



Утверждены
Советом директоров РДК (ЗАО)
Протокол № СД-5/2015 от 14 апреля 2015 года

Председатель Совета директоров

В.А. Серегин

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

Внести в Правила осуществления клиринговой деятельности Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» на срочном рынке ЗАО «СПБМТСБ», утвержденные Советом директоров РДК (ЗАО) (протокол № СД-18/2014 от 25.12.2014г.) (далее – Правила клиринга) следующие изменения и дополнения:

1. Термин «Расчетная организация» в пункте 1 Статьи 01.01 Раздела 01 Правил клиринга изложить в следующей редакции:

«Расчетная организация кредитная организация, проводящая расчеты по итогам торгов на основании соответствующих поручений Клиринговой организации к Счету Клиринговой организации в соответствии с договором, заключенным с Клиринговой организацией.

Уполномоченными Расчетными организациями являются АО «АЛЬФА-БАНК», ОАО Банк ВТБ, Банк ГПБ (АО), ОАО «Сбербанк России», Банк «ВБРР» (АО), НКО ЗАО НРД. »

2. Удалить из пункта 1 Статьи 01.01 Раздела 01 Правил клиринга термин «Регулирующие органы».
3. По тексту Правил клиринга заменить термин «Нормативные правовые акты регулирующих органов» термином «Нормативные акты Банка России».
4. По тексту Правил клиринга заменить термин «Регулирующие органы» термином «Банк России».
5. Дополнить Статью 02.01 Раздела 02 Правил клиринга пунктом 20 в следующей редакции:

«20. После получения Клиринговой организацией копии документа, являющегося основанием для обращения взыскания, наложения ареста на имущество, находящееся на клиринговых счетах, и принадлежащее Участнику клиринга, а также приостановления операций по клиринговому счету, Клиринговая организация определяет размер денежных средств данного Участника клиринга,

оставшихся после исполнения (прекращения) обязательств данного Участника клиринга по итогам клиринга, в день, когда Клиринговая организация получила указанные документы. При определении указанного размера денежных средств не учитываются денежные средства, предоставленные в обеспечение и/или в оплату обязательств из договоров, заключенных данным Участником клиринга за счет Клиентов данного Участника клиринга.»

6. Пункт 8 Статьи 02.04 Раздела 02 Правил клиринга изложить в следующей редакции:

«8. Несоблюдение Общим клиринговым участником либо Индивидуальным клиринговым участником любого из требований, установленных пунктом 7 настоящей статьи, обращение взыскания, наложение ареста на имущество, находящееся на клиринговых счетах, и принадлежащее Участнику клиринга, а также введение процедур банкротства в отношении Участника клиринга, а в отношении Участника клиринга - кредитной организации также отзыв лицензии на осуществление банковских операций, может являться основанием для недопущения к клиринговому обслуживанию или ограничения/прекращения допуска к клиринговому обслуживанию данного Участника клиринга.»

7. В подпункте а) пункта 6 Статьи 02.07 Раздела 02 Правил клиринга заменить термин «Нормативно правовые акты» термином «Нормативные правовые акты».

8. В первом абзаце пункта 3 Статьи 04.02 Раздела 04 Правил клиринга заменить термин «Отчет о движении средств» термином «Отчет об обеспечении».

9. Пункт 9 Статьи 04.02 Раздела 04 Правил клиринга изложить в следующей редакции:

«9. Возврат денежных средств в рублях из состава депозитной маржи Участника клиринга осуществляется по распоряжению данного Участника клиринга на Банковский счет Участника клиринга, либо путем перевода денежных средств в состав гарантийного вноса, вносимого для денежного обеспечения Договоров поставки в секции «Нефтепродукты» в соответствии со статьей 07.14 Правил клиринга.

В случае если исполнение Распоряжения на возврат денежных средств в рублях из состава депозитной маржи Участника клиринга может привести к задолженности по депозитной марже данного Участника клиринга, Распоряжение на возврат денежных средств не исполняется.

После получения Клиринговой организацией копии документа, являющегося основанием для обращения взыскания, наложения ареста на имущество, находящееся на клиринговых счетах, и принадлежащее Участнику клиринга, а также приостановления операций по клиринговому счету, Распоряжение на возврат денежных средств в рублях из состава депозитной маржи Участника клиринга, в котором указаны торговые регистры для учета депозитной маржи, предоставленной в обеспечение обязательств Участника клиринга, не исполняется.

Распоряжение на возврат денежных средств в рублях из состава депозитной маржи Участника клиринга подается по форме, установленной Операционным регламентом. В Распоряжении на возврат денежных средств обязательно указываются реквизиты Банковского Счета Участника клиринга, а также код торгового регистра Участника клиринга.»

10. Пункт 11 Статьи 04.02 Раздела 04 Правил клиринга изложить в следующей редакции:

«11. Возврат денежных средств в иностранной валюте из состава депозитной маржи Участника клиринга осуществляется по распоряжению данного Участника клиринга на Банковский счет Участника клиринга в иностранной валюте.

В случае если исполнение Распоряжения на возврат денежных средств в иностранной валюте из состава депозитной маржи Участника клиринга может привести к задолженности по депозитной марже данного Участника клиринга, Распоряжение на возврат денежных средств не исполняется.

После получения Клиринговой организацией копии документа, являющегося основанием для обращения взыскания, наложения ареста на имущество, находящееся на клиринговых счетах, и принадлежащее Участнику клиринга, а также приостановления операций по клиринговому счету, Распоряжение на возврат денежных средств в иностранной валюте из состава депозитной маржи Участника клиринга, в котором указаны торговые регистры для учета депозитной маржи, предоставленной в обеспечение обязательств Участника клиринга, не исполняется.

Распоряжение на возврат денежных средств в иностранной валюте из состава депозитной маржи Участника клиринга подается по форме, установленной Операционным регламентом. В Распоряжении на возврат денежных средств обязательно указываются реквизиты Банковского Счета Участника клиринга в иностранной валюте, а также код торгового регистра Участника клиринга.»

11. Дополнить пункт 11 Статьи 04.03 Раздела 04 Правил клиринга следующим абзацем:

«После получения Клиринговой организацией копии документа, являющегося основанием для обращения взыскания, наложения ареста на имущество, находящееся на клиринговых счетах, и принадлежащее Участнику клиринга, а также приостановления операций по клиринговому счету, Распоряжение на возврат денежных средств из состава взноса в Коллективный гарантийный фонд такого Участника клиринга не исполняется.»

12. Пункт 12 Статьи 04.03 Раздела 04 Правил клиринга изложить в следующей редакции:

«12. Изъятие денежных средств из состава взноса Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд осуществляется по распоряжению данного Участника клиринга. Распоряжение на возврат денежных средств подается по форме, установленной Операционным регламентом. В Распоряжении на возврат денежных средств обязательно указываются реквизиты Банковского Счета Участника клиринга, а также код регистра учета взноса Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд.»

13. Дополнить пункт 17 Статьи 04.03 Раздела 04 Правил клиринга следующим абзацем:

«— Если в последний день истекшего квартала у Участника клиринга отсутствует взнос в Коллективный гарантийный фонд, а также ему прекращен допуск к клиринговому обслуживанию, то доля средств этого Участника клиринга считается равной нулю.»

14. Пункт 10 Статьи 04.04 Раздела 04 Правил клиринга изложить в следующей редакции:

«10. Возврат денежных средств в рублях из состава поставочной маржи Участника клиринга осуществляется по распоряжению данного Участника клиринга на Банковский счет Участника клиринга при отсутствии у данного Участника клиринга задолженности по депозитной марже.

В случае если исполнение Распоряжения на возврат денежных средств в рублях из состава поставочной маржи Участника клиринга может привести к превышению Требования к размеру поставочной маржи по портфелю позиций над Размером поставочной маржи на соответствующем регистре учета поставочной маржи, Распоряжение на возврат денежных средств не исполняется.

После получения Клиринговой организацией копии документа, являющегося основанием для обращения взыскания, наложения ареста на имущество,

находящееся на клиринговых счетах, и принадлежащее Участнику клиринга, а также приостановления операций по клиринговому счету, Распоряжение на возврат денежных средств в рублях из состава поставочной маржи Участника клиринга, в котором указаны регистры учета поставочной маржи для учета поставочной маржи, предоставленной в обеспечение позиций, открытых за счет Участника клиринга, не исполняется.

Распоряжение на возврат денежных средств в рублях подается по форме, установленной Операционным регламентом. В Распоряжении на возврат денежных средств обязательно указываются реквизиты Банковского Счета Участника клиринга, а также код регистра учета поставочной маржи Участника клиринга.»

15. Пункт 12 Статьи 04.04 Раздела 04 Правил клиринга изложить в следующей редакции:

«12. Возврат денежных средств в иностранной валюте из состава поставочной маржи Участника клиринга осуществляется по распоряжению данного Участника клиринга на Банковский счет в иностранной валюте Участника клиринга при отсутствии у данного Участника клиринга задолженности по депозитной марже.

В случае если исполнение Распоряжения на возврат денежных средств в иностранной валюте из состава поставочной маржи Участника клиринга может привести к превышению Требования к размеру поставочной маржи по портфелю позиций над Размером поставочной маржи на соответствующем регистре учета поставочной маржи, Распоряжение на возврат денежных средств не исполняется.

После получения Клиринговой организацией копии документа, являющегося основанием для обращения взыскания, наложения ареста на имущество, находящееся на клиринговых счетах, и принадлежащее Участнику клиринга, а также приостановления операций по клиринговому счету, Распоряжение на возврат денежных средств в иностранной валюте из состава поставочной маржи Участника клиринга, в котором указаны регистры учета поставочной маржи для учета поставочной маржи, предоставленной в обеспечение позиций, открытых за счет Участника клиринга, не исполняется.

Распоряжение на возврат денежных средств в иностранной валюте подается по форме, установленной Операционным регламентом. В Распоряжении на возврат денежных средств обязательно указываются реквизиты Банковского Счета в иностранной валюте Участника клиринга, а также код регистра учета поставочной маржи Участника клиринга.»

16. Дополнить Статью 07.02 Раздела 07 Правил клиринга пунктом 8 в следующей редакции:

«8. При получении Клиринговой организацией копии документа, являющегося основанием для обращения взыскания, наложения ареста на имущество, находящееся на клиринговых счетах, и принадлежащее Участнику клиринга, а также приостановления операций по клиринговому счету, после 14:00, Клиринговая организация может провести в 18:00 дополнительную клиринговую сессию в отношении обязательств из срочных контрактов и/или в отношении обязательств из Договоров предпоставочного периода, заключенных от имени и за счет данного Участника клиринга. В ходе клиринговой сессии обязательства данного Участника клиринга прекращаются в полном объеме или частично уплатой неустойки в пользу Клиринговой организации.

Решение о проведении клиринговой сессии принимается Генеральным директором. В соответствии с решением Генерального директора прекращение обязательств может осуществляться как по всем, так и по отдельным сериям срочных контрактов и Договорам предпоставочного периода, заключенных от имени и за счет данного

Участника клиринга. В решении Генерального директора указывается количество позиций по каждой серии срочных контрактов и Договоров предпоставочного периода, обязательства по которым подлежат прекращению.

Количество позиций по каждой серии срочных контрактов и Договоров предпоставочного периода, обязательства по которым подлежат прекращению, определяются таким образом, чтобы в результате списания с клирингового счета суммы взыскания средств, либо суммы, на которую наложен арест, не возникало задолженности по депозитной марже данного Участника клиринга, либо превышения Требования к размеру поставочной маржи по одному или нескольким портфелям позиций данного Участника клиринга над Размером поставочной маржи на соответствующих регистрах учета поставочной маржи.

Порядок определения размера неустойки определяется в соответствии с Методикой проведения принудительной ликвидации позиций, утверждаемой Генеральным директором РДК (ЗАО).

В течение следующего торгового дня осуществляется принудительная ликвидация позиций Клиринговой организации, как центрального контрагента, имеющих направленность, противоположную направленности позиций Участника клиринга по каждой серии срочных контрактов, обязательства по которым прекращены в соответствии с настоящим пунктом, в соответствующем количестве.»

17. В подпункте ж) пункта 2 Статьи 07.09 Раздела 07 Правил клиринга заменить термин «Отчет о договорах предпоставочного торгового периода» термином «Отчет о договорах предпоставочного периода».
18. В первом абзаце пункта 1 Статьи 07.11 Раздела 07 Правил клиринга заменить фразу «осуществляется» фразой «может осуществляться».
19. Дополнить пункт 1 Статьи 07.11 Раздела 07 Правил клиринга подпунктом з) в следующей редакции:
 - «з) в случае обращения взыскания, наложения ареста на имущество, находящееся на клиринговых счетах, и принадлежащее Участнику клиринга, а также приостановления операций по клиринговому счету.»
20. В пункте 2 Статьи 07.11 Раздела 07 Правил клиринга заменить фразу «осуществляется в соответствии с подпунктом д)» фразой «осуществляется в соответствии с подпунктами д) и з)».
21. Заменить по тексту Приложения 05 к Правилам клиринга термин «ГПБ (ОАО)» термином «Банк ГПБ (АО)»
22. В форме Отчета о позициях по фьючерсным контрактам (CL001_F) в Приложении 08 к Правилам клиринга изменить название формы отчета с «Отчет о позициях (фьючерсы)» на «Отчет о позициях».
23. В форме Отчета о позициях по фьючерсным контрактам (CL001_F) в Приложении 08 к Правилам клиринга изменить название полей 16 и 21 с «Депозитная маржа» на «Требование к размеру депозитной маржи».
24. Пункты 4 и 5 Отчета о договорах предпоставочного периода (CL007) в Приложении 08 к Правилам клиринга изложить в следующей редакции:
 - «4. По каждой паре значений позиционный регистр для учета поставочных позиций - серия срочных контрактов отражаются следующие суммарные значения:

Позиция в образце отчета	Содержание
14.	Суммарное плановое количество базисного актива (сумма значений в поле 6) данной серии срочных контактов по данному позиционному регистру
15.	Суммарное фактическое количество базисного актива (сумма значений в поле 7) данной серии срочных контактов по данному позиционному регистру
16.	Суммарный размер неустойки (сумма значений в поле 8), соответствующий данному позиционному регистру
17.	Суммарная стоимость не поставленной партии (сумма значений в поле 10) по серии срочных контрактов на позиционном регистре
18.	Суммарные требования к оплате транспортировки (сумма значений в поле 11) по данной серии срочных контрактов по данному позиционному регистру
19.	Суммарный размер обязательств (сумма значений в поле 12) по данной серии срочных контрактов по данному позиционному регистру
20.	Суммарный размер поставочной маржи (сумма значений в поле 13) по данной серии срочных контрактов по данному позиционному регистру

5. По каждому позиционному регистру для учета поставочных позиций Участника клиринга отображаются следующие суммарные значения:

Позиция в образце отчета	Содержание
21.	Суммарный размер неустойки (сумма значений в поле 8) по регистру
22.	Суммарная стоимость не поставленной партии (сумма значений в поле 10) по регистру
23.	Суммарный транспортный сбор (сумма значений в поле 11) по регистру
24.	Суммарный размер обязательств (сумма значений в поле 12) по регистру
25.	Суммарный размер поставочной маржи (сумма значений в поле 13) по регистру

»