2. Правила определяют порядок осуществления Клиринговой организацией клиринга по сделкам, заключенным на срочном рынке Организатора торговли, а также по договорам, заключаемым во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам.
3. Правила регулируют отношения между Клиринговой организацией и Участниками клиринга, а также между Участниками клиринга, в связи с:
 - а) принятием Участников клиринга на клиринговое обслуживание;
 - б) определением и контролем требований, предъявляемых Клиринговой организацией к Участникам клиринга;
 - в) прекращением клирингового обслуживания Участников клиринга;
 - г) осуществлением клиринга по совершенным сделкам,а также иные отношения между Клиринговой организацией и Участниками клиринга, а также между Участниками клиринга, в связи с совершением сделок.
4. Правила, иные Внутренние документы Клиринговой организации, регламентирующие порядок совершения клиринга, решения Совета Директоров, Генерального директора, принятые по вопросам клиринга в установленном порядке, являются обязательными для исполнения Участниками клиринга.
5. Незнание положений Правил, иных Внутренних документов Клиринговой организации, регламентирующих порядок совершения клиринга, а также решений Совета Директоров, Генерального директора, не освобождает Участника клиринга от их исполнения.
6. Все приложения к Правилам являются их неотъемлемой частью.

Статья 01.03. Порядок внесения изменений и дополнений в Правила

1. Правила, изменения и дополнения в Правила утверждаются Советом Директоров и вступают в силу в дату, определяемую Советом Директоров или Генеральным директором по поручению Совета Директоров.
2. О вступлении в силу Правил, изменений и дополнений в Правила Участники клиринга извещаются путем направления уведомления не позднее, чем за пять рабочих дней до вступления их в силу.

Уведомления о вступлении в силу Правил клиринга, а также изменений и дополнений в Правила клиринга рассылаются в электронном виде по адресам, указанным Участниками клиринга в Анкете Участника клиринга. Вышеуказанные Уведомления, а также текст новой редакции Правил клиринга, либо изменений и дополнений в них могут быть направлены в виде электронных документов в соответствии с Правилами ЭДО. Формат и категория данных электронных документов установлены Операционным регламентом.

3. Днем оповещения Участников клиринга о введении в действие Правил, а также изменений и дополнений в Правила является день направления Участникам клиринга уведомлений в соответствии с [пунктом 2 настоящей статьи](#).
4. Текст Правил, а также изменения и дополнения в Правила раскрываются на странице Клиринговой организации в сети Интернет не позднее дня оповещения Участников клиринга об изменениях и/или дополнениях в Правила. По требованию (запросу) Участника клиринга текст соответствующего документа представляется Клиринговой организацией на бумажном носителе.

Статья 01.04. Порядок оповещения Участников клиринга

1. Оповещение Участников клиринга осуществляется путем направления Клиринговой организацией информационного сообщения. Информационное сообщение может быть направлено:
 - а) посредством электронного сообщения по Системе клиринга;
 - б) по почте;
 - в) курьером;
 - г) посредством размещения информации на странице Клиринговой организации в сети Интернет;
 - д) в форме электронного документа.
2. Днем оповещения Участника клиринга является день направления ему информационного сообщения в соответствии с настоящей статьей.
3. Если оповещение Участника клиринга было сделано не в письменной форме, то по требованию данного Участника клиринга ему выдается письменное информационное сообщение.
4. Информационные сообщения направляются по адресам, указанным Участниками клиринга в порядке, установленном Внутренними документами Клиринговой организации.

РАЗДЕЛ 02. КЛИРИНГОВОЕ ОБСЛУЖИВАНИЕ УЧАСТНИКОВ

Статья 02.01. Принципы клирингового обслуживания

1. Клиринговая организация осуществляет обслуживание Участников клиринга, заключивших Договор о клиринговом обслуживании, по срочным контрактам, заключенным на срочном рынке Организатора торговли, а также по договорам, заключаемым во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам.
2. Порядок клирингового обслуживания Участников клиринга различается в зависимости от категорий Участников клиринга, установленных в пункте 8 настоящей статьи.
3. Клиринговое обслуживание Участника клиринга прекращается при расторжении договора о клиринговом обслуживании в случаях и порядке, предусмотренных данным договором.
4. Клиринговая организация выполняет функции центрального контрагента по срочным контрактам, т.е является покупателем по отношению к каждому Участнику клиринга-продавцу срочного контракта и продавцом по отношению к каждому Участнику клиринга-покупателю срочного контракта, в порядке, предусмотренном настоящими Правилами.
5. Основаниями прекращения обязательств по срочным контрактам являются:
 - а) надлежащее исполнение обязательств по серии фьючерса;
 - б) наличие встречных обязательств по одной серии фьючерса, позиции по которым учитываются на одном позиционном регистре;
 - в) основания, предусмотренные Правилами клиринга (в том числе, уплата неустойки) в случаях неисполнения Участником клиринга обязательств по серии фьючерса, определяемых в соответствии с Правилами клиринга и Спецификацией;
 - г) иные основания, предусмотренные Правилами клиринга.

По основаниям, указанным в настоящем пункте, срочные контракты прекращаются в порядке, предусмотренном настоящими Правилами.
6. При осуществлении клирингового обслуживания Участников клиринга по сделкам, заключенным на срочном рынке Организаторов торговли, Клиринговая организация осуществляет клиринг с частичным обеспечением.
7. Клиринговая организация не осуществляет клиринг по сделкам, совершенным без участия Организатора торговли.

8. Клиринговая организация осуществляет клиринг на основании документов от Организатора торговли без подтверждений от Участников клиринга совершенных в ходе торгов сделок.
9. Клиринговое обслуживание предусматривает следующие категории клирингового участия:
 - а) «Общий клиринговый участник» – Участник клиринга, осуществляющий в порядке и случаях, предусмотренных настоящими Правилами и спецификациями соответствующих срочных контрактов, следующие действия:
 - от своего имени и за свой счет - расчеты с Клиринговой организацией по результатам совершенных сделок; внесение обеспечения, гарантирующего исполнение заключенных (от своего имени и за свой счет) срочных контрактов; исполнение обязательств по совершенным сделкам в целях поставки базового актива;
 - от своего имени и за счет своего Клиента - расчеты с Клиринговой организацией по результатам совершенных сделок от имени данного Участника клиринга и за счет Клиента; внесение обеспечения, гарантирующего исполнение заключенных срочных контрактов от своего имени и за счет Клиента; исполнение обязательств по совершенным сделкам в целях поставки базового актива от своего имени и за счет Клиента;
 - в случае, если Клиент Участника клиринга является Участником поставки - внесение обеспечения, гарантирующего исполнение договоров, заключаемых во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам от имени и за счет такого Клиента (поставочная маржа); перечисление денежных средств по договорам, заключаемым во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам от имени данного Клиента в оплату поставки и стоимости транспортных расходов по каждому договору.
 - б) «Индивидуальный клиринговый участник» – Участник клиринга, осуществляющий в порядке и случаях, предусмотренных настоящими Правилами и спецификациями соответствующих срочных контрактов, следующие действия:
 - от своего имени и за свой счет - расчеты с Клиринговой организацией по результатам совершенных сделок; внесение обеспечения, гарантирующего исполнение заключенных срочных контрактов; исполнение обязательств по поставке и/или оплате базового актива.
10. Участник клиринга имеет право в соответствии заключенным Договором о клиринговом обслуживании и Правилами участвовать в клиринге по сделкам, зарегистрированным Организатором торговли, а также иные права, установленные указанным договором и Правилами.

11. Участник клиринга обязан в соответствии с Правилами своевременно и в полном объеме выполнять следующие обязанности:
 - а) предоставлять в Клиринговую организацию необходимые документы и информацию в соответствии с Правилами;
 - б) соблюдать установленные согласно Правилам лимиты;
 - в) оплачивать по результатам клиринга обязательства по вариационной марже;
 - г) исполнять свои обязательства перед Клиринговой организацией;
 - д) соблюдать режим конфиденциальности информации, которая становится доступной Участнику клиринга в связи с его клиринговым обслуживанием;
 - е) исполнять решения, принятые уполномоченными органами Клиринговой организации в рамках их компетенции;
 - ж) разрешать споры в порядке, установленном Правилами;
 - з) иные обязанности, возникающие в соответствии с Правилами и Договором о клиринговом обслуживании.
12. Отзыв Центральным банком Российской Федерации лицензии на осуществление банковских операций может являться основанием ограничения допуска Участника клиринга, являющегося кредитной организацией, к клиринговому обслуживанию.
13. Каждый Участник клиринга согласен с тем, что информация о его наименовании, месте нахождения и иных данных, указанных им в Анкете Участника клиринга, а также о присвоенном ему Клиринговой организацией коде Участника клиринга, может раскрываться на сайте Клиринговой организации в сети Интернет.

Статья 02.02. Требования, предъявляемые к Участникам клиринга

1. Показатели финансового состояния Участников клиринга должны соответствовать предъявляемым к ним требованиям, установленным [Приложением 04 к Правилам](#).
2. Для подтверждения своего финансового состояния Участники клиринга обязаны предоставлять Клиринговой организации аудиторское заключение по результатам проверки деятельности организации за последний год с приложением баланса и отчета о прибылях и убытках, оформленных в соответствии с требованиями, предъявляемыми законодательством Российской Федерации к составлению аудиторских заключений для организаций – резидентов и в соответствии с Международными стандартами аудита для организаций - нерезидентов, а также следующие документы финансовой отчетности:
 - а) Кредитные организации - резиденты:
 - (i) оборотная ведомость по счетам бухгалтерского учета

- (ii) информация об обязательных нормативах (форма 0409135) – ежемесячно;
 - (iii) расчет собственных средств (капитала) (форма 0409134) – ежемесячно;
 - (iv) отчет о прибылях и убытках (форма 0409102) – ежеквартально.
- б) Некредитные организации - резиденты:
- (i) бухгалтерский баланс (форма №1) – ежеквартально;
 - (ii) отчет о прибылях и убытках (форма №2) – ежеквартально;
 - (iii) расчет собственного капитала по форме, установленной регулируемыми органами (расчет размера собственного капитала для профессиональных участников рынка ценных бумаг, расчет стоимости чистых активов для некредитных организаций, не являющихся профессиональными участниками рынка ценных бумаг) – ежеквартально.
- в) Организации – нерезиденты предоставляют финансовую отчетность, подготовленную в соответствии с Международными стандартами финансовой отчетности:
- (i) бухгалтерский баланс – ежеквартально;
 - (ii) отчет о прибылях и убытках – ежеквартально;
 - (iii) отчет об изменениях в капитале – ежеквартально.
3. Участники клиринга должны предоставлять указанные в настоящей статье документы финансовой отчетности в форматах, установленных Операционным Регламентом.
4. В случае несоответствия финансовой отчетности требованиям, предъявляемым настоящими Правилами, нормативными правовыми актами Центрального банка Российской Федерации, Министерства Финансов Российской Федерации и иных уполномоченных федеральных органов исполнительной власти, Клиринговая организация направляет Участникам клиринга соответствующее сообщение по электронной почте не позднее пяти рабочих дней после дня получения от данных Участников клиринга финансовой отчетности.
5. В случае получения от Клиринговой организации сообщения с заключением о несоответствии финансовой отчетности требованиям, предъявляемым настоящими Правилами, нормативными правовыми актами Центрального банка Российской Федерации, Министерства Финансов Российской Федерации и иных уполномоченных федеральных органов исполнительной власти, Участник клиринга обязан устранить все замечания и направить финансовую отчетность в Клиринговую организацию повторно.

6. Указанные в настоящей статье документы финансовой отчетности Общие клиринговые участники и Индивидуальные клиринговые участники должны предоставлять в следующие сроки:
- а) отчетность по состоянию на месячную дату – не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным;
 - б) отчетность по состоянию на квартальную дату:
 - (i) отчетность по состоянию на 31 декабря – в составе годовой отчетности;
 - (ii) отчетность по состоянию на 31 марта - не позднее 15 мая;
 - (iii) отчетность по состоянию на 30 июня - не позднее 15 августа;
 - (iv) отчетность по состоянию на 30 сентября - не позднее 15 ноября
 - в) отчетность за год – не позднее 15 (пятнадцатого) апреля года, следующего за отчетным;
 - г) аудиторское заключение – в составе годовой отчетности.

Если последний день срока предоставления финансовой отчетности приходится на выходной или праздничный день, днем окончания срока считается следующий за ним рабочий день.

7. Участники клиринга обязаны незамедлительно уведомлять Клиринговую организацию обо всех существенных изменениях своего финансового состояния.
8. Новые значения требований к показателям финансового состояния Участников клиринга при их изменении, если иное не установлено Советом Директоров, применяются для Участников клиринга и организаций, вступающих на клиринговое обслуживание, начиная со следующей даты:
- а) при увеличении данных значений – с ближайшей даты сдачи в Клиринговую организацию документов финансовой отчетности по истечении 3 (трех) календарных месяцев с момента утверждения данных значений;
 - б) при снижении данных значений – с даты их утверждения.
9. Несоответствие хотя бы одного показателя финансового состояния Участника клиринга предъявляемым к нему требованиям может являться основанием ограничения допуска данного Участника клиринга к клиринговому обслуживанию или прекращения допуска данного Участника клиринга к клиринговому обслуживанию.
10. Непредоставление Участником клиринга в установленный срок финансовой отчетности в соответствии с настоящей статьей может являться основанием для ограничения допуска данного Участника клиринга к клиринговому обслуживанию.

Статья 02.03. Порядок организации клирингового обслуживания. Требования к документам Участников клиринга.

1. Клиринговая организация осуществляет клиринговое обслуживание лиц, заключивших Договор о клиринговом обслуживании, в течение срока действия данного Договора, а также после прекращения действия Договора в части исполнения обязательств, возникших до прекращения его действия.
2. Типовая форма Договора о клиринговом обслуживании между Клиринговой организацией и Участником клиринга приведена в Приложении 1 к Правилам.
3. Для заключения Договора о клиринговом обслуживании российским юридическим лицом в Клиринговую организацию должны быть представлены следующие документы:
 - а) Анкета Участника клиринга (форма предусмотрена в Приложении №02 к настоящим Правилам);
 - б) нотариально засвидетельствованная копия свидетельства о государственной регистрации юридического лица;
 - в) нотариально засвидетельствованная копия устава юридического лица (со всеми изменениями и дополнениями);
 - г) нотариально засвидетельствованная копия документа, подтверждающего постановку юридического лица на учет в налоговом органе с указанием ИНН;
 - д) выписка из единого государственного реестра юридических лиц, выданная не ранее 30 дней к моменту представления в Клиринговую организацию, или нотариально засвидетельствованная копия вышеуказанной выписки;
 - е) карточка с нотариально засвидетельствованными образцами оттиска печати юридического лица и подписей лиц, уполномоченных подписывать необходимые документы от имени юридического лица, или ее копия, засвидетельствованная нотариально либо одной из расчетных организаций;
 - ж) нотариально засвидетельствованная или заверенная уполномоченным лицом организации - юридического лица копия документа, подтверждающего избрание (назначение) на должность единоличного исполнительного органа юридического лица (приказ, решение учредителей, решение общего собрания акционеров / участников, решение иного органа управления и т.п.), оригинал (или нотариально засвидетельствованная, или заверенная уполномоченным лицом организации – юридического лица копия) доверенности лица, уполномоченного действовать от имени юридического лица;
 - з) нотариально засвидетельствованная или заверенная уполномоченным лицом организации - юридического лица копия лицензии Профессионального участника рынка ценных бумаг для профессиональных участников и банковской лицензии для кредитных организаций;

- и) документы финансовой отчетности, предусмотренные пунктом 2 статьи 02.02 Правил.
4. Для заключения Договора иностранным юридическим лицом в Клиринговую организацию должны быть представлены следующие документы:
- а) Анкета Участника клиринга (форма предусмотрена в Приложении №03 к настоящим Правилам);
 - б) копии учредительных документов (при наличии консульской легализации либо апостиля);
 - в) выписка из торгового или банковского реестра или иного государственного реестра юридических лиц страны происхождения иностранного юридического лица (при наличии консульской легализации либо апостиля);
 - г) документ, подтверждающий постановку иностранного юридического лица на налоговый учет в стране происхождения иностранного юридического лица (при наличии консульской легализации либо апостиля) и, в случае постановки на налоговый учет в Российской Федерации, - в налоговом органе Российской Федерации;
 - д) документ, подтверждающий полномочия лица осуществлять юридические действия от имени иностранного юридического лица – нерезидента; оригинал (или нотариально засвидетельствованная копия) доверенности лица, уполномоченного действовать от имени юридического лица (при наличии консульской легализации либо апостиля);
 - е) нотариально засвидетельствованная копия документа, подтверждающего избрание (назначение) на должность лица, имеющего право действовать от имени юридического лица без доверенности (приказ, решение учредителей, решение общего собрания акционеров / участников, решение иного органа управления и т.п.) (при наличии консульской легализации либо апостиля);
 - ж) нотариально засвидетельствованный образец подписи лица, уполномоченного подписывать необходимые документы от имени юридического лица и, при наличии, оттиск печати юридического лица (например, карточка с образцами оттиска печати и подписей, альбом подписей уполномоченных лиц, доверенность, содержащая подпись уполномоченного лица) (при наличии консульской легализации либо апостиля) либо указанные образцы подписи и печати, заверенные уполномоченным сотрудником Клиринговой организации;
 - з) документы финансовой отчетности, предусмотренные пунктом 2 статьи 02.02 Правил.
5. Датой принятия лица на клиринговое обслуживание считается дата заключения с ним Договора о клиринговом обслуживании.
6. Документы, предоставляемые организацией в Клиринговую организацию в соответствии с подпунктами а), е) – и) пункта 3, и пункта

4 настоящей статьи, оформляются в бумажной форме на государственном языке Российской Федерации, подписываются уполномоченным лицом организации и заверяются печатью организации. Помарки и исправления в документах не допускаются. Указанные документы направляются письмом или курьером по почтовому адресу Клиринговой организации или организации, имеющей полномочия принимать от имени Клиринговой организации такие документы.

Документы, указанные в подпунктах б) – д) пункта 3 настоящей статьи могут быть предоставлены в сканированном виде.

7. Клиринговая организация отказывает в рассмотрении предоставленных документов в любом из следующих случаев:

- а) отсутствия в распоряжении Клиринговой организации хотя бы одного из указанных в пунктах 3 и 4 настоящей статьи документов;
- б) некомплектность и/или несоответствие предоставленного документа и/или прилагаемых к нему документов требованиям к оформлению, установленным Правилами.

Об отказе в рассмотрении документов Клиринговая организация оповещает организацию в установленном Правилами порядке.

В случае отказа в рассмотрении документов организация вправе изъять предоставленные в Клиринговую организацию документы.

8. Участники клиринга обязаны обеспечивать полноту и достоверность информации и документов, предоставляемых в Клиринговую организацию в соответствии с Правилами.

9. Участники клиринга обязаны сообщать Клиринговой организации об изменении их организационно-правовой формы, Устава, получении, приостановлении или отзыве лицензии профессионального участника, приобретении или потере статуса налогового резидента, отзыве банковской лицензии, места нахождения, почтового адреса, смене руководства, прекращении полномочий лиц, имеющих право подписывать документы от имени организации, а также в случае изменения сведений, содержащихся в Анкете Участника клиринга или в иных представленных в Клиринговую организацию документах. При этом:

- а) Данная информация должна предоставляться в письменной форме за подписью руководителя организации.
- б) Информация о данных изменениях должна быть предоставлена в Клиринговую организацию не позднее следующего рабочего дня после вступления в силу данных изменений.
- в) В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете Участника клиринга, предоставляется Анкета Участника клиринга с измененными данными.

Участники клиринга самостоятельно несут риск последствий, связанных с непредставлением или несвоевременным представлением указанной в настоящем пункте информации.

В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете Участника клиринга или в иных представленных в Клиринговую организацию документах, Участник клиринга обязан предоставить новую Анкету Участника клиринга и соответствующие документы, подтверждающие такие изменения.

10. Участники клиринга обязаны информировать Клиринговую организацию о применявшихся к ним административных и налоговых санкциях, а к их руководству и сотрудникам, которые связаны или планируются быть связанными с деятельностью по совершению сделок, - уголовных наказаниях. При этом:
 - а) Данная информация должна предоставляться в письменной форме за подписью руководителя организации.
 - б) Участники клиринга должны предоставлять информацию о применявшихся санкциях не позднее, чем через 10 (десять) рабочих дней после применения данных санкций.
11. Клиринговая организация вправе в любое время требовать от Участников клиринга предоставления любой дополнительной информации о себе, в том числе характеризующей их финансовое состояние. При этом запрашиваемая информация должна быть предоставлена в срок, указанный в запросе, а если такой срок не указан, то в течение 10 (десяти) рабочих дней со дня получения запроса Клиринговой организации.
12. Непредоставление Участником клиринга в установленный Правилами срок информации/документов или предоставление недостоверной информации может являться основанием для применения к нему следующих санкций:
 - а) ограничения допуска данного Участника клиринга к клиринговому обслуживанию.

Статья 02.04. Допуск Участников клиринга к клиринговому обслуживанию

1. К проведению операций в Системе клиринга от имени Участника клиринга допускаются исключительно Операторы данного Участника клиринга. Каждому Оператору в Системе клиринга присваивается уникальный код.
2. Участник клиринга несет ответственность за все действия, совершаемые его Оператором в Системе клиринга.

3. Оператор Участника клиринга допускается к проведению операций в Системе клиринга после предоставления Участником клиринга в Клиринговую организацию доверенности по форме, установленной Операционным Регламентом.
4. Для проведения расчетов по итогам клиринга Участник клиринга обязан иметь не менее одного банковского счета в одной из Расчетных организаций (далее - Банковский Счет) и сообщить реквизиты этого Банковского Счета в Клиринговую организацию в форме Уведомления, предусмотренного Операционным Регламентом.
5. В случае необходимости изменения реквизитов Банковского Счета Участника клиринга, Участник клиринга предоставляет в Клиринговую организацию новое Уведомление о реквизитах Банковского счета не позднее, чем за 3 (три) рабочих дня до начала проведения таким Участником клиринга расчетов с использованием измененных реквизитов.
6. Порядок зачисления и списания денежных средств по Банковскому Счету в Расчетной организации определяется соответствующим договором банковского счета, заключаемым между Участником клиринга и Расчетной организацией.
7. Для получения допуска к клиринговому обслуживанию Общие клиринговые участники и Индивидуальные клиринговые участники, помимо заключения договора о клиринговом обслуживании, обязаны:
 - а) предоставить в Клиринговую организацию реквизиты не менее одного банковского счета, открытого в одной из Расчетных организаций, необходимого для проведения расчетов по результатам совершенных сделок от своего имени и за свой счет; Общие клиринговые участники также должны предоставить в Клиринговую организацию реквизиты не менее одного банковского счета, открытого в одной из Расчетных организаций, необходимого для проведения расчетов по результатам совершенных сделок от своего имени и за счет своих Клиентов;
 - б) перечислить взнос в Коллективный гарантийный фонд в порядке и размере, установленном Правилами для соответствующей категории;
 - в) предоставить доверенность на Оператора;
 - г) получить доступ к осуществлению документооборота в СЭД в соответствии с Правилами ЭДО;
 - д) получить технический доступ к программно-техническому комплексу РДК (ЗАО) на срочном рынке и предоставить в РДК (ЗАО) Акт технической готовности Участника к работе с удаленным рабочим местом на срочном рынке в соответствии с Договором об обеспечении технического доступа к программно-техническому комплексу РДК (ЗАО) на срочном рынке.
8. Несоблюдение Общим клиринговым участником либо Индивидуальным клиринговым участником любого из требований, установленных пунктом 7 настоящей статьи, может являться

основанием для недопущения к клиринговому обслуживанию или ограничения/прекращения допуска к клиринговому обслуживанию данного Участника клиринга.

9. Решение об ограничении допуска (о предоставлении, ограничении, либо прекращении допуска) Участника клиринга к клиринговому обслуживанию принимается Генеральным директором, или лицом, уполномоченным Генеральным директором. О данном решении участник клиринга уведомляется в порядке, установленном [статьей 01.04 Правил](#).

Статья 02.05. Изменение категории клирингового участия

1. Для изменения категории клирингового участия Участник клиринга должен предоставить в Клиринговую организацию Дополнительное соглашение об изменении категории клирингового участия к Договору о клиринговом обслуживании по форме, предусмотренной [Приложением 05 к Правилам](#), а также выполнить требования, предъявляемые Клиринговой организацией к соответствующей категории, предусмотренные [Статьей 02.02. Правил и условия допуска](#) Участников клиринга к клиринговому обслуживанию, установленные для соответствующей категории клирингового участия [Статьей 02.04 Правил](#).
2. Для изменения категории клирингового участия с категории «Общий клиринговый участник» на категорию «Индивидуальный клиринговый участник», Участник клиринга должен закрыть все позиционные регистры, предназначенные для учета позиций его Клиентов.
3. Датой изменения категории клирингового участия считается дата заключения с ним Дополнительного соглашения об изменении категории клирингового участия к Договору о клиринговом обслуживании.

Статья 02.06. Присвоение статуса Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя

1. Статус Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя присваивается Участнику клиринга / Клиенту Участника клиринга в отношении определенного типа срочных контрактов. Для получения статуса Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя Участник клиринга / Клиент Участника клиринга должен отвечать требованиям, предъявляемым Клиринговой организацией к Гарантирующему поставщику / Гарантирующему покупателю в отношении данного типа срочных контрактов.
2. Требования, предъявляемые Клиринговой организацией к Гарантирующему поставщику / Гарантирующему покупателю в

- отношении определенного типа срочных контрактов определяются в соответствии с Методикой выбора Гарантирующих поставщиков / Гарантирующих покупателей, утверждаемой Генеральным директором РДК (ЗАО).
3. Для получения статуса Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя Участнику клиринга / Клиенту Участника клиринга, Участник клиринга должен предоставить в Клиринговую организацию заявление по форме, установленной [Приложением 06 к Правилам](#).
 4. В заявлении на получение статуса Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя указывается:
 - а) тип срочных контрактов, в отношении которого Участник клиринга / Клиент Участника клиринга претендует на получение статуса Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя;
 - б) статус «Гарантирующий поставщик», либо «Гарантирующий покупатель», на получение которого претендует Участник клиринга / Клиент Участника клиринга.
 5. Решение о присвоении статуса Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя Участнику клиринга / Клиенту Участника клиринга принимается Генеральным директором, или лицом, уполномоченным Генеральным директором. О данном решении участник клиринга уведомляется в порядке, установленном [статьей 01.04 Правил](#).
 6. Для выполнения функций Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя, предусмотренных Разделом 08 Правил, Участнику клирингу, имеющему соответствующий статус, либо Участнику клиринга, обслуживающему Клиента, имеющего соответствующий статус, открываются специальные позиционные регистры. Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя.
 7. Участник клиринга, являющийся несостоятельным в соответствии со [статьей 07.07. Правил](#), лишается статуса Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя. Кроме того, Участник клиринга /Клиент Участника клиринга, может быть лишен статуса Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя, если данный Участник клиринга /Клиент Участника клиринга перестает соответствовать требованиям, установленным Методикой выбора Гарантирующих поставщиков / Гарантирующих покупателей, утверждаемой Генеральным директором РДК (ЗАО). Решение о лишении статуса Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя принимается Генеральным директором, или лицом, уполномоченным Генеральным директором.

РАЗДЕЛ 03. ОБСЛУЖИВАНИЕ КЛИЕНТОВ

Статья 03.01. Условия и порядок обслуживания Клиентов

1. Под обслуживанием Клиентов понимаются отношения между Общим клиринговым участником и его Клиентом, связанные с совершением данным Общим клиринговым участником сделок от своего имени и за счет данного Клиента, а также в случае, если Клиент Участника клиринга является Участником поставки - отношения между Общим клиринговым участником и его Клиентом, связанные с внесением Общим клиринговым участником обеспечения, гарантирующего исполнение обязательств по договорам, заключаемым во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам от имени и за счет такого Клиента (поставочной маржи), а также отношения, связанные с перечислением денежных средств в оплату поставки и транспортных расходов по каждому договору.
2. Условия и порядок обслуживания Общим клиринговым участником Клиента определяются в двустороннем порядке с соблюдением требований настоящей Статьи.
3. Для регистрации Клиента Общим клиринговым участником обязан предоставить в Клиринговую организацию предусмотренные Операционным Регламентом сведения о своих клиентах (включая данные об ИНН).
4. В случае несоблюдения Общим клиринговым участником требований к документам, содержащим сведения, необходимые для регистрации Клиентов, а также нарушения порядка предоставления данных сведений, Клиринговая организация не несет ответственности перед данным Участником клиринга, а также перед его Клиентами за несвоевременную их регистрацию, либо регистрацию клиентов в Системе клиринга на основе ошибочных данных, полученных от Участника клиринга.
5. Технологические особенности открытия позиционных регистров, в том числе требования к документам, содержащим сведения, необходимые для открытия или закрытия позиционных регистров (Распоряжений на открытие/закрытие позиционных регистров), определяются Операционным Регламентом.
6. Общим клиринговым участником имеет возможность открывать неограниченное количество позиционных регистров для обособленного учета позиций одного Клиента.
7. Условием отмены регистрации Клиента является отсутствие позиций на всех позиционных регистрах, открытых для учета позиций данного Клиента.

8. В целях обслуживания Клиента по договорам, заключаемым во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам от имени его Клиентов, Общий клиринговый участник обязан предусмотреть в договоре с Клиентом положения, в соответствии с которым Клиент поручает, а Общий клиринговый участник принимает на себя обязательство осуществлять денежные расчеты по договорам, заключаемым во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам от имени данного Клиента, включая расчеты по оплате поставки и стоимости транспортных расходов по каждому договору.

В Договоре между Общим клиринговым участником и Клиентом должно быть предусмотрено, что Общий клиринговый участник вносит поставочную маржу в обеспечение исполнения договоров, заключаемых во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам от имени данного Клиента, из состава которой удерживается неустойка в случаях, предусмотренных настоящими Правилами клиринга и договором, заключенным во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам (Договором поставки).

Статья 03.02. Защита интересов Клиентов

1. Общим клиринговым участникам запрещается совершать действия, вводящие в заблуждение их Клиентов, в том числе предоставлять недостоверные отчеты и другую недостоверную информацию. При этом не имеет значения, имело ли место действительное заблуждение Клиента или нет.
2. Общий клиринговый участник обязан незамедлительно извещать своих Клиентов о возникновении ситуаций, которые влекут или могут повлечь за собой принудительное закрытие позиций, открытых в интересах данных Клиентов.
3. Общий клиринговый участник обязан ознакомить Клиента с действующими Внутренними документами Клиринговой организации и рисками, связанными с совершением сделок.
4. Общий клиринговый участник обязан своевременно информировать Клиента об изменениях во Внутренних документах и решениях уполномоченных органов Организатора торговли и Клиринговой организации, касающихся проведения торгов и осуществления клиринга.

РАЗДЕЛ 04. ОБЕСПЕЧЕНИЕ

Статья 04.01. Депозитная маржа

1. Участник клиринга обязан обеспечить наличие на каждом денежном торговом регистре суммы депозитной маржи в размере, не меньшем требования к размеру депозитной маржи по соответствующему портфелю позиций.
2. Депозитная маржа может вноситься Участником клиринга только в российских рублях.
3. Расчет требований к размеру депозитной маржи Участников клиринга производится каждый торговый день в ходе клиринговой сессии после взаимозачета позиций.
4. Требование к размеру депозитной маржи Участника клиринга определяется отдельно по каждому портфелю позиций.
5. Требование к размеру депозитной маржи по портфелю позиций определяется, как сумма следующих величин:
 - а) требование, рассчитанное в соответствии с методологией SPAN©;
 - б) накопленный убыток по вариационной марже;
 - в) предварительная поставочная маржа.

Параметры, необходимые для расчета требования в соответствии с методологией SPAN©, определяются в соответствии с Методикой определения параметров гарантийной системы, утверждаемой решением Генерального директора.

Предварительная поставочная маржа рассчитывается следующим образом:

$$ППМ = \sum_{i=1}^N \left[sr_i * \sum_{j=1}^K |pos_{ij}| \right]$$

где

ППМ – размер предварительной поставочной маржи;

$\sum_{i=1}^N []$ – сумма значений, рассчитываемых по заключенной в скобки формуле по всем сериям срочных контрактов с ближайшим сроком исполнения, в отношении которых решением Генерального директора установлена ставка предварительной поставочной маржи;

sr_i – ставка предварительной поставочной маржи, установленная по данной серии срочных контрактов решением Генерального директора;

$\sum_{j=1}^K |pos_{ij}|$ – сумма количества открытых позиций по i -ому инструменту на j -ом позиционном регистре.

Накопленный убыток по вариационной марже по портфелю позиций в ходе торговой сессии в каждый момент времени рассчитывается как сумма накопленных убытков по всем позиционным регистрам, входящим в портфель позиций. Накопленный убыток по вариационной марже по позиционному регистру рассчитывается следующим образом:

$$CVM = \sum [(PB_i^* - PA_i^*) * \min(QA_i^*, QB_i^*)],$$

где

CVM – накопленный убыток по вариационной марже на данном позиционном регистре;

QA_i^* – количество позиций на продажу по i -той серии срочных контрактов;

QB_i^* – количество позиций на покупку по i -той серии срочных контрактов;

PA_i^* – средневзвешенная цена продажи по i -той серии срочных контрактов, определяемая по всем сделкам на продажу, заключенным в течение текущей торговой сессии на момент расчета накопленного убытка по вариационной марже данным Участником клиринга по всем позиционным регистрам, входящим в данный портфель позиций по следующей формуле:

$$P = \sum_k P_k * Q_k / \sum_k Q_k,$$

где

P_k – цена k -ой сделки;

Q_k – объем k -ой сделки.

PB_i^* – средневзвешенная цена покупки по i -той серии срочных контрактов, определяемая по всем сделкам на покупку, заключенным в течение текущей торговой сессии на момент расчета накопленного убытка по вариационной марже данным Участником клиринга по всем позиционным регистрам, входящим в данный портфель позиций по следующей формуле:

$$P = \sum_k P_k * Q_k / \sum_k Q_k,$$

где

P_k – цена k -ой сделки;

Q_k – объем k -ой сделки.

Накопленный убыток по вариационной марже по портфелю позиций в ходе клиринговой сессии равен нулю.

6. Требования к размеру депозитной маржи Участника клиринга отражаются в Отчетах, предоставляемых Участникам клиринга в соответствии со [статьей 07.08 Правил](#).
7. Внесение депозитной маржи Участника клиринга осуществляется путем зачисления денежных средств на Счет Клиринговой организации в любой из Расчетных организаций.
8. При перечислении денежных средств на Счет Клиринговой организации для внесения депозитной маржи обязательно указывается назначение платежа, однозначно определяющее данные средства как депозитную маржу, ссылка на номер и дату Договора между Клиринговой организацией и Участником клиринга, а также код денежного торгового регистра Участника клиринга (Пример назначения платежа: «Перечисление средств депозитной маржи. НДС не облагается. Договор № от ЧЧ.ММ.ГГГГ. Код участника . Код денежного торгового регистра .»).
9. Избыток депозитной маржи Участника клиринга по портфелю позиций в каждый момент времени определяется как превышение размера депозитной маржи этого Участника клиринга по портфелю позиций на данный момент времени над суммой требования к размеру депозитной маржи Участника клиринга по данному портфелю позиций
10. Возврат денежных средств из состава депозитной маржи Участника клиринга осуществляется по распоряжению данного Участника клиринга. В Распоряжении на возврат средств обязательно указываются реквизиты Банковского Счета Участника клиринга, ссылка на номер и дату Договора между Клиринговой организацией и Участником клиринга, а также код денежного торгового регистра Участника клиринга (Пример назначения платежа: «Возврат средств депозитной маржи. НДС не облагается. Договор №от ЧЧ.ММ.ГГГГ. Код участника . Код денежного торгового регистра . Банковский счет »).

Возврат денежных средств из состава депозитной маржи с определенного денежного регистра Участника клиринга осуществляется в размере, не превышающем избыток депозитной маржи по соответствующему портфелю позиций. В случае если исполнение распоряжения на возврат денежных средств из состава депозитной маржи Участника клиринга может привести к задолженности по депозитной марже данного Участника клиринга, Распоряжение на возврат денежных средств не исполняется.

11. Клиринговая организация исполняет вышеуказанные Распоряжения в порядке и сроки, определенные Операционным Регламентом.

Статья 04.02. Коллективный гарантийный фонд

1. Коллективный гарантийный фонд формируется из взносов Участников клиринга и может быть использован исключительно в целях урегулирования ситуаций несостоятельности Участников клиринга.
2. Коллективный гарантийный фонд формируется в соответствии с Правилами и Порядком создания, размещения и использования гарантийных фондов РДК (ЗАО) при осуществлении клиринга на срочном рынке (далее – Порядок), утверждаемым в установленном порядке.
3. Требования к размерам взносов Общих клиринговых участников и Индивидуальных клиринговых участников в Коллективный гарантийный фонд устанавливается Генеральным директором в зависимости от категории клирингового участия.
4. Внесение Общим клиринговым участником и Индивидуальным клиринговым участником взноса в Коллективный гарантийный фонд в размере не меньшем требования к размеру взноса в Коллективный гарантийный фонд является необходимым условием допуска Участников клиринга данных категорий к клиринговому обслуживанию.
5. Размер требования к размеру взноса Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд, а также информация о размере данного фонда отражается в Отчете «Параметры гарантийной системы», предоставляемом Участникам клиринга в соответствии со [статьей 07.08 Правил](#).
6. Внесение взноса Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд осуществляется путем зачисления денежных средств на Счет Клиринговой организации в любой из Расчетных организаций.
7. При перечислении денежных средств на Счет Клиринговой организации для внесения взноса в Коллективный гарантийный фонд обязательно указывается назначение платежа, однозначно определяющее данные средства как взнос в Коллективный гарантийный фонд, ссылка на номер и дату Договора между Клиринговой организацией и Участником клиринга, а также код денежного регистра учета взноса Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд (Пример назначения платежа: «Перечисление гарантийного взноса. НДС не облагается. Договор № от ЧЧ.ММ.ГГГГ. Код Участника клиринга . Код денежного регистра учета взноса в Коллективный гарантийный фонд.»).
8. В случае увеличения требования к размеру взноса в Коллективный гарантийный фонд, установленного для определенной категории, Участник клиринга соответствующей категории обязан осуществить увеличение своего взноса в Коллективный гарантийный фонд до размера требования к размеру взноса в Коллективный гарантийный фонд.

фонд в сроки, установленные в соответствующем решении Генерального директора.

9. В случае полного или частичного использования взноса Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд, осуществляемого в целях урегулирования ситуаций несостоятельности Участников клиринга в соответствии со [статьей 06.04 Правил](#), либо в соответствии с Разделом 08 Правил, Участник клиринга обязан осуществить восстановление своего взноса в Коллективный гарантийный фонд до размера требования к размеру взноса в Коллективный гарантийный фонд, установленного для соответствующей категории в срок, устанавливаемый решением Генерального директора. Участники клиринга оповещаются о данном решении в порядке, установленном Правилами в течение 5 (пяти) рабочих дней после даты принятия такого решения.
10. Неоплата Участником клиринга требования к увеличению/восстановлению своего взноса в Коллективный гарантийный фонд в случаях и порядке, предусмотренных настоящей статьей, может являться основанием для применения к нему всех или некоторых санкций из числа следующих:
- а) ограничение его допуска к клиринговому обслуживанию;
 - б) принудительная ликвидация позиций данного Участника клиринга, а также прекращение его клирингового обслуживания.
11. Изъятие денежных средств из состава взноса Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд может осуществляться в размере свободного остатка взноса данного Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд, определяемого по следующей формуле:

$$I = F - \left(C + \frac{\max(D_i - M_i^0, 0)}{k} \right)$$

где

F - размер взноса в Коллективный гарантийный фонд данного Участника клиринга;

M_i^0 - максимальный торговый лимит Участника клиринга, при соответствии размера его вклада в Коллективный гарантийный фонд требованию, установленному для соответствующей категории клирингового участия;

D_i - сумма требований к размеру депозитной маржи данного Участника клиринга по всем портфелям;

k - коэффициент, устанавливаемый в соответствии с Методикой определения параметров гарантийной системы, утверждаемой решением Генерального директора;

С - требование к размеру вноса в Коллективный гарантийный фонд, установленное для соответствующей категории клирингового участия.

Изъятие денежных средств из состава вноса в Коллективный гарантийный фонд Участника клиринга, имеющего задолженность по депозитной марже, не допускается.

12. Изъятие денежных средств из состава вноса Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд осуществляется по распоряжению данного Участника клиринга. В Распоряжении на возврат средств обязательно указываются реквизиты Банковского Счета Участника клиринга, ссылка на номер и дату Договора между Клиринговой организацией и Участником клиринга, а также код денежного регистра учета гарантийного вноса (Пример назначения платежа: «Возврат вноса в Коллективный гарантийный фонд. НДС не облагается. Договор № от ЧЧ.ММ.ГГГГ. Код участника . Код денежного регистра учета вноса в Коллективный гарантийный фонд . Банковский счет »).
13. Клиринговая организация исполняет вышеуказанные Распоряжения в порядке и сроки, определенные Операционным Регламентом.

Статья 04.03. Поставочная маржа

1. Участника клиринга обязан вносить поставочную маржу в соответствии с настоящей статьей в размере, не меньшем требования к размеру поставочной маржи.
2. В последний торговый день по определенной серии срочных контрактов в ходе клиринговой сессии осуществляется внесение поставочной маржи Участника клиринга путем перевода Клиринговой организацией средств из состава депозитной маржи Участника клиринга с денежного регистра учета депозитной маржи на денежный регистр учета поставочной маржи.
3. Если иное не установлено Правилами для соответствующего типа поставочных срочных контрактов, требование к размеру поставочной маржи Участника клиринга по поставочным срочным контрактам рассчитывается по следующей формуле:

$$MT = \sum_{пс} [\Pi_{пс} \times п_{пс}] + \sum_{пс} [K_{пс} \times к_{пс}],$$

где

MT - требование к размеру поставочной маржи по портфелю позиционных регистров;

- $\sum_{пс} []$ - сумма значений, рассчитываемых по заключенной в скобки формуле отдельно для каждого позиционного регистра, входящего в портфель позиционных регистров, на котором учтены чистые позиции по определенной серии срочных контрактов;
- $\Pi_{пс}$ - ставка поставочной маржи, установленная для коротких позиций по данной серии поставочных срочных контрактов решением Генерального директора;
- $\Pi_{пс}$ - объем чистых коротких позиций по определенной серии срочных контрактов в единицах базового актива на данном позиционном регистре/ объем обязательств по сделкам предпоставочного периода в единицах базового актива, учитываемых на данном позиционном регистре;
- $K_{пс}$ - ставка поставочной маржи, установленная для длинных позиций по данной серии поставочных срочных контрактов решением Генерального директора;
- $K_{пс}$ - объем чистых длинных позиций по определенной серии срочных контрактов в единицах базового актива на данном позиционном регистре/ объем обязательств по сделкам предпоставочного периода в единицах базового актива, учитываемых на данном позиционном регистре.

Ставка поставочной маржи устанавливается в отношении единицы базового актива по соответствующему срочному контракту.

4. Требование к размеру поставочной маржи Участника клиринга отражается в «Отчете о поставочных позициях», предоставляемом Участникам клиринга в соответствии со [статьей 07.08 Правил](#).
5. В случае увеличения требования к размеру поставочной маржи, Участник клиринга обязан осуществить до внесение поставочной маржи в сроки, установленные Операционным регламентом для соответствующего типа срочных контрактов.
6. До внесение поставочной маржи Участника клиринга осуществляется путем зачисления денежных средств на Счет Клиринговой организации в любой из Расчетных организаций.
7. При перечислении денежных средств на Счет Клиринговой организации для внесения поставочной маржи обязательно указывается назначение платежа, однозначно определяющее данные средства как поставочную маржу, ссылка на номер и дату Договора между Клиринговой организацией и Участником клиринга, а также код денежного регистра учета поставочной маржи Участника клиринга (Пример назначения платежа: «Перечисление поставочной маржи. НДС не облагается. Договор № от ЧЧ.ММ.ГГГГ. Код Участника клиринга . Код денежного регистра учета поставочной маржи .»).

8. Учет суммы доведения поставочной маржи Участника клиринга осуществляется Клиринговой организацией в порядке возрастания кодов поставочных позиционных регистров, а в рамках одного поставочного позиционного регистра – в порядке возрастания кодов срочных контрактов (в алфавитном порядке). Участник клиринга может указать иной порядок учета поставочной маржи, направив в Клиринговую организацию соответствующее уведомление. Уведомления направляются в виде электронных документов в соответствии с Правилами ЭДО. Формат и категория данных электронных документов установлены Операционным регламентом.
9. Избыток поставочной маржи Участника клиринга по регистру учета поставочной маржи в каждый момент времени определяется как превышение размера поставочной маржи этого Участника клиринга, учитываемого на данном регистре над требованием к размеру поставочной маржи Участника клиринга по соответствующему поставочному позиционному регистру.
10. Возврат избытка поставочной маржи Участника клиринга осуществляется по распоряжению данного Участника клиринга при отсутствии у данного Участника клиринга задолженности по депозитной марже.
В Распоряжении на возврат средств обязательно указываются реквизиты Банковского Счета Участника клиринга, ссылка на номер и дату Договора между Клиринговой организацией и Участником клиринга, а также код денежного регистра учета поставочной маржи Участника клиринга (Пример назначения платежа: «Возврат средств поставочной маржи. НДС не облагается. Договор № от ЧЧ.ММ.ГГГГ. Код участника . Код денежного регистра учета поставочной маржи . Банковский счет »).
11. Клиринговая организация исполняет вышеуказанные Распоряжения в порядке и сроки, определенные Операционным Регламентом.
12. При наличии избытка поставочной маржи, определенного в момент проведения клиринговой сессии, денежные средства в размере избытка поставочной маржи переводятся Клиринговой организацией с денежного регистра учета поставочной маржи на денежный регистр учета депозитной маржи.

Статья 04.05. Гарантийный фонд Клиринговой организации

1. Гарантийный фонд Клиринговой организации формируется из собственных средств Клиринговой организации в соответствии с Правилами и Порядком.

2. Гарантийный фонд Клиринговой организации может быть использован в целях урегулирования ситуаций несостоятельности Участников клиринга.

РАЗДЕЛ 05. СИСТЕМА ЛИМИТОВ

Статья 05.01. Система лимитов

1. В ходе проведения торгов и клиринга действуют следующие лимиты:
 - а) лимит изменения цены;
 - б) лимит на долю рынка;
 - в) торговый лимит.

а также иные лимиты, устанавливаемые и контролируемые Организатором торговли в соответствии с Внутренними документами Организатора торговли.
2. Значения лимитов на долю рынка и лимитов изменения цены, а также срок вступления в силу новых значений данных лимитов устанавливаются в соответствии с Методикой определения параметров гарантийной системы, утверждаемой решением Генерального директора.
3. О значениях лимитов на долю рынка и лимитов изменения цены, а также сроках вступления в силу новых значений данных лимитов Участники клиринга оповещаются посредством размещения данной информации на странице Клиринговой организации в сети Интернет.
4. Значения лимитов, предусмотренных [пунктом 1 настоящей статьи](#), отражаются в Отчете «Параметры гарантийной системы», предоставляемом Участникам клиринга в соответствии со [статьей 07.08 Правил](#).
5. Контроль соблюдения лимитов, предусмотренных [пунктом 1 настоящей статьи](#), осуществляется Клиринговой организацией. Если исполнение заявки может привести к несоблюдению какого-либо лимита, контролируемого Клиринговой организацией, то Клиринговая организация в Отчете о соответствии заявки Участника торгов ограничениям, установленным Клиринговой организацией, направляемом Организатору торговли, указывает на несоответствие данной заявки ограничениям, установленным Клиринговой организацией. На основании данной информации Организатор торговли не принимает данную заявку.

Статья 05.02. Лимит изменения цены

1. Лимит изменения цены представляет собой максимально допустимое отклонение цен сделок, которые могут заключаться по заявке в отношении определенной серии срочных контрактов, от расчетной цены, установленной для данной серии срочных контрактов в предыдущий торговый день.

2. Если указанная в заявке цена не соответствует действующему на момент подачи данной заявки лимиту изменения цены, то Клиринговая организация в Отчете о соответствии заявки Участника торгов ограничениям, установленным Клиринговой организацией, направляемом Организатору торговли, указывает на несоответствие данной заявки ограничениям, установленным Клиринговой организацией. На основании данной информации Организатор торговли не принимает данную заявку к исполнению.
3. В ходе режима торгов «Запрос котировок» лимит изменения цены по серии срочных контрактов устанавливается в виде минимальной и максимальной допустимых цен по данной серии срочных контрактов, определяемых в соответствии с Методикой принудительной ликвидации.

Статья 05.03. Лимит на долю рынка

1. Лимит на долю рынка представляет собой максимально допустимую долю чистых позиций Участника клиринга по серии срочных контрактов, определенных по группе позиционных регистров, открытых для учета позиций одного владельца, в суммарном количестве чистых позиций одной направленности на всех позиционных регистрах всех Участников клиринга по данной серии срочных контрактов.
2. Нарушением лимита на долю рынка Участником клиринга по определенной серии срочных контрактов по группе позиционных регистров, открытых для учета позиций одного владельца, считается превышение доли количества чистых позиций по данной серии срочных контрактов данного Участника клиринга, открытых по данной группе позиционных регистров, в суммарном количестве чистых позиций одной направленности на всех позиционных регистрах всех Участников клиринга по данной серии срочных контрактов над значением лимита на долю рынка, установленным для данной серии срочных контрактов.
3. Если после возможного полного исполнения заявки в момент ее подачи данным Участником клиринга может быть нарушен лимит на долю рынка, Клиринговая организация в Отчете о соответствии заявки Участника торгов ограничениям, установленным Клиринговой организацией, направляемом Организатору торговли, указывает на несоответствие данной заявки ограничениям, установленным Клиринговой организацией. На основании данной информации Организатор торговли не принимает данную заявку к исполнению.
4. Если лимит на долю рынка по определенной серии срочных контрактов окажется нарушенным Участником клиринга по группе позиционных

регистров, открытых для учета позиций одного владельца, то Клиринговой организацией осуществляются следующие действия:

- а) до устранения нарушения Клиринговая организация ограничивает допуск к клиринговому обслуживанию по данной серии срочных контрактов по данной группе позиционных регистров;
 - б) Клиринговая организация обращается к Организатору торговли с ходатайством о снятии всех активных заявок по данной группе позиционных регистров по данной серии срочных контрактов. При этом указанные заявки снимаются Организатором торговли.
5. Контроль лимита на долю рынка осуществляется в том случае, если количество чистых позиций Участника клиринга по серии срочных контрактов, определенных по группе позиционных регистров, открытых для учета позиций одного владельца, превышает пороговое значение, установленное решением Генерального директора.

Статья 05.04. Торговый лимит, Максимальный торговый лимит

1. Значение Торгового лимита для определенного портфеля позиционных регистров Участника клиринга устанавливается в размере депозитной маржи на соответствующем денежном торговом регистре.
2. Если полное или частичное исполнение заявки, поданной с какого-либо позиционного регистра, входящего в портфель позиционных регистров, с учетом возможного исполнения всех или некоторых других активных заявок, поданных с позиционных регистров, входящих в данный портфель позиционных регистров, может привести к превышению требования к размеру депозитной маржи по данному портфелю, над значением Торгового лимита, установленным для данного портфеля, Клиринговая организация в Отчете о соответствии заявки Участника торгов ограничениям, установленным Клиринговой организацией, направляемом Организатору торговли, указывает на несоответствие данной заявки ограничениям, установленным Клиринговой организацией. На основании данной информации Организатор торговли не принимает данную заявку к исполнению.
3. Если полное или частичное исполнение заявки, поданной с какого-либо позиционного регистра Участника клиринга, с учетом возможного исполнения всех или некоторых других активных заявок, поданных с позиционных регистров Участника клиринга, может привести к превышению суммой требований к размеру депозитной маржи по всем портфелям данного Участника клиринга, значения Максимального Торгового лимита, установленного для данного Участника клиринга, либо суммы Торговых лимитов, установленных для всех портфелей Участника клиринга, Клиринговая организация в Отчете о соответствии заявки Участника торгов ограничениям, установленным Клиринговой организацией, направляемом Организатору торговли, указывает на

несоответствие данной заявки ограничениям, установленным Клиринговой организацией. На основании данной информации Организатор торговли не принимает данную заявку к исполнению.

4. Значение Максимального Торгового лимита для каждого Участника клиринга устанавливается в соответствии с Методикой определения параметров гарантийной системы, утверждаемой решением Генерального директора.
5. Требование к размеру депозитной маржи определяется в ходе каждой торговой сессии в режиме реального времени по каждому портфелю позиционных регистров каждого Участника клиринга.
6. Требование к размеру депозитной маржи по портфелю позиционных регистров определяется как максимум из 3-х величин:
 - а) требование к размеру депозитной маржи, определяемое с учетом предположения об исполнении всех заявок на покупку;
 - б) требование к размеру депозитной маржи, определяемое с учетом предположения об исполнении всех заявок на продажу;
 - в) требование к размеру депозитной маржи, определяемое без учета заявок.

Статья 05.05. Особенности контроля лимитов в ходе торгов в режиме запроса котировок

1. В ходе торгов в режиме запроса котировок Клиринговая организация не контролирует соблюдение лимита на долю рынка, а также соблюдение Торгового лимита.
2. Лимиты изменения цены по каждой серии срочных контрактов, действующие в ходе данного режима торгов, устанавливаются как максимальное и минимальное значение допустимых цен заявок решением Генерального директора.

Статья 05.06. Особенности контроля лимитов в ходе торгового периода «Специальная торговая сессия»

1. В ходе торгового периода «Специальная торговая сессия» Клиринговая организация не контролирует соблюдение лимита на долю рынка, а также соблюдение Торгового лимита для заявок, поданных со специальных позиционных регистров Гарантирующих покупателей / Гарантирующих поставщиков.
2. Лимит изменения цены по каждой серии срочных контрактов, действующий в ходе данного торгового периода, устанавливается в

размере ставки поставочной маржи, установленной для данной серии срочных контрактов решением Генерального директора.

РАЗДЕЛ 06. СВЕРКА СДЕЛОК И УЧЕТ ПОЗИЦИЙ

Статья 06.01. Сверка Сделок

1. Клиринговая организация осуществляет клиринг только по позициям, которые открыты по сделкам, заключенным с Клиринговой организацией.
2. Для осуществления сверки сделок Клиринговой организацией, Организатор торговли по окончании торгов передает Клиринговой организации Реестр Сделок.

Статья 06.02. Организация учета позиций

1. Позиции Участников клиринга учитываются на позиционных регистрах.
2. Возможные виды позиционных регистров Участника клиринга определяются в соответствии с присвоенной ему категорией.
3. Для учета позиций используются следующие виды позиционных регистров:
 - а) Общему клиринговому участнику могут быть открыты следующие виды позиционных регистров:
 - позиционные регистры для учета позиций Общего клирингового участника, в том числе отдельные позиционные регистры для учета поставочных позиций;
 - позиционные регистры для учета позиций Клиентов Общего клирингового участника, в том числе отдельные позиционные регистры для учета поставочных позиций;
 - специальные позиционные регистры Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя.
 - б) Индивидуальному клиринговому участнику могут быть открыты следующие виды позиционных регистров:
 - позиционные регистры для учета позиций Индивидуального клирингового участника, в том числе отдельные позиционные регистры для учета поставочных позиций;
 - специальные позиционные регистры Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя.
4. Все виды позиционных регистров открываются Участнику клиринга на основании распоряжений данного Участника клиринга.
5. Технологические особенности открытия позиционных регистров, в том числе требования к документам, содержащим сведения, необходимые для открытия или закрытия позиционных регистров (Распоряжений на открытие/закрытие позиционных регистров), определяются Операционным Регламентом.

Статья 06.03. Управление позициями

1. В ходе клиринговой сессии могут осуществляться следующие операции по управлению позициями Участников клиринга и их Клиентов:
 - а) перевод позиций между позиционными регистрами;
 - б) закрытие позиций;
 - в) взаимозачет позиций по каждому позиционному регистру.
2. Перевод позиций между позиционными регистрами осуществляется:
 - а) по заявлению на перевод позиций в соответствии с настоящей статьей;
 - б) при осуществлении принудительной ликвидации позиций в соответствии с Правилами.
3. Позиции закрываются:
 - а) в результате исполнения срочного контракта;
 - б) в результате взаимозачета позиций;
 - в) в других случаях, предусмотренных Правилами.
4. Закрытие позиции по определенной цене означает, что данная позиция перед ее закрытием переоценивается по данной цене с соответствующим начислением вариационной маржи.
5. В ходе каждой клиринговой сессии взаимозачет позиций производится на каждом из позиционных регистров каждого Участника клиринга в максимальном количестве в автоматическом режиме.
6. Перевод позиций с одного позиционного регистра на другой по заявлению Участника клиринга на перевод позиций осуществляется при одновременном выполнении следующих условий:
 - а) перевод позиций осуществляется между позиционными регистрами, предназначенными для учета позиций одного и того же Участника клиринга или для учета позиций одного и того же Клиента;
 - б) в результате такого перевода не будут нарушены лимиты, контролируемые Клиринговой организацией.
7. Заявление на перевод позиций оформляется в соответствии с образцом, приведенным в Операционном Регламенте.
8. Перевод позиций осуществляется в ходе клиринговой сессии в день предоставления данного заявления по расчетным ценам,

определенным в ходе данной клиринговой сессии для серий срочных контрактов, позиции по которым подлежат переводу.

Статья 06.04. Принудительная ликвидация позиций Участника клиринга и Клиентов, осуществляемая Клиринговой организацией

1. Принудительная ликвидация позиций Общих клиринговых участников и их Клиентов, а также Индивидуальных клиринговых участников в соответствии с настоящей статьей осуществляется в следующих случаях:
 - а) при превышении в момент начала принудительной ликвидации позиций суммы требований к размеру депозитной маржи, определенных по всем портфелям позиций Участника клиринга над суммарным размером депозитной маржи данного Участника клиринга, определенным по всем денежным торговым регистрам данного Участника клиринга, в случае наличия у данного Участника клиринга задолженности по депозитной марже, определенной по итогам предшествующей клиринговой сессии;
 - б) на основании ходатайства Организатора торговли в случае исключения Участника клиринга из состава участников торгов;
 - в) в случаях и по основаниям, установленным Спецификациями срочных контрактов;
 - г) в случае приостановления или аннулирования у Участника клиринга лицензии биржевого посредника на совершение фьючерсных и опционных сделок в биржевой торговле на территории Российской Федерации, выданной уполномоченным федеральным органом исполнительной власти;
 - д) в случае превышения суммы требований к размеру депозитной маржи, определенных по всем портфелям позиций данного Участника клиринга, над Максимальным Торговым лимитом, установленным для данного Участника клиринга в соответствии с [пунктом 2 статьи 05.04 Правил](#).
 - е) при наступлении иных обстоятельств, делающих невозможным дальнейшее участие Участника клиринга в торгах или расчетах по результатам торгов;
2. Решение об осуществлении принудительной ликвидации позиций Участника клиринга и его Клиентов (далее – Ликвиданта) принимается Генеральным директором. В соответствии с решением Генерального директора, принудительная ликвидация позиций может осуществляться как по всем, так и по отдельным сериям срочных контрактов, при этом в случае, когда принудительная ликвидация позиций Участника клиринга осуществляется в соответствии с [подпунктом д\) пункта 1 настоящей статьи](#), в решении Генерального директора может быть указано количество позиций по каждой серии срочных контрактов, подлежащих принудительной ликвидации.

3. Временной регламент осуществления процедур, предусмотренных настоящей статьей Правил, включая момент начала принудительной ликвидации позиций, устанавливается Расписанием операционного дня Клиринговой организации, предусмотренным Операционным Регламентом.
4. В момент начала принудительной ликвидации позиций, установленный Операционным Регламентом, Клиринговая организация прекращает допуск Ликвиданта к клиринговому обслуживанию, а также обращается к Организатору торговли с ходатайством о снятии всех активных заявок данного Клирингового участника. При этом указанные заявки снимаются Организатором торговли.
5. В целях осуществления принудительной ликвидации позиций Ликвиданта и прекращения его обязательств по каждой серии срочных контрактов Клиринговой организацией осуществляются следующие действия.
 - а) В первую очередь Клиринговой организацией определяется количество позиций противоположной направленности данного Ликвиданта, а также количество позиций противоположной направленности каждого из Клиентов данного Ликвиданта. Данные позиции подлежат взаимозачету в ходе клиринговой сессии в соответствии с Методикой проведения принудительной ликвидации позиций, утверждаемой Генеральным директором РДК (ЗАО) (далее - Методика ликвидации), и не учитываются при совершении действий, предусмотренных подпунктами в) и г) настоящего пункта;
 - б) Во вторую очередь Клиринговой организацией определяется количество позиций противоположной направленности различных Ликвидантов и Клиентов различных Ликвидантов. Данные позиции подлежат закрытию в соответствии с подпунктом г) настоящего пункта и не учитываются при совершении действий, предусмотренных подпунктом в) настоящего пункта;
 - в) В случае, если за исключением позиций, определенных согласно предыдущим подпунктам настоящего пункта, на позиционных регистрах, предназначенных для учета позиций Ликвиданта и Клиентов Ликвиданта существует остаток чистых позиций (далее – Ликвидируемые позиции), в третью очередь Клиринговой организацией в целях открытия позиций противоположной направленности по отношению к Ликвидируемым позициям совершаются сделки в режиме запроса котировок, осуществляемом в соответствии с Внутренними документами Организатора торговли, в следующем порядке.

Клиринговая организация направляет Участникам клиринга информацию о необходимости подачи заявок в режиме запроса котировок с указанием следующих параметров:

- Серия срочных контрактов;
- Количество срочных контрактов;
- Лимиты изменения цены по данной серии срочных контрактов.

Общие клиринговые участники и Индивидуальные клиринговые участники обязаны в течение периода подачи заявок Участниками клиринга в режиме запроса котировок, время и порядок проведения которого установлено Внутренними документами Организатора торговли, подать заявки на покупку и на продажу с указанным Клиринговой организацией объемом по каждой из указанных Клиринговой организацией серии срочных контрактов.

Неисполнение Участником клиринга обязанности подать заявки в соответствии с настоящим пунктом Правил может являться основанием для применения к нему всех или некоторых санкций из числа следующих:

- Штраф, определяемый в соответствии с Методикой ликвидации; сумма штрафа удерживается Клиринговой организацией из состава депозитной маржи Участника клиринга;
- Ограничение его допуска к клиринговому обслуживанию.

Выбор заявок, на основании которых заключаются сделки в режиме «Запрос котировок», осуществляется в соответствии с Методикой ликвидации.

- г) По итогам осуществления действий, предусмотренных подпунктами а) - в) настоящего пункта, Клиринговой организацией в ходе клиринговой сессии осуществляется прекращение обязательств по срочным контрактам Ликвиданта.

В случае если по итогам осуществления действий в режиме запроса котировок Клиринговой организацией открыто количество позиций, равное количеству Ликвидируемых позиций, Обязательства по срочным контрактам Ликвиданта прекращаются уплатой Ликвидантом неустойки в пользу Клиринговой организации.

В случае если количество Ликвидируемых позиций, уменьшенное на количество позиций, открытых в режиме запроса котировок, больше нуля, обязательства по срочным контрактам Ликвиданта прекращаются уплатой Ликвидантом неустойки в пользу Клиринговой организации. При этом обязательства по срочным контрактам Клиринговой организации

перед добросовестными Участниками клиринга в размере остатка Ликвидируемых позиций также прекращаются уплатой неустойки Клиринговой организацией в пользу добросовестного Участника клиринга.

Порядок выбора позиций противоположной направленности добросовестных Участников клиринга, а также порядок определения размера неустойки определяется в соответствии с Методикой ликвидации.

Неустойка удерживается Клиринговой организацией из состава депозитной маржи Участника клиринга. Неустойка переводится Клиринговой организацией на денежный торговый регистр Участника клиринга.

6. Если в определенный день торги по какой-либо серии срочных контрактов не проводятся или признаны несостоявшимися, то принудительная ликвидация позиций Ликвиданта по данной серии срочных контрактов, которая должна быть осуществлена в данный день в соответствии с Правилами, осуществляется в ближайший следующий торговый день, в который проводятся торги данными срочными контрактами.

Статья 06.05. Принудительная ликвидация позиций Клиентов, осуществляемая Общим клиринговым участником

1. Принудительная ликвидация позиций Клиентов Общего клирингового участника может производиться Общим клиринговым участником исключительно в случаях, предусмотренных в договорах между данными организациями.
2. Принудительная ликвидация Общим клиринговым участником позиций его Клиента осуществляется путем открытия Общим клиринговым участником по собственной инициативе на соответствующих позиционных регистрах позиций, равных по количеству и противоположных по направленности чистым позициям, открытым на этих регистрах к моменту начала принудительной ликвидации позиций.

РАЗДЕЛ 07. ПОРЯДОК ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГА

Статья 07.01. Клиринговая сессия

1. В ходе проведения клиринговых сессий осуществляются следующие операции:
 - а) управление позициями в соответствии со [статьей 06.03. Правил](#);
 - б) расчет взаимных денежных обязательств Участников клиринга и Клиринговой организации по вариационной марже в соответствии со [статьей 07.02. Правил](#);
 - в) корректировка позиций по рынку;
 - г) расчет обязательств Участников клиринга по клиринговым сборам в соответствии со [статьей 07.03. Правил](#);
 - д) расчет обязательств Участников клиринга по поставочным сборам в соответствии со [статьей 07.04. Правил](#);
 - е) расчет требования к размеру депозитной маржи в соответствии со [статьей 04.01. Правил](#);
 - ж) операции, предусмотренные Спецификациями поставочных фьючерсных контрактов при исполнении фьючерсных контрактов в соответствии со [статьей 08.01. Правил](#);
 - з) перевод средств из состава депозитной маржи в состав поставочной маржи в последний торговый день по серии поставочных срочных контрактов;
 - и) списание/зачисление вариационной маржи с/на разделы денежных позиционных регистров Клиринговых участников в соответствии со [статьей 07.06. Правил](#);
 - к) Возврат избытка поставочной маржи с денежного регистра учета поставочной маржи на денежный регистр учета депозитной маржи в соответствии со [статьей 04.04. Правил](#);
 - л) формирование отчетов, в соответствии со [статьей 07.08 Правил](#).
2. Время проведения клиринговых сессий и состав операций, осуществляемых в ходе каждой из клиринговых сессий, определяется Операционным Регламентом.

Статья 07.02. Вариационная маржа

1. Обязательства (требования) Участника клиринга по вариационной марже определяются каждый торговый день в ходе клиринговой сессии по всем открытым на момент начала данной клиринговой сессии позициям Участника клиринга до взаимозачета данных позиций.
2. Размер обязательства (требования) Участника клиринга по вариационной марже по каждой позиции рассчитывается по следующей формуле:

- а) для длинной позиции: $BM = (C_p - C_t) \times SI_M / I_M$;
- б) для короткой позиции: $BM = -(C_p - C_t) \times SI_M / I_M$;

где:

- BM - вариационная маржа. Отрицательное значение вариационной маржи означает обязательство Участника клиринга перед Клиринговой организацией, положительное – требование Участника клиринга;
- C_p - расчетная цена, определенная для срочного контракта, по которому открыта данная позиция, в день расчета вариационной маржи;
- C_t - текущая цена данной позиции на момент окончания торговой сессии в день расчета вариационной маржи;
- I_M - минимальное изменение цены, установленное Спецификацией срочного контракта, по которому открыта данная позиция;
- SI_M - стоимостная оценка минимального изменения цены, установленная Спецификацией срочного контракта, по которому открыта данная позиция.

3. Положительное значение обязательства по вариационной марже по позиции Участника клиринга означает обязательство Клиринговой организации в пользу Участника клиринга (требование Участника клиринга), отрицательное значение – обязательство Участника клиринга в пользу Клиринговой организации.
4. Нетто-обязательство Участника клиринга по вариационной марже по портфелю позиций определяется как сальдо обязательств и требований по всем позициям данного Участника клиринга и его Клиентов, входящим в соответствующий портфель позиций.
5. Отрицательное значение нетто-обязательства Участника клиринга означает обязательство Участника клиринга в пользу Клиринговой организации, положительное – обязательство Клиринговой организации в пользу Участника клиринга (требование Участника клиринга). Нетто-обязательство Участника клиринга по вариационной марже указывается в отчетах, формируемых по результатам клиринговой сессии, с указанием соответствующего знака.

Статья 07.03. Клиринговый сбор

1. Обязательства Участников клиринга по уплате клирингового сбора определяются каждый торговый день по всем сделкам, совершенным от имени данного Участника клиринга в течение данного торгового дня.
2. Размер обязательства по уплате клирингового сбора по каждой сделке рассчитывается как произведение следующих величин:

- а) ставка клирингового сбора, установленная для соответствующих типов срочных контрактов в соответствии с Тарифами Клиринговой организации;
 - б) количество срочных контрактов, в отношении которых заключена данная сделка.
3. Счет на оплату клирингового сбора выставляется по окончании календарного месяца и включает обязательства по уплате клирингового сбора за каждый торговый день в течение данного календарного месяца. Оплата счетов должна производиться Участниками клиринга в срок не позднее последнего дня месяца, следующего за оплачиваемым, при условии, что счет за оказанные в течение месяца услуги выставлен в срок не позднее 10-и рабочих дней, следующих за последним днем оплачиваемого месяца.
4. Совет Директоров вправе в соответствии с настоящими Правилами устанавливать льготы по уплате клирингового сбора для всех Участников клиринга, либо для Участников клиринга с определенной категорией.

Статья 07.04. Поставочный сбор

1. Обязательства Участника клиринга по уплате поставочного сбора определяются в последний торговый день поставочными срочными контрактами по чистым позициям на всех позиционных регистрах этого Участника клиринга по данным срочным контрактам на конец торгового дня.
2. Поставочный сбор уплачивается по длинным и по коротким открытым позициям.
3. Размер обязательства по уплате поставочного сбора рассчитывается как произведение следующих величин:
 - а) ставка поставочного сбора, установленная для соответствующих типов срочных контрактов в соответствии с Тарифами Клиринговой организации;
 - б) количество чистых позиций, по которым взимается поставочный сбор.
4. Счет на оплату поставочного сбора выставляется по окончании календарного месяца и включает обязательства по уплате поставочного сбора за каждый последний торговый день по поставочным срочным контрактам в течение данного календарного месяца. Оплата счетов должна производиться Участниками клиринга в срок не позднее последнего дня месяца, следующего за оплачиваемым, при условии, что счет за оказанные в течение месяца

услуги выставлен в срок не позднее 10-и рабочих дней, следующих за последним днем оплачиваемого месяца.

5. Совет Директоров вправе в соответствии с настоящими Правилами устанавливать льготы по уплате поставочного сбора для всех Участников клиринга, либо для Участников клиринга с определенной категорией.

Статья 07.05. Списание/зачисление вариационной маржи

1. При наличии у Клиринговой организации нетто-обязательства по вариационной марже по определенному портфелю позиций Участника клиринга, в ходе клиринговой сессии сумма денежных средств в размере нетто-обязательства Клиринговой организации по вариационной марже по данному портфелю позиций зачисляется на соответствующий денежный торговый регистр данного Участника клиринга.
2. При наличии у Участника клиринга нетто-обязательства по вариационной марже по определенному портфелю позиций данного Участнику клиринга, в ходе клиринговой сессии сумма денежных средств в размере нетто-обязательства Участника клиринга по вариационной марже по данному портфелю позиций списывается с соответствующего денежного торгового регистра данного Участника клиринга.
3. Порядок расчетов по результатам торгов между Общим клиринговым участником и его Клиентом регулируется двусторонними соглашениями между Общим клиринговым участником и Клиентом.

Статья 07.06. Задолженность по депозитной марже

1. Задолженностью Участника клиринга по депозитной марже по портфелю позиций является превышение требования к размеру депозитной маржи по портфелю позиций над размером депозитной маржи, учитываемой на соответствующем денежном торговом регистре, с учетом списания/зачисления нетто-обязательства по вариационной марже по соответствующему портфелю позиций.
2. Участник клиринга обязан погасить задолженность по депозитной марже по портфелю позиций до 14:00 следующей торговой сессии.
3. При наличии у Участника клиринга задолженности по депозитной марже по портфелю позиций на момент начала торговой сессии, Участнику клиринга ограничивается допуск к клиринговому обслуживанию по данному портфелю позиций.
4. Задолженностью Участника клиринга по депозитной марже является превышение суммы требований к размеру депозитной маржи по всем

портфелям позиций данного Участника клиринга над суммой депозитной маржи, учитываемой на всех денежных торговых регистрах, с учетом списания/зачисления нетто-обязательства по вариационной марже по соответствующим портфелям позиций.

5. При наличии у Участника клиринга задолженности по депозитной марже на момент начала торговой сессии, Участнику клиринга ограничивается допуск к клиринговому обслуживанию.
6. Наличие у Участника клиринга задолженности по депозитной марже является основанием для принудительной ликвидации позиций данного Участника клиринга в соответствии со [статьей 06.04. Правил](#).

Статья 07.07 . Несостоятельность Участника клиринга

1. Несостоятельностью Участника клиринга признается ситуация в ходе клиринговой сессии, при которой для погашения суммы нетто-обязательств по вариационной марже по всем портфелям позиций данного Участника клиринга и/или неустойки и/или штрафа, взимаемых в случае проведения процедуры принудительной ликвидации позиций, недостаточно суммы денежных средств по всем денежным торговым регистрам данного Участника клиринга.
2. При возникновении ситуации несостоятельности Участника клиринга для оплаты его задолженности по оплате вариационной маржи и/или неустойки используются средства обеспечения в следующем порядке:
 - а) депозитная маржа данного несостоятельного Участника клиринга, после чего
 - б) избыток поставочной маржи данного несостоятельного Участника клиринга, после чего
 - в) взнос данного несостоятельного Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд.
3. В результате использования денежных средств обеспечения для оплаты задолженности по вариационной марже и/или неустойки и/или штрафа несостоятельного Участника клиринга в соответствии с пунктом 2 настоящей статьи, задолженность Участника клиринга перед Клиринговой организацией может быть полностью не погашена. В этом случае Клиринговая организация вправе для оплаты своих обязательств по вариационной марже и/или выплаты неустойки добросовестным Участникам клиринга осуществить действия, предусмотренные пунктом 4 настоящей статьи. При этом несостоятельный Участник клиринга и Клиринговая организация соглашаются с тем, что обязательство этого Участника клиринга перед Клиринговой организацией по уплате вариационной маржи и/или неустойки и/или штрафа (в непогашенной части), существовавшее между ними при урегулировании ситуации несостоятельности Участника клиринга, прекращается путем замены (новации) данного обязательства на обязательство Участника клиринга перед

Клиринговой организацией по возмещению денежных средств, использованных Клиринговой организацией в ходе урегулирования ситуации несостоятельности данного Участника. Размер обязательства Участника клиринга по уплате вариационной маржи и/или неустойки и/или штрафа (в непогашенной части а также размер обязательства Участника клиринга по возмещению денежных средств, использованных Клиринговой организацией в ходе урегулирования ситуации несостоятельности данного Участника, определяются следующим образом:

$$ОН = (ВМ + Н + Ш) - (ДМ + ИПМ + ГВ);$$

где:

- ОН - обязательство по возмещению денежных средств, использованных Клиринговой организацией в ходе урегулирования ситуации несостоятельности данного Участника;
- ВМ - обязательство Участника клиринга по уплате вариационной маржи, определенное в ходе последней клиринговой сессии;
- Н - обязательство Участника клиринга по уплате неустойки в пользу Клиринговой организации в соответствии со Статьей 06.04;
- Ш - обязательство Участника клиринга по уплате штрафа за неисполнение обязанности подать заявки в ходе режима «Запрос котировок» в соответствии со Статьей 06.04;
- ДМ - депозитная маржа данного несостоятельного Участника клиринга;
- ИПМ - избыток поставочной маржи данного несостоятельного Участника клиринга;
- ГВ - взнос данного несостоятельного Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд.

4. При возникновении ситуации, предусмотренной в пункте 3 настоящей статьи, Клиринговая организация вправе для оплаты своих обязательств по вариационной марже и/или выплаты неустойки в адрес добросовестных Участников клиринга использовать средства обеспечения в следующем порядке:
 - а) взносы несостоятельных Участников клиринга в Коллективный гарантийный фонд, в размере остатка от использования на оплату задолженности данных Участников клиринга по вариационной марже и/или неустойки и/или штрафа в ходе текущей клиринговой сессии пропорционально размеру остатка, после чего
 - б) обязательные части взносов иных Участников клиринга в Коллективный гарантийный фонд, определяемые как минимум из фактического размера вноса Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд и требования к размеру

- взноса, установленного для соответствующей категории Участников клиринга, пропорционально размеру этих частей взносов, после чего
- в) добровольные части взносов иных Участников клиринга в Коллективный гарантийный фонд, определяемые как разница между фактическим размером взноса Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд и требования к размеру взноса, установленного для соответствующей категории Участников клиринга, пропорционально размеру этих частей взносов, после чего
 - г) Гарантийный фонд Клиринговой организации.
5. Информация об использовании средств Коллективного гарантийного фонда отражается в Отчете «Параметры гарантийной системы», предоставляемом Участникам клиринга в соответствии со [статьей 07.08 Правил](#).
6. Участник клиринга обязан осуществить оплату своего обязательства перед Клиринговой организацией по возмещению средств, использованных Клиринговой организацией в ходе урегулирования ситуации несостоятельности данного Участника, а также возместить Клиринговой организации все иные документально подтвержденные расходы, связанные с урегулированием ситуации несостоятельности данного Участника. Оплата осуществляется на основании письменного требования, направляемого Клиринговой организацией несостоятельному Участнику клиринга с указанием размера и порядка оплаты обязательства, а также срока исполнения данного требования.
7. В случае полной или частичной оплаты несостоятельным Участником клиринга своего обязательства перед Клиринговой организацией по возмещению средств, использованных Клиринговой организацией в ходе урегулирования ситуации несостоятельности данного Участника, данная сумма используется Клиринговой организацией на пополнение Коллективного гарантийного фонда и восстановление использованных средств Гарантийного фонда Клиринговой организации. Суммы пополнения взносов Участников клиринга в Коллективный гарантийный фонд, а также Гарантийного фонда Клиринговой организации определяются по следующей формуле:

$$F_{i/KO} = \frac{B}{\sum_i a_i + a_{KO}} \cdot a_{i/KO}$$

где

$F_{i/KO}$ - сумма пополнения взноса i-го Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд, либо сумма восстановления Гарантийного фонда Клиринговой организации;

- В - сумма оплаты несостоятельным Участником клиринга своего обязательства перед Клиринговой организацией по возмещению средств, использованных Клиринговой организацией в ходе урегулирования ситуации несостоятельности данного Участника;
 - a_i - сумма средств из состава взноса i -го Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд, использованная Клиринговой организацией в ходе урегулирования ситуации несостоятельности Участника;
 - $a_{ко}$ - сумма средств из состава Гарантийного фонда Клиринговой организации, использованная Клиринговой организацией в ходе урегулирования ситуации несостоятельности Участника.
8. В случае отсутствия оплаты несостоятельным Участником клиринга своего обязательства перед Клиринговой организацией по возмещению средств, использованных Клиринговой организацией в ходе урегулирования ситуации несостоятельности данного Участника, в течение четырех календарных месяцев после срока, указанного в письменном требовании Клиринговой организацией, Клиринговая организация вправе обратиться в суд с заявлением о взыскании задолженности.

Статья 07.08. Порядок предоставления Участникам Клиринга отчетов по итогам клиринга

1. По результатам клиринговой сессии Участники клиринга получают следующие отчеты:
 - (i) Отчет о позициях по фьючерсным контрактам (форма № CL001_F);
 - (ii) Финансовый отчет (форма № CL002);
 - (iii) Отчет о параметрах гарантийной системы (форма № CL003);
 - (iv) Отчет о поставочных позициях (форма № CL006) - отчет предоставляется начиная с последнего торгового дня по серии срочных контрактов;
 - (v) Отчет о сделках предпоставочной торговой сессии (форма № CL007) - отчет предоставляется в день/период исполнения серии срочных контрактов.
2. Отчеты предоставляются в форме электронных документов в соответствии с Правилами ЭДО во время, установленное Операционным регламентом.
3. Формы/форматы (реквизиты) отчетов установлены Операционным Регламентом.

Статья 07.09. Возражения Участника клиринга по результатам клиринговой сессии

1. В случае, если Участник клиринга не согласен с результатами клиринговой сессии по причине технической, арифметической или иного рода ошибки, он может заявить возражения по результатам клиринговой сессии.
2. Возражения составляются в письменной форме и подписываются уполномоченным лицом Участника клиринга. Возражения должны содержать изложение причин и существа возникших разногласий.
3. Возражения должны быть заявлены Клиринговой организации не позднее 15 (пятнадцати) часов по московскому времени торгового дня, следующего после даты проведения клиринговой сессии, к результатам которой предъявляются данные возражения.
4. Если Участник клиринга не заявил возражений по результатам клиринговой сессии в сроки и порядке, установленные настоящей статьей, то считается, что он безусловно и полностью согласен с результатами данной клиринговой сессии и информацией, отраженной в полученных им отчетах по ее результатам.
5. По результатам рассмотрения возражений Участника клиринга Клиринговая организация оформляет письменный ответ Участнику клиринга, который направляет ему не позднее следующего рабочего дня после даты получения данных возражений.
6. Урегулирование разногласий по возражениям Участника клиринга осуществляется в соответствии с порядком разрешения споров, предусмотренным Правилами.

РАЗДЕЛ 08. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ПОСТАВКЕ БАЗОВОГО АКТИВА И РАСЧЕТОВ ПО ПОСТАВКЕ ПО ПОСТАВОЧНЫМ СРОЧНЫМ КОНТРАКТАМ

Статья 08.01. Порядок исполнения обязательств по поставке базового актива и расчетов по поставке по поставочному фьючерсному контракту на дизельное топливо

1. Поставка базового актива осуществляется по чистым позициям, определенным на момент окончания торгов в последний торговый день по серии срочных контрактов отдельно по каждому из позиционных регистров, открытых для учета позиций каждого Участника поставки (далее – поставочные позиции Участника поставки).
2. В ходе клиринговой сессии по итогам последнего торгового дня по серии срочных контрактов, Клиринговая организация осуществляет перевод поставочных позиций Участников поставки на позиционные регистры для учета поставочных позиций.
3. Участник клиринга, являющийся Участником поставки, либо Участник клиринга, обслуживающий данного Участника поставки в качестве Клиента, обязан предоставить в Клиринговую организацию Уведомление о реквизитах, необходимых для заключения Договора поставки в порядке, предусмотренном Операционным регламентом.
4. Клиринговая организация осуществляет контроль за соблюдением следующих требований при подаче заявок на поставку базового актива и заявок на оплату поставки в ходе предпоставочной торговой сессии:
 - а) объем заявки на поставку базового актива, поданной с указанием определенного позиционного регистра, не может превышать объем коротких поставочных позиций в единицах базового актива по соответствующей серии срочных контрактов, учитываемых на данном позиционном регистре, уменьшенное на объем, указанный в заявках на поставку базового актива, поданных с указанием данного позиционного регистра и принятых Организатором торговли ранее.
 - б) объем заявки на оплату поставки, поданной с указанием определенного позиционного регистра, не может превышать объем длинных поставочных позиций в единицах базового актива по соответствующей серии срочных контрактов, учитываемых на данном позиционном регистре, уменьшенное на объем, указанный в заявках на оплату поставки, поданных с указанием данного позиционного регистра и принятых Организатором торговли ранее.

- в) в Клиринговую организацию предоставлено Уведомление о реквизитах, необходимых для заключения Договора поставки в отношении Участника поставки, позиции которого учитываются на данном позиционном регистре;
- г) Организатором торгов в Клиринговую организацию предоставлено Уведомление о выполнении условий допуска к предпоставочной торговой сессии в отношении Участника поставки, позиции которого учитываются на данном позиционном регистре.

При несоответствии заявки на поставку базового актива / заявки на оплату поставки требованиям настоящего пункта, Клиринговая организация направляет Организатору торговли информацию о несоответствии данной заявки на поставку базового актива / заявки на оплату поставки ограничениям, установленным Клиринговой организацией. На основании данной информации Организатор торговли не принимает данную заявку на поставку базового актива / заявку на оплату поставки к исполнению.

- 5. В случае если на момент окончания периода подачи заявок на поставку базового актива / заявок на оплату поставки суммарный объем заявок на поставку базового актива / на оплату поставки превышает суммарный объем заявок на оплату поставки / на поставку базового актива, Клиринговая организация оповещает Организатора торговли о необходимости проведения Специальной торговой сессии в целях заключения сделок с Гарантирующими покупателями / Гарантирующими поставщиками (далее – Специальная торговая сессия). Специальная торговая сессия осуществляется в порядке и в сроки, установленные Внутренними документами Организатора торговли.
- 6. В случае если на момент окончания периода подачи заявок на поставку базового актива / заявок на оплату поставки суммарный объем заявок на поставку базового актива превышает суммарный объем заявок на оплату поставки, Клиринговая организация оповещает Участников клиринга, являющихся Гарантирующими покупателями, либо Участников клиринга, обслуживающих Клиентов, являющихся Гарантирующими покупателями о необходимости подать заявки на покупку фьючерсных контрактов в объеме превышения суммарного объема заявок на поставку базового актива над суммарным объемом заявок на оплату поставки.

В случае если на момент окончания периода подачи заявок на поставку базового актива / заявок на оплату поставки суммарный объем заявок на оплату поставки превышает суммарный объем заявок на поставку базового актива, Клиринговая организация оповещает Участников клиринга, являющихся Гарантирующими поставщиками, либо Участников клиринга, обслуживающих Клиентов, являющихся Гарантирующими поставщиками о необходимости подать заявки на

продажу фьючерсных контрактов в объеме превышения суммарного объема заявок на оплату поставки над суммарным объемом заявок на поставку базового актива.

7. Гарантирующие покупатели / Гарантирующие поставщики обязаны в ходе Специальной торговой сессии обеспечить подачу заявки на покупку / на продажу за свой счет с указанным Клиринговой организацией объемом по каждой из указанных Клиринговой организацией серии срочных контрактов.

Неисполнение Гарантирующим покупателем / Гарантирующим поставщиком обязанности, предусмотренной настоящим пунктом Правил, может являться основанием для принятия решения о лишении данной организации статуса Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя.

8. В ходе Специальной торговой сессии суммарный объем заявок, поданных за счет Гарантирующего поставщика / Гарантирующего покупателя не может превышать объем заявок, указанный Клиринговой организацией.

При несоответствии заявки на поставку базового актива / заявки на оплату поставки требованиям настоящего пункта, Клиринговая организация направляет Организатору торговли информацию о несоответствии данной заявки на поставку базового актива / заявки на оплату поставки ограничениям, установленным Клиринговой организацией. На основании данной информации Организатор торговли не принимает данную заявку на поставку базового актива / заявку на оплату поставки к исполнению.

9. По окончании Специальной торговой сессии в целях заключения сделок с Гарантирующими покупателями / Гарантирующими поставщиками осуществляется клиринговая сессия по сериям срочных контрактов, в отношении которых проводилась Специальная торговая сессия.

10. На основании информации от Организатора торговли о заключенных сделках предпоставочной торговой сессии, Клиринговой организацией в ходе расчетов по поставке осуществляются следующие действия:

- а) в случае, если по поставочным позициям не были поданы заявки на поставку базового актива или заявки на оплату поставки, по таким позициям взимается неустойка в размере, определяемом в соответствии с пунктом 11 настоящей статьи. Неустойка удерживается в пользу Клиринговой организации и перечисляется из состава поставочной маржи Участника клиринга, являющегося Участником поставки, по поставочным позициям которого не были поданы соответствующие заявки, либо Участником клиринга, обслуживающим Клиента, являющегося Участником поставки, по поставочным позициям

которого не были поданы соответствующие заявки. Поставочные позиции, в отношении которых не были поданы заявки на поставку базового актива или заявки на оплату поставки, закрываются, обязательства Участника клиринга и Клиринговой организации по данным срочным контрактам прекращаются.

- б) поставочные позиции, в отношении которых были поданы заявки на поставку базового актива или заявки на оплату поставки, но не заключены сделки предпоставочного периода, закрываются в размере неисполненного объема по соответствующим заявкам на поставку базового актива и оплату поставки, обязательства Участника клиринга и Клиринговой организации по данным срочным контрактам прекращаются. При этом Клиринговой организацией по таким позициям уплачивается неустойка в пользу Участника клиринга в размере поставочной маржи по данным позициям. Неустойка выплачивается Клиринговой организацией путем перечисления соответствующей суммы средств Участнику клиринга, являющемуся Участником поставки, по поставочным позициям которого были поданы соответствующие заявки, либо Участнику клиринга, обслуживающему Клиента, являющегося Участником поставки, по поставочным позициям которого были поданы соответствующие заявки.
- в) поставочные позиции, в отношении которых были заключены сделки предпоставочного периода, закрываются, обязательства Участника клиринга и Клиринговой организации по данным срочным контрактам прекращаются. Поставочная маржа по данным позициям блокируется Клиринговой организацией в обеспечение исполнения сделок предпоставочного периода. В случае заключения сделок предпоставочного периода от имени Участника поставки, являющегося Клиентом Участника клиринга, Участник клиринга, обслуживающий данного Клиента, соглашается с тем, что поставочная маржа данного Участника клиринга блокируется в обеспечение исполнения сделок предпоставочного периода, заключенных от имени его Клиента.

11. Размер неустойки, взимаемой по позициям, определенным подпунктом а) пункта 10 настоящей статьи, определяется по следующей формуле:

$$N = [\text{кол-во позиций}] * [\text{ставка неустойки}].$$

Ставка неустойки = (Нко + VM) / (Ок + Оп), где

- Нко - сумма неустойки, уплачиваемой Клиринговой организацией в соответствии с подпунктом б) пункта 10 настоящей статьи;
- VM - сумма вариационной маржи, уплачиваемой Клиринговой организацией по сделкам, заключенным в ходе Специальной торговой сессии;

- Ок - количество позиций, по которым не были выставлены заявки на оплату поставки на момент окончания периода подачи заявок на поставку базового актива / заявок на оплату поставки Участниками поставки;
- Оп - количество позиций, по которым не были выставлены заявки на поставку базового актива на момент окончания периода подачи заявок на поставку базового актива / заявок на оплату поставки Участниками поставки.
12. По заключенным сделкам предпоставочного периода Клиринговой организацией рассчитываются обязательства Участников поставки:
- а) обязательство Участника поставки - продавца, равно произведению объема сделки в контрактах на количество базового актива по одному фьючерсу;
- б) обязательство Участника поставки - покупателя, определяется по следующей формуле:
 $O_{оп} = K * Ц$, где
 $O_{оп}$ - обязательство по оплате поставки;
К - объем сделки в единицах базового актива;
Ц - цена единицы базового актива (включая НДС по ставке 18%);
- в) обязательство Участника поставки - покупателя по оплате транспортных услуг устанавливается в размере, определенном Биржей в соответствии со Спецификацией фьючерсного контракта.
- Обязательства по сделкам предпоставочного периода отражаются в «Отчете о сделках предпоставочного периода», предоставляемом Участникам клиринга в соответствии со [статьей 07.08 Правил](#).
13. В срок, определенный Спецификацией фьючерсного контракта, Организатор торговли представляет в Клиринговую организацию Уведомления о подписании Участниками поставки Договоров поставки.
14. В случае не подписания Участником поставки, являющимся стороной по сделке предпоставочного периода, Договора поставки в сроки, предусмотренные Спецификацией фьючерсного контракта, при условии подписания другой стороной по сделке предпоставочного периода Договора поставки, такой Участник поставки, на основании соответствующих Уведомлений, полученных от Биржи, признается не исполнившим обязательства по сделке предпоставочного периода. С Участника поставки, не исполнившего указанные в настоящем пункте обязательства по сделке предпоставочного периода, удерживается неустойка в размере поставочной маржи, которая перечисляется в адрес стороны по сделке предпоставочного периода, в отношении которой представлено Уведомление о подписании Договора поставки.

Неустойка перечисляется из состава поставочной маржи Участника клиринга, являющегося Участником поставки, не исполнившим обязательства указанные в настоящем пункте, либо Участника клиринга, обслуживающего Клиента, не исполнившего указанные в настоящем пункте обязательства и заблокированной в обеспечение данной сделки предпоставочного периода в соответствии с подпунктом в) пункта 10 настоящей статьи. Уплата неустойки Участником поставки, не исполнившим указанные в настоящем пункте обязательства по сделке предпоставочного периода, Участнику поставки, являющемуся стороной по сделке предпоставочного периода, в отношении которой представлено Уведомление о подписании Договора поставки, прекращает обязательства сторон по сделке предпоставочного периода.

15. В случае не подписания Договора поставки в сроки, предусмотренные Спецификацией фьючерсного контракта, в отношении обеих сторон по сделке предпоставочного периода, стороны, на основании соответствующих Уведомлений, полученных от Биржи, признаются исполнившими обязательства по подписанию Договора поставки. Обязательства сторон по сделке предпоставочного периода прекращаются. При этом Клиринговая организация осуществляет возврат поставочной маржи сторонам по сделке предпоставочного периода в порядке, предусмотренном статьей 04.03 Правил.
16. При предоставлении в Клиринговую организацию Уведомления об урегулировании обязательств сторонами по сделке предпоставочного периода, в сроки, установленные Спецификацией фьючерсного контракта, обязательства сторон по сделке предпоставочного периода прекращаются. При этом Клиринговая организация осуществляет возврат поставочной маржи сторонам по сделке предпоставочного периода в порядке, предусмотренном статьей 04.03 Правил.
17. В срок, определенный Спецификацией фьючерсного контракта, Организатор торговли представляет в Клиринговую организацию Уведомления о подписании Участниками поставки – покупателями Реквизитных заявок по каждой из сделок предпоставочного периода.

В случае не предоставления Уведомления о подписании Участником поставки – покупателем Реквизитной заявки по сделке предпоставочного периода, такой Участник поставки, на основании соответствующих Уведомлений, полученных от Биржи, признается не исполнившим обязательства по сделке предпоставочного периода. С Участника поставки - покупателя, не исполнившего указанные в настоящем пункте обязательства по сделке предпоставочного периода, удерживается неустойка в размере поставочной маржи, которая перечисляется в адрес Участника поставки - продавца. Неустойка перечисляется из состава поставочной маржи Участника клиринга, являющегося Участником поставки, не исполнившим обязательства указанные в настоящем пункте, либо Участника клиринга, обслуживающего Клиента, не исполнившего указанные в настоящем

пункте обязательства и заблокированной в обеспечение данной сделки предпоставочного периода в соответствии с подпунктом в) пункта 10 настоящей статьи. Уплата неустойки Участником поставки - покупателем, не исполнившим указанные в настоящем пункте обязательства по сделке предпоставочного периода, Участнику поставки – продавцу прекращает обязательства сторон по сделке предпоставочного периода. При этом по данной сделке предпоставочного периода осуществляется возврат поставочной маржи Участнику клиринга, являющемуся Участником поставки - продавцом, либо Участнику клиринга, обслуживающему Клиента, являющегося Участником поставки - продавцом в порядке, предусмотренном статьей 04.03 Правил.

18. Участник клиринга, являющийся Участником поставки - покупателем, обязан в срок, определенный Спецификацией фьючерсного контракта, обеспечить наличие денежных средств в размере, не меньшем суммы своего денежного обязательства по оплате поставки (включая НДС) и оплате транспортных услуг (включая НДС) по всем сделкам предпоставочного периода на расчетном счете Клиринговой организации в одном из расчетных банков в порядке, установленном Операционным регламентом.

Участник клиринга, обслуживающий Клиента, являющегося Участником поставки - покупателем, обязан в срок, определенный Спецификацией фьючерсного контракта, обеспечить наличие денежных средств в размере, не меньшем суммы денежного обязательства по оплате поставки и оплате транспортных услуг по всем сделкам предпоставочного периода, заключенным от имени данного Клиента, на расчетном счете Клиринговой организации в одном из расчетных банков в порядке, установленном Операционным регламентом.

19. Участник клиринга имеет право указать Клиринговой организации последовательность контроля оплаты обязательств по сделкам предпоставочного периода путем направления в адрес Клиринговой организации электронного документа «Уведомление об оплате поставки». Технологические особенности оформления «Уведомления об оплате поставки» определяются Операционным Регламентом.
20. В случае выполнения обязательств по оплате поставки и оплате транспортных услуг по сделке предпоставочного периода в соответствии с пунктом 10 настоящей статьи, Клиринговая организация в сроки, установленные Спецификацией фьючерсного контракта, осуществляет возврат поставочной маржи по этой сделке предпоставочного периода Участнику клиринга, являющемуся Участником поставки - покупателем, либо Участнику клиринга, обслуживающему Клиента, являющемуся Участником поставки - покупателем и сообщает Участнику клиринга, являющемуся Участником поставки - продавцом, либо Участнику клиринга, обслуживающему Клиента, являющемуся Участником поставки - продавцом о выполнении обязательств по оплате поставки и оплате

транспортных услуг по данной сделке предпоставочного периода в «Отчете о сделках предпоставочного периода», предоставляемом Участникам клиринга в соответствии со [статьей 07.08 Правил](#).

21. В случае невыполнения обязательств по оплате поставки и оплате транспортных услуг по сделке предпоставочного периода в соответствии с пунктом 10 настоящей статьи, в сроки, установленные Спецификацией фьючерсного контракта, такой Участник поставки признается не исполнившим обязательства по сделке предпоставочного периода. С Участника поставки, не исполнившего указанные в настоящем пункте обязательства по сделке предпоставочного периода, удерживается неустойка в размере поставочной маржи, которая перечисляется в адрес Участника поставки - продавца. Неустойка перечисляется из состава поставочной маржи Участника клиринга, являющегося Участником поставки, не исполнившим обязательства указанные в настоящем пункте, либо Участника клиринга, обслуживающего Клиента, не исполнившего указанные в настоящем пункте обязательства и заблокированной в обеспечение данной сделки предпоставочного периода в соответствии с подпунктом в) пункта 10 настоящей статьи. Уплата неустойки Участником поставки, не исполнившим указанные в настоящем пункте обязательства по сделке предпоставочного периода, Участнику поставки, являющемуся стороной по сделке предпоставочного периода, в отношении которой представлено Уведомление о подписании Договора поставки, прекращает обязательства сторон по сделке предпоставочного периода. При этом по данной сделке предпоставочного периода осуществляется возврат поставочной маржи Участнику клиринга, являющемуся Участником поставки - продавцом, либо Участнику клиринга, обслуживающему Клиента, являющегося Участником поставки - продавцом в порядке, предусмотренном статьей 04.03 Правил.
22. Если поставка (отгрузка) всего объёма реального товара по сделке предпоставочного периода осуществляется несколькими поставочными партиями, Участник клиринга, являющийся Участником поставки – продавцом, либо Участник клиринга, обслуживающий Клиента, являющегося Участником поставки – продавцом, может информировать Клиринговую организацию о поставке каждой отдельной партии реального товара, сообщая в Клиринговую организацию количество и стоимость (включая НДС) фактически отгруженной партии реального товара по форме, установленной Спецификацией фьючерсного контракта.
23. На основании информации, полученной в соответствии с пунктом 22 настоящей Статьи, Клиринговая организация перечисляет на счет Участника поставки - продавца, указанный в Уведомлении о реквизитах, необходимых для заключения Договора поставки, денежные средства в размере стоимости каждой фактически отгруженной партии реального товара по сделке предпоставочного периода, но не более полного размера обязательства Участника

поставки - покупателя по оплате поставки по соответствующей сделке предпоставочного периода, включая НДС в порядке, установленном Операционным регламентом.

24. При получении от Участника поставки – продавца уведомления о завершении поставки, оформленного в порядке, установленном Операционным регламентом, Клиринговая организация в сроки, установленные Спецификацией фьючерсного контракта перечисляет на счет Участника поставки - продавца, указанный в Уведомлении о реквизитах, необходимых для заключения Договора поставки, денежные средства в размере стоимости фактически отгруженного реального товара по сделке предпоставочного периода (либо в размере разницы между полным размером денежного обязательств Участника поставки - покупателя по соответствующей сделке предпоставочного периода и стоимостью ранее фактически отгруженных партий реального товара по этой сделке предпоставочного периода, если поставка всего объема реального товара в соответствии с заключённой сделкой предпоставочного периода осуществлялась несколькими поставочными партиями), но не более полного размера обязательств Участника поставки - покупателя по оплате поставки по соответствующей сделке предпоставочного периода, включая НДС, а также в размере фактической стоимости транспортных расходов по сделке (включая НДС).
25. В случае не предоставления Участником поставки - продавцом Уведомления о завершении поставки после истечения месяца исполнения, он признается не исполнившим обязательства по сделке предпоставочного периода. С Участника поставки - продавца, не исполнившего обязательства по сделке предпоставочного периода, удерживается неустойка в размере поставочной маржи, пропорционально объему базового актива, не поставленному по данной сделке предпоставочного периода за вычетом допустимого отклонения величины фактической поставочной партии, установленного Спецификацией фьючерсного контракта, в адрес Участника поставки – покупателя, являющегося стороной по сделке предпоставочного периода. Неустойка перечисляется из состава поставочной маржи Участника клиринга, являющегося Участником поставки, не исполнившим обязательства указанные в настоящем пункте, либо Участника клиринга, обслуживающего Клиента, не исполнившего указанные в настоящем пункте обязательства и заблокированной в обеспечение данной сделки предпоставочного периода в соответствии с подпунктом в) пункта 10 настоящей статьи. Уплата неустойки Участником поставки-продавцом, не исполнившим указанные в настоящем пункте обязательства по сделке предпоставочного периода, Участнику поставки-покупателю, являющемуся стороной по сделке предпоставочного периода, прекращает обязательства сторон по данной сделке предпоставочного периода

Клиринговая организация не позднее следующего рабочего дня после признания Участника поставки - продавца не исполнившим обязательства по сделке предпоставочного периода осуществляет возврат суммы оплаты поставки и суммы оплаты транспортных услуг по данной сделке предпоставочного периода Участнику клиринга, являющемуся стороной по сделке предпоставочного периода, исполнившей обязательства, либо Участнику клиринга, обслуживающему Клиента, являющегося стороной по сделке предпоставочного периода, исполнившей обязательства, пропорционально объему базового актива, не поставленному по данной сделке предпоставочного периода. Возврат денежных средств осуществляется на счет Участника поставки, являющегося стороной по сделке предпоставочного периода, исполнившей обязательства, указанный в Уведомлении о реквизитах, необходимых для заключения Договора поставки.

РАЗДЕЛ 09. ЧРЕЗВЫЧАЙНЫЕ СИТУАЦИИ

Статья 09.01. Определение чрезвычайных ситуаций

1. Под чрезвычайной ситуацией понимаются обстоятельства, которые по оценке Клиринговой организации нарушили, нарушают или могут нарушить нормальное осуществление клиринга в соответствии с Правилами.
2. Чрезвычайными могут быть признаны следующие ситуации:
 - а) принятие или любые изменения законодательных или иных актов государственных органов Российской Федерации или Банка России или распоряжения данных органов, инструкции, указания, заявления, письма, телеграммы или иные действия, включая невозможность осуществления согласования с государственными органами или Банком России в тех случаях, когда такое согласование является необходимым в соответствии с действующим законодательством или Правилами (далее – акты), которые прямо или косвенно или при определенном их толковании или определенном стечении обстоятельств, начиная с момента утверждения данных актов или с иного срока, по оценке Клиринговой организации, временно или на неопределенный срок сделали, делают или могут сделать невозможным или значительно затруднить дальнейшее проведение клиринга и/или расчетов в том виде, форме и порядке, в которых данные операции проводились до принятия указанных актов. К таким последствиям могут быть отнесены:
 - (i) невозможность проведения клиринга;
 - (ii) невозможность использования значительной, по оценке Клиринговой организации, части депозитной маржи Участников клиринга для оплаты их задолженностей в случае возникновения ситуаций несостоятельности.
 - б) любые события и/или обстоятельства, которые, по оценке Клиринговой организации временно или на неопределенный срок сделали, делают или могут сделать невозможным или значительно затруднить проведение расчетов Участниками клиринга по их обязательствам;
 - в) любые события и/или обстоятельства, которые, по оценке Клиринговой организации, временно или на неопределенный срок сделали, делают или могут сделать невозможным или значительно затруднить выполнение Клиринговой организацией и/или Расчетной организацией операций по обеспечению осуществления клиринга или расчетов. К таким событиям/обстоятельствам, в том числе, могут быть отнесены:
 - (i) пожары или иные несчастные случаи;

- (ii) разрушения или значительные повреждения занимаемых указанными организациями помещений;
 - (iii) нестабильность или отключение электроэнергии, которое не может быть нейтрализовано имеющимися в распоряжении указанных организаций техническими средствами;
 - (iv) неработоспособность программного обеспечения, вычислительной техники, оргтехники, средств связи, включая средства телекоммуникаций;
 - (v) массовые беспорядки, вооруженные столкновения, демонстрации;
- г) любые события и/или обстоятельства, которые по оценке Клиринговой организации создали, создают или могут создать угрозу жизни или здоровью сотрудников Клиринговой организации и/или Расчетной организации и/или представителей Участников клиринга в помещениях Клиринговой организации и/или Расчетной организации;
- д) любые другие подобные по оценке Клиринговой организации события или обстоятельства.
3. Для признания ситуации чрезвычайной достаточно решения Генерального директора.
4. В случае признания Генеральным директором ситуации чрезвычайной, Генеральный директор предпринимает следующие действия:
- а) оповещение Участников клиринга в установленном Правилами порядке о возникновении данной ситуации и предпринятых в связи с этим Генеральным директором действиях;
 - б) по усмотрению Генерального директора, - приостановка проведения всех или некоторых операций с любого момента времени на срок, определенный Генеральным директором.
5. При возникновении дефицита обеспечения, Генеральным директором, помимо иных действий, установленных настоящей статьей, могут быть предприняты следующие действия:
- а) отмена результатов последней проведенной клиринговой сессии и признание обязательств невозникшими;
 - б) приостановка проведения всех операций.

Статья 09.02. Урегулирование чрезвычайных ситуаций

1. В качестве мер по урегулированию чрезвычайной ситуации Генеральный директор вправе:

- а) потребовать внесения Участниками клиринга дополнительных денежных средств в состав их депозитной маржи;
 - б) осуществить закрытие всех позиций всех Участников клиринга по всем или некоторым сериям срочных контрактов по расчетным ценам, определенным в торговый день, по результатам которого были проведены последние расчеты по нетто-обязательствам, или по иным ценам, устанавливаемым по решению Клиринговой организации;
 - в) осуществить единовременную переоценку всех позиций всех Участников клиринга по всем или некоторым сериям срочных контрактов по ценам, устанавливаемым по решению Генерального директора, без начисления и выплаты соответствующей вариационной маржи в соответствии с Правилами;
 - г) изменить способ и срок исполнения срочных контрактов по всем или некоторым сериям срочных контрактов;
 - д) осуществить иные действия в случае необходимости.
2. При принятии решений по урегулированию чрезвычайных ситуаций Генеральный директор вправе:
 - а) устанавливать сроки оповещения Участников клиринга о своих решениях;
 - б) устанавливать сроки и порядок исполнения своих решений;
 - в) обуславливать порядок вступления в силу своих решений определенными обстоятельствами;
 - г) созывать совещания представителей Участников клиринга.
3. Решения Генерального директора по урегулированию чрезвычайной ситуации являются обязательными для исполнения Участниками клиринга.
4. Клиринговая организация обязана обеспечивать по результатам каждой клиринговой сессии своевременное и полное перечисление Участникам клиринга суммы требований Участников клиринга по вариационной марже только в пределах следующих средств:
 - а) суммы оплаты Участниками клиринга своих обязательств по вариационной марже в соответствии с Правилами за вычетом суммы требований Участников клиринга по вариационной марже в соответствии с Правилами;
 - б) совокупной суммы средств, которая в соответствии со [статьей 07.08 Правил](#) может быть израсходована для оплаты задолженностей Участников клиринга, а также для оплаты Клиринговой организацией своих обязательств по вариационной марже.
5. О решениях Генерального директора по урегулированию чрезвычайной ситуации Участники клиринга оповещаются в установленном

Правилами порядке не позднее принятия данных мер в соответствии с данным решением.

6. По решению Генерального директора все или часть вопросов, связанных с урегулированием чрезвычайных ситуаций, предусмотренных настоящим разделом, могут быть переданы на рассмотрение Совета Директоров.

РАЗДЕЛ 10. ПОРЯДОК РАЗРЕШЕНИЯ СПОРОВ

- 10.1. Все гражданско-правовые споры и разногласия, возникающие в связи с осуществлением Клиринговой организацией деятельности в соответствии с настоящими Правилами клиринга подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражном суде г. Москвы.

Приложение 01
к Правилам осуществления
клиринговой деятельности
РДК (ЗАО) на срочном рынке
ЗАО «СПБМТСБ»

ДОГОВОР № _____

ОБ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГОВОГО ОБСЛУЖИВАНИЯ
НА СРОЧНОМ РЫНКЕ ЗАО «СПБМТСБ»

г. Москва

“ ”

200 г.

Закрытое акционерное общество «Расчетно–депозитарная компания», именуемое в дальнейшем «Клиринговая Организация», в лице Генерального директора Азимовой Ларисы Владимировны, действующей на основании Устава с одной стороны, и _____, именуемый в дальнейшем "Участник клиринга", в лице _____, действующего на основании _____, с другой стороны, далее вместе именуемые "Стороны", заключили настоящий Договор на осуществление клирингового обслуживания на срочном рынке ЗАО «СПБМТСБ» (далее – "Договор"), о нижеследующем:

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

В целях настоящего Договора термины и определения используются в значениях, установленных Правилами осуществления клиринговой деятельности РДК (ЗАО) на срочном рынке (далее – Правила осуществления клиринговой деятельности), а также законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

2. ПРЕДМЕТ ДОГОВОРА

По настоящему Договору Клиринговая Организация в порядке, установленном Правилами осуществления клиринговой деятельности, оказывает Участнику клиринга услуги по осуществлению клиринга (клиринговому обслуживанию) в отношении сделок, заключаемых от имени Участника клиринга на срочном рынке, а также по договорам, заключаемым во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам от имени Участника клиринга и/или от имени Клиентов Участника клиринга, включая определение обязательств Участника клиринга по уплате вариационной маржи и клирингового сбора в пользу Клиринговой Организации, иных обязательств Участника клиринга, а также определение обязательств Участника клиринга по внесению обеспечения, гарантирующего исполнение сделок, заключаемых от имени Участника клиринга и/или от имени Клиентов Участника клиринга, а также по договорам, заключаемым во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам от имени Участника

клиринга и/или от имени Клиентов Участника клиринга в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности, которые являются неотъемлемой частью настоящего Договора.

По настоящему Договору Участник клиринга приобретает все права и обязанности, установленные Правилами осуществления клиринговой деятельности для Участников клиринга с категорией

Общий клиринговый участник/Индивидуальный клиринговый участник.

3. ПРАВА КЛИРИНГОВОЙ ОРГАНИЗАЦИИ

Клиринговая Организация в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности РДК (ЗАО) на срочном рынке, Операционным регламентом РДК (ЗАО) на срочном рынке, Методикой определения параметров гарантийной системы РДК (ЗАО) на срочном рынке, Порядком создания, размещения и использования гарантийных фондов РДК (ЗАО) при осуществлении клиринга на срочном рынке, Методикой принудительной ликвидации при осуществлении клиринговой деятельности РДК (ЗАО) на срочном рынке (далее вместе именуются «Внутренние документы»), вправе:

3.1. В случаях, предусмотренных Внутренними документами, осуществлять принудительную ликвидацию позиций Участника клиринга.

3.2. При возникновении ситуаций, признаваемых чрезвычайными в соответствии с Внутренними документами, закрывать все позиции Участника клиринга, приостанавливать проведение всех или некоторых операций.

3.3. В одностороннем порядке вносить изменения и дополнения в Правила осуществления клиринговой деятельности (в том числе путем утверждения Правил осуществления клиринговой деятельности в новой редакции), а также в одностороннем порядке вводить в действие Базовые тарифы РДК (ЗАО) за оказание услуг участникам клиринга и изменения в них в порядке, предусмотренном внутренними документами РДК (ЗАО).

3.4. Осуществлять иные права в соответствии с Внутренними документами.

4. ОБЯЗАННОСТИ КЛИРИНГОВОЙ ОРГАНИЗАЦИИ

Клиринговая Организация обязана:

4.1. Осуществлять клиринг по сделкам и позициям Участника клиринга, а также по договорам, заключаемым во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам от имени данного Участника клиринга и/или от имени его Клиентов, в соответствии с Внутренними документами.

4.2. Предоставлять Участнику клиринга отчеты по результатам клиринга и расчетов.

4.3. Уведомлять Участника клиринга о внесении изменений и дополнений в Правила осуществления клиринговой деятельности в порядке, установленном Правилами осуществления клиринговой деятельности, а также об утверждении новой редакции Базовых тарифов, путем направления уведомления не позднее чем за 5 рабочих дней до даты вступления их в силу. Уведомления о вступлении в силу изменений в Базовые тарифы направляются по адресам, в том числе электронным, указанным Участниками клиринга в Анкете Участника клиринга. Днем оповещения Участников клиринга о вступлении в силу изменений в Базовые тарифы РДК (ЗАО) является день отправки вышеуказанных уведомлений.

4.4. Выполнять иные обязанности перед Участником клиринга в соответствии с Внутренними документами.

4.5. Обеспечивать по результатам каждой клиринговой сессии своевременное и полное перечисление Участникам клиринга суммы требований Участников клиринга по вариационной марже только в пределах суммы следующих средств:

- а) сумма оплаты Участниками клиринга своих обязательств по вариационной марже в соответствии с Внутренними документами;
- б) совокупная сумма средств (обеспечения), которые могут быть израсходованы в соответствии с Внутренними документами для оплаты задолженностей Участников клиринга, а также для оплаты Клиринговой организацией своих обязательств по вариационной марже.

5. ПРАВА УЧАСТНИКА КЛИРИНГА

Участник клиринга реализует свои права в объеме, предусмотренном Внутренними документами для Участников клиринга с категорией, указанной в Статье 2 настоящего договора.

6. ОБЯЗАННОСТИ УЧАСТНИКА КЛИРИНГА

Участник клиринга обязуется исполнять Внутренние документы, в том числе своевременно и в полном объеме выполнять следующие обязанности:

6.1. Соблюдать лимиты, установленные в соответствии с Внутренними документами.

6.2. Исполнять все обязательства, возникающие в связи с заключением сделок от имени данного Участника клиринга, а также по договорам, заключаемым во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам от имени данного Участника клиринга и/или от имени его Клиентов, по которым Клиринговая Организация в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности осуществляет клиринг, включая обязательства по уплате клирингового сбора, поставочного сбора и иных сборов и вознаграждений в пользу Клиринговой Организации.

6.3. Участник клиринга обязуется выдать доверенность Клиринговой организации на заключение договора коммерческого представительства с Реализатором в порядке, предусмотренном Внутренними документами.

6.4. Предоставлять Клиринговой Организации необходимые документы и информацию в соответствии с Внутренними документами.

6.5. Предоставлять депозитную маржу, поставочную маржу, а также средства обеспечения исполнения его обязательств в случаях и порядке, определяемых Внутренними документами.

6.6. Возмещать в порядке, определяемом Внутренними документами Клиринговой организации, средства обеспечения, использованные Клиринговой Организацией в случаях и порядке, определяемых Внутренними документами.

6.7. Исполнять свои обязательства перед Клиентами в соответствии с Внутренними документами.

6.8. Подавать в режиме торгов «Запрос котировок» заявки в соответствии с Внутренними документами в случае, если Участник клиринга является Участником торгов в соответствии с Внутренними документами Организатора торговли, либо обеспечить подачу заявок от своего имени в режиме торгов «Запрос котировок» в соответствии с Внутренними документами, в случае, если Участник клиринга является Клиентом Участника торгов в соответствии с Внутренними документами Организатора торговли.

6.9. Признавать решения, принятые уполномоченными органами Клиринговая Организация в соответствии с Внутренними документами, и выполнять данные решения.

6.10. Разрешать споры в порядке, установленном настоящим Договором и Внутренними документами.

6.11. Своевременно и полном объеме исполнять обязательства по поставке базового актива и оплате поставки, возникающие по договорам, заключаемым во исполнение обязательств по поставочным срочным контрактам.

6.12. Выполнять иные обязанности в соответствии с Внутренними документами.

7. ОТВЕТСТВЕННОСТЬ СТОРОН

7.1. Стороны несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение своих обязанностей по настоящему Договору в соответствии с законодательством Российской Федерации.

7.2. Стороны освобождаются от ответственности за частичное или полное неисполнение обязательств по настоящему Договору при условии наступления обстоятельств, определенных в Разделе 9 настоящего Договора.

7.3. Клиринговая организация не несет ответственности за:

7.3.1. неисполнение или ненадлежащее исполнение своих обязанностей по настоящему Договору, вызванное действием или бездействием Участника клиринга, в результате которого Клиринговая организация не могла выполнить свои обязанности в соответствии с настоящим Договором, в том числе Правилами клиринга;

7.3.2. неисполнение или ненадлежащее исполнение своих обязанностей по настоящему Договору, вследствие признания ситуации чрезвычайной в связи с наступлением событий, предусмотренных пунктом 2 статьи 09.01 Правил клиринга (за исключением случаев, когда такие события возникли вследствие виновных действий или бездействия Клиринговой организации);

7.3.3. убытки Участника клиринга, если они возникли вследствие умысла или грубой неосторожности Участника клиринга;

7.3.4. неисполнение Биржей, другими лицами своих обязательств по обеспечению правильности, своевременности и достоверности информации, передаваемой РДК (ЗАО) от Биржи, других лиц;

7.3.5. неисполнение или ненадлежащее исполнение условий настоящего Договора, в том числе Правил клиринга, вызванное представлением Участником клиринга недостоверных данных, содержащихся в документах, представленных Участником клиринга при заключении настоящего Договора, а также в соответствии с порядком, определенным Правилами клиринга, или несвоевременном уведомлении Клиринговой организацией об изменении таких данных;

7.3.6. неисполнение Биржей своих обязательств перед Участником клиринга;

7.4. Клиринговая организация не несет ответственности по обязательствам Участника перед третьими лицами.

8. ОБСТОЯТЕЛЬСТВА, ИСКЛЮЧАЮЩИЕ ОТВЕТСТВЕННОСТЬ СТОРОН (ФОРС-МАЖОР)

8.1. Ни одна из Сторон не несет ответственности в случае невыполнения, несвоевременного или ненадлежащего выполнения ею какого-либо ее обязательства по настоящему Договору, если указанное невыполнение, несвоевременное или ненадлежащее выполнение обусловлены исключительно наступлением и/или действием обстоятельств непреодолимой силы (форс-мажорных обстоятельств), в том числе технических сбоев, неисправностей, ошибок и отказов в оборудовании и программном обеспечении, пожаров, аварий, актов террора, диверсий и

саботажа, забастовок, смены политического режима и другие политических осложнений, изменений законодательства и других нормативно правовых актов, военных действий, массовых беспорядков и других непредвиденных обстоятельств, неконтролируемых Сторонами.

Перечисленные в настоящем пункте обстоятельства исключают ответственность Сторон, если только причиной их наступления не явились виновные действия стороны, как умышленные, так и неумышленные, которые выгодны виновной Стороне для наступления какого-либо из перечисленных обстоятельств.

8.2. Затронутая форс-мажорными обстоятельствами Сторона незамедлительно, но не позднее дня, следующего за днем наступления события, информирует другую Сторону об этих обстоятельствах и об их последствиях и принимает все возможные меры с целью максимально ограничить отрицательные последствия, вызванные указанными форс-мажорными обстоятельствами.

Сторона, для которой создались форс-мажорные обстоятельства, должна незамедлительно, но не позднее дня следующего за днем наступления события, известить другую сторону о прекращении этих обстоятельств.

8.3. Неизвещение или несвоевременное извещение другой Стороны Стороной, для которой создавалась невозможность исполнения обязательства по Договору, о наступлении форс-мажорных обстоятельств, влечет за собой утрату права ссылаться на эти обстоятельства.

9. КОНФИДЕНЦИАЛЬНОСТЬ

9.1. Клиринговая Организация обеспечивает конфиденциальность информации о Клиринговых участниках, включая информацию о производимых операциях по счетам Участника клиринга и иные сведения об Участнике клиринга, ставшие известными в связи с осуществлением клиринговой деятельности.

9.2. Сведения об Участнике клиринга могут быть предоставлены только самому Участнику клиринга, лицензирующему органу в рамках его полномочий. Иным государственным органам и их должностным лицам такие сведения могут быть предоставлены исключительно в случаях, предусмотренных федеральными законами.

10. ПОРЯДОК РАЗРЕШЕНИЯ СПОРОВ

10.1. Письменные заявления (жалобы, претензии, предложения, запросы и прочие обращения), поступающие от Участника клиринга в Клиринговую Организацию, регистрируются в Клиринговой Организации в день их поступления и рассматриваются в течение 1 (одного) месяца с момента их регистрации, после чего на имя Клирингового участника предоставляется письменный ответ за подписью уполномоченного лица.

10.2. Все споры, возникающие между Сторонами, подлежат урегулированию путем переговоров Сторон между собой. В случае невозможности урегулирования споров путем проведения переговоров между Сторонами, спор разрешается в Арбитражном суде г. Москвы.

11. ОПЛАТА УСЛУГ

11.1. Оплата услуг Клиринговой Организации по настоящему Договору осуществляется согласно утвержденным Базовым тарифам РДК (ЗАО) за клиринговое обслуживание, действующим на дату предоставления услуги.

11.2. Счет выставляется по окончании календарного месяца и включает все оказанные в течение календарного месяца услуги.

11.3. Оплата счетов производится в срок не позднее последнего дня месяца, следующего за оплачиваемым, при условии, что счет за оказанные в течение месяца услуги выставлен в срок не позднее 10-и рабочих дней, следующих за последним днем оплачиваемого месяца.

11.4. Акт оказанных услуг по настоящему договору, подписанный со стороны РДК (ЗАО), и соответствующие счета-фактуры выставляются Участнику клиринга не позднее пятого рабочего дня месяца, следующего за месяцем, в котором оказаны услуги.

12. СРОК ДЕЙСТВИЯ ДОГОВОРА

12.1. Настоящий Договор вступает в силу с момента его подписания Сторонами и заключен на неопределенный срок.

12.2. Изменения и дополнения в настоящий Договор могут быть внесены по соглашению Сторон, оформленному в письменном виде и подписанному уполномоченными представителями Сторон, за исключением случая, предусмотренного п.3.3 настоящего Договора.

12.3. Настоящий Договор может быть расторгнут в одностороннем порядке по инициативе любой из Сторон путем письменного уведомления другой Стороны не позднее чем за 1 (один) месяц до даты расторжения.

12.4. Прекращение действия настоящего Договора не освобождает Стороны от исполнения обязательств, возникших до прекращения действия настоящего Договора.

13. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

13.1. Настоящий Договор составлен в 2-х экземплярах на русском языке, имеющих одинаковую юридическую силу: один экземпляр хранится у Участника клиринга, другой - в Клиринговой Организации.

13.2. Все приложения, а также изменения и дополнения к настоящему Договору, являются его неотъемлемой частью.

14. РЕКВИЗИТЫ И ПОДПИСИ СТОРОН

Клиринговая Организация:

Закрытое акционерное общество «Расчетно-депозитарная компания» (РДК (ЗАО))

115419, г. Москва, 2-ой Верхний Михайловский проезд, д.9, стр.2,

р/с 40702810600000000443 в ГПБ (ОАО) г. Москва,

БИК 044525823,

к/с 30101810200000000823 в ОПЕРУ Московского ГТУ Банка России,

ИНН 7725117665,

ОКПО 18452783,

КПП 774401001

Участник клиринга:

Наименование:	
Место нахождения:	
ИНН:	
КПП:	
ОКПО:	
Наименование банка:	
Р/с №	
К/с №	
БИК	

Клиринговая Организация

Участник клиринга

_____/Л.В. Азимова/
м.п.

_____/_____
м.п.

Приложение 02
к Правилам осуществления
клиринговой деятельности
РДК (ЗАО) на срочном рынке
ЗАО «СПбМТСБ»

Форма Анкеты Участника клиринга - юридического лица (резидент)

АНКЕТА УЧАСТНИКА КЛИРИНГА (российского юридического лица)	Код участника _____
Организация _____ <i>(полное наименование юридического лица с указанием организационно-правовой формы)</i>	
ИНН _____ / КПП _____	
Основной государственный регистрационный номер (ОГРН) _____	
Дата выдачи документа _____	
Регистрирующий орган _____	
Место нахождения (в соответствии с Уставом Организации) _____ _____	
Адрес для направления корреспонденции (с указанием индекса) _____ _____	
Телефоны/факс _____ <i>(междугородный код и номер телефона)</i>	
Адрес электронной почты _____	
Контактное лицо: _____ _____	
Подпись участника клиринга: _____ / _____ <i>подпись</i> <i>наименование должности, ФИО</i> уполномоченного лица Организации	

МП	«__» _____
200__ г.	

Приложение 03
к Правилам осуществления
клиринговой деятельности
РДК (ЗАО) на срочном рынке
ЗАО «СПбМТСБ»

Форма Анкеты Участника клиринга - юридического лица (нерезидент)

АНКЕТА УЧАСТНИКА КЛИРИНГА (иностранного юридического лица)	Код участника _____
Организация _____ <i>(полное наименование юридического лица с указанием организационно-правовой формы)</i>	
Юрисдикция _____	
Код иностранной организации (КИО) _____	
Наименование и номер документа о регистрации юридического лица: _____	
Дата выдачи документа _____	
Регистрирующий орган _____	
Место нахождения (в соответствии с Уставом Организации) _____ _____	
Адрес для направления корреспонденции (с указанием индекса) _____ _____	
Телефоны/факс _____ <i>(междугородный код и номер телефона)</i>	
Адрес электронной почты _____	
Контактное лицо: _____ _____	
Подпись участника клиринга: _____ /	

<p>_____</p> <p>подпись</p> <p>Организации</p>	<p>_____</p> <p>наименование должности, ФИО уполномоченного лица</p> <p>МП</p> <p>«__» _____</p>
<p>200__ г.</p>	

Приложение 04
к Правилам осуществления
клиринговой деятельности
РДК (ЗАО) на срочном рынке
ЗАО «СПБМТСБ»

Требования к финансовому состоянию Участников клиринга

1. К финансовому состоянию Участников клиринга – кредитных организаций предъявляются следующие требования:
 - а) Размер собственных средств (капитал) Участников клиринга, рассчитанный по формуле, используемой для расчета обязательных нормативов ЦБ РФ по состоянию баланса на последнюю отчетную дату перед принятием Участника клиринга на клиринговое обслуживание, а также на каждую отчетную дату с момента принятия Участника клиринга на клиринговое обслуживание, должен составлять не менее:
 - i) Общий Клиринговый Участник 2 000 000 рублей;
 - ii) Индивидуальный Клиринговый Участник 1 000 000 рублей;
 - б) Баланс Участника клиринга по состоянию на последнюю отчетную дату перед принятием Участника клиринга на клиринговое обслуживание должен быть безубыточным, то есть разница между пассивом и активом по счету 706 не должна быть отрицательной. С момента принятия Участника клиринга на клиринговое обслуживание убыточность баланса данного Участника клиринга по состоянию на отчетную дату допускается не чаще одного раза в год.
 - в) Участник клиринга, по состоянию на последнюю отчетную дату перед принятием Участника клиринга на клиринговое обслуживание, а также на каждую отчетную дату с момента принятия Участника клиринга на клиринговое обслуживание, должен соблюдать обязательные нормативы, установленные Инструкцией № 110-И Центрального Банка Российской Федерации “Об обязательных нормативах банков”.
2. К финансовому состоянию Участников клиринга – некредитных организаций предъявляются следующие требования:
 - а) Размер собственных средств (капитал) Участника клиринга, рассчитанный в соответствии с требованиями уполномоченного федерального органа исполнительной власти по состоянию на последнюю отчетную дату перед принятием Участника клиринга на клиринговое обслуживание, а также на каждую отчетную дату

с момента принятия Участника клиринга на клиринговое обслуживание, должен составлять не менее:

- i) Общий Клиринговый Участник 2 000 000 рублей;
- ii) Индивидуальный Клиринговый Участник 1 000 000 рублей;

- б) Финансовый результат деятельности Участника клиринга по состоянию на последнюю отчетную дату перед принятием Участника клиринга на клиринговое обслуживание должен быть положительным, то есть значение финансового результата по строке 470 «Нераспределенная прибыль (непокрытый убыток)» «Бухгалтерского баланса» (форма № 1), не должно быть отрицательным. С момента принятия Участника клиринга на клиринговое обслуживание отрицательное значение финансового результата деятельности данного Участника клиринга допускается не чаще одного раза в год.

Приложение 05
к Правилам осуществления
клиринговой деятельности
РДК (ЗАО) на срочном рынке
ЗАО «СПБМТСБ»

Образец Дополнительного соглашения об изменении категории клирингового участия к Договору о клиринговом обслуживании.

ДОПОЛНИТЕЛЬНОЕ СОГЛАШЕНИЕ К ДОГОВОРУ № _____

ОБ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГОВОГО ОБСЛУЖИВАНИЯ
НА СРОЧНОМ РЫНКЕ

г. Москва

“ ”

200 г.

Закрытое акционерное общество «Расчетно–депозитарная компания», именуемое в дальнейшем «Клиринговая Организация», в лице Генерального директора Азимовой Ларисы Владимировны, действующей на основании Устава с одной стороны, и _____, именуемый в дальнейшем "Участник клиринга", в лице _____, действующего на основании _____, с другой стороны, далее вместе именуемые "Стороны", заключили настоящий Договор на осуществление клирингового обслуживания на срочном рынке (далее – "Договор"), о нижеследующем:

1. Изложить второй абзац Раздела 2 Договора в следующей редакции:

«По настоящему Договору Участник клиринга приобретает все права и обязанности, установленные Правилами осуществления клиринговой деятельности для Участников клиринга с категорией

Общий клиринговый участник/Индивидуальный клиринговый участник»

3. Настоящее Дополнительное соглашение является неотъемлемой частью Договора и вступает в силу с даты его подписания Сторонами.
4. Настоящее Дополнительное соглашение составлено в двух экземплярах, имеющих одинаковую юридическую силу, по одному экземпляру для Депозитария и Депонента.

5. Реквизиты и подписи Сторон:

Клиринговая Организация:

Закрытое акционерное общество «Расчетно-депозитарная компания» (РДК (ЗАО))

115419, г. Москва, 2-ой Верхний Михайловский проезд, д.9, стр.2,
р/с 40702810600000000443 в ГПБ (ОАО) г. Москва,
БИК 044525823,
к/с 30101810200000000823 в ОПЕРУ Московского ГТУ Банка России,
ИНН 7725117665,
ОКПО 18452783,
КПП 774401001

Участник клиринга:

Наименование:	
Место нахождения:	
ИНН:	
КПП:	
ОКПО:	
Наименование банка:	
Р/с №	
К/с №	
БИК	

Клиринговая Организация

Участник клиринга

_____/Л.В. Азимова/
м.п.

_____/_____
м.п.

