

## УТВЕРЖДЕНЫ

Советом директоров РДК (ЗАО)

Протокол № СД-9/2013 от «19» ноября 2013 года

Председатель Совета директоров - В.В. Таций  
(Зарегистрированы Службой Банка России по  
финансовым рынкам 23 декабря 2013 года)

### ИЗМЕНЕНИЯ И ДОПОЛНЕНИЯ В ПРАВИЛА ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ЗАКРЫТОГО АКЦИОНЕРНОГО ОБЩЕСТВА «РАСЧЕТНО- ДЕПОЗИТАРНАЯ КОМПАНИЯ» ПО СДЕЛКАМ С РЕАЛЬНЫМ ТОВАРОМ

Внести в Правила осуществления клиринговой деятельности Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» по сделкам с реальным товаром, утвержденные Советом директоров РДК (ЗАО) 29.04.2013, протокол № СД-4/2013, следующие изменения и дополнения:

1. Изложить следующие термины и определения в пункте 1.1 раздела 1 «Термины и определения» в следующей редакции:

***Банковский счет  
Участника клиринга***

Банковский счет Участника клиринга, открытый в одной из Аккредитованных кредитных организаций для получения от Клиринговой организации денежных средств по результатам клиринга, в том числе, в оплату реального товара по Сделкам, Неустоек, а также при возврате денежных средств, ранее перечисленных на Клиринговые счета

***Дата дефолта  
Покупателя по Сделке***

Для Сделки общего клирингового пула Датой дефолта Покупателя по Сделке признается рабочий день, следующий за Датой обеспечения Сделки в случае отрицательного результата Контроля обеспечения денежных обязательств, или рабочий день, следующий за датой поступления в Клиринговую организацию от Контролера поставки или Поставщика по Сделке (когда это предусмотрено Внутренними документами Биржи) информации о неоплате Покупателем транспортных расходов и/или о непредставлении Покупателем реквизитной заявки и/или о невыполнении Покупателем иных предусмотренных Внутренними документами Биржи действий.

Для Сделки выделенного клирингового пула Датой дефолта Покупателя по Сделке признается третий рабочий день после Даты завершения расчетов по Сделке в случае неперечисления Покупателем денежных средств во

исполнение денежного обязательства по Сделке или рабочий день, следующий за датой поступления в Клиринговую организацию от Контролера поставки или Поставщика по Сделке (когда это предусмотрено Внутренними документами Биржи) информации о неоплате Покупателем транспортных расходов и/или о непредставлении Покупателем реквизитной заявки и/или о невыполнении Покупателем иных предусмотренных Внутренними документами Биржи действий.

В Дату дефолта Покупателя по Сделке прекращается возможность исполнить денежные обязательства в соответствии с настоящими Правилами клиринга.

***Дата дефолта  
Продавца по Сделке***

Пятый рабочий день, следующий за Датой завершения поставки, когда для Продавца по Сделке, в случае неподтверждения поставки в соответствии с требованиями настоящих Правил клиринга, прекращается возможность исполнить товарные обязательства в соответствии с настоящими Правилами клиринга

2. Дополнить пункт 1.1 раздела 1 «Термины и определения» после термина «Реальный товар» новым термином «Регулирующие органы» в следующей редакции:

***Регулирующие органы*** Банк России и (или) ФСФР России (до передачи полномочий Банку России)

3. В пунктах 2.11 и 2.12 раздела 2 «Общие положения. Заключение договора» слова «федеральным органом исполнительной власти в области финансовых рынков» заменить на слова «Банком России».

4. Изложить пункт 4.2.6 Раздела 4 «Порядок организации клирингового обслуживания Участников клиринга и предъявляемые к ним требования» в следующей редакции:

«4.2.6. Карточка с нотариально засвидетельствованными образцами оттиска печати юридического лица (управляющей организации или управляющего в случае, если полномочия единоличного исполнительного органа юридического лица переданы управляющей организации или управляющему) и подписей лиц, уполномоченных подписывать необходимые документы от имени юридического лица, или ее копия, засвидетельствованная нотариально либо одной из кредитных организаций, или указанные образцы печати юридического лица и подписей уполномоченных лиц, заверенные сотрудником Клиринговой организации;».

5. Изложить пункт 4.3.6 Раздела 4 «Порядок организации клирингового обслуживания Участников клиринга и предъявляемые к ним требования» в следующей редакции:

«4.3.6. Карточка с нотариально засвидетельствованными образцами оттиска печати индивидуального предпринимателя и подписей лиц, уполномоченных подписывать необходимые документы от имени индивидуального предпринимателя, или ее копия, засвидетельствованная нотариально либо одной из кредитных организаций, или указанные образцы печати индивидуального предпринимателя и подписей уполномоченных лиц, заверенные сотрудником Клиринговой организации.».

**6.** Дополнить раздел 4 «Порядок организации клирингового обслуживания Участников клиринга и предъявляемые к ним требования» новым пунктом 4.5 в следующей редакции:

«4.5. В целях присвоения кодов Участникам клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 4.11 настоящих Правил клиринга, в соответствии с требованиями нормативных правовых актов регулирующих органов, для заключения Договора об оказании клиринговых услуг, юридическим лицам, которые в соответствии с законодательством РФ являются:

- доверительным управляющим ценными бумагами;
- управляющей компанией паевого инвестиционного фонда;
- управляющей компанией, осуществляющей доверительное управление средствами пенсионных накоплений, сформированных в негосударственном пенсионном фонде;
- управляющей компанией, осуществляющей доверительное управление накоплениями для жилищного обеспечения военнослужащих

необходимо дополнительно предоставить в РДК (ЗАО) копию соответствующей лицензии, выданной уполномоченным органом на право осуществления соответствующего вида деятельности; а также, для управляющих средствами пенсионных накоплений, сформированных в НПФ, и управляющих накоплениями для жилищного обеспечения военнослужащих, необходимо предоставить информацию о коде/номере соответствующего инвестиционного портфеля.»

**7.** Пункт 4.5 раздела 4 «Порядок организации клирингового обслуживания Участников клиринга и предъявляемые к ним требования» считать пунктом 4.6, и в первом абзаце данного пункта слова «в пунктах 4.2.1, 4.2.6, 4.2.7, 4.3.1, 4.3.6 и 4.4» заменить на слова «в пунктах 4.2.1, 4.2.6, 4.2.7, 4.3.1, 4.3.6, 4.4 и 4.5», во втором абзаце - слова «в пунктах 4.2.2 – 4.2.5 и 4.3.2 – 4.3.5» заменить на слова «в пунктах 4.2.2 – 4.2.5, 4.3.2 – 4.3.5 и 4.5», в третьем - слова «в пунктах 4.2. - 4.4» заменить на слова «в пунктах 4.2. - 4.5».

**8.** Дополнить Раздел 4 «Порядок организации клирингового обслуживания Участников клиринга и предъявляемые к ним требования» новыми пунктами 4.7 и 4.8 в следующей редакции:

«4.7. В целях получения допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга обязан сообщить в Клиринговую организацию реквизиты своего Банковского Счета в форме Уведомления о реквизитах Банковского счета (по предусмотренной Регламентом форме У-БР). В случае необходимости изменения реквизитов Банковского Счета, 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.

Порядок зачисления и списания денежных средств по Банковскому счету Участника клиринга определяется соответствующим договором банковского счета, заключаемым между Участником клиринга и Аккредитованной кредитной организацией (далее – АКО).

4.8. В случае закрытия Банковского Счета Участника клиринга и/или несоблюдения Участником клиринга предусмотренного пунктом 4.7. настоящих Правил клиринга порядка информирования Клиринговой организации об изменении реквизитов Банковского Счета Участника клиринга, Клиринговая организация вправе ограничить клиринговое обслуживание такого Участника клиринга в целях недопущения совершения Сделок от имени такого Участника клиринга на Бирже.».

9. Пункты 4.6 – 4.8, 4.8.1-4.8.3 раздела 4 «Порядок организации клирингового обслуживания Участников клиринга и предъявляемые к ним требования» считать соответственно пунктами 4.9. – 4.11, 4.11.1-4.11.3. Пункт 4.8.4 исключить.

10. В новом пункте 4.11 слова ««федерального органа исполнительной власти в области финансовых рынков» заменить на слова «регулирующих органов».

11. Дополнить раздел 4 «Порядок организации клирингового обслуживания Участников клиринга и предъявляемые к ним требования» новым пунктом 4.12 в следующей редакции:

«4.12. Клиринговая организация информирует Участника клиринга о присвоенном ему коде не позднее следующего рабочего дня после допуска такого Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в форме отчетного документа «Уведомление о кодах регистрации Участника клиринга и об учетных регистрах Участника клиринга» (по предусмотренной Регламентом форме О-02).

Клиринговая организация информирует Участника клиринга о присвоенных кодах клиента не позднее следующего рабочего дня после регистрации клиентов и (или) клиентов клиента такого Участника клиринга в Системе клиринга в форме отчетного документа «Отчет о зарегистрированных клиентах.

Клиринговая организация информирует Участника клиринга о коде, присвоенном Оператору Участника клиринга, не позднее следующего рабочего дня после регистрации Оператора в Системе клиринга в форме отчетного документа «Уведомление о регистрации оператора Участника клиринга» (по предусмотренной Регламентом форме О-01).».

12. Пункты 4.9-4.15 раздела 4 «Порядок организации клирингового обслуживания Участников клиринга и предъявляемые к ним требования» считать соответственно пунктами 4.13-4.19.

13. В абзаце втором нового пункта 4.13 раздела 4 «Порядок организации клирингового обслуживания Участников клиринга и предъявляемые к ним требования» после слов «электронного документа» дополнить словами «(за исключением любых форм доверенностей)», слово «цифровой» исключить. В абзаце втором и пятом указанного пункта слово «ЭЦП» заменить словом «ЭП».

14. Новый пункт 4.16 раздела 4 «Порядок организации клирингового обслуживания Участников клиринга и предъявляемые к ним требования» дополнить последним предложением в следующей редакции:

«Учетные и иные регистры, указанные Участником клиринга в вышеуказанном Поручении, в целях настоящих Правил клиринга именуются обособленными клиентскими регистрами.».

**15.** Пункт 5.2 раздела 5 «Порядок использования средств, подтверждающих, что документ исходит от уполномоченного лица» изложить в следующей редакции:

«5.2. Клиринговая организация обеспечивает защищенность и целостность электронных сообщений, направляемых на Биржи, а также получаемых от Бирж, в результате применения комплекса организационных и технических мер, предусмотренных договорными отношениями между Клиринговой организацией и Биржами.

Обмен документами в форме электронных сообщений между Клиринговой организацией и Биржами в соответствии с настоящими Правилами клиринга может осуществляться путем установления технического двунаправленного доступа из Системы электронных торгов (далее – Система торгов) в Систему клиринга (и наоборот) либо без установления такого технического двунаправленного доступа с применением сертификатов ключей проверки электронных подписей, соответствующих требованиям Правил ЭДО и выданных уполномоченным лицам.

Электронное сообщение, переданное (полученное) с использованием сертификатов ключей проверки электронных подписей уполномоченных лиц, признается электронным документом, равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному уполномоченным на это лицом.»

**16.** В пункте 6.1 раздела 6 «Меры, направленные на управление рисками при осуществлении клиринга» слова «- контроль обеспеченности заявок в ходе торговых сессий на Бирже;» заменить на слова «- контроль обеспеченности заявок и/или сделок в ходе и по результатам торговых сессий на Бирже;».

**17.** В пункт 6.3 раздела 6 «Меры, направленные на управление рисками при осуществлении клиринга» слова «федеральным органом исполнительной власти в области финансовых рынков» заменить на слова «регулирующими органами».

**18.** В пункте 7.12 раздела 7 «Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу. Условия Соглашения об индивидуальном клиринговом обеспечении» исключить слова «или в электронном формате МТ542».

**19.** В пунктах 7.13.1 и 7.13.2 раздела 7 «Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу. Условия Соглашения об индивидуальном клиринговом обеспечении» заменить слова «форме П-12» на слова «форме П-13».

**20.** В пунктах 7.13.3 и 7.13.4 раздела 7 «Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу. Условия Соглашения об индивидуальном клиринговом обеспечении» заменить слова «форме П-13» на слова «форме П-14».

**21.** В пункте 7.14 раздела 7 «Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу. Условия Соглашения об индивидуальном клиринговом обеспечении» исключить слова «или в электронном формате МТ103» и заменить слова «14:00 по московскому времени» на слова «15:30 по московскому времени».

**22.** В пункте 7.16 раздела 7 «Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу. Условия Соглашения об индивидуальном клиринговом обеспечении» последнее предложение изложить в следующей редакции:

«При этом Клиринговая организация вправе осуществить Технологический перевод денежных средств и/или иных активов денежного обеспечения между денежными

позиционными регистрами Участника клиринга, за исключением списания денежных средств и/или иных активов денежного обеспечения с обособленных клиентских регистров.».

23. Изложить Раздел 8 «Порядок и условия допуска обязательств к клирингу. Взаимодействие с Биржей» в следующей редакции:

## **«РАЗДЕЛ 8. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ. ВЗАИМОДЕЙСТВИЕ С БИРЖЕЙ.»**

8.1. Обязательства из Сделок допускаются к клирингу на основании Сводного реестра сделок, направляемого Биржей в Клиринговую организацию по итогам торгов в соответствии с заключенным между Биржей и Клиринговой организацией Договором о взаимодействии.

8.2. Товарное обязательство (требование) Участника клиринга по Сделке определяется Клиринговой организацией в единицах измерения биржевого товара согласно Внутренним документам Биржи (с точностью до третьего знака после запятой) в размере Количества биржевого товара, указанного в параметрах Сделки в полученном от Биржи Сводном реестре сделок.

8.3. Денежное обязательство (требование) Участника клиринга по Сделке определяется Клиринговой организацией в российских рублях (с точностью до копеек по правилам математического округления) как произведение его товарного требования (обязательства) по этой Сделке и цены Сделки (включающей Налог на добавленную стоимость, далее – НДС), указанной в параметрах Сделки в полученном от Биржи Сводном реестре сделок.

8.4. Клиринговая организация уведомляет Биржу обо всех Участниках клиринга, обязательства которых из совершаемых на Бирже Сделок могут быть допущены к клирингу. В случае исключения организации из состава Участников клиринга, обязательства которых из совершаемых на Бирже Сделок допускаются к клирингу, а также при изменении организационно-правовой формы, наименования и иных касающихся вышеуказанных Участников клиринга данных, Клиринговая организация информирует об этом Биржу.

8.5. В соответствии с Договором о взаимодействии между Биржей и Клиринговой организацией Клиринговая организация направляет на Биржу уведомления при открытии, закрытии либо блокировке позиционных регистров Участников клиринга в Системе клиринга, а также в случаях предоставления либо прекращения полномочий Участников торгов по использованию позиционных регистров Участников клиринга для совершения Сделок на Бирже от имени этих Участников клиринга.

8.6. При организации взаимодействия между ЗАО «Биржа «Санкт-Петербург» и Клиринговой организацией до начала торговой сессии Клиринговая организация информирует Биржу о текущих значениях свободного единого (денежного) и товарного лимитов в отношении соответствующих позиционных регистров Участников клиринга в виде Уведомления о денежных и товарных лимитах.

8.7. В случае организации взаимодействия между Биржей и Клиринговой организацией с использованием технического двунаправленного доступа из Системы торгов в Систему клиринга (и наоборот) в ходе торгов, Клиринговая организация осуществляет контроль безопасности заявок.

8.7.1. В ходе проведения торговой сессии при каждой подаче Участником торгов заявки Биржа средствами Системы торгов передает в Систему клиринга Клиринговой организации Запрос на обеспечение поданной заявки.

8.7.1.1. При поступлении от Биржи Запроса на обеспеченность заявки на покупку с указанием в ней денежного позиционного регистра в Системе клиринга проверяется возможность уменьшения текущего значения свободного единого (по сумме активов денежного обеспечения) лимита по данному регистру Участника клиринга на величину произведения Ставки денежной обеспеченности заявки покупателя, указанной в заявке цены и объема заявки в товарном выражении (определяется как произведение количества лотов в заявке и размера одного биржевого лота по соответствующему биржевому инструменту). Вышеуказанное произведение представляет собой размер денежного обеспечения заявки на покупку. При возможности такого уменьшения (в пределах текущего значения свободного единого лимита) Клиринговая организация уменьшает текущее значение свободного единого лимита на размер денежного обеспечения заявки на покупку и направляет на Биржу Уведомление об обеспеченности заявки, в противном случае – Уведомление о необеспеченности заявки.

8.7.1.2. При поступлении от Биржи Запроса на обеспеченность заявки на продажу с указанием в ней денежного позиционного регистра в Системе клиринга проверяется возможность уменьшения текущего значения свободного единого (по сумме активов денежного обеспечения) лимита по данному регистру Участника клиринга на величину произведения Ставки денежной обеспеченности заявки продавца и объема заявки в товарном выражении. Вышеуказанное произведение представляет собой размер денежного обеспечения заявки на продажу. При возможности такого уменьшения (в пределах текущего значения свободного единого лимита) Клиринговая организация уменьшает текущее значение свободного единого лимита на размер денежного обеспечения заявки на продажу и направляет на Биржу Уведомление об обеспеченности заявки, в противном случае – Уведомление о необеспеченности заявки.

8.7.1.3. Текущее значение свободного единого лимита по денежному позиционному регистру уменьшается в Системе клиринга при осуществлении контроля обеспеченности заявок в следующем порядке: в первую очередь уменьшение происходит за счет имущественных прав по банковским гарантиям, учитываемым как вид актива денежного обеспечения на этом регистре, во вторую очередь – за счет денежных средств, учитываемых как вид актива денежного обеспечения на этом регистре.

8.7.1.4. При поступлении от Биржи Запроса на обеспеченность заявки на продажу с указанием в ней товарного позиционного регистра в Системе клиринга проверяется возможность уменьшения текущего значения свободного товарного лимита (в отношении указанного в заявке биржевого товара) по данному регистру Участника клиринга на величину произведения Ставки товарной обеспеченности заявки продавца и объема заявки в товарном выражении. Вышеуказанное произведение представляет собой размер товарного обеспечения заявки. При возможности такого уменьшения (в пределах текущего значения свободного товарного лимита) Клиринговая организация уменьшает текущее значение свободного товарного лимита на размер товарного обеспечения заявки и направляет на Биржу Уведомление об обеспеченности заявки, в противном случае – Уведомление о необеспеченности заявки.

8.7.2. В ходе проведения торговой сессии при снятии каждой заявки, в отношении которой на Биржу от Клиринговой организации поступило Уведомление о ее

обеспеченности, Биржа средствами Системы торгов передает в Систему клиринга Клиринговой организации Уведомление о снятии заявки.

8.7.2.1. При поступлении от Биржи Уведомления о снятии заявки, имеющей денежное обеспечение, в Системе клиринга увеличивается текущее значение свободного единого лимита по соответствующему денежному позиционному регистру Участника клиринга на величину денежного обеспечения этой заявки.

8.7.2.2. При поступлении от Биржи Уведомления о снятии заявки на продажу, поданной с указанием товарного позиционного регистра, в Системе клиринга увеличивается текущее значение свободного товарного лимита (в отношении указанного в заявке биржевого товара) по данному товарному регистру Участника клиринга на величину товарного обеспечения этой заявки.

8.7.3. В ходе проведения торговой сессии при заключении каждой Сделки Биржа средствами Системы торгов передает в Систему клиринга Клиринговой организации Уведомление о заключении сделки. При этом Клиринговая организация осуществляет проверку направления на Биржу Уведомлений об обеспеченности заявок, на основании которых совершена вышеуказанная Сделка, а также проводит сверку параметров этой Сделки и содержащихся в Системе клиринга параметров заявок, на основании которых эта Сделка совершена. В случае их несовпадения (за исключением условий, предусмотренных в пунктах 8.7.3.1. и 8.7.3.2. настоящих Правил клиринга) Клиринговая организация не принимает Уведомление о заключении сделки и передает на Биржу Уведомление об ошибке.

8.7.3.1. При поступлении от Биржи Уведомления о заключении сделки, цена которой ниже цены, указанной в соответствующей заявке на покупку, в Системе клиринга увеличивается текущее значение свободного единого лимита по соответствующему денежному позиционному регистру Участника клиринга – Покупателя на величину произведения Ставки денежной обеспеченности заявки покупателя, объема заявки (Сделки) в денежном выражении и положительной разницы между ценой, указанной в заявке, и ценой Сделки. При этом в Системе клиринга пересчитывается (уменьшается) денежное обеспечение соответствующей заявки на покупку.

8.7.3.2. При поступлении от Биржи Уведомления о заключении сделки, денежный объем которой меньше объема заявки на покупку в денежном выражении (произведение цены заявки, количества лотов в заявке и размера одного биржевого лота по соответствующему биржевому товару), поданной не на условиях «все или отклонить», в Системе клиринга увеличивается текущее значение свободного единого лимита по соответствующему денежному позиционному регистру Участника клиринга – Покупателя на величину произведения Ставки денежной обеспеченности заявки покупателя и положительной разницы между объемами заявки и заключенной Сделки в денежном выражении. При этом в Системе клиринга пересчитывается (уменьшается) денежное обеспечение соответствующей заявки на покупку.

8.8. Обмен документами, указанными в пункте 8.7. настоящих Правил клиринга, между Биржей и Клиринговой организацией осуществляется в форме обмена электронными сообщениями, соответственно, Системы торгов и Системы клиринга путем установления технического двунаправленного доступа из Системы торгов в Систему клиринга (и наоборот) с использованием средств, подтверждающих, что документ исходит от уполномоченного на это лица, в порядке, установленном в пункте 5.2. настоящих Правил клиринга.



8.9. В случае осуществления Клиринговой организацией контроля обеспеченности заявок в ходе торгов (в соответствии с пунктом 8.7 настоящих Правил клиринга) при осуществлении допуска обязательств к клирингу Клиринговая организация осуществляет сверку всех параметров Сделок в Сводном реестре сделок и содержащихся в Системе клиринга данных из Уведомлений о заключении сделок, направляемых Биржей в Клиринговую организацию в ходе торговых сессий с учетом требований пункта 8.7.3. настоящих Правил клиринга.

Клиринговая организация не допускает к клирингу обязательства из Сделки, в случае если в отношении такой Сделки Клиринговая организация не принимала от Биржи Уведомление о заключении сделки или в случае несовпадения параметров такой Сделки в Сводном реестре сделок и ее параметров в Уведомлении о заключении сделки. В предусмотренных выше случаях Клиринговая организация передает на Биржу Уведомление об ошибке в отношении полученного Сводного реестра сделок.

При положительном результате сверки всех параметров Сделок в Сводном реестре сделок и содержащихся в Системе клиринга данных из Уведомлений о заключении сделок, направляемых Биржей в Клиринговую организацию в ходе торговых сессий, Клиринговая организация допускает к клирингу обязательства из Сделок. При этом указанные в пункте 8.7 настоящих Правил клиринга денежное и товарное обеспечение заявок признаются соответственно денежным и товарным обеспечением Сделок.

8.10. При организации взаимодействия между ЗАО «Биржа «Санкт-Петербург» и Клиринговой организацией после получения от Биржи Сводного реестра сделок Клиринговая организация проводит его сверку в целях осуществления допуска обязательств к клирингу.

8.10.1. Клиринговая организация не допускает к клирингу обязательства из всех Сделок, указанных в Сводном реестре сделок, в случае если денежное или товарное обеспечение, требуемое для таких Сделок, превышает соответствующее значение свободного единого (денежного) или товарного лимита, указанного в переданном на Биржу Клиринговой организацией Уведомлении о денежных и товарных лимитах. В предусмотренных выше случаях Клиринговая организация передает на Биржу Уведомление об ошибке в отношении полученного Сводного реестра сделок.

8.10.2. При допуске к клирингу обязательств из Сделок на основании Сводного реестра сделок, указанного в пункте 8.10. настоящих Правил клиринга, в Системе клиринга производится уменьшение текущих значений свободных единых и товарных лимитов в размере, соответственно, денежного и товарного обеспечения по Сделкам.

8.10.3. Денежное обеспечение по Сделкам на покупку определяется в разрезе денежных позиционных регистров Участников клиринга как сумма произведений Ставок денежной обеспеченности и объема соответствующих Сделок в денежном выражении (совершенных с указанием данного денежного позиционного регистра). Денежное обеспечение по Сделкам на продажу определяется в разрезе денежных позиционных регистров Участников клиринга как сумма произведений Ставок денежной обеспеченности и объема соответствующих Сделок в товарном выражении (совершенных с указанием данного денежного позиционного регистра).

8.10.4. Товарное обеспечение по Сделкам определяется в отношении каждого из переданных на Биржу товарных лимитов (в разрезе товарных позиционных регистров Участников клиринга) как сумма произведений Ставок товарной обеспеченности и объема соответствующих Сделок в товарном выражении (совершенных с указанием данного товарного позиционного регистра).».

**24.** Пункт 9.1.1 раздела 9 «Порядок проведения клиринга» изложить в следующей редакции:

«9.1.1. В общий клиринговый пул включаются допущенные к клирингу денежные обязательства Участников клиринга – Покупателей, Дата начала контроля обеспечения по которым наступила и прекращение которых осуществляется в момент и в порядке, установленном в настоящем Разделе Правил клиринга.

Если иное не установлено внутренними документами Биржи, Дата начала контроля обеспечения денежных обязательств определяется в Системе клиринга для всех Сделок как первый рабочий день после даты совершения Сделки (дата «Т+1», где «Т» - дата заключения Сделки).».

**25.** Пункт 9.15 раздела 9 «Порядок проведения клиринга» изложить в следующей редакции:

«9.15. Участники клиринга – контрагенты по Сделке вправе инициировать прекращение всех обязательств по такой Сделке по соглашению сторон. В этих целях оба Участника клиринга – контрагента по Сделке должны направить в Клиринговую организацию Уведомление о взаимном прекращении обязательств по сделке (в предусмотренной Регламентом форме 3-05). Неустойка по такой сделке не взимается.

Прекращение обязательств по Сделкам по соглашению Сторон оформляется распоряжением Генерального директора Клиринговой организации на основании предоставленных в Клиринговую организацию вышеуказанных Уведомлений со стороны обоих контрагентов по таким Сделкам.».

**26.** В пункте 9.17 раздела 9 «Порядок проведения клиринга» первое предложение изложить в следующей редакции:

«Решение о признании Несостоятельности Участников клиринга по Сделкам принимается Генеральным директором Клиринговой организации.».

**27.** В пункте 9.18.5 раздела 9 «Порядок проведения клиринга» в последнем предложении после слов «Участника клиринга» поставить запятую и дополнить словами «за исключением списания денежных средств с обособленных клиентских регистров.».

**28.** Пункт 9.18.6 раздела 9 «Порядок проведения клиринга» дополнить новым предложением в следующей редакции:

«В этом случае Генеральным директором Клиринговой организации принимается решение об исключении обязательств по такой сделке из общего клирингового пула без их прекращения.».

**29.** В разделе 10 «Порядок исполнения обязательств по итогам клиринга. Порядок проведения операций по клиринговым счетам» исключить пункт 10.2 и пункты 10.3 – 10.5 считать пунктами 10.2 – 10.4.

**30.** Пункты 11.3 и 11.4 раздела 11 «Перечень учетных и иных регистров, их назначение и порядок ведения» изложить в следующей редакции:

«11.3. Каждый денежный позиционный регистр Участника клиринга имеет следующие значения:

- начальные значения (на начало рабочего дня) по каждому активу денежного обеспечения;
- текущие значения свободного денежного лимита (в т.ч. на начало и на конец рабочего дня);
- текущие значения свободного лимита по банковским гарантиям (в т.ч. на начало и на конец рабочего дня);
- текущие значения свободного единого лимита (в т.ч. на начало и на конец рабочего дня);
- итоговые значения (на конец рабочего дня) по каждому активу денежного обеспечения. Вышеуказанные значения не могут быть отрицательными в Системе клиринга.

11.3.1. Значения свободного денежного лимита по позиционному регистру определяются в Системе клиринга по следующей формуле:

$$L_c = S_c + C_c - D_c - B_c - P_c - R_c, \text{ где}$$

$L_c$  – текущее значение свободного денежного лимита (по позиционному регистру);

$S_c$  – значение свободного денежного лимита (по позиционному регистру) на начало рабочего дня;

$C_c$  – зачисления денежных средств на соответствующий позиционный регистр в ходе рабочего дня (до определения текущего значения свободного денежного лимита);

$D_c$  – списания денежных средств с соответствующего позиционного регистра в ходе рабочего дня (до определения текущего значения свободного денежного лимита);

$B_c$  – суммарный размер денежного обеспечения заявок (поданных с указанием соответствующего денежного позиционного регистра), порядок определения которого установлен в пункте 8.7 настоящих Правил клиринга и за счет денежных средств, учитываемых как вид актива денежного обеспечения;

$P_c$  – суммарный размер денежного обеспечения Сделок на покупку (обязательства из которых допущены к клирингу в текущем дне, но не имеющих в Системе клиринга статуса Подтвержденных к поставке Сделок), порядок определения которого установлен пунктами 8.9 и 8.10.3 настоящих Правил клиринга и за счет денежных средств, учитываемых как вид актива денежного обеспечения;

$R_c$  – суммарный размер денежного обеспечения Сделок на продажу (обязательства из которых допущены к клирингу в текущем дне и не прекращены в клиринговом пуле), порядок определения которого установлен пунктами 8.9 и 8.10.3 настоящих Правил клиринга и за счет денежных средств, учитываемых как вид актива денежного обеспечения.

11.3.2. Значения свободного лимита по банковским гарантиям определяются в Системе клиринга по следующей формуле:

$$L_g = S_g + C_g - D_g - B_g - P_g - R_g, \text{ где}$$

$L_g$  – текущее значение свободного лимита по банковским гарантиям (по позиционному регистру);

$S_g$  – значение свободного лимита по банковским гарантиям (по позиционному регистру) на начало рабочего дня;

$S_g$  – зачисления имущественных прав по банковским гарантиям на соответствующий позиционный регистр в ходе рабочего дня (до определения текущего значения свободного лимита по банковским гарантиям);

$D_g$  – списания имущественных прав по банковским гарантиям с соответствующего позиционного регистра в ходе рабочего дня (до определения текущего значения свободного лимита по банковским гарантиям);

$B_g$  – суммарный размер денежного обеспечения заявок (поданных с указанием соответствующего денежного позиционного регистра), порядок определения которого установлен в пункте 8.7 настоящих Правил клиринга и за счет имущественных прав по банковским гарантиям, учитываемым как вид актива денежного обеспечения;

$P_g$  – суммарный размер денежного обеспечения Сделок на покупку (обязательства из которых допущены к клирингу в текущем дне, но не имеющих в Системе клиринга статуса Подтвержденных к поставке Сделок), порядок определения которого установлен пунктами 8.9 и 8.10.3 настоящих Правил клиринга и за счет имущественных прав по банковским гарантиям, учитываемым как вид актива денежного обеспечения;

$R_g$  – суммарный размер денежного обеспечения Сделок на продажу (обязательства из которых допущены к клирингу в текущем дне и не прекращены в клиринговом пуле), порядок определения которого установлен пунктами 8.9 и 8.10.3 настоящих Правил клиринга и за счет имущественных прав по банковским гарантиям, учитываемым как вид актива денежного обеспечения.

11.3.3. Значения свободного единого лимита определяются в Системе клиринга по следующей формуле:

$$L_e = L_c + L_g.$$

11.4. Каждый клиринговый регистр Участника клиринга имеет следующие значения:

- начальные значения (на начало рабочего дня);
- текущие значения свободного денежного лимита (в т.ч. на начало и на конец рабочего дня);
- итоговые значения (на конец рабочего дня).

Вышеуказанные значения не могут быть отрицательными в Системе клиринга.

Значения свободного денежного лимита по клиринговому регистру определяются в Системе клиринга по следующей формуле:

$$L_p = S_p + C_p - D_p - M_p, \text{ где}$$

$L_p$  – текущее значение свободного денежного лимита (по клиринговому регистру);

$S_p$  – значение свободного денежного лимита (по клиринговому регистру) на начало рабочего дня;

$C_p$  – зачисления на соответствующий клиринговый регистр в ходе рабочего дня (до определения текущего значения свободного денежного лимита);

$D_p$  – списания с соответствующего клирингового регистра в ходе рабочего дня (до определения текущего значения свободного денежного лимита);

Mr – суммарный размер допущенных к клирингу в текущем дне и не прекращённых денежных обязательств из Сделок, Контроль обеспечения которых проведен (по соответствующему клиринговому регистру) в общем клиринговом пуле.».

**31.** Пункт 11.7 раздела 11 «Перечень учетных и иных регистров, их назначение и порядок ведения» изложить в следующей редакции:

«11.7. Каждый товарный позиционный регистр Участника клиринга имеет следующие значения:

- начальные значения (на начало рабочего дня) по каждому биржевому товару;
- текущие значения свободного товарного лимита (в т.ч. на начало и на конец рабочего дня) по каждому биржевому товару;
- итоговые значения (на конец рабочего дня) по каждому биржевому товару.

Вышеуказанные значения не могут быть отрицательными в Системе клиринга.

Начальные (отличные от нуля) значения по товарным позиционным регистрам Участников клиринга устанавливаются в Системе клиринга на основании информации, передаваемой в Клиринговую организацию Контролерами поставки по соответствующему биржевому товару или Биржей.

Значения свободного товарного лимита по биржевому товару определяются в Системе клиринга по следующей формуле:

$$L_m = S_m + C_m - D_m - V_m - O_m, \text{ где}$$

$L_m$  – текущее значение свободного товарного лимита по биржевому товару (m);

$S_m$  – значение свободного товарного лимита на начало рабочего дня по биржевому товару (m);

$C_m$  – зачисления на соответствующий позиционный регистр в ходе рабочего дня (до определения текущего значения свободного товарного лимита) по биржевому товару (m);

$D_m$  – списания с соответствующего позиционного регистра в ходе рабочего дня (до определения текущего значения свободного товарного лимита) по биржевому товару (m);

$V_m$  – суммарный размер товарного обеспечения заявок (поданных с указанием соответствующего товарного позиционного регистра по биржевому товару (m)), порядок определения которого установлен в пункте 8.7 настоящих Правил клиринга;

$O_m$  – суммарный размер товарного обеспечения Сделок (обязательства из которых допущены к клирингу в текущем дне) по биржевому товару (m), порядок определения которого установлен пунктами 8.9 и 8.10.4 настоящих Правил клиринга.».

**32.** В пункте 11.11 раздела 11 «Перечень учетных и иных регистров, их назначение и порядок ведения» исключить слова «или в электронном формате МТ999».

**33.** Пункты 12.2 и 12.3 раздела 12 «Порядок предоставления Участникам клиринга отчетных документов по итогам клиринга» изложить в следующей редакции:

«12.2. Отчетные документы по итогам клиринга предоставляются Участникам клиринга в электронном виде посредством УРМ и/или путем рассылки по адресам электронной почты, специально предоставленным Клиринговой организацией каждому Участнику клиринга или указанным в Анкете участника клиринга. Для получения отчетных документов в форме электронных документов посредством УРМ Участник клиринга

обязан выполнить условия, устанавливаемые Правилами ЭДО, а также иметь доступ к Системе клиринга через УРМ.

12.3. Предоставление отчетных документов по итогам клиринга в бумажной форме либо повторное предоставление отчетных документов в форме электронных документов осуществляется только по соответствующему Запросу Участника клиринга по предусмотренной Регламентом форме 3-06. При этом отчетные документы на основании вышеуказанного запроса в бумажной форме направляются Участнику клиринга по почте или выдаются в офисе Клиринговой организации представителю Участника клиринга, имеющему соответствующие полномочия на основании доверенности.»

34. В пункте 15.2 раздела 15 «Конфиденциальность» слова федеральному органу исполнительной власти в области финансовых рынков» заменить на слова «Банку России».

35. Изложить приложения 2 - 4 в следующей редакции:



**Приложение 3**  
к Правилам осуществления  
клиринговой деятельности РДК (ЗАО)  
по сделкам с реальным товаром

<p><b>АНКЕТА УЧАСТНИКА КЛИРИНГА</b> <b>(физического лица/индивидуального предпринимателя)</b> <i>(нужное подчеркнуть)</i></p>	<p>Идентификатор участника</p> <hr/>
<p>ФИО _____ <i>(ФИО полностью)</i></p>	
<p>ИНН <i>(при наличии)</i>/КПП <i>(для ИП)</i> _____ / _____ Гражданство _____ Документ, удостоверяющий личность _____ <i>(паспорт, удостоверение личности, иное)</i> Серия _____ Номер _____ Код подразделения _____ Выдан «__» _____ г. <i>(наименование организации, выдавшей документ)</i></p>	
<p>Заполняется ИП: Свидетельство о регистрации _____ Дата гос. регистрации «__» _____ г. Регистрирующий орган _____ <i>(наименование организации, выдавшей документ)</i></p>	
<p>Лицензия биржевого брокера № _____ Место выдачи _____ Дата выдачи _____ Срок действия _____</p>	
<p>Адрес регистрации (прописки): Страна: _____ Индекс _____ Регион _____ Район _____ Город _____ Улица _____ Дом _____ Корпус _____ Квартира _____ Адрес для корреспонденции (почтовый) <i>(заполняется в случае отличия от адреса регистрации (прописки))</i>: Страна: _____ Индекс _____ Регион _____ Район _____ Город _____ Улица _____ Дом _____ Корпус _____ Квартира _____ Телефоны/факс _____ <i>(междугородный код и номер телефона)</i> Адрес электронной почты для направления отчетных документов Клиринговой организации _____ Дополнительная информация _____</p>	
<p><b>Подпись Участника клиринга:</b> _____ / _____ <i>подпись</i> <i>расшифровка подписи</i> «__» _____ 20__ г. <i>(дата заполнения анкеты)</i></p>	
<p>В соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» я даю согласие Закрытому акционерному обществу «Расчетно-депозитарная компания», место нахождения: Российская Федерация, 115419, г. Москва, 2-й Верхний Михайловский пр-д, д. 9, стр. 2 (далее – Клиринговая организация) на проверку и обработку, включая сбор, запись,</p>	



систематизацию, накопление, хранение, уточнение (обновление, изменение), извлечение, использование, передачу (распространение, предоставление, доступ), обезличивание, блокирование, удаление, уничтожение персональных данных, указанных в настоящей анкете, предоставляемых в РДК (ЗАО) иным способом или полученных РДК (ЗАО) в процессе исполнения договора, с использованием средств автоматизации и/или без использования таких средств, в целях исполнения договорных обязательств, соблюдения законодательства, в целях информирования меня о продуктах и услугах, разработанных Клиринговой организацией, а также в целях раскрытия на сайте РДК (ЗАО) ряда данных, таких как ФИО, ИНН, адрес, контактные данные. Клиринговая организация вправе проверить достоверность предоставленных мною персональных данных, в том числе, с использованием услуг других операторов, а также использовать информацию о неисполнении и/или ненадлежащем исполнении договорных обязательств при рассмотрении вопросов о предоставлении других услуг и заключении новых договоров.

Согласие предоставляется с момента подписания настоящего документа и действительно бессрочно. Субъект персональных данных вправе отозвать настоящее согласие, письменно уведомив об этом РДК (ЗАО). Настоящим участник клиринга гарантирует и подтверждает, что им получены согласия на обработку РДК (ЗАО) персональных данных всех субъектов персональных данных, персональные данные которых предоставляются им в РДК (ЗАО), а также что все такие субъекты персональных данных проинформированы об обработке их персональных данных РДК (ЗАО).

« \_\_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ г. \_\_\_\_\_ / \_\_\_\_\_

**АНКЕТА УЧАСТНИКА КЛИРИНГА  
(иностранного юридического лица)**

Идентификатор  
участника  
\_\_\_\_\_

Организация \_\_\_\_\_  
*(полное наименование юридического лица с указанием организационно-правовой формы)*

Юрисдикция \_\_\_\_\_

Код иностранной организации (КИО) \_\_\_\_\_

Наименование и номер документа о регистрации юридического лица:

Дата выдачи документа \_\_\_\_\_

Регистрирующий орган \_\_\_\_\_

Место нахождения (в точном соответствии с Уставом Организации)

Почтовый адрес / Адрес для направления корреспонденции (с указанием индекса)

Телефоны/факс \_\_\_\_\_  
*(междугородный код и номер телефона)*

Адрес электронной почты для направления отчетных документов Клиринговой организации

Контактное лицо: \_\_\_\_\_

Настоящим участник клиринга гарантирует и подтверждает, что им получены согласия на обработку РДК (ЗАО) персональных данных всех субъектов персональных данных, персональные данные которых предоставляются им в РДК (ЗАО), а также что все такие субъекты персональных данных проинформированы об обработке их персональных данных РДК (ЗАО).

**Подпись участника клиринга:**

\_\_\_\_\_  
*подпись* / \_\_\_\_\_  
*наименование должности, ФИО уполномоченного лица Организации*

МП

«\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

36. Пункты 1 и 4 приложения 8 «Формы отчетных документов по итогам клиринга для Участников клиринга» изложить в следующей редакции:

**1. Сводный отчет об обязательствах и требованиях Участника клиринга**

**Форма О-03**

Участник клиринга: <Наименование, Код, Идентификатор>

**Денежные обязательства**

Номер клирингового регистра / регистра учета денежных обязательств <1>:

№ сделки	Код товара	Контрагент	Дата заключения	Дата начала контроля обеспечения	Дата обеспечения	Дата завершения поставки	Статус	Денежное обязательство на дату заключения, руб.	В т.ч. НДС, руб.	Товарное обязательство на дату заключения, тонн	Денежное обязательство на текущую дату, руб.	Товарное обязательство на текущую дату, тонн	Денежное обеспечение по сделке, руб.	Денежный позиционный регистр	Сумма сбора РДК (ЗАО)

Номер клирингового регистра / регистра учета денежных обязательств <n>:

№ сделки	Код товара	Контрагент	Дата заключения	Дата начала контроля обеспечения	Дата обеспечения	Дата завершения поставки	Статус	Денежное обязательство на дату заключения, руб.	В т.ч. НДС, руб.	Товарное обязательство на дату заключения, тонн	Денежное обязательство на текущую дату, руб.	Товарное обязательство на текущую дату, тонн	Денежное обеспечение по сделке, руб.	Денежный позиционный регистр	Сумма сбора РДК (ЗАО)

**Товарные обязательства**

Номер клирингового регистра / регистра учета товарных обязательств <1>:

№ сделки	Код товара	Контрагент	Дата заключения	Дата начала контроля обеспечения	Дата обеспечения	Дата завершения поставки	Статус	Денежное обязательство на дату заключения, руб.	В т.ч. НДС, руб.	Товарное обязательство на дату заключения, тонн	Денежное обязательство на текущую дату, руб.	Товарное обязательство на текущую дату, тонн	Денежное обеспечение по сделке, руб.	Денежный позиционный регистр	Сумма сбора РДК (ЗАО)

Номер клирингового регистра / регистра учета товарных обязательств <n>:

№ сделки	Код товара	Контрагент	Дата заключения	Дата начала контроля обеспечения	Дата обеспечения	Дата завершения поставки	Статус	Денежное обязательство на дату заключения, руб.	В т.ч. НДС, руб.	Товарное обязательство на дату заключения, тонн	Денежное обязательство на текущую дату, руб.	Товарное обязательство на текущую дату, тонн	Денежное обеспечение по сделке, руб.	Денежный позиционный регистр	Сумма сбора РДК (ЗАО)

#### 4. Отчет о движении средств по клиринговым регистрам Участника клиринга

Форма О-06

Участник клиринга: <Наименование, Код, Идентификатор>

**Номер регистра:**

Начальное значение (на начало дня): \_\_\_\_\_ руб.

В т.ч. свободно (на начало дня): \_\_\_\_\_ руб.

Номер операции	Сумма по операции, руб.				Значения по регистру после операции, руб.		Номер сделки
	Зачисление	Списание	Блокировка	Разблокировка	Итого на регистре	В т.ч. свободно	

Итого на регистре (на конец дня): \_\_\_\_\_ руб.

В т.ч. свободно (на конец дня): \_\_\_\_\_ руб.

**Номер регистра:**

Начальное значение (на начало дня): \_\_\_\_\_ руб.

В т.ч. свободно (на начало дня): \_\_\_\_\_ руб.

Номер операции	Сумма по операции, руб.				Значения по регистру после операции, руб.		Номер сделки
	Зачисление	Списание	Блокировка	Разблокировка	Итого на регистре	В т.ч. свободно	

Итого на регистре (на конец дня): \_\_\_\_\_ руб.

В т.ч. свободно (на конец дня): \_\_\_\_\_ руб.