



Утверждены  
Советом директоров РДК (ЗАО)  
протокол № СД-7/2014 от 29.04.2014

Председатель Совета Директоров  
\_\_\_\_\_ В.В. Таций

**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 решением Совета директоров РДК (ЗАО) от 19.11.2013 (протокол № СД-9/2013) и зарегистрированные Службой Банка России по финансовым рынкам 20 декабря 2013 года, с изменениями, утвержденными решением Совета директоров РДК (ЗАО) от 06.02.2014 (протокол № СД-1/2014) и зарегистрированными Службой Банка России по финансовым рынкам 17 марта 2014 года (далее – Правила клиринга) следующие изменения и дополнения:

1. По тексту Правил клиринга заменить термины «Спецификация», «Спецификация поставочного срочного контракта», «Спецификация данного срочного контракта», «Спецификация соответствующего срочного контракта» термином «Спецификация срочного контракта» в соответствующем падеже.
2. По тексту Правил клиринга заменить термин «Реальный товар» термином «Биржевой товар» в соответствующем падеже.
3. Исключить из пункта 1 Статьи 01.01 Раздела 01 Правил клиринга термин «Договор с реальным товаром»
4. Дополнить пункт 1 Статьи 01.01 Раздела 01 Правил клиринга после термина «Договор предпоставочного периода» термином «Договор поставки в Секции «Нефтепродукты» в следующей редакции:

**«Договор поставки в Секции «Нефтепродукты»** договор поставки товара, заключенный в соответствии с Правилами проведения организованных торгов в Секции «Нефтепродукты» Закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа».

»

5. По тексту Правил клиринга заменить термин «Договор с реальным товаром» термином «Договор поставки в Секции «Нефтепродукты» в соответствующем падеже.
6. Термин «Исполнение срочного контракта» в пункте 1 Статьи 01.01 Раздела 01 Правил клиринга изложить в следующей редакции:

**«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 и, для поставочного срочного контракта – также заключение Участниками поставки Договоров предпоставочного периода или Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты» на условиях и в порядке, установленном Спецификацией срочного контракта, Правилами торгов и иными внутренними документами Биржи. »

7. Дополнить пункт 1 Статьи 01.04 Раздела 01 Правил клиринга подпунктом е) в следующей редакции:

«е) посредством Индивидуальной почтовой системы.»

8. Подпункт б) пункта 2 Статьи 02.02 Раздела 02 Правил клиринга изложить в следующей редакции:

«б) Некредитные организации - резиденты:

- (i) бухгалтерский баланс (форма №0710001) – ежеквартально;
- (ii) отчет о финансовых результатах (форма №0710002) – ежеквартально;
- (iii) для организаций, являющихся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, управляющими компаниями инвестиционных фондов, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами - расчет собственных средств (капитала) по форме, установленной регулируемыми органами – ежеквартально;
- (iv) расчет оценки стоимости чистых активов акционерного общества по форме, установленной регулируемыми органами – ежеквартально.»

9. Пункты 11, 12 Статьи 02.03 Раздела 02 Правил клиринга изложить в следующей редакции:

«11. Клиринговая организация вправе в любое время требовать от Участников клиринга предоставления дополнительной информации, в том числе характеризующей их финансовое состояние, необходимой Клиринговой организации для анализа финансовой устойчивости Участника клиринга и/или анализа эффективности системы управления рисками Участника клиринга. 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 клиринга срок информации/документов или предоставление недостоверной информации может являться основанием для ограничения допуска данного Участника клиринга к клиринговому обслуживанию.»

10. Абзац iii) подпункта б) пункта 5 Статьи 02.07 Раздела 02 Правил клиринга изложить в следующей редакции:
  - «iii) убытки Участника клиринга, если они возникли вследствие умысла или грубой неосторожности этого Участника клиринга;»
11. Последний абзац пункта 9 Статьи 04.02 Раздела 04 Правил клиринга изложить в следующей редакции:
  - « В Распоряжении на возврат денежных средств в рублях из состава депозитной маржи Участника клиринга обязательно указываются реквизиты Банковского Счета Участника клиринга, ссылка на номер и дату Договора о клиринговом обслуживании между Клиринговой организацией и Участником клиринга, а также код торгового регистра Участника клиринга.»
12. Последний абзац пункта 11 Статьи 04.02 Раздела 04 Правил клиринга изложить в следующей редакции:
  - « В Распоряжении на возврат средств в иностранной валюте из состава депозитной маржи Участника клиринга обязательно указываются реквизиты Банковского Счета Участника клиринга в иностранной валюте, ссылка на номер и дату Договора о клиринговом обслуживании между Клиринговой организацией и Участником клиринга, а также код торгового регистра Участника клиринга.»
13. Пункт 6 Статьи 04.03 Раздела 04 Правил клиринга изложить в следующей редакции:
  - « Внесение вклада Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд осуществляется путем зачисления денежных средств в рублях на Счет учета Коллективного гарантийного фонда.»
14. Пункт 12 Статьи 04.03 Раздела 04 Правил клиринга изложить в следующей редакции:
  - «12. Изъятие денежных средств из состава вклада 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 о клиринговом обслуживании между Клиринговой организацией и Участником клиринга, а также код регистра учета вклада Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд.»
15. Пункт 19 Статьи 04.03 Раздела 04 Правил клиринга изложить в следующей редакции:
  - «19. В случае изъятия средств из состава Коллективного гарантийного фонда, Клиринговая организация доводит до сведения Участника клиринга часть денежных средств, которая является доходом от размещения средств гарантийного фонда во вклады в Расчетных организациях и/или от начисления процентов на остаток денежных средств по Счету учета Коллективного гарантийного фонда в части вклада участников клиринга, путем отражения этой информации в Отчете об изъятии вклада в Коллективный гарантийный фонд, форма которого установлена Приложением 08 к Правилам клиринга.  
Отчет об изъятии вклада в Коллективный гарантийный фонд предоставляется Участнику клиринга во время, установленное Операционным регламентом.»
16. Последний абзац пункта 10 Статьи 04.04 Раздела 04 Правил клиринга изложить в следующей редакции:

- « В Распоряжении на возврат средств обязательно указываются реквизиты Банковского Счета Участника клиринга, ссылка на номер и дату Договора о клиринговом обслуживании между Клиринговой организацией и Участником клиринга, а также код регистра учета поставочной маржи Участника клиринга.»
17. Последний абзац пункта 12 Статьи 04.04 Раздела 04 Правил клиринга изложить в следующей редакции:
- « В Распоряжении на возврат средств обязательно указываются реквизиты Банковского Счета в иностранной валюте Участника клиринга, ссылка на номер и дату Договора о клиринговом обслуживании между Клиринговой организацией и Участником клиринга, а также код регистра учета поставочной маржи Участника клиринга.»
18. В подпункте и) пункта 3 Статьи 07.02 Раздела 07 Правил клиринга текст «пунктом 8» заменить на «пунктом 6».
19. В пункте 2 Статьи 07.03 Раздела 07 Правил клиринга термин «текущая цена данной позиции» заменить на «текущая цена позиции».
20. В пункте 1 Статьи 07.07 Раздела 07 Правил клиринга текст «пунктом 7» заменить на «пунктом 5».
21. Пункт 2 Статьи 07.08 Раздела 07 Правил клиринга дополнить следующим предложением:
- « Размер пени округляется до копеек по правилам математического округления.»
22. В пункте 4 Статьи 07.08 Раздела 07 Правил клиринга текст «пунктом 4» заменить на «пунктом 5».
23. В пункте 6 Статьи 07.08 Раздела 07 Правил клиринга текст «пунктом 8» заменить на «пунктом 6».
24. В пункте 10 Статьи 07.08 Раздела 07 Правил клиринга текст «пунктом 10» заменить на «пунктом 8».
25. Подпункт г) пункта 1 Статьи 07.11 Раздела 07 Правил клиринга изложить в следующей редакции:
- «г) в случае приостановления или аннулирования у Участника клиринга лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности или иных видов лицензий/разрешительных документов в соответствии с законодательством Российской Федерации;»
26. Исключить из пункта 7 Статьи 07.13 Раздела 07 Правил клиринга подпункт г). Подпункты д), е) считать подпунктами г), д) соответственно.
27. В пункте 2 Статьи 07.14 Раздела 07 Правил клиринга текст «пунктом 10» заменить на «пунктом 9».
28. В пункте 3 Статьи 07.14 Раздела 07 Правил клиринга текст «пунктом 9» заменить на «пунктом 7».
29. В подпункте б) пункта 21 Статьи 08.01 Раздела 08 Правил клиринга текст «пунктом 20» заменить на «пунктом 19».

30. Дополнить Статью 08.01 Раздела 08 Правил клиринга пунктом 25 в следующей редакции:

«25. Срок поставки товара по Договору предпоставочного периода в отдельных случаях может быть изменен путем заключения дополнительного соглашения, если в Приложении № 04 к Правилам торгов установлена такая возможность.»

Пункты 25, 26 считать пунктами 26, 27 соответственно.

31. В пункте 27 Статьи 08.01 Раздела 08 Правил клиринга текст «пунктом 4» заменить на «пунктом 5».

32. Дополнить Раздел 08 Правил клиринга Статьей 08.02 в следующей редакции:

**«Статья 08.02. Порядок исполнения обязательств по поставке базисного актива и расчетов по поставке по поставочным фьючерсным контрактам с поставкой на региональных базисах**

1. Исполнение серии срочных контрактов осуществляется путем выплаты Участниками клиринга вариационной маржи, начисленной по позициям, открытым по данной серии фьючерса, со дня открытия данных позиций до последнего торгового дня по данной серии фьючерса включительно, и заключения Участниками поставки от своего имени Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты» на условиях и в порядке, установленных внутренними документами Биржи.

В целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты» от своего имени Участник поставки должен являться Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга по договорам с биржевым товаром.

2. В целях заключения Участником поставки Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты», Участник поставки в ходе основного режима торгов в Секции «Нефтепродукты» ЗАО «СПбМТСБ» осуществляет подачу адресных заявок от своего имени, если он является Участником торгов в Секции «Нефтепродукты», либо обеспечивает подачу адресных заявок от своего имени Участником торгов, осуществляющем обслуживание данного Участника поставки в качестве Клиента в Секции «Нефтепродукты». Параметры адресных заявок должны соответствовать требованиям, определенным Правилами торгов и иными внутренними документами Биржи.

Исполнение обязательств из Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты», заключенных во исполнение фьючерсных контрактов, осуществляется в соответствии с Правилами клиринга по договорам с биржевым товаром.

3. В ходе клиринговой сессии по итогам последнего торгового дня по серии срочных контрактов, Клиринговая организация осуществляет перевод чистых позиций, определенных 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 – поставочных позиций Участников поставки) на позиционные регистры для учета поставочных позиций.

Во исполнение обязательств по поставке, на торговом регистре Участника клиринга, являющегося Участником поставки, либо на торговом регистре Участника клиринга, обслуживающего клиента - Участника поставки, блокируется обеспечение в размере требования к размеру депозитной маржи по позициям, вышедшим на поставку.

4. Участник поставки обязан обеспечить выполнение условий допуска к поставке по поставочным позициям, установленных Правилами торгов и иными внутренними документами Биржи.
5. В день исполнения поставочных фьючерсов, до момента начала клиринговой сессии, установленного Операционным регламентом, Биржа предоставляет в Клиринговую организацию следующие документы:
  - а) Уведомление о выполнении условий допуска к поставке по поставочным позициям Участников поставки;
  - б) Отчет об определении сторон по Договорам поставки в Секции «Нефтепродукты», отражающий требования к параметрам адресных заявок, установленные в соответствии с Правилами торгов и иными внутренними документами Биржи;
  - в) Выписку из Реестра заявок в Секции «Нефтепродукты»;
  - г) Выписку из Реестра сделок в Секции «Нефтепродукты».
6. На основании документов, предоставленных Биржей в Клиринговую организацию в соответствии с пунктом 5 настоящей статьи, Клиринговая организация в ходе клиринговой сессии осуществляет следующие действия:
  - а) в случае если по поставочным позициям не были выполнены условия допуска к поставке, по таким позициям взимается неустойка в размере, определенном в соответствии с пунктом 7 настоящей статьи. Неустойка удерживается в пользу Клиринговой организации и перечисляется из состава депозитной маржи Участника клиринга, являющегося Участником поставки, по поставочным позициям которого не были выполнены условия допуска к поставке, либо Участником клиринга, обслуживающим Клиента - Участника поставки, по поставочным позициям которого не были выполнены условия допуска к поставке. Поставочные позиции, в отношении которых не были выполнены условия допуска к поставке, обязательства Участника клиринга и Клиринговой организации по данным срочным контрактам прекращаются;
  - б) в случае если по поставочным позициям Участником поставки – Продавцом не были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты», соответствующие требованиям, установленным Правилами торгов, по таким позициям взимается неустойка в размере, определенном в соответствии с пунктом 7 настоящей статьи. Неустойка удерживается в пользу Клиринговой организации и перечисляется из состава депозитной маржи Участника клиринга, являющегося Участником поставки - Продавцом, по поставочным позициям которого не были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты», либо Участником клиринга, обслуживающим Клиента, являющегося Участником поставки - Продавцом, по поставочным позициям которого не были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты». Поставочные позиции, в отношении которых не были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты», обязательства Участника клиринга и Клиринговой организации по данным срочным контрактам прекращаются;
  - в) в случае если по поставочным позициям Участником поставки – Продавцом были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты», соответствующие требованиям, установленным

Правилами торгов, при этом Участником поставки – Покупателем, определенным Биржей в качестве стороны по Договору поставки в Секции «Нефтепродукты» в отношении поставочных позиций данного Участника поставки – Продавца, не были поданы соответствующие встречные заявки, по таким позициям Участника поставки – Покупателя взимается неустойка в размере, определенном в соответствии с пунктом 7 настоящей статьи. Неустойка удерживается в пользу Клиринговой организации и перечисляется из состава депозитной маржи Участника клиринга, являющегося Участником поставки - Покупателем, по поставочным позициям которого не были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты», либо Участником клиринга, обслуживающим Клиента, являющегося Участником поставки - Покупателем, по поставочным позициям которого не были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты». Поставочные позиции, в отношении которых не были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты», закрываются, обязательства Участника клиринга и Клиринговой организации по данным срочным контрактам прекращаются;

- г) в случае если по поставочным позициям были выполнены условия допуска к поставке, но в отношении данных позиций не были определены стороны по Договору поставки в Секции «Нефтепродукты» в соответствии с Правилами торгов, по таким позициям уплачивается неустойка в пользу Участника клиринга в размере требования к размеру депозитной маржи по данным позициям. Неустойка выплачивается Клиринговой организацией путем перечисления соответствующей суммы средств Участнику клиринга, являющемуся Участником поставки, по поставочным позициям которого были выполнены условия допуска к поставке, либо Участнику клиринга, обслуживающему Клиента, являющегося Участником поставки, по поставочным позициям которого были выполнены условия допуска к поставке. Поставочные позиции, в отношении которых не были определены стороны по Договору поставки в Секции «Нефтепродукты» в соответствии с Правилами торгов, закрываются. Обязательства Участника клиринга и Клиринговой организации по данным срочным контрактам прекращаются.
- д) в случае если по поставочным позициям, в отношении которых Участником поставки - Продавцом были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты», соответствующие требованиям, установленным Правилами торгов, но не были заключены Договоры поставки в Секции «Нефтепродукты», по таким позициям Клиринговой организацией уплачивается неустойка в пользу Участника клиринга в размере требования к размеру депозитной маржи по данным позициям. Неустойка выплачивается Клиринговой организацией путем перечисления соответствующей суммы средств Участнику клиринга, являющемуся Участником поставки - Продавцом, по поставочным позициям которого были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты», либо Участнику клиринга, обслуживающему Клиента, являющегося Участником поставки - Продавцом, по поставочным позициям которого были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты». Поставочные позиции, в отношении которых Участником поставки - Продавцом были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты», соответствующие требованиям, установленным Правилами торгов, но не были заключены

Договоры поставки в Секции «Нефтепродукты», закрываются. Обязательства Участника клиринга и Клиринговой организации по данным срочным контрактам прекращаются.

- е) в случае если по поставочным позициям Участником поставки – Продавцом не были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты», соответствующие требованиям, установленным Правилами торгов, позиции Участника поставки – Покупателя, определенного Биржей в качестве стороны по Договору поставки в Секции «Нефтепродукты» в отношении поставочных позиций данного Участника поставки – Продавца, по таким позициям Клиринговой организацией уплачивается неустойка в пользу Участника клиринга в размере требования к размеру депозитной маржи по данным позициям. Неустойка выплачивается Клиринговой организацией путем перечисления соответствующей суммы средств Участнику клиринга, являющемуся Участником поставки – Покупателем, либо Участнику клиринга, обслуживающему Клиента, являющегося Участником поставки – Покупателем. Поставочные позиции, в отношении которых Участником поставки – Продавцом не были поданы заявки в целях заключения Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты», соответствующие требованиям, установленным Правилами торгов, позиции Участника поставки – Покупателя, определенного Биржей в качестве стороны по Договору поставки в Секции «Нефтепродукты» в отношении поставочных позиций данного Участника поставки – Продавца, закрываются. Обязательства Участника клиринга и Клиринговой организации по данным срочным контрактам прекращаются.
- ж) поставочные позиции, в отношении которых были заключены Договоры в Секции «Нефтепродукты», закрываются, обязательства Участника клиринга и Клиринговой организации по данным срочным контрактам прекращаются исполнением.

В случае если суммы денежных средств в рублях на торговом регистре учета депозитной маржи недостаточно для удержания неустойки из состава депозитной маржи Участника клиринга, задолженность Участника клиринга урегулируется в соответствии со статьей 07.08 Правил клиринга.

7. Размер неустойки, взимаемой по позициям, определенным подпунктами а)-в) пункта 6 настоящей статьи, определяется по следующей формуле:

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

Ставка неустойки =  $N_{\text{ко}} / (O_{\text{у}} + O_{\text{к}} + O_{\text{п}})$ , где

- $N_{\text{ко}}$  - сумма неустойки, уплачиваемой Клиринговой организацией в соответствии с подпунктами г), д) и е) пункта 6 настоящей статьи;
- $O_{\text{у}}$  - количество позиций, закрытых в соответствии с подпунктом а) пункта 6 настоящей статьи;
- $O_{\text{к}}$  - количество позиций, закрытых в соответствии с подпунктом б) пункта 6 настоящей статьи;
- $O_{\text{п}}$  - количество позиций, закрытых в соответствии с подпунктом в) пункта 6 настоящей статьи.

8. Информация о поставочных позициях и неустойке отображается в Отчете о поставочных позициях, предоставляемом Участникам клиринга в соответствии со статьей 07.09 Правил клиринга.»



33. Пункты 1, 2 Статьи 09.01 Раздела 09 Правил клиринга изложить в следующей редакции:

- «1. Под чрезвычайной ситуацией понимаются обстоятельства, которые нарушили, нарушают или могут нарушить нормальное осуществление клиринга в соответствии с Правилами клиринга.
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 клиринга (далее – акты), которые прямо или косвенно, начиная с момента утверждения данных актов или с иного срока, 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 части обеспечения для исполнения обязательств, допущенных к клирингу.
  - б) любые события и/или обстоятельства, которые временно или на неопределенный срок сделали, делают или могут сделать невозможным или значительно затруднить проведение расчетов Участниками клиринга по их обязательствам и/или невозможность использования значительной части обеспечения для исполнения обязательств, допущенных к клирингу;
  - в) любые события и/или обстоятельства, которые 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 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 события или обстоятельства.»

34. Пункт 2 Приложения 04 к Правилам клиринга изложить в следующей редакции:

«2. К финансовому состоянию Участников клиринга – некредитных организаций предъявляются следующие требования:

а) Для организаций, являющихся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, управляющими компаниями инвестиционных фондов, паевыми инвестиционными фондами, негосударственными пенсионными фондами, размер собственных средств (капитал) Участника клиринга, рассчитанный в соответствии с требованиями Банка России 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 5 000 000 рублей;

(ii) Индивидуальный клиринговый участник 5 000 000 рублей;

б) Для организаций, не являющихся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, управляющими компаниями инвестиционных фондов, паевыми инвестиционными фондами, негосударственными пенсионными фондами, оценка стоимости чистых активов Участника клиринга, рассчитанная по форме, утвержденной приказом Министерства финансов Российской Федерации №10н, ФКЦБ РФ от 29.01.2003 №03-6/пз, 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, должна составлять не менее:

(i) Индивидуальный клиринговый участник 10 000 000 рублей;

в) 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 1370 «Нераспределенная прибыль (непокрытый убыток)» «Бухгалтерского баланса» (форма №0710001), 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.»

35. Пункт 2 Отчета о движении средств (CL002) в Приложении 08 к Правилам клиринга изложить в следующей редакции:

«2. Каждому регистру и виду имущества соответствует таблица с информацией о движении средств по регистру в течение дня T:

Позиция в образце отчета	Содержание
1.	Уникальный код операции/№ поручения
2.	Время операции

3.	Тип операции
4.	Регистр/счет, с которого/на который переведено имущество
5.	Количество внесенного/изъятого имущества
6.	Текущий остаток на регистре после выполнения операции

»

36. Пункт 4 Отчета о движении средств (CL002) в Приложении 08 к Правилам клиринга изложить в следующей редакции:

«4. Образец отчета:

**РДК (ЗАО)**  
**Отчет о движении средств**  
 <Дата>

**Идентификатор Участника клиринга:** <Идентификатор Участника клиринга>

**Код Участника клиринга:** <Код Участника клиринга>

**Регистр:** <Код регистра>

**Код вида имущества:** <Код вида имущества>

**Входящий остаток:** <Входящий остаток в единицах имущества>

**Исходящий остаток:** <Исходящий остаток в единицах имущества>

Код поручения	Время операции	Тип операции	Корреспондент	Сумма	Текущий остаток
1	2	3	4	5	6

»

37. Из таблицы в пункте 2 Отчета об обеспечении (CL004) в Приложении 08 к Правилам клиринга исключить строку, соответствующую позиции 20 в образце отчета. Позиции 21-23 в образце отчета считать позициями 20-22 соответственно.
38. Из таблицы в пункте 3 Отчета об обеспечении (CL004) в Приложении 08 к Правилам клиринга исключить строку, соответствующую позиции 15 в образце отчета. Позиции 16-18 в образце отчета считать позициями 15-17 соответственно.
39. Пункты 2-4 Отчета о параметрах имущества, принимаемого в обеспечение (CL005) в Приложении 08 к Правилам клиринга изложить в следующей редакции:
- «2. Первая таблица содержит информацию о ценах и дисконтах различных видов имущества, используемых для определения Стоимости видов имущества, их минимальных кратных объемах, приоритетах и датах приема в обеспечение:

<b>Позиция в образце отчета</b>	<b>Содержание</b>
1.	Код вида имущества, учитываемого в составе индивидуального или коллективного клирингового обеспечения
2.	Наименование данного вида имущества
3.	Цена единицы данного вида имущества
4.	Дисконт к цене единицы данного вида имущества (в процентах)
5.	Стоимость данного вида имущества
6.	Минимальный объем данного вида имущества, принимаемый в обеспечение
7.	Дата начала приема в обеспечение данного вида имущества
8.	Дата окончания приема в обеспечение данного вида имущества
9.	Дата регистрации данного вида имущества
10.	Дата последнего изменения параметров данного вида имущества

3. Вторая таблица содержит информацию о максимальной доле имущества, учитываемого при расчете размера индивидуального или коллективного клирингового обеспечения.

<b>Позиция в образце отчета</b>	<b>Содержание</b>
11.	Код вида имущества, учитываемого в составе индивидуального или коллективного клирингового обеспечения

<b>Позиция в образце отчета</b>	<b>Содержание</b>
12.	Приоритет учета видов имущества при расчете обеспечения

4. Образец отчета:

**РДК (ЗАО)**

**Отчет о параметрах имущества, принимаемого в обеспечение**

<Дата>

**Идентификатор Участника клиринга:** <Идентификатор Участника клиринга>

**Код Участника клиринга:** <Код Участника клиринга>

Код вида имущества	Наименование	Цена вида имущества	Дисконт к цене вида имущества	Стоимость вида имущества	Минимальный кратный объем	Дата начала приема	Дата окончания приема	Дата регистрации	Дата последнего изменения
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10

**Тип регистра:** <Наименование типа регистра>

**Максимальная доля имущества в обеспечении:** <Максимальная доля имущества в обеспечении>

Код вида имущества	Приоритет
11	12

»

40. Дополнить Приложение 08 к Правилам клиринга формой Отчета об изъятии части взноса в Коллективный гарантийный фонд (CL008) в следующей редакции:

«

**Форма CL008**

**Отчет об изъятии части взноса в Коллективный гарантийный фонд**

**Участник клиринга:** <Идентификатор Участника клиринга>/<Наименование Участника клиринга>

<Дата изъятия средств>	
Сумма до изъятия средств	
Изъято всего	
-из взноса в Коллективный гарантийный фонд	
-из доходов от размещения Коллективного гарантийного фонда	

**После изъятия средств взнос Участника в Коллективный гарантийный фонд составил:**

»