

ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЛУЖБА ПО
ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО

Дата: "02" ноября 2011 г.

в реестре за № 11-2886/02-110

Заместитель

руководителя: С.К. Зорин



УТВЕРЖДЕНО
решением Биржевого Совета
ЗАО «Санкт - Петербургская Валютная Биржа»
от 03 февраля 2011 г. (Протокол № 228)
с изменениями и дополнениями
от 22 июля 2011 г. (Протокол № 234)

Председатель Биржевого Совета



В.А. Шорин/

**Правила
осуществления клиринговой деятельности
ЗАО "Санкт-Петербургская Валютная Биржа"**

Санкт - Петербург
2011 г.



ОГЛАВЛЕНИЕ

1. Общие положения.	4
1.1. Термины и определения.	4
1.2. Основные положения.	10
1.3. Предмет клиринговой деятельности.	10
2. Порядок осуществления многостороннего клиринга.	11
2.1. Порядок взаимодействия участников клиринга с СПВБ, расчетным депозитарием и расчетной организацией.	11
2.2. Порядок регистрации участников клиринга и клиентов участника клиринга.	12
2.3. Порядок зачисления денежных средств на торговые счета и ценных бумаг на торговые счета депо и счета депо поставки.	12
2.4. Порядок приема и обработки информации от расчетного депозитария и расчетной организации о размерах остатков.	14
2.5. Порядок изменения значений клиринговых регистров.	19
2.6. Порядок установления и контроля за соблюдением лимитов по допустимому объему сделок.	20
2.7. Порядок проведения проверки обеспеченности сделок денежными средствами и ценными бумагами и определения подлежащих исполнению обязательств участников клиринга.	21
2.8. Порядок определения обязательств клиентов участников клиринга.	24
2.9. Порядок действий в случае расхождения данных при сверке и контроле обеспеченности сделок клирингового пула.	25
2.10. Порядок и сроки передачи поручений в расчетную организацию и расчетный депозитарий.	26
2.11. Порядок и сроки получения информации о проведенных расчетах от расчетной организации и расчетного депозитария.	26
2.12. Порядок проведения сверки результатов расчетов.	27
2.13. Порядок действий в случае расхождения данных при сверке.	27
2.14. Порядок обеспечения исполнения обязательств.	28
2.15. Особенности проведения промежуточных расчетов.	28
2.16. Порядок и сроки предоставления отчетов участникам клиринга.	29
2.17. Порядок распределения и/или возмещения убытков участников клиринга в случае отмены расчетов по заключенным сделкам.	29
2.18. Порядок формирования, хранения и использования Гарантийного фонда.	30
2.19. Организация учета, порядок формирования реестров.	30
2.20. Особенности осуществления клиринга по клиринговому пулу сделок РЕПО с Банком России.	30

3. Тарифы СПВБ.	33
4. Список расчетных организаций	33
5. Список расчетных депозитариев.	34
6. Приложения.	35
6.1. Приложение №1 Договор клирингового обслуживания	35
6.2. Приложение №2. Регламент информационного взаимодействия СПВБ с расчетными депозитариями и расчетными организациями при проведении клиринга и расчетов по результатам сделок с ценными бумагами, заключенных через СПВБ.	40
6.3. Приложение №3. Доверенность на расчеты по торговым счетам депо и счетам депо поставки участника клиринга в расчетном депозитарии	43
6.4. Приложение №4. Доверенность на расчеты по торговым счетам участника клиринга в расчетной организации.	44
6.5. Приложение №5. Доверенность на передачу/получение документов	45
6.6. Приложение №5А Уведомление участником клиринга о взаимосвязи счета депо и денежного счета 46	
6.7. Приложение №6 Анкета участника клиринга	47
6.8. Приложение № 7 Форматы обмена данными с расчетными депозитариями.	48
6.9. Приложение №8. Формат обмена данными с ЗАО ПРЦ	57
6.10. Приложение №9. Формат обмена данными с РП ММВБ	61
6.11. Приложение №10. Форматы файлов обмена данными между системой торгов и клиринговой системой	65
6.12. Приложение №11. Формы отчетов для участника клиринга	68
6.13. Приложение №12. Формы реестров	83

1. Общие положения.

1.1. Термины и определения.

Андеррайтер – профессиональный участник рынка ценных бумаг, имеющий соответствующую лицензию и осуществляющий на основании договора с эмитентом операции по размещению и обращению ценных бумаг, выпущенных эмитентом.

Внутренний регламент клиринговой организации (далее - **Регламент**) – внутренний нормативный документ СПВБ, определяющий порядок работы СПВБ как клирингового центра.

Возмещение – сумма денежных средств, подлежащая уплате одним Участником клиринга другому Участнику клиринга, являющемуся его контрагентом по сделке с ценными бумагами, в случае и размере, установленными Правилами торговли и настоящими Правилами.

Гарантийное обеспечение – денежные средства и ценные бумаги участника клиринга, предназначенные для обеспечения исполнения обязательств по сделкам с кодами расчетов "Sn", совершенным участником клиринга.

Гарантийный фонд СПВБ – фонд, формируемый СПВБ из собственных средств и средств участников клиринга для обеспечения исполнения ими обязательств по сделкам с ценными бумагами, включенным в клиринговый пул.

Денежные позиции Участника клиринга - сумма денежных средств, которые могут быть использованы для обеспечения собственных заявок Участника клиринга на покупку ценных бумаг в течение торгов, либо для обеспечения заявок клиентов Участника клиринга на покупку ценных бумаг в течение торгов.

Денежные торговые счета - счета, открытые Участнику клиринга (или счета, право распоряжения которыми принадлежит Участнику клиринга на основании доверенности владельца счета) в расчетной организации для учета денежных средств и проведения расчетов как по собственным сделкам Участника клиринга, так и по сделкам, совершенным им в интересах его клиентов.

В указанных целях в расчетной организации участнику клиринга могут быть открыты следующие виды денежных торговых счетов:

счет собственных средств, предназначенный для учета денежных средств, принадлежащих Участнику клиринга;

брокерский счет, предназначенный для учета денежных средств клиентов Участника клиринга.

Клиринговый счет – денежный клиринговый счет - счет в российских рублях открытый Расчетной организацией для Клирингового центра, предназначенный для учета операций с денежными средствами Участников клиринга и клиентов Участников клиринга при осуществлении Клиринговым центром многостороннего клиринга по сделкам, заключенным на СПВБ.

Держатель – организация, осуществляющая на основании лицензии депозитарное обслуживание Участников клиринга, имеющая в расчетном депозитарии корреспондентский счет депо и открывшая на нем отдельные торговые разделы для проведения операций с ценными бумагами Участников клиринга и/или их клиентов по результатам заключенных участниками клиринга сделок.

Клиринговая система - совокупность программно-технических средств, баз данных, телекоммуникационных средств, иного оборудования и программного обеспечения, предназначенная для технического обеспечения процедур осуществления клиринговой деятельности.

Клиринговая деятельность - профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг по определению взаимных обязательств по сделкам, заключенным на рынке ценных бумаг и финансовых инструментов (сбор, сверка, корректировка информации по сделкам с

ценными бумагами, подготовка бухгалтерских документов по ним) и их зачету по поставкам ценных бумаг и расчетам по ним.

Клиринговый лист ценных бумаг Биржи – список ценных бумаг, по сделкам с которыми клиринговой организацией осуществляется многосторонний клиринг.

Клиринговый пул - совокупность сделок с ценными бумагами, заключенных в Секции, исполнение которых наступает не позже начала расчетов по результатам клиринга.

Клиринговый регистр - регистр, открытый СПВБ для учета ценных бумаг, денежных средств, предназначенных для исполнения обязательств участников клиринга, размещенных, в том числе, на торговых счетах, и обязательств участника клиринга по результатам сделок с ценными бумагами.

Клиринговый центр - СПВБ как организация, осуществляющая клиринг по сделкам, заключенным Участниками клиринга на СПВБ.

Корзина РЕПО - список ценных бумаг, любую/любые из которых Участник торгов – продавец по договору РЕПО может поставить покупателю по договору РЕПО в качестве обеспечения по сделке РЕПО (с учетом ограничений, предусмотренных Спецификацией РЕПО).

Лимит Участника торгов по денежным средствам – максимальный возможный размер обязательств Участника торгов по денежным средствам, рассчитанный клиринговой организацией на текущий торговый день.

Лимит Участника торгов по ценным бумагам - максимальный возможный размер обязательств Участника торгов по ценным бумагам, рассчитанный клиринговой организацией на текущий торговый день.

Многосторонний клиринг – порядок осуществления клиринговой деятельности, при котором определение обязательств каждого участника клиринга и расчеты по сделкам клирингового пула производятся по итогам неттинга всех совершенных, подтвержденных и обеспеченных необходимым количеством ценных бумаг и денежных средств сделок каждого участника клиринга, входящих в клиринговый пул

Неттинг – вид клиринговых расчетов, при которых встречные однородные обязательства полностью или частично прекращаются зачетом и определяются обязательства участников клиринга по сделкам клирингового пула Обязательства участников клиринга в не зачетной части, определяются как нетто-обязательства или нетто-требования участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам.

Нетто-обязательство участника клиринга по денежным средствам - определяемая посредством неттинга сумма денежных средств, представляющая собой отрицательную разницу между суммой требований и суммой обязательств участника клиринга по денежным средствам по результатам сделок с ценными бумагами, заключенных данным участником клиринга и включенных в клиринговый пул.

СПВБ осуществляет расчет нетто-обязательств участников клиринга в отношении тех денежных торговых счетов, которые были указаны Участником клиринга при заключении сделки с ценными бумагами.

Нетто-обязательство участника клиринга по ценным бумагам - определяемое посредством неттинга количество ценных бумаг, представляющее собой отрицательную разницу между суммой требований и суммой обязательств участника клиринга по ценным бумагам по результатам сделок с ценными бумагами, заключенных данным участником клиринга и включенных в клиринговый пул .

СПВБ осуществляет расчет нетто-обязательств участников клиринга в отношении тех торговых разделов счетов депо, которые были указаны Участником клиринга при заключении сделки с ценными бумагами.

Нетто-требование участника клиринга по денежным средствам - определяемая посредством неттинга сумма денежных средств, представляющая собой положительную разницу между суммой требований и суммой обязательств участника клиринга по

денежным средствам по результатам сделок с ценными бумагами, заключенных данным участником клиринга и включенных в клиринговый пул.

СПВБ осуществляет расчет нетто-требований участников клиринга в отношении тех денежных торговых счетов, которые были указаны Участником клиринга при заключении сделки с ценными бумагами.

Нетто-требование участника клиринга по ценным бумагам - определяемое посредством неттинга количество ценных бумаг, представляющее собой положительную разницу между суммой требований и суммой обязательств участника клиринга по ценным бумагам по результатам сделок с ценными бумагами, заключенных данным участником клиринга и включенных в клиринговый пул.

СПВБ осуществляет расчет нетто-требований участников клиринга в отношении тех торговых разделов счетов депо, которые были указаны Участником клиринга при заключении сделки с ценными бумагами.

Норма гарантийного обеспечения – соотношение между суммой гарантийного обеспечения и величиной Положения Участника торгов по денежным средствам, устанавливаемое СПВБ для Участника торгов в отношении ценных бумаг и финансовых инструментов, допущенных к обращению в Секции.

Обеспеченная сделка – сделка с ценными бумагами, прошедшая процедуру контроля обеспечения, включенная в расчет нетто-обязательств и нетто-требований Участника клиринга.

Однородные сделки РЕПО - сделки РЕПО, заключенные между двумя Участниками торгов, действующими от своего имени или от имени одних и тех же инвесторов, исполнение первых и/или вторых частей которых приходится на одну дату.

Организатор торговли – организатор торговли (в том числе фондовая биржа), осуществляющий деятельность по организации торговли на рынке ценных бумаг на основании лицензии и в соответствии с Правилами торговли, а также по организации торговли иными финансовыми инструментами на основании других лицензий.

Позиция депо – торговая позиция депо, или позиция депо поставки,

Позиция депо поставки – количество ценных бумаг, которые депонируются на различных разделах счетов депо поставки участников клиринга для исполнения обязательств по сделкам с ценными бумагами в соответствии с Правилами торговли. Позиция депо поставки участника клиринга определяется в отношении каждого счета депо поставки по каждой ценной бумаге.

Позиции участника клиринга - совокупность денежных позиций и позиций депо участника клиринга.

Поставка против платежа - порядок исполнения обязательств по результатам сделок с ценными бумагами, при котором перечисление ценных бумаг и денежных средств по счетам участников клиринга производится только после проверки и подтверждения наличия на счетах участников клиринга достаточного количества ценных бумаг и денежных средств для исполнения обязательств по результатам заключенных сделок.

Правила торговли - "Правила торговли в фондовой секции ЗАО "Санкт-Петербургская Валютная Биржа"".

Процедура контроля обеспечения – определение достаточности денежных средств и ценных бумаг на торговых счетах для исполнения Участниками клиринга – контрагентами по сделке с ценными бумагами обязательств по денежным средствам и/или ценным бумагам, возникших в результате заключения сделки, дата исполнения которой наступила.

Рабочее место Участника клиринга - совокупность программно-технических средств, используемых Участником клиринга для технического доступа к системе торгов СПВБ.

Расчетная организация - небанковская кредитная организация, ведущая счета участников клиринга и осуществляющая расчеты по денежным средствам по результатам клиринга на основании поручений и/или иных документов СПВБ.

Расчетный депозитарий - депозитарий, имеющий соответствующую лицензию и осуществляющий проведение всех операций по счетам депо участников клиринга при исполнении обязательств по результатам сделок, заключенных через организаторов торговли на рынке ценных бумаг.

Регламент взаимодействия - Регламент взаимодействия СПВБ с расчетным депозитарием и расчетной организацией – перечень выполняемых Сторонами операций по подготовке, обработке и обмену информацией, определяющий состав и формы документов информационного обмена, а также время начала и продолжительность выполнения этих операций. Регламент взаимодействия определяется договорами, заключаемыми СПВБ с расчетным депозитарием и расчетной организацией, и является приложением и неотъемлемой частью Правил.

Сводное поручение – сводное поручение депо и/или сводное платежное поручение.

Сводное платежное поручение – поручение на перевод денежных средств, представляющее собой совокупность платежных поручений, составляемых по результатам клиринга, и являющееся основанием для совершения операций списания денежных средств с соответствующих торговых счетов участника клиринга, а также зачисления денежных средств на соответствующие торговые счета.

Сводное поручение депо – поручение на перевод ценных бумаг, представляющее собой совокупность поручений депо, составляемых по результатам клиринга являющееся основанием для совершения операций списания ценных бумаг с торговых счетов депо и счетов депо поставки участника клиринга, а также зачисления ценных бумаг на торговые счета депо и счета депо поставки.

Сделка РЕПО - договор, по которому одна сторона (продавец по договору РЕПО) обязуется в срок, установленный этим договором, передать в собственность другой стороне (покупателю по договору РЕПО) ценные бумаги, а покупатель по договору РЕПО обязуется принять ценные бумаги и уплатить за них определенную денежную сумму (первая часть договора РЕПО) и по которому покупатель по договору РЕПО обязуется в срок, установленный этим договором, передать ценные бумаги в собственность продавца по договору РЕПО, а продавец по договору РЕПО обязуется принять ценные бумаги и уплатить за них определенную денежную сумму (вторая часть договора РЕПО).

Сделка с кодом расчетов "Т0" – сделка с ценными бумагами, заключенная Участниками торгов при условии полного обеспечения заявок ценными бумагами и денежными средствами и с исполнением сделки в день ее заключения.

Сделка с кодом расчетов "Sn" – сделка с ценными бумагами, заключенная Участниками торгов при условии частичного обеспечения заявок денежными средствами и ценными бумагами. Датой исполнения обязательств по сделке является дата $S+n$, где S – дата заключения сделки, а n – число торговых дней, следующих после даты заключения сделки. В случае исполнения обязательств по сделке в день ее заключения ($n=0$) используется код расчетов $S0$. Допустимые коды расчетов определяются Регламентом торгов для каждого финансового инструмента в Секции.

Сделка РЕПО с Банком России – сделка РЕПО, заключенная в отдельном торговом сегменте, контрагентом по которой является Банк России. По сделкам РЕПО с Банком России СПВБ формирует отдельный клиринговый пул.

Сделка РЕПО с кодом расчетов "Sn" – сделка РЕПО, заключенная Участниками торгов на основе адресных заявок, при условии обеспечения заявок денежными средствами в объеме, достаточном для уплаты комиссионного вознаграждения Организатору торговли. Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО является дата $S+n$, где S – дата заключения сделки, а n – число торговых дней, следующих после даты заключения сделки. В случае исполнения обязательств по сделке в день ее заключения ($n=0$) используется код расчетов $S0$. Допустимые коды расчетов определяются Спецификацией РЕПО.

Сделка своп – сделка представляет собой продажу одним Участником торгов другому Участнику торгов ценных бумаг с условием одновременной покупки других ценных бумаг.

Система электронных торгов СПВБ (далее - Система торгов) - совокупность вычислительных средств, программного обеспечения, баз данных, телекоммуникационных средств и другого оборудования, обеспечивающая возможность ввода, хранения, обработки и раскрытия информации, необходимой для заключения и исполнения сделок с ценными бумагами.

Система управления обеспечением (СУО) – совокупность вычислительных средств, программного обеспечения, баз данных, телекоммуникационных средств и другого оборудования, обеспечивающая возможность ввода, хранения, обработки и раскрытия информации, необходимой для подбора обеспечения по сделкам РЕПО.

Срок РЕПО – промежуток времени, выраженный в календарных днях, между датами исполнения первой и второй частей сделки РЕПО. Срок РЕПО исчисляется со дня, следующего за днем исполнения первой части сделки РЕПО, до дня исполнения второй части сделки РЕПО включительно. Для сделки РЕПО, первая и вторая части которой исполняются в один торговый день (внутридневное РЕПО), Срок РЕПО принимается равным одному дню.

Ставка РЕПО – величина, выраженная в процентах годовых, которая устанавливается при заключении сделки РЕПО и используется для расчета дохода по сделке РЕПО.

Стоимость обратного выкупа – сумма денежных средств, которую продавец по договору РЕПО должен уплатить покупателю по договору РЕПО в дату исполнения второй части сделки РЕПО.

Стоимость покупки по РЕПО – сумма денежных средств, которую покупатель должен заплатить продавцу за ценные бумаги по первой части сделки РЕПО.

Сумма РЕПО – величина, отражающая сумму привлеченных/предоставленных по сделке РЕПО денежных средств, по состоянию на текущую дату.

Счет депо поставки – счет депо (либо раздел счета депо) участника клиринга или держателя в расчетном депозитарии, предназначенный для учета ценных бумаг, заблокированных для обеспечения обязательств участника клиринга по результатам сделок с кодом расчетов “Sn” , а также раздел счета депо поставки, открытый на корреспондентском счете депо держателя в расчетном депозитарии для проведения операций по результатам сделок, заключенным данным участником клиринга.

Счета депо поставки, открытые в расчетном депозитарии, подразделяются на:

счет депо поставки (раздел счета депо) владельца (типа “А”), открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве;

счет депо поставки (раздел счета депо) номинального держателя (типа “В”), открытый Участнику клиринга или депозитарию для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;

счет депо поставки (раздел счета депо) владельца с попечителем (типа “С”), открытый клиенту Участника клиринга, являющегося попечителем этого счета;

счет депо поставки (раздел счета депо) доверительного управляющего (типа “D”), открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве доверительного управления;

счет депо поставки (раздел счета депо) владельца (типа “F”), открытый держателю для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве;

счет депо поставки (раздел счета депо) номинального держателя (типа “L”), открытый держателю для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;

счет депо поставки (раздел счета депо) доверительного управляющего (типа “Y”), открытый держателю для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве доверительного управления.

счет депо поставки типа (раздел счета депо) "P" – открывается участнику клиринга в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг, необходимых для расчетов с эмитентом.

Торговая позиция депо – количество ценных бумаг, которые могут быть использованы для обеспечения заявок Участника клиринга на продажу ценных бумаг в течение данных торгов. Торговая позиция депо Участника клиринга определяется в отношении каждого торгового счета депо по каждой ценной бумаге.

Торговый счет - торговый счет депо и/или денежный торговый счет.

Торговый счет депо – счет депо (либо раздел счета депо) участника клиринга или держателя в расчетном депозитарии, предназначенный для учета ценных бумаг участника клиринга и проведения операций с ценными бумагами по результатам заключенных сделок.

В целях настоящих Правил под торговым счетом участника клиринга также понимается торговый раздел, открытый на корреспондентском счете депо держателя в расчетном депозитарии для проведения операций по результатам сделок, заключенным данным участником клиринга.

Торговые счета депо подразделяются на:

торговый счет депо (раздел счета депо) владельца (типа "А"), открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве;

торговый счет депо (раздел счета депо) номинального держателя (типа "В"), открытый Участнику клиринга или депозитарию для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;

торговый счет депо (раздел счета депо) владельца с попечителем (типа "С"), открытый клиенту Участника клиринга, являющегося попечителем этого счета;

торговый счет депо (раздел счета депо) доверительного управляющего (типа "D"), открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве доверительного управления;

торговый счет депо (раздел счета депо) владельца - эмитента (типа "Е"), открытый эмитенту для учета размещаемых или погашаемых ценных бумаг;

торговый счет депо (раздел счета депо) владельца (типа "F"), открытый держателю для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве;

торговый счет депо (раздел счета депо) номинального держателя (типа "L"), открытый держателю для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;

торговый счет депо (раздел счета депо) доверительного управляющего (типа "Y"), открытый держателю для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве доверительного управления;

торговый счет депо (раздел счета депо) эмиссионного агента (типа "BE"), открытый уполномоченному депозитарию для учета ценных бумаг эмитента, предназначенных для размещения, а также для учета ценных бумаг в процессе погашения.

Уполномоченный депозитарий – профессиональный участник рынка ценных бумаг, имеющий право на депозитарную деятельность на основании соответствующей лицензии и осуществляющей на основании договора с Эмитентом централизованное хранение выпуска ценных бумаг.

Участник клиринга - юридическое лицо, заключившее с ЗАО СПВБ Договор об осуществлении клирингового обслуживания по сделкам с ценными бумагами, заключенными на бирже (Приложение №1 к настоящим Правилам клиринга).

Фондовая секция СПВБ (далее Секция) - организационная форма объединения профессиональных Участников рынка ценных бумаг – Участников торгов в Секции, основанная на членстве.

Ценные бумаги - ценные бумаги в том смысле, в котором они определяются действующим законодательством, а также инвестиционные паи, допущенные к торгам в Секции в соответствии с Правилами листинга.

1.2. Основные положения.

1.2.1. Настоящие "Правила осуществления клиринговой деятельности ЗАО "Санкт-Петербургская Валютная Биржа" (далее - Правила), разработаны в соответствии с законодательством Российской Федерации, Положением о клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг Российской Федерации, утвержденным Постановлением Федеральной комиссии по рынку ценных бумаг от 14 августа 2002 года № 32/пс (далее - Положение о клиринговой деятельности), Уставом ЗАО "Санкт-Петербургская Валютная Биржа" (далее - СПВБ) и иными правовыми актами и иными внутренними нормативными документами СПВБ.

1.2.2. СПВБ в качестве клиринговой организации действует на основании лицензии на осуществление клиринговой деятельности и осуществляет свою деятельность в соответствии с действующим законодательством Российской Федерации, настоящими Правилами и соответствующими договорами, заключаемыми с расчетными депозитариями, расчетными организациями и участниками клиринга.

1.2.3. СПВБ совмещает деятельность организатора торговли на рынке ценных бумаг (фондовой биржи) и клирингового центра.

1.2.4. СПВБ осуществляет клиринговую деятельность только в отношении сделок, зарегистрированных в фондовой секции СПВБ. Клиринг по иным сделкам не производится.

1.2.5. СПВБ, расчетный депозитарий, расчетная организация и участник клиринга далее по тексту настоящих Правил могут именоваться "Сторонами".

1.2.6. Настоящие Правила утверждаются Биржевым Советом СПВБ и подлежат регистрации Федеральной службой по финансовым рынкам (далее – ФСФР) в порядке, установленном действующим законодательством РФ.

1.3. Предмет клиринговой деятельности.

1.3.1. Предметом деятельности СПВБ как клирингового центра является проведение клиринга по результатам сделок с ценными бумагами, заключаемых Участниками клиринга в ходе торговой сессии, проводимой СПВБ в соответствии с Правилами торговли.

1.3.2. При проведении клиринга СПВБ:

- Осуществляет определение обязательств участников клиринга по сделкам клирингового пула посредством неттинга на основании реестра сделок
- Обеспечивает обособленный учет обязательств каждого участника клиринга посредством ведения клиринговых регистров.
- Осуществляет прием и обработку информации от расчетного депозитария и расчетной организации о размерах остатков ценных бумаг и денежных средств на торговых счетах участников клиринга.
- Осуществляет формирование и передачу в расчетный депозитарий и расчетную организацию сводных поручений на проведение операций по торговым счетам и счетам депо поставки участников клиринга по итогам сделок, а также учет и хранение данных поручений посредством ведения "Реестра поручений, направленных расчетному депозитарию и расчетной организации".
- Осуществляет контроль исполнения в расчетном депозитарии и расчетной организации сводных поручений, содержащих нетто-обязательства и нетто-требования участников клиринга, рассчитанные по результатам клиринга.

- Осуществляет формирование отчетов по итогам клиринга для каждого участника клиринга и каждого его клиента и их передачу участникам клиринга в сроки, установленные договором клирингового обслуживания, заключаемого с участником клиринга.
- Организует систему мер по защите информации в соответствии с "Порядком хранения и защиты информации".
- Осуществляет дублированное хранение информации о сделках, остатках на торговых счетах денежных средств и ценных бумаг, результатах клиринга, переданных в расчетную организацию и расчетный депозитарий поручениях.
- Организует систему управления рисками ликвидности, системными рисками и рисками неисполнения обязательств, в отношении которых осуществляется клиринг.
- Создает Гарантийный фонд СПВБ в соответствии с "Порядком создания, размещения и использования специального (гарантийного) фонда".

2. Порядок осуществления многостороннего клиринга.

2.1. Порядок взаимодействия участников клиринга с СПВБ, расчетным депозитарием и расчетной организацией.

2.1.1. Расчеты по нетто-обязательствам и нетто-требованиям участников клиринга по денежным средствам осуществляет расчетная организация на основании договоров, заключенных с СПВБ и участниками клиринга, в соответствии с Положениями Банка России и настоящими Правилами.

2.1.2. В соответствии с договором, заключенным с участником клиринга, расчетная организация для учета денежных средств и проведения расчетов по результатам сделок с ценными бумагами открывает участнику клиринга следующие денежные торговые счета:

- счет собственных средств;
- специальный брокерский счет.

2.1.3. Расчеты по нетто-обязательствам и нетто-требованиям участников клиринга по ценным бумагам осуществляет расчетный депозитарий на основании договоров, заключенных с СПВБ и участниками клиринга, в соответствии с Условиями осуществления депозитарной деятельности расчетного депозитария и Правилами.

2.1.4. В соответствии с договором, заключенным с участником клиринга или держателем, расчетный депозитарий для учета ценных бумаг и проведения операций с ценными бумагами по результатам заключенных сделок открывает участнику клиринга торговые счета депо (разделы счетов депо) и счета депо поставки (разделы счетов депо).

2.1.5. Услуги по клиринговому обслуживанию предоставляются участнику клиринга на основании заключаемого с СПВБ Договора клирингового обслуживания по установленной в Приложении № 1 форме. Для исполнения указанного договора Участник клиринга обязан выполнить следующие требования:

- предоставить СПВБ доверенность на передачу/получение документов, выданную ответственному лицу участника клиринга по установленной форме (Приложение №5);
- предоставить СПВБ заполненную анкету участника клиринга (Приложение №6);
- открыть денежные торговые счета в расчетной организации;
- выдать СПВБ Доверенность на осуществление расчетов по торговым счетам участника клиринга в расчетной организации (Приложение № 4). Клиринг по сделкам, заключенным участником клиринга за счет лица, открывшего собственный торговый счет в расчетной организации, производится только после предоставления таким лицом СПВБ доверенности на осуществление расчетов (Приложение № 4) по результатам сделок, заключенным данным участником клиринга;

- открыть торговые счета депо (разделы счетов депо) и, при необходимости, счета депо поставки (разделы счетов депо) в расчетном депозитарии или у держателя;
- выдать СПВБ доверенность на осуществление расчетов по торговым счетам депо и счетам депо поставки участника клиринга в расчетном депозитарии (Приложение № 3);
- В том случае, когда депозитарное обслуживание участника клиринга производится держателем, услуги по клиринговому обслуживанию участника клиринга предоставляются только после открытия держателем на своем корреспондентском счете депо в расчетном депозитарии торговых разделов и/или разделов счета депо поставки для проведения операций по результатам сделок, заключенным данным участником клиринга, и предоставления держателем СПВБ доверенности (по форме Приложения №3) на осуществление расчетов по таким разделам счета депо;
- выдать СПВБ Уведомление о взаимосвязи счета депо и денежного счета участника клиринга (Приложение № 5А).

2.2. Порядок регистрации участников клиринга и клиентов участника клиринга.

2.2.1. СПВБ на основании предоставленной участниками клиринга информации осуществляет регистрацию участников клиринга и присваивает каждому участнику уникальный код в соответствии с требованиями нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг

2.2.2. СПВБ осуществляет регистрацию участника клиринга не позднее следующего рабочего дня после получения анкеты.

2.2.3. В случае если участник клиринга осуществляет доверительное управление, данному участнику клиринга присваиваются коды по количеству учредителей доверительного управления.

2.2.4. СПВБ осуществляет регистрацию клиентов участников клиринга в соответствии с требованиями нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг

2.2.5. Предоставление услуг по клиринговому обслуживанию начинается только после выполнения всех требований, перечисленных в пп. 2.1.5 и п.2.2. Правил.

2.3. Порядок зачисления денежных средств на торговые счета и ценных бумаг на торговые счета депо и счета депо поставки.

2.3.1. Порядок зачисления денежных средств на торговые счета.

2.3.1.1. Участник клиринга, планирующий заключение на текущих торгах сделок "Т0" по покупке ценных бумаг за счет собственных средств, должен зарезервировать в полном объеме сумму денежных средств, необходимую для обеспечения исполнения его обязательств по денежным средствам с текущей датой исполнения, на "счете собственных средств", открытом в расчетной организации.

2.3.1.2. Участник клиринга, планирующий заключение на текущих торгах сделок "Sn" по покупке ценных бумаг за счет собственных средств, должен зарезервировать сумму денежных средств равную гарантийному обеспечению, необходимую для исполнения его обязательств, на "счете собственных средств", открытом в расчетной организации.

2.3.1.3. Участник клиринга, имеющий обязательства по денежным средствам по сделкам "Sn", заключенным за счет собственных средств, с текущей датой исполнения обязан зарезервировать в полном объеме сумму денежных средств, необходимую для исполнения обязательств на «счете собственных средств» за вычетом суммы гарантийного обеспечения, зарезервированной ранее.

2.3.1.4. Участник клиринга, планирующий заключение на текущих торгах сделок "Т0" по покупке ценных бумаг в интересах клиентов, должен зарезервировать в полном объеме сумму денежных средств, необходимую для обеспечения исполнения обязательств по денежным средствам на специальном брокерском счете, открытом в расчетной организации.

2.3.1.5. Участник клиринга, планирующий заключение на текущих торгах сделок "Sn" по покупке ценных бумаг в интересах клиентов должен зарезервировать сумму денежных

средств равную гарантийному обеспечению необходимую для обеспечения исполнения его обязательств, на специальном брокерском счете, открытом в расчетной организации. Участник клиринга, имеющий обязательства по денежным средствам по сделкам с кодом расчетов «Sn», заключенным в интересах клиента, с текущей датой исполнения обязан зарезервировать в полном объеме сумму денежных средств, необходимую для исполнения обязательств на специальном брокерском счете за вычетом суммы гарантийного обеспечения, зарезервированной ранее.

2.3.1.6. Участник клиринга, имеющий обязательства по денежным средствам по сделке РЕПО, заключенной за счет собственных средств, с текущей датой исполнения, должен зарезервировать в полном объеме сумму денежных средств необходимых для исполнения сделки РЕПО или сумму нетто-обязательств по однородным сделкам РЕПО, рассчитанную клиринговым центром, на «счете собственных средств» в расчетной организации.

2.3.1.7. Участник клиринга, имеющий обязательства по денежным средствам по сделке РЕПО, заключенной за счет средств клиента, с текущей датой исполнения должен зарезервировать в полном объеме сумму денежных средств необходимых для исполнения нетто-обязательств по однородным сделкам РЕПО, рассчитанную клиринговым центром, на специальном брокерском счете в расчетной организации.

2.3.1.8. В том случае, когда договором комиссии, заключенным между клиентом и Участником клиринга, последнему предоставлено право использования денежных средств клиента, Участник клиринга, имеющий обязательства по денежным средствам по сделкам «T0», «Sn» и/или планирующий заключение на текущих торгах сделок «T0», «Sn» по покупке ценных бумаг, вправе использовать для обеспечения исполнения обязательств по денежным средствам денежные средства клиентов, учитываемые на брокерских счетах. Время, до истечения которого участник клиринга должен подать поручение на перевод денежных средств на счета в расчетной организации, определяется договором участника клиринга с расчетной организацией.

2.3.1.9. Расчетная организация блокирует зарезервированные денежные средства на торговых счетах участника клиринга в соответствии с Правилами и договором с участником клиринга.

2.3.1.10. Блокировка зарезервированных денежных средств на торговых счетах участника клиринга в расчетной организации означает, что списание зарезервированных денежных средств с торговых счетов участника клиринга производится только на основании сводного платежного поручения или других документов СПВБ, предусмотренных настоящими Правилами.

2.3.1.11. Порядок зачисления денежных средств на торговые счета участника клиринга в расчетной организации, а также списания денежных средств с этих счетов устанавливается положениями Банка России и договором между расчетной организацией и участником клиринга.

2.3.2. Порядок зачисления ценных бумаг на торговые счета депо и счета депо поставки.

2.3.2.1. Участник клиринга, планирующий заключение на текущих торгах сделок по продаже ценных бумаг с кодом расчетов «T0», должен обеспечить наличие ценных бумаг в количестве, необходимом для обеспечения исполнения его обязательств по ценным бумагам на соответствующем торговом счете депо в расчетном депозитарии.

2.3.2.2. Участник клиринга, планирующий заключение на текущих торгах сделок по продаже ценных бумаг с кодом расчетов «Sn», должен обеспечить наличие ценных бумаг в количестве, необходимом для гарантийного обеспечения, на соответствующем торговом счете депо в расчетном депозитарии.

2.3.2.3. Участник клиринга, имеющий обязательство по ценным бумагам по сделкам с кодом расчетов «Sn», должен обеспечить наличие ценных бумаг в количестве, необходимом для исполнения сделки (за вычетом предварительно зарезервированного гарантийного обеспечения), на соответствующем торговом счете депо в расчетном депозитарии.

2.3.2.4. Участник клиринга, имеющий обязательство по поставке ценных бумаг по сделке РЕПО с текущей датой исполнения, должен обеспечить наличие ценных бумаг в количестве, необходимом для исполнения сделки РЕПО, или количестве нетто-

обязательств по однородным сделкам РЕПО, рассчитанных клиринговым центром, на соответствующем торговом счете депо в расчетном депозитарии.

2.3.2.5. Время, до истечения которого участник клиринга должен подать поручение на перевод ценных бумаг на торговый счет в расчетном депозитарии, определяется договором участника клиринга с расчетным депозитарием и Правилами торговли.

2.3.2.6. Расчетный депозитарий блокирует зарезервированные ценные бумаги на торговом счете депо участника клиринга в соответствии с Правилами и договором с участником клиринга.

2.3.2.7. Блокировка торговых счетов депо и счетов депо поставки в расчетном депозитарии означает, что списание зарезервированных ценных бумаг с торговых счетов депо и счетов депо поставки участников клиринга производится только на основании сводного поручения депо СПВБ или других распоряжений, предусмотренных настоящими Правилами.

2.3.2.8. Порядок зачисления ценных бумаг на торговые счета депо и/или счета депо поставки участников клиринга, а также списания ценных бумаг с торговых счетов депо и/или счетов депо поставки регулируется договором между расчетным депозитарием и участником клиринга.

2.4. Порядок приема и обработки информации от расчетного депозитария и расчетной организации о размерах остатков.

2.4.1. Порядок приема и обработки информации от расчетной организации и расчетного депозитария о размерах остатков на торговых счетах и счетах депо поставки участников клиринга определяется Правилами и договором СПВБ с расчетным депозитарием и расчетной организацией и предусматривает следующие основные условия:

- порядок доступа к информации и условия соблюдения конфиденциальности;
- виды и форматы принимаемых и передаваемых документов;
- сроки и порядок передачи документов;
- полномочия сотрудников СПВБ, расчетной организации и расчетного депозитария, осуществляющих указанные операции;
- порядок обработки и контроля полученной информации;
- условия дублирования и резервирования каналов передачи информации;
- условия и сроки хранения полученных документов.

2.4.2. Расчетная организация передает СПВБ отчет об остатках на торговых счетах участников клиринга в формате, согласованном в договоре между расчетной организацией и СПВБ (Приложение № 8).

2.4.3. Расчетный депозитарий передает СПВБ отчет об остатках на торговых счетах депо и счетах депо поставки участников клиринга в формате, согласованном в договоре между расчетным депозитарием и СПВБ (Приложение № 7).

2.4.4. Отчеты представляют собой электронные документы, передаваемые по электронной почте с соблюдением условий криптографической защиты информации и содержащие электронную подпись отправителя.

2.4.5. Время и порядок обмена электронными документами определяется Регламентом взаимодействия (Приложение №2).

2.4.6. Типовые формы документов обмена информацией между СПВБ и расчетными депозитариями, расчетными организациями приведены в Приложениях №№7, 8, 9.

2.4.7. В соответствии с условиями договоров между СПВБ и расчетным депозитарием (расчетными организациями), могут применяться иные, отличные от приведенных в Приложениях №№ 7, 8, 9 согласованные сторонами формы документов.

2.4.8. С целью обработки и учета информации, получаемой из расчетного депозитария и расчетной организации, СПВБ открывает следующие клиринговые регистры:

Регистр "Ценные бумаги участника клиринга – свои" (регистр типа "А") – клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных ценных бумаг участника клиринга, зарезервированных им в расчетном депозитарии.

На данном клиринговом регистре открываются следующие разделы:

Раздел "Ценные бумаги участника клиринга, зарезервированные на торги - свои" (типа "АТ") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета собственных ценных бумаг участника клиринга, зарезервированных им для участия в торгах. Раздел типа "АТ" соответствует торговому счету депо типа "А", открытому участнику клиринга в расчетном депозитарии для предварительного депонирования ценных бумаг для торгов.

Раздел "Ценные бумаги участника клиринга, заблокированные для расчетов с эмитентом - свои" (типа "АР") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета собственных ценных бумаг участника клиринга, заблокированных им для расчетов с эмитентом. Раздел типа "АР" соответствует счету депо поставки типа "Р", открытому участнику клиринга в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг, необходимых для расчетов с эмитентом.

Раздел "Ценные бумаги участника клиринга, заблокированные для расчетов по сделкам с кодом расчетов "Sn" - свои" (типа "АD") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета собственных ценных бумаг участника клиринга, заблокированных им для исполнения обязательств по сделкам с кодом расчетов "Sn". Раздел типа "АD" соответствует счету депо поставки типа "D", открытому участнику клиринга в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг, необходимых для исполнения обязательств по сделкам с кодом расчетов "Sn".

Регистр "Ценные бумаги участника клиринга – клиенты" (регистр типа "В") – клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета ценных бумаг клиентов участника клиринга, зарезервированных ими в расчетном депозитарии.

На данном клиринговом регистре открываются следующие разделы:

Раздел "Ценные бумаги участника клиринга, зарезервированные на торги - клиенты" (типа "ВТ") – раздел клирингового регистра, предназначенный для совокупного учета ценных бумаг клиентов участника клиринга, зарезервированных ими для участия в торгах. Раздел типа "ВТ" соответствует торговому счету депо типа "В", открытому участнику клиринга в расчетном депозитарии для предварительного депонирования ценных бумаг клиентов для торгов.

Раздел "Ценные бумаги участника клиринга, заблокированные для расчетов с эмитентом - клиенты" (типа "ВР") – раздел клирингового регистра, предназначенный для совокупного учета ценных бумаг клиентов участника клиринга, заблокированных ими для расчетов с эмитентом. Раздел типа "ВР" соответствует счету депо поставки типа "Р", открытому участнику клиринга в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг, необходимых для расчетов с эмитентом.

Раздел "Ценные бумаги участника клиринга, заблокированные для расчетов по сделкам с кодом расчетов "Sn" - клиенты" (типа "ВD") – раздел клирингового регистра, предназначенный для совокупного учета ценных бумаг клиентов участника клиринга, заблокированных ими для расчетов по сделкам с кодом расчетов "Sn". Раздел типа "ВD" соответствует счету депо поставки типа "D", открытому участнику клиринга в расчетном депозитарии для учета ценных бумаг, заблокированных им для исполнения обязательств по сделкам с кодом расчетов "Sn".

Регистр "Ценные бумаги участника клиринга – клиенты" (регистр типа "С") – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг лица, имеющего попечителя – Участника клиринга, зарезервированных им в расчетном депозитарии.

На данном клиринговом регистре открываются следующие разделы:

Раздел "Ценные бумаги участника клиринга, зарезервированные на торги - клиенты" (типа "СТ") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета ценных бумаг лица, имеющего попечителя - Участника клиринга, зарезервированных им для участия в торгах. Раздел типа "СТ" соответствует торговому счету депо типа "С", открытому участнику клиринга в расчетном депозитарии для предварительного депонирования ценных бумаг для торгов.

Раздел "Ценные бумаги участника клиринга, заблокированные для расчетов с эмитентом - клиенты" (типа "СП") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета ценных бумаг лица, имеющего попечителя – Участника клиринга, заблокированных им для расчетов с эмитентом. Раздел типа "СП" соответствует счету депо поставки типа "Р", открытому участнику клиринга в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг, необходимых для расчетов с эмитентом.

Раздел "Ценные бумаги участника клиринга, заблокированные для расчетов по сделкам с кодом расчетов "Sn" - клиенты" (типа "CD") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета ценных бумаг лица, имеющего попечителя – Участника клиринга, заблокированных им для расчетов по сделкам с кодом расчетов "Sn". Раздел типа "CD" соответствует счету депо поставки типа "D", открытому участнику клиринга в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг, необходимых для исполнения обязательств по сделкам с кодом расчетов "Sn"

Регистр "Ценные бумаги участника клиринга –ДУ" (регистр типа "D") – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг в доверительном управлении участника клиринга, зарезервированных им в расчетном депозитарии.

На данном клиринговом регистре открываются следующие разделы:

Раздел "Ценные бумаги участника клиринга, зарезервированные на торги - ДУ" (типа "DT") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета ценных бумаг в доверительном управлении участника клиринга, зарезервированных им для участия в торгах. Раздел типа "DT" соответствует торговому счету депо типа "D", открытому участнику клиринга в расчетном депозитарии для предварительного депонирования ценных бумаг для торгов

.Раздел "Ценные бумаги участника клиринга, заблокированные для расчетов с эмитентом - ДУ" (типа "DP") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета ценных бумаг в доверительном управлении участника клиринга, заблокированных им для расчетов с эмитентом. Раздел типа "DP" соответствует счету депо поставки типа "Р", открытому участнику клиринга в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг, необходимых для расчетов с эмитентом.

Раздел "Ценные бумаги участника клиринга, заблокированные для расчетов по сделкам с кодом расчетов "Sn" - ДУ" (типа "DD") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета ценных бумаг в доверительном управлении участника клиринга, заблокированных им для расчетов по сделкам с кодом расчетов "Sn". Раздел типа "DD" соответствует счету депо поставки типа "D", открытому участнику клиринга в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг, необходимых для исполнения обязательств по сделкам с кодом расчетов "Sn".

Регистр "Ценные бумаги участника клиринга, зарезервированные на торги - свои" (регистр типа "ЕТ") - клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг эмитента - участника клиринга, зарезервированных им для размещения. Регистр типа "ЕТ" соответствует торговому счету депо типа "Е" (разделу торгового счета депо), открытому участнику клиринга в расчетном депозитарии для предварительного депонирования ценных бумаг для размещения, а также для учета ценных бумаг в процессе погашения.

Регистр "Ценные бумаги Участника клиринга – свои" (регистр типа "F") – клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных ценных бумаг Участника клиринга, зарезервированных им у держателя.

На данном клиринговом регистре открываются следующие разделы:

Раздел "Ценные бумаги Участника клиринга, зарезервированные на торги - свои" (типа "FT") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета собственных ценных бумаг Участника клиринга, зарезервированных для участия в торгах. Раздел типа "FT" соответствует торговому счету депо типа "F", открытому держателю в расчетном депозитарии для предварительного депонирования ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве.

Раздел "Ценные бумаги Участника клиринга, заблокированные для расчетов с эмитентом - свои" (типа "FP") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета собственных ценных бумаг Участника клиринга, заблокированных для расчетов с эмитентом. Раздел типа "FP" соответствует счету депо поставки типа "P", открытому держателю в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг Участника клиринга, необходимых для расчетов с эмитентом.

Раздел "Ценные бумаги Участника клиринга, заблокированные для расчетов по сделкам с кодом расчетов "Sn" - свои" (типа "FD") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета собственных ценных бумаг Участника клиринга, заблокированных для исполнения обязательств по сделкам с кодом расчетов "Sn". Раздел типа "FD" соответствует счету депо поставки типа "D", открытому держателю в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг Участника клиринга, необходимых для исполнения обязательств по сделкам с кодом расчетов "Sn".

Регистр "Ценные бумаги клиентов Участника клиринга" (регистр типа "L") – клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, зарезервированных ими у держателя.

На данном клиринговом регистре открываются следующие разделы:

Раздел "Ценные бумаги клиентов Участника клиринга, зарезервированные на торги" (типа "LT") – раздел клирингового регистра, предназначенный для совокупного учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, зарезервированных для участия в торгах. Раздел типа "LT" соответствует торговому счету депо типа "L", открытому держателю в расчетном депозитарии для предварительного депонирования ценных бумаг клиентов Участника клиринга.

Раздел "Ценные бумаги клиентов Участника клиринга, заблокированные для расчетов с эмитентом" (типа "LP") – раздел клирингового регистра, предназначенный для совокупного учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, заблокированных для расчетов с эмитентом. Раздел типа "LP" соответствует счету депо поставки типа "P", открытому держателю в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг клиентов Участника клиринга, необходимых для расчетов с эмитентом.

Раздел "Ценные бумаги клиентов Участника клиринга, заблокированные для расчетов по сделкам с кодом расчетов "Sn" (типа "LD") – раздел клирингового регистра, предназначенный для совокупного учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, заблокированных для расчетов по сделкам с кодом расчетов "Sn". Раздел типа "LD" соответствует счету депо поставки типа "D", открытому держателю в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг клиентов Участника клиринга, необходимых для исполнения обязательств по сделкам с кодом расчетов "Sn".

Регистр "Ценные бумаги в доверительном управлении Участника клиринга – ДУ" (регистр типа "Y") – клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга, зарезервированных им у держателя.

На данном клиринговом регистре открываются следующие разделы:

Раздел "Ценные бумаги в доверительном управлении Участника клиринга, зарезервированные на торги - ДУ" (типа "YT") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга, зарезервированных для участия в торгах. Раздел типа "YT" соответствует торговому счету депо типа "Y", открытому держателю в расчетном депозитарии для предварительного депонирования ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга.

Раздел "Ценные бумаги в доверительном управлении Участника клиринга, заблокированные для расчетов с эмитентом - ДУ" (типа "YP") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга, заблокированных для расчетов с эмитентом. Раздел типа "YP" соответствует счету депо поставки типа "P", открытому держателю в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга, необходимых для расчетов с эмитентом.

Раздел "Ценные бумаги в доверительном управлении Участника клиринга, заблокированные для расчетов по сделкам с кодом расчетов "Sn" - ДУ" (типа "YD") – раздел клирингового регистра, предназначенный для учета ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга, заблокированных для расчетов по сделкам с кодом расчетов "Sn". Раздел типа "YD" соответствует счету депо поставки типа "D", открытому держателю в расчетном депозитарии для блокирования ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга, необходимых для исполнения обязательств по сделкам с кодом расчетов "Sn".

Регистр "Ценные бумаги участника клиринга, зарезервированные на торги" (регистр типа "BE") - клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг, находящихся в процессе размещения или погашения. Регистр типа "BE" соответствует торговому счету депо типа "BE" (разделу торгового счета депо), открытому уполномоченному депозитарию в расчетном депозитарии для учета ценных бумаг, находящихся в процессе размещения или погашения.

Регистр "Денежные средства участника клиринга, зарезервированные на торги" (регистр типа "MT") - клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств участника клиринга и его клиентов, зарезервированных ими для участия в торгах по сделкам с кодом расчетов "T0". Регистр типа "MT" соответствует денежному торговому счету типа "30403", открытому участнику клиринга в расчетной организации для предварительного депонирования денежных средств с целью участия в торгах.

Регистр "Денежные средства участника клиринга, зарезервированные на торги - клиенты" (регистр типа "KT") - клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств клиентов участника клиринга, зарезервированных ими для участия в торгах по сделкам с кодом расчетов "T0". Регистр типа "KT" соответствует брокерскому счету типа "30403", открытому участнику клиринга в расчетной организации для предварительного резервирования денежных средств его клиентов для участия в торгах.

Регистр "Денежные средства участника клиринга, в рублях зарезервированные на торги" (регистр типа "RTS") - клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств участника клиринга, зарезервированных ими для участия в торгах по сделкам с кодом расчетов "Sn" Регистр типа "RTS" соответствует денежному торговому счету типа "30405", открытому участнику клиринга в расчетной организации для гарантийного обеспечения расчетов.

Регистр "Денежные средства участника клиринга, в рублях - свободные" (регистр типа "RPS") - клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств участника клиринга свободных от обязательств по сделкам с кодом расчетов "Sn",

Регистр "Денежные средства участника клиринга, в рублях - заблокированные" (регистр типа "RBS") - клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств участника клиринга заблокированных под исполнение обязательств по сделкам с кодом расчетов "Sn",

Регистр "Денежные средства участника клиринга в рублях, зарезервированные на торги - клиенты" (регистр типа "RTK") - клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств клиентов участника клиринга, зарезервированных ими для участия в торгах по сделкам с кодом расчетов "Sn" Регистр типа "RTK" соответствует денежному торговому счету типа "30405", открытому участнику клиринга в расчетной организации для гарантийного обеспечения расчетов.

Регистр "Денежные средства клиентов участника клиринга, в рублях - свободные" (регистр типа "РПК") - клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств клиентов участника клиринга свободных от обязательств по сделкам с кодом расчетов "Sn",

Регистр "Денежные средства клиентов участника клиринга, в рублях - заблокированные" (регистр типа "РБК") - клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств клиентов участника клиринга заблокированных под исполнение обязательств по сделкам с кодом расчетов "Sn".

2.4.9. На основании значений клиринговых регистров, перечисленных в п. 2.4.8 Правил, СПББ перед началом торгов формирует в системе торгов начальные позиции на торги участников клиринга. Начальные позиции на торги по сделкам с кодом расчетов "Т0", сделкам РЕПО с Банком России участника клиринга устанавливаются равными значениям остатков на соответствующих клиринговых регистрах (торговых счетах).

2.4.10. Начальные позиции по денежным средствам и ценным бумагам на торги по сделкам с кодом расчетов "Sn" устанавливаются равными значениям на клиринговых регистрах, учитывающих свободные от исполнения обязательств денежные средства и ценные бумаги.

2.4.11. Перед началом торгов Участник клиринга осуществляет сверку остатков денежных средств и ценных бумаг, зарезервированных на торговых счетах и счетах депо поставки, с величиной соответствующих начальных позиций в системе торгов. В случае наличия расхождений, Участник клиринга обязан незамедлительно проинформировать об этом СПББ.

2.5. Порядок изменения значений клиринговых регистров.

2.5.1. После блокировки торговых счетов и счетов депо поставки расчетный депозитарий и расчетная организация могут повторно передавать информацию об остатках на торговых счетах и счетах депо поставки только в следующих случаях:

- расчетная организация и расчетный депозитарий направляют повторно отчет для исправления ошибок или дополнения информации, содержащейся в первоначальном отчете;
- в случае дополнительного зачисления ценных бумаг или денежных средств на торговые счета или счета депо поставки участников клиринга;
- в случае списания ценных бумаг или денежных средств с торговых счетов;
- по запросу клирингового центра

2.5.2. Участник клиринга имеет право дополнительно зачислять ценные бумаги и денежные средства на свои торговые счета и счета депо поставки в порядке и в сроки, установленные договорами участника клиринга с расчетной организацией и расчетным депозитарием.

2.5.3. В том случае, когда договоры между участником клиринга и расчетной организацией или расчетным депозитарием не предусматривают возможности дополнительного зачисления участником клиринга ценных бумаг и денежных средств на торговые счета и счета депо поставки, изменение соответствующих клиринговых регистров и торговых позиций на основаниях, указанных в п 2.5.1 Правил, не производится.

2.5.4. Участник клиринга имеет право в течение торгов списывать денежные средства и/или ценные бумаги с торговых счетов в расчетной организации/расчетном депозитарии. Расчетная организация при получении поручения на списание средств от участника клиринга направляет СПББ запрос на возможность произвести такое списание.

2.5.5. СПББ после получения запроса осуществляет проверку достаточности денежных средств и/или ценных бумаг на торговом счете участника клиринга. Сумма денежных средств на торговом счете участника клиринга, остающаяся после списания, должна обеспечивать исполнение обязательств участника клиринга по сделкам, срок исполнения которых наступает после окончания текущей торговой сессии. В сумме указанных обязательств учитываются все обязательства по сделкам по покупке ценных бумаг с кодом расчетов «Т0» и «S0», совершенных во время текущей торговой сессии.

2.5.6. При успешной проверке достаточности денежных средств и/или ценных бумаг, СПВБ направляет расчетной организации/расчетному депозитарию подтверждение, на основании которого расчетная организация/расчетный депозитарий производит списание денежных средств и/или ценных бумаг. Если результат проверки отрицательный, СПВБ направляет расчетной организации отказ в подтверждении, который служит основанием для отказа расчетной организацией в исполнении платежного поручения участника клиринга.

2.5.7. СПВБ производит изменение значений клиринговых регистров, содержащих информацию о начальных значениях остатков на торговых счетах и счетах депо поставки участников клиринга, в соответствии с отчетами, вновь полученными от расчетного депозитария или расчетной организации, в течение 30 минут после получения отчетов.

2.5.8. После выполнения указанных выше операций с торговыми счетами и счетами депо поставки участников клиринга СПВБ формирует и передает в систему торгов сведения об изменении остатков на торговых счетах и счетах депо поставки участников клиринга в течение 30 минут после получения отчетов из расчетного депозитария и/или расчетной организации.

2.5.9. Взаимодействие между СПВБ, расчетным депозитарием и расчетной организацией при изменении клиринговых регистров осуществляется в том же порядке, что и при первоначальном установлении значений клиринговых регистров в клиринговой системе и значений позиций участников клиринга в системе торгов.

2.6. Порядок установления и контроля за соблюдением лимитов по допустимому объему сделок.

2.6.1. СПВБ устанавливает для участников клиринга лимиты по допустимому объему сделок с ценными бумагами путем установки начальных позиций по ценным бумагам и денежным средствам участника клиринга в системе торгов. Значения начальных позиций в системе торгов формируются согласно п.2.4.9 Правил. Лимит по сделкам с ценными бумагами с частичным обеспечением по ценным бумагам и денежным средствам рассчитывается исходя из значения начальных позиций по ценным бумагам на торговом счете и установленного решением Правления СПВБ объема частичного обеспечения в случае его требования.

2.6.2. В ходе торгов контроль за соблюдением лимитов по допустимому объему сделок участников клиринга производится СПВБ в системе торгов путем проверки обеспеченности заявок и сделок Участников клиринга в соответствии с Правилами торговли.

2.6.3. В ходе торговой сессии в системе торгов рассчитываются текущие и плановые торговые позиции.

2.6.4. В системе торгов осуществляется учет изменений позиций по денежным средствам и позиций депо:

- при поступлении в систему торгов заявок, удовлетворении и снятии заявок, находящихся в системе торгов;
- при изменении начального значения соответствующей позиции по денежным средствам и начального значения соответствующей позиции депо Участника клиринга.

2.6.5. СПВБ на основании анализа информации о финансовом состоянии участников клиринга устанавливает для каждого участника клиринга максимальный лимит операций по покупке ценных бумаг по сделкам с кодами расчетов "Sn",

2.6.6. СПВБ в соответствии с документами, регулирующими порядок заключения сделок РЕПО в фондовой секции СПВБ, может устанавливать максимальный лимит по заключению сделок РЕПО. СПВБ устанавливает максимальный лимит по заключению сделок РЕПО между двумя участниками клиринга, если один из указанных участников клиринга передал СПВБ информацию о необходимости установления такого лимита и его величине или порядке расчета указанной величины. Возможность получения от участника клиринга распоряжения на установление лимитов на совершение сделок РЕПО с другими участниками клиринга регулируется договором между СПВБ и участником клиринга.

2.6.7. В ходе торговой сессии в системе торгов СПВБ рассчитывает объем нетто-обязательств участника клиринга по денежным средствам по сделкам с кодами расчетов "Sn",. Заявки Участника клиринга, исполнение которых приведет к превышению нетто-обязательств участника

клиринга по денежным средствам по сделкам с кодами расчетов "Sn", над значением максимального лимита, системой торгов не принимаются.

2.7. Порядок проведения проверки обеспеченности сделок денежными средствами и ценными бумагами и определения подлежащих исполнению обязательств участников клиринга.

2.7.1. После окончания торговой сессии или во время, определенное регламентом как время проведения промежуточных расчетов, СПВБ формирует реестр сделок. Реестр сделок представляет собой электронный документ в формате, определенном в Приложении №10 к Правилам. Порядок и сроки формирования реестра сделок определяются Регламентом взаимодействия.

2.7.2. В соответствии с условиями исполнения сделок, Клиринговый центр определяет сделки, которые должны быть исполнены при расчетах и включает указанные сделки в клиринговый пул. В клиринговый пул включаются сделки срок исполнения которых наступает не позже начала расчетов по результатам клиринга. Клиринговый центр осуществляет определение и учет обязательств и требований по денежным средствам по каждой позиции по денежным средствам Участника клиринга (в соответствии с условиями заключенных им сделок, обязательства по которым включены в соответствующий клиринговый пул). Клиринговый центр осуществляет определение и учет обязательств и требований по ценным бумагам по каждой позиции депо и по каждой учетной позиции Участника клиринга в отношении каждой ценной бумаги в отдельности (в соответствии с условиями заключенных им сделок, обязательства по которым включены в соответствующий клиринговый пул).

2.7.3. Все операции по итогам сделок клирингового пула производятся на основании реестров сделок, формируемых по итогам торгов, без дополнительного подтверждения сделок со стороны участников клиринга.

2.7.4. На основании реестров сделок СПВБ определяет нетто-обязательства и нетто-требования участников клиринга по ценным бумагам и денежным средствам.

2.7.5. Нетто-обязательства (нетто-требования) участника клиринга по денежным средствам определяются отдельно по каждому денежному торговому счету участника клиринга. Нетто-обязательство (нетто-требование) участника клиринга по денежным средствам рассчитывается по формуле:

НОД = СТ - СО, где:

НОД - нетто-обязательство (нетто-требование) участника клиринга по соответствующему денежному торговому счету;

СТ - сумма требований участника клиринга по соответствующему денежному торговому счету, рассчитываемая по всем сделкам, включенным в клиринговый пул (срок исполнения по которым наступил), по которым участник клиринга выступает продавцом ценных бумаг, в том числе при включении в клиринговый пул обязательств по исполнению второй части сделки РЕПО;

СО - сумма обязательств участника клиринга по соответствующему денежному торговому счету, рассчитываемая по всем сделкам, включенным в клиринговый пул, по которым участник клиринга выступает покупателем ценных бумаг, в том числе при включении в клиринговый пул обязательств по исполнению второй части сделки РЕПО.

Отрицательное значение НОД означает нетто-обязательство участника клиринга по соответствующему денежному торговому счету, положительное значение НОД - нетто-требование участника клиринга по соответствующему денежному торговому счету.

2.7.6. Нетто-обязательство (нетто-требование) участника клиринга по ценным бумагам определяется по каждой ценной бумаге по каждому торговому счету депо. При этом нетто-обязательство (нетто-требование) участника клиринга по ценным бумагам, рассчитывается по формуле:

НОЦ = СТЦ - СОЦ, где:

НОЦ - нетто-обязательство (нетто-требование) участника клиринга по данной ценной бумаге и данному счету депо;

СТЦ - сумма требований участника клиринга по данному счету депо, рассчитываемая по всем обеспеченным сделкам с данной ценной бумагой, включенным в клиринговый пул, по которым участник клиринга выступает покупателем ценных бумаг, в том числе при включении в клиринговый пул обязательств по исполнению второй части сделки РЕПО;

СОЦ - сумма обязательств участника клиринга по данному счету депо, рассчитываемая по всем обеспеченным сделкам с данной ценной бумагой, включенным в клиринговый пул, по которым участник клиринга выступает продавцом ценных бумаг, в том числе при включении в клиринговый пул обязательств по исполнению второй части сделки РЕПО.

Отрицательное значение НОЦ означает нетто-обязательство участника клиринга по данной ценной бумаге и данному счету депо, положительное значение НОЦ - нетто-требование участника клиринга по данной ценной бумаге и данному счету депо.

2.7.7. Для сделки с кодом расчетов "T0", а также первой части сделок РЕПО с кодом расчетов "Sn" в день исполнения сделки обязательство (требование) по ценным бумагам равно количеству ценных бумаг, проданных (купленных) в соответствии с заключенной сделкой.

2.7.8. Для сделки с кодом расчетов "Sn" в день ее заключения обязательство (требование) по ценным бумагам равно количеству ценных бумаг, необходимых для гарантийного обеспечения заключенной сделки.

2.7.9. Для сделки с кодом расчетов "Sn" в день исполнения обязательство (требование) по ценным бумагам равно количеству ценных бумаг, проданных (купленных) в соответствии с заключенной сделкой с учетом ценных бумаг, переданных в качестве гарантийного обеспечения в день заключения сделки.

2.7.10. Для второй части сделки РЕПО в день исполнения второй части обязательство (требование) по ценным бумагам равно количеству ценных бумаг, подлежащих возврату в соответствии с условиями исполнения второй части сделки РЕПО.

2.7.11. Обязательство (требование) по денежным средствам по сделке с кодом расчетов "T0", а также по первой части сделки РЕПО с кодом расчетов "S0" в день заключения сделки равно сумме сделки с учетом средств, необходимых для уплаты комиссионного сбора.

2.7.12. Обязательство по денежным средствам по сделке с кодом расчетов "Sn" в день заключения равно сумме гарантийного обеспечения по ее исполнению.

2.7.13. Обязательство (требование) по денежным средствам по сделке с кодом расчетов "Sn" в день исполнения равно сумме денежных средств, равной сумме сделки с учетом средств, необходимых для уплаты комиссионного вознаграждения и средств ранее переданных в качестве гарантийного обеспечения.

2.7.14. Обязательство (требование) по денежным средствам по первой части сделки РЕПО с кодом расчетов "Sn" (где n – отлично от 0) в день заключения сделки равно сумме денежных средств, необходимых для уплаты комиссионного сбора, в день исполнения сделки – сумме РЕПО.

2.7.15. Обязательство (требование) по денежным средствам по второй части сделки РЕПО в день ее исполнения равно стоимости обратного выкупа в соответствии с условиями заключения сделки.

2.7.16. СПВБ определяет нетто-обязательства и нетто-требования участников клиринга и вносит соответствующие значения в следующие клиринговые регистры:

2.7.16.1. Регистры "Обязательства по ценным бумагам участника клиринга, сформированные по результатам собственных сделок" (регистры типа "OAT", "OAP", "OAD", "OFT", "OFD", "OFF") - клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по

ценным бумагам участника клиринга, сформированных по результатам сделок, заключенных с ценными бумагами.

2.7.16.2. Регистры "Обязательства по ценным бумагам участника клиринга, сформированные по результатам клиентских сделок" (регистры типа "OBT", "OBP", "OBD", "OLT", "OLD", "OLP", "OBE") - клиринговые регистры, предназначенные для учета совокупных обязательств по ценным бумагам клиентов участника клиринга, сформированных по результатам сделок с ценными бумагами, заключенных по поручению клиентов участников клиринга.

2.7.16.3. Регистры "Обязательства по ценным бумагам участника клиринга, сформированные по результатам клиентских сделок" (регистры типа "OCT", "OCP", "OCD",) - клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по ценным бумагам участника клиринга, имеющего попечителя - Участника клиринга, сформированных по результатам сделок с ценными бумагами, заключенных по поручению участника клиринга.

2.7.16.4. Регистры "Обязательства по ценным бумагам участника клиринга, сформированные по результатам собственных сделок" (регистры типа "ODT", "ODP", "ODD", "OYT", "OYP", "OYD") - клиринговые регистры, предназначенные для учета обязательств по ценным бумагам в доверительном управлении участника клиринга, сформированных по результатам заключенных им сделок с ценными бумагами.

2.7.16.5. Регистр "Обязательства по ценным бумагам участника клиринга, сформированные по результатам собственных сделок" (регистр типа "OE") - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по ценным бумагам участника клиринга - эмитента, сформированных по результатам сделок с ценными бумагами, заключенных по его поручению.

2.7.16.6. Регистр "Обязательства по денежным средствам, сформированные по результатам собственных сделок участника клиринга" (регистр типа "OM") - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным средствам участника клиринга, сформированных по результатам собственных сделок, заключенных с ценными бумагами.

2.7.16.7. Регистр "Обязательства по денежным средствам в рублях, сформированные по результатам собственных сделок участника клиринга" (регистр типа "OPS") - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным средствам участника клиринга, сформированных по результатам собственных сделок с кодом расчетов "Sn", заключенных с ценными бумагами.

2.7.16.8. Регистр "Обязательства по денежным средствам в рублях, сформированные по результатам сделок, заключенных участником клиринга в интересах клиентов" (регистр типа "OPK") - клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным средствам участника клиринга, сформированных по результатам сделок с кодом расчетов "Sn", заключенных с ценными бумагами в интересах клиентов.

2.7.16.9. Регистр "Обязательства по денежным средствам, сформированные по результатам сделок, заключенных участником клиринга в интересах клиентов" (регистр типа "OK")-клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств по денежным средствам участника клиринга, сформированных по результатам сделок, заключенных участником клиринга с ценными бумагами в интересах клиентов.

2.7.16.10. При этом нетто-обязательства вносятся в регистры с отрицательным знаком, а нетто-требования - с положительным.

2.7.17. Обеспеченность ценными бумагами и денежными средствами всех сделок участника клиринга, входящих в клиринговый пул, контролируется процедурами контроля обеспечения, применяемыми в клиринговой системе.

2.7.18. СПББ проверяет обеспеченность сделок участника клиринга путем сравнения значений клиринговых регистров, перечисленных в п. 2.7.16, со значениями клиринговых регистров, перечисленных в п. 2.4.8 и содержащих информацию о значениях остатков на торговых счетах и счетах депо поставки участников клиринга после получения данных из расчетного депозитария или расчетной организации.

2.7.19. В том случае, когда модули значений нетто-обязательств участников клиринга по ценным бумагам и денежным средствам не превышают значения клиринговых регистров, содержащих информацию о начальных значениях остатков по денежным средствам и ценным бумагам на торговых счетах и счетах депо поставки участников клиринга, соответственно, сделки участника клиринга считаются обеспеченными ценными бумагами и денежными средствами.

2.7.20. По результатам неттинга СПВБ на основании значений клиринговых регистров, перечисленных в п.2.7.16, формирует и передает:

- в расчетный депозитарий - сводное поручение депо, которое является основанием для проведения операций по торговым счетам депо и счетам депо поставки участников клиринга;
- в расчетную организацию – сводное платежное поручение, которое является основанием для проведения операций по денежным торговым счетам участников клиринга.

2.8. Порядок определения обязательств клиентов участников клиринга.

2.8.1. На основании реестра сделок СПВБ определяет нетто-обязательства и нетто-требования клиентов участников клиринга по ценным бумагам и денежным средствам.

2.8.2. Нетто-обязательство (нетто-требование) каждого клиента участника клиринга по денежным средствам рассчитывается по формуле:

НОД = СТ - СО, где:

НОД - нетто-обязательство (нетто-требование) клиента участника клиринга;

СТ - сумма требований клиента участника клиринга, рассчитываемая по всем сделкам, включенным в клиринговый пул, по покупке ценных бумаг, заключенным от имени данного клиента.

СО - сумма обязательств клиента участника клиринга, рассчитываемая по всем сделкам, включенным в клиринговый пул, по продаже ценных бумаг, заключенным от имени данного клиента.

Отрицательное значение НОД означает нетто-обязательство клиента участника клиринга, положительное значение НОД - нетто-требование клиента участника клиринга.

2.8.3. Нетто-обязательство (нетто-требование) клиента участника клиринга по ценным бумагам определяется по каждой ценной бумаге. При этом нетто-обязательство (нетто-требование) клиента участника клиринга по ценным бумагам, рассчитывается по формуле:

НОЦ = СТЦ - СОЦ, где:

НОЦ - нетто-обязательство (нетто-требование) клиента участника клиринга по данной ценной бумаге;

СТЦ - сумма требований клиента участника клиринга, рассчитываемая по всем сделкам, включенным в клиринговый пул, по покупке данной ценной бумаги, заключенным от имени данного клиента.

СОЦ - сумма обязательств клиента участника клиринга, рассчитываемая по всем сделкам, включенным в клиринговый пул, по продаже данной ценной бумаги, заключенным от имени данного клиента.

Отрицательное значение НОЦ означает нетто-обязательство клиента участника клиринга по данной ценной бумаге, положительное значение НОЦ - нетто-требование клиента участника клиринга по данной ценной бумаге.

2.8.4. Обязательства (требования) по денежным средствам и ценным бумагам по сделкам, заключенным по поручению клиента участника клиринга, рассчитываются в порядке, определенном в пп. 2.7.7-2.7.13.

2.8.5. Учет обязательств (требований) каждого клиента участника клиринга по ценным бумагам осуществляется на отдельных разделах регистров типа "OBT", "OBP", "OBD", "OLT", "OLD", "OLP".

2.8.6. Учет обязательств (требований) каждого клиента участника клиринга по денежным средствам осуществляется на отдельных разделах регистров типа "OK", "OPK", "OPB"

2.9. Порядок действий в случае расхождения данных при сверке и контроле обеспеченности сделок клирингового пула.

2.9.1. В случае, когда при проверке обеспеченности сделок модули значений нетто-обязательств участников клиринга по денежным средствам превышают значения клиринговых регистров, содержащих информацию о начальных значениях остатков по денежным средствам на торговых счетах участников клиринга, СПВБ не осуществляет неттинг по всем сделкам клирингового пула. Клиринговый центр в этом случае выявляет причины отсутствия обеспеченности сделок и осуществляет исключение обязательств по необеспеченным сделкам из клирингового пула. Исключению подлежат только обязательства по сделкам, относящимся к торговым счетам, в отношении которых выявлен недостаток обеспечения. Обязательства по сделкам исключаются в следующем порядке: а) обязательства по второй части сделки РЕПО; б) обязательства по исполнению сделок (в том числе первой части сделки РЕПО) с кодом расчетов "Sn"; в) обязательства по иным сделкам.

2.9.2. В случае, если участник клиринга, по торговому счету которого выявлен недостаток обеспечения имеет обязательства по этому торговому счету по вторым частям сделок РЕПО, срок исполнения которых наступил, клиринговый центр исключает обязательства по второй части сделки РЕПО из клирингового пула и передает информацию о неисполненных сделках в торговую систему для урегулирования в соответствии с Правилами торговли. Исключение указанных сделок из клирингового пула производится таким образом, чтобы в результате был исполнен максимально возможный объем обязательств участника клиринга. В случаях предусмотренных Правилами торговли и иными документами, регулирующими порядок заключения сделок РЕПО в фондовой секции СПВБ, участник клиринга, являющийся второй стороной по сделкам, обязательства по которым не прошли контроль обеспечения, может сообщить СПВБ об особом порядке исключения обязательств по вторым частям сделок РЕПО. В случае, если после исключения обязательств по исполнению вторых частей сделок РЕПО процедура контроля обеспечения успешна, СПВБ выполняет действия в соответствии с п. 2.9.5 настоящих Правил.

2.9.3. В случае, если после исключения из клирингового пула обязательств по исполнению вторых частей сделок РЕПО участник клиринга имеет необеспеченные обязательства из клирингового пула исключаются сделки с кодом расчетов «Sn». При исключении из клирингового пула обязательств по сделке с кодом расчетов «Sn», Клиринговый центр включает в клиринговый пул обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения в соответствии с разделом 2.17 настоящих Правил. Исключение сделок из клирингового пула производится таким образом, чтобы в результате был исполнен максимально возможный объем обязательств.

2.9.4. В случае, если после исключения из клирингового пула необеспеченных обязательств по вторым частям сделок РЕПО и по исполнению сделок с кодом расчетов «Sn» обеспечения недостаточно для исполнения обязательств по иным сделкам реестр сделок передается обратно в систему торгов, в которой в соответствии с Правилами торгов необеспеченным сделкам присваивается статус неисполненных и они исключаются из клирингового пула.

2.9.5. После проведения описанных в пп.2.9.1-2.9.4 действий СПВБ вновь формирует реестр сделок и производит определение обязательств участников клиринга.

2.9.6. Контроль результатов неттинга проводится в соответствии с алгоритмами и процедурами определения ошибок, допущенных в клиринговой системе при расчетах.

2.9.7. При проведении контроля значений клиринговых регистров СПВБ осуществляет сверку значений позиций Участников клиринга в системе торгов на момент формирования реестра сделок, по которым производится клиринг, с соответствующими значениями клиринговых регистров, содержащих информацию о значениях остатков на торговых счетах и счетах депо поставки участников клиринга с учетом исполнения их нетто-обязательств и нетто-требований.

2.9.8. В том случае, когда при контроле результатов неттинга обнаружены ошибки, СПВБ осуществляет их поиск, устраняет найденные ошибки и повторно производит определение обязательств участников клиринга.

2.9.9. СПВБ уведомляет ФСФР о факте обнаружения недостаточности ценных бумаг и (или) денежных средств для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула, когда это повлекло за собой задержку расчетов на три часа и более.

2.10. Порядок и сроки передачи поручений в расчетную организацию и расчетный депозитарий.

2.10.1. СПВБ передает в расчетный депозитарий и расчетную организацию отчеты в форме сводного платежного поручения и сводного поручения депо на проведение операций по торговым счетам и счетам депо поставки участников клиринга по итогам сделок клирингового пула. Поручения передаются в форме электронного документа. Форматы и время передачи поручений определяются в договорах СПВБ с расчетным депозитарием и расчетной организацией.

2.10.2. Время передачи поручений, а также сроки исполнения данных поручений определяются в Регламенте взаимодействия.

2.10.3. Типовые формы документов обмена информацией между СПВБ и расчетными депозитариями (расчетными организациями) приведены в Приложениях №№ 7,8,9.

2.10.4. Условиями договоров, заключаемых между СПВБ и расчетными депозитариями (расчетными организациями), могут устанавливаться иные, то есть отличные от приведенных в Приложениях №№ 7, 8, 9 формы документов.

2.11. Порядок и сроки получения информации о проведенных расчетах от расчетной организации и расчетного депозитария.

2.11.1. На основании полученных от СПВБ поручений расчетный депозитарий и расчетная организация осуществляют переводы ценных бумаг и денежных средств по счетам участников клиринга. Время осуществления операций определяется Регламентом взаимодействия.

2.11.2. Расчетная организация на основании сводного платежного поручения осуществляет списание денежных средств с соответствующих торговых счетов участников клиринга, имеющих нетто-обязательства по денежным средствам, в размере их нетто-обязательств и их зачисление на соответствующее торговые счета участников клиринга, имеющих нетто-требования по денежным средствам, в размере их нетто-требований.

2.11.3. При проведении расчетов расчетная организация проводит списание денежных средств со счетов собственных средств, брокерских счетов и специальных брокерских счетов Участников клиринга в размере их нетто-обязательств:

- на счет № 30407 - денежный счет "Расчеты по зачету обязательств и требований расчетных центров по итогам операций их участников на ОРЦБ"- счет расчетной организации, предназначенный для осуществления расчетов по итогам торгов;
- на счет № 60322 - денежный счет "Расчеты с прочими кредиторами" - счет расчетной организации, предназначенный для осуществления расчетов по уплате комиссионного вознаграждения Участниками клиринга по итогам торгов.

2.11.4. При проведении расчетов расчетная организация проводит зачисление денежных средств на счета собственных средств, брокерские счета и специальные брокерские счета участников клиринга в размере их нетто-требований со счета № 30407.

2.11.5. Расчетный депозитарий на основании сводного поручения депо осуществляет:

- списание ценных бумаг с торговых счетов депо участников клиринга, имеющих нетто-обязательства по ценным бумагам, и их зачисление на торговые счета депо участников клиринга, имеющих нетто-требования по ценным бумагам по сделкам с кодом расчетов "T0" в день T;
- списание ценных бумаг в размере гарантийного обеспечения с торговых счетов депо участников клиринга, имеющих нетто-обязательства по ценным бумагам, и их зачисление на счета депо поставки тех же участников клиринга, по сделкам с кодом расчетов Sn в день совершения сделки

- списание ценных бумаг с торговых счетов депо участников клиринга, имеющих нетто-обязательства по ценным бумагам, и их зачисление на торговые счета депо участников клиринга, имеющих нетто-требования по ценным бумагам по сделкам с кодом расчетов Sn и сделкам РЕПО в день исполнения обязательств;
- списание ценных бумаг со счетов депо поставки участников клиринга, имеющих нетто-обязательства по ценным бумагам, и их зачисление на торговые счета депо участников клиринга, имеющих нетто-требования по ценным бумагам по сделкам с кодом расчетов "Sn" в день исполнения обязательств;
- списание ценных бумаг со счетов депо поставки участников клиринга, имеющих нетто-обязательства по ценным бумагам, и их зачисление на торговые счета депо тех же участников клиринга по сделкам с кодом расчетов "Sn" в случае необеспеченности сделок денежными средствами в день исполнения обязательств.

2.11.6. Расчетный депозитарий осуществляет переводы по торговым счетам депо и счетам депо поставки участников клиринга в корреспонденции со счетом депо, открытым в расчетном депозитарии, для технического обеспечения процедуры поставки ценных бумаг в соответствии с нетто-обязательствами и нетто-требованиями участников клиринга. Наименование, обозначение и режим указанного счета депо определяется Условиями депозитарной деятельности данного расчетного депозитария.

2.11.7. Расчетная организация и расчетный депозитарий передают СПВБ отчеты об остатках на торговых счетах и счетах депо поставки участников клиринга, сформированные по итогам обработки сводного платежного поручения и сводного поручения депо, соответственно, в формате отчета об остатках на торговых счетах и счетах депо поставки участников клиринга (Приложения №№ 7,8,9). Время и порядок обмена электронными документами определяется Регламентом взаимодействия.

2.12. Порядок проведения сверки результатов расчетов.

2.12.1. СПВБ осуществляет сверку результатов расчетов на основании отчетов, полученных из расчетного депозитария и расчетной организации в следующем порядке:

2.12.1.1. СПВБ на основании полученных из расчетной организации и расчетного депозитария отчетов об остатках на торговых счетах и счетах депо поставки участников клиринга, сформированных по итогам обработки сводного платежного поручения и сводного поручения депо, соответственно, заполняет клиринговые регистры, перечисленные в п. 2.4.8

2.12.1.2. В клиринговой системе проводится сверка значений соответствующих клиринговых регистров с данными, полученными в результате собственных расчетов, по каждому участнику клиринга.

2.12.1.3. При отсутствии расхождений СПВБ направляет в расчетную организацию и расчетный депозитарий поручение на разблокировку торговых счетов участников клиринга или в случае проведения промежуточных расчетов – уведомление о завершении промежуточных расчетов.

2.12.1.4. После получения от СПВБ поручения на разблокировку расчетная организация и расчетный депозитарий осуществляют разблокировку денежных средств на денежных торговых счетах и разблокировку ценных бумаг на торговых счетах депо участников клиринга, соответственно.

2.12.1.5. С момента разблокировки торговых счетов расчеты по нетто-обязательствам и нетто-требованиям участников клиринга считаются выполненными, обязательства участников клиринга по сделкам клирингового пула считаются исполненными.

2.12.1.6. Порядок взаимодействия, время начала и сроки исполнения операций сверки определяются Регламентом взаимодействия.

2.13. Порядок действий в случае расхождения данных при сверке.

2.13.1. В случае обнаружения расхождений при проведении сверки значений соответствующих клиринговых регистров с данными, полученными в результате собственных расчетов, по каждому участнику клиринга СПВБ формирует протокол расхождений и направляет его в расчетную

организацию и/или расчетный депозитарий для установления причин расхождения данных. Сроки выявления расхождений определяется договором, заключаемым СПВБ с расчетной организацией и/или расчетным депозитарием, и Регламентом взаимодействия

2.13.2. СПВБ, расчетная организация и/или расчетный депозитарий, руководствуясь собственными внутренними процедурами, предпринимают действия, по поиску и выявлению причин, приведших к расхождению данных, и их устранению.

2.13.3. В зависимости от характера выявленных причин расхождения данных Стороны повторно, полностью или частично, выполняют действия, описанные в пп. 2.10 и 2.11 Правил, после которых СПВБ повторно проводит сверку остатков на торговых счетах и счетах депо поставки участников клиринга в соответствии с п. 2.12 Правил.

2.13.4. Порядок присвоения сделкам клирингового пула статуса «неисполненные» определен в Правилах торгов.

2.13.5. СПВБ уведомляет ФСФР о факте обнаружения расхождения данных при проведении сверки в случаях, когда указанные расхождения повлекли за собой задержку расчетов на три часа и более.

2.14. Порядок обеспечения исполнения обязательств.

2.14.1. Для обеспечения исполнения обязательств участников клиринга по сделкам с ценными бумагами СПВБ осуществляет следующие действия:

2.14.1.1. Устанавливает в соответствии с п. 2.6 Правил лимиты по допустимому объему сделок каждому участнику клиринга.

2.14.1.2. Осуществляет расчет обязательств (требований) участников клиринга и включение их в сводные поручения только по обеспеченным сделкам.

2.14.1.3. Устанавливает требование к договорам, заключаемым с расчетным депозитарием и расчетной организацией, о блокировке торговых счетов участников клиринга после передачи СПВБ отчетов об остатках.

2.15. Особенности проведения промежуточных расчетов.

2.15.1. Промежуточные расчеты проводятся с целью предоставления возможности участникам клиринга списания денежных средств в размере их нетто-требований по денежным средствам, рассчитанных по итогам сделок данного участника клиринга с наступившим сроком расчетов, заключенных в период с начала торговой сессии до времени начала промежуточных расчетов (или в период между промежуточными расчетами).

2.15.2. Время проведения промежуточных расчетов определяется регламентом взаимодействия.

2.15.3. Для проведения промежуточных расчетов СПВБ формирует клиринговый пул из сделок, срок исполнения которых наступил к моменту начала промежуточных расчетов.

2.15.4. СПВБ производит расчет обязательств участников клиринга и их клиентов по сделкам клирингового пула в порядке, определенном в пп.2.7, 2.8 и проверку обеспеченности сделок в порядке, определенном в п. 2.7.

2.15.5. При выявлении необеспеченных сделок, СПВБ в соответствии с порядком, установленным Правилами, исключает необеспеченные сделки из клирингового пула. В случае исключения из клирингового пула сделок РЕПО с Банком России СПВБ переносит расчеты по указанным сделкам на следующую расчетную сессию. В отношении иных сделок, исключенных из клирингового пула, СПВБ производит действия в соответствии с п.2.9. По обеспеченным сделкам клирингового пула осуществляется стандартная процедура расчетов, предусмотренная Правилами.

2.15.6. На время проверки обеспеченности сделок клирингового пула и выполнения действий, описанных в п. 2.9, системой торгов заявки участников клиринга не принимаются.

2.15.7. После завершения действий, описанных выше, СПВБ в порядке, определенном Правилами формирует и передает сводные поручения для расчетной организации и расчетного депозитария, получает отчеты и производит сверку.

2.15.8. После успешного завершения сверки СПВБ корректирует в системе торгов начальные позиции участников клиринга, изменяя их до значений, равных текущим позициям на момент формирования реестра сделок, по результатам которого были сформированы сводные поручения, и направляет расчетной организации и расчетному депозитарию уведомление о завершении промежуточных расчетов. С этого момента промежуточные расчеты считаются законченными.

2.15.9. Форма уведомления о завершении промежуточных расчетов согласовывается в договорах СПВБ с расчетным депозитарием и расчетной организацией.

2.15.10. В случае несовпадений данных при сверке СПВБ производит действия, определенные п. 2.13.

2.15.11. После окончания сверки разблокировка торговых счетов участников клиринга не производится.

2.15.12. В период проведения промежуточных расчетов СПВБ не принимает запросы на списание денежных средств, не производит проверку достаточности и не выдает подтверждения расчетной организации для списания денежных средств с торговых счетов участника клиринга.

2.16. Порядок и сроки предоставления отчетов участникам клиринга.

2.16.1. СПВБ формирует отчетные документы для участников клиринга, содержащие информацию об итогах проведения клиринга и расчетов. Форма отчетов приведена в Приложении № 11 к Правилам.

2.16.2. Отчеты участнику клиринга в бумажной форме предоставляются по месту расположения СПВБ уполномоченным представителям участников клиринга.

2.16.3. Отчеты для клиентов участника клиринга формируются СПВБ в электронном виде. Участник клиринга при помощи рабочего места Участника клиринга самостоятельно их распечатывает и передает своим клиентам. Отчет для клиента участника клиринга в бумажной форме, подписанный уполномоченным сотрудником СПВБ, предоставляется по отдельному запросу участника клиринга его уполномоченным представителям.

2.16.4. Порядок и сроки предоставления указанных отчетов устанавливаются договором об осуществлении клирингового обслуживания, заключенным клиринговой организацией с участником клиринга.

2.17. Порядок распределения и/или возмещения убытков участников клиринга в случае отмены расчетов по заключенным сделкам.

2.17.1. СПВБ не будет нести ответственность в случае непроведения расчетов по сделкам, заключенным участником клиринга, если их проведение окажется невозможным вследствие обстоятельств непреодолимой силы.

2.17.2. СПВБ не отвечает за последствия отмены торгов и/или расчетов по основаниям, предусмотренным Правилами торгов.

2.17.3. СПВБ не отвечает за убытки участника клиринга в случае признания сделок неисполненными или неудовлетворении оферт вследствие недостаточности денежных средств или ценных бумаг участника клиринга для завершения расчетов в день исполнения обязательств.

2.17.4. Порядок уплаты Возмещения по сделкам с кодом расчетов «Sn». В случае, если сделка с кодом расчетов «Sn» отменена из-за отсутствия обеспечения на день расчетов на торговых счетах одного из участников клиринга при том, что участник клиринга, являющийся другой стороной по сделке полностью исполнил свои обязательства по предоставлению обеспечения, участник клиринга, имеющий необеспеченные обязательства выплачивает участнику клиринга, являющемуся второй стороной по сделке Возмещение в размере гарантийного обеспечения. Возмещение по сделке с ценными бумагами удерживается путем списания денежных средств (в размере соответствующего обязательства по уплате Возмещения) с торгового счета Участника клиринга и зачисления этих денежных средств на торговый счет Участника клиринга – контрагента по этой сделке. Возмещение по сделке может быть удержано только в полном объеме, частичное удержание Возмещения по сделке не допускается. В случае, если участник клиринга не исполнивший обязательства по сделке предоставлял в качестве гарантийного

обеспечения ценные бумаги СПВБ производит удержание и перевод Возмещения по согласованию со сторонами сделки.

2.17.5. СПВБ не несет ответственности:

- за непроведение расчетов по нетто-обязательствам и нетто-требованиям участников клиринга в случае неисполнения расчетной организацией и/или расчетными депозитариями сводных поручений СПВБ;
- за действия расчетной организации и/или расчетных депозитариев после передачи им распоряжений на разблокировку денежных средств на денежных торговых счетах и ценных бумаг на торговых счетах депо, соответственно.

2.17.6. В том случае, когда исключение сделок из клирингового пула и/или отмена результатов торгов были вызваны ошибочными действиями СПВБ, в результате чего участнику клиринга был причинен ущерб, СПВБ обязуется возместить ему убытки из собственных средств в порядке и сумме, согласованной Сторонами в претензионном порядке. Порядок рассмотрения претензий определяется договором о клиринговом обслуживании.

2.18. Порядок формирования, хранения и использования Гарантийного фонда.

2.18.1. В целях управления рисками, связанными с необходимостью обеспечения обязательств по сделкам, а также в целях возмещения убытков участников клиринга, связанных с не проведением расчетов по итогам заключенных сделок, СПВБ формирует гарантийный фонд.

2.18.2. Порядок формирования, хранения и использования Гарантийного фонда определяется "Порядком создания, размещения и использования специального (гарантийного) фонда".

2.18.3. СПВБ уведомляет ФСФР о факте использования средств Гарантийного фонда.

2.19. Организация учета, порядок формирования реестров.

2.19.1. СПВБ ведет следующие реестры:

2.19.1.1. "Реестр участников клиринга". Данный реестр формируется на основании анкет участников клиринга и содержит всю информацию по каждому участнику клиринга, содержащуюся в анкете (приложение №6). Записи в данный реестр производятся не позднее второго рабочего дня после передачи участником клиринга СПВБ анкеты. Помимо данных, содержащихся в анкете участника клиринга, в данный реестр вносится дата аккредитации в качестве участника клиринга (дата подписания договора клирингового обслуживания) и информация о принятых СПВБ дисциплинарных мерах по приостановлению и прекращению клирингового обслуживания участника клиринга.

2.19.1.2. "Реестр клиентов участника клиринга". Записи в данный реестр производятся в день внесения участником клиринга изменений информации о своих клиентах,.

2.19.1.3. "Реестр остатков ценных бумаг и денежных средств, размещенных на торговых счетах участников клиринга". Записи в данный реестр производятся на основании отчетов об остатках на торговых счетах, предоставляемых СПВБ расчетным депозитарием и расчетной организацией каждый раз после получения данных отчетов.

2.19.1.4. "Реестр принятых поручений (договоров клирингового обслуживания)". Реестр содержит информацию о номере договора, датах начала и окончания действия договора, коде и наименовании участника клиринга. Записи в данный реестр вносятся в день подписания сторонами договора клирингового обслуживания (приложение №1 к Правилам).

2.19.1.5. "Реестр поручений СПВБ". Реестр содержит информацию о дате, времени и номере реестра сделок, сформированного по итогам торгов на СПВБ.

2.19.1.6. "Реестр сделок, по которым осуществлен клиринг". Данный реестр содержит информацию о всех сделках, прошедших процедуру контроля обеспечения. Записи в реестр производятся на основании реестров сделок, результатов проверки обеспеченности и получении отчетов от расчетной организации и расчетного депозитария каждый раз после проведения расчетов.

2.19.1.7. "Реестр поручений, направленных расчетной организации и расчетному депозитарию". Данный реестр содержит информацию о сводных поручениях, направленных

в расчетную организацию и расчетный депозитарий. Записи в данный реестр производятся каждый раз после отправки сводных поручений в расчетную организацию и расчетный депозитарий и получения отчетов от них.

2.19.1.8. "Реестр отправленных отчетов". Записи в данный реестр производятся после завершения расчетов и содержат информацию, содержащуюся в предоставленных участнику клиринга и(или) его клиенту отчетах.

2.19.2. Указанные в п. 2.19.1 реестры ведутся в электронном виде.

2.19.3. СПВБ ведет "Журнал входящих документов", в котором фиксируется предоставление участниками клиринга документов клирингового учета, определенных в п.2.1.5

2.19.4. Формы реестров и журналов, указанных в пп. 2.19.1 и 2.19.3, определены в Приложении № 12 к Правилам.

2.19.5. Документы клирингового учета хранятся в течение пяти лет в соответствии с требованиями, установленными законодательством Российской Федерации.

2.20. Особенности осуществления клиринга по Клиринговому пулу сделок РЕПО с Банком России.

2.20.1. Порядок зачисления денежных средств на торговые счета и ценных бумаг на торговые счета депо

2.20.1.1. Участник клиринга – продавец по сделке РЕПО, планирующий заключение на текущих торгах сделок РЕПО с кодом расчетов "T0" перед подачей заявок РЕПО должен зарезервировать в полном объеме сумму денежных средств, необходимую для обеспечения исполнения его обязательств по уплате комиссионного вознаграждения организатору торговли на торговом счете, открытом в расчетной организации, а также ценных бумаг на соответствующем торговом счете депо в расчетном депозитарии в объеме, необходимом для полного исполнения обязательств по первой части таких сделок РЕПО,

2.20.1.2. Участник клиринга – продавец по сделке РЕПО, планирующий заключение на текущих торгах сделок РЕПО с кодом расчетов "Sn" перед подачей заявок РЕПО должен зарезервировать в полном объеме сумму денежных средств, необходимую для обеспечения исполнения его обязательств по уплате комиссионного вознаграждения организатору торговли на торговом счете, открытом в расчетной организации,

2.20.1.3. Участник клиринга, имеющий нетто-обязательство по денежным средствам по итогам неттинга всех сделок РЕПО клирингового пула, заключенным или подлежащим заключению на основе зарегистрированных Организатором торговли оферт с указанием одного и того же торгового счета. с текущей датой исполнения, обязан зарезервировать в полном объеме сумму нетто-обязательств, рассчитанную Клиринговым центром, на соответствующем торговом счете до начала проведения расчетов в соответствии регламентом Клирингового центра. На основании выданной участником клиринга доверенности Клиринговый центр вправе использовать при осуществлении расчетов по клиринговому пулу денежные средства, принадлежащие участнику клиринга и находящиеся на всех торговых разделах торгового счета участника клиринга, открытых данному участнику в расчетной организации.

2.20.1.4. Участник клиринга, имеющий нетто-обязательство по ценным бумагам по итогам неттинга всех сделок РЕПО клирингового пула, заключенных или подлежащих заключению на основе зарегистрированных Организатором торговли оферт с указанием одного и того же торгового счета депо с текущей датой исполнения обязан зарезервировать в порядке, установленном Правилами торговли ценные бумаги в объеме, достаточном для исполнения нетто-обязательств, рассчитанных Клиринговым центром, на соответствующем торговом счете депо до начала проведения расчетов в соответствии регламентом Клирингового центра. На основании выданной участником клиринга доверенности Клиринговый центр вправе использовать при осуществлении расчетов по клиринговому пулу ценные бумаги, принадлежащие участнику клиринга и находящиеся на всех торговых разделах торгового счета депо участника клиринга, открытых данному участнику в расчетном депозитарии.

2.20.1.5. Блокировка зарезервированных денежных средств и ценных бумаг на торговых счетах участника клиринга осуществляется на период проведения расчетов по клиринговому пулу в соответствии с Регламентом взаимодействия и означает, что списание зарезервированных денежных средств и ценных бумаг с торговых счетов участника клиринга производится только на основании сводного платежного поручения и сводного поручения депо Клирингового центра.

2.20.1.6. Время, до истечения которого участник клиринга должен подать поручение на зачисление средств на торговый счет в расчетной организации, а также на перевод ценных бумаг на торговый счет в расчетном депозитарии, определяется документами расчетной организации/расчетного депозитария и Правилами торговли.

2.20. 2. Порядок изменения значений клиринговых регистров

2.20.2.1. Порядок изменения значений клиринговых регистров определен в пункте 2.5. настоящих Правил с учетом следующего.

2.20.2.2. Участник клиринга имеет право в течение торгов списывать ценные бумаги/денежные средства с торговых счетов в расчетном депозитарии/расчетной организации. Расчетный депозитарий/расчетная организация при получении поручения на списание ценных бумаг/денежных средств от участника клиринга направляет СПВБ запрос на возможность произведения такого списания.

2.20.2. 3. СПВБ после получения запроса осуществляет проверку достаточности ценных бумаг/денежных средств на торговом счете участника клиринга. Сумма ценных бумаг/денежных средств на торговом счете участника клиринга, остающаяся после списания, должна обеспечивать исполнение обязательств участника клиринга по заключенным сделкам с кодом расчетов T0.

2.20.2.4. При успешной проверке достаточности ценных бумаг/денежных средств, СПВБ направляет расчетному депозитарию/расчетной организации подтверждение, на основании которого расчетный депозитарий/расчетная организация производит списание ценных бумаг/денежных средств. Если результат проверки отрицательный, СПВБ направляет расчетному депозитарию/расчетной организации отказ в подтверждении, который служит основанием для отказа расчетным депозитарием/расчетной организацией в исполнении поручения участника клиринга.

2.20.2.5. СПВБ производит изменение значений клиринговых регистров, содержащих информацию о начальных значениях остатков на торговых счетах и счетах депо участников клиринга, в соответствии с отчетами, вновь полученными от расчетного депозитария или расчетной организации, в течение 30 минут после получения отчетов.

2.20.3. Порядок проведения проверки обеспеченности сделок денежными средствами и ценными бумагами и определения подлежащих исполнению обязательств участников клиринга установлен пунктом 2.7. настоящих Правил с учетом следующего.

2.20.3.1. После окончания торговой сессии или во время, определенное регламентом как время проведения промежуточных расчетов, СПВБ формирует реестр сделок и оферт. Реестр сделок и оферт представляет собой электронный документ в формате, определенном в Приложении №10 к Правилам. Порядок и сроки формирования реестра сделок и оферт определяются Регламентом взаимодействия.

2.20.3.2. В соответствии с условиями заключения/исполнения сделок, Клиринговый центр определяет сделки, которые могут быть заключены/исполнены в текущую расчетную сессию и включает указанные сделки в клиринговый пул. В клиринговый пул включаются сделки срок исполнения которых наступает в текущую дату. Клиринговый центр осуществляет определение и учет обязательств и требований по денежным средствам по каждой позиции по денежным средствам Участника клиринга (в соответствии с условиями заключенных им сделок, обязательства по которым включены в соответствующий клиринговый пул). Клиринговый центр осуществляет определение и учет обязательств и требований по ценным бумагам по каждой позиции депо и по каждой учетной позиции Участника клиринга в отношении каждой ценной бумаги в отдельности (в соответствии с условиями заключенных им сделок, обязательства по которым включены в соответствующий клиринговый пул).

2.20.3.3. На основании реестра сделок и оферт СПВБ в соответствии с Правилами определяет нетто-обязательства и нетто-требования участников клиринга по ценным бумагам и/или денежным средствам и осуществляет проверку обеспеченности сделок участника клиринга и процедуры в соответствии с пунктом 2.7. настоящих Правил.

2.20.4. Порядок действий в случае расхождения данных при сверке и контроле обеспеченности сделок/оферт клирингового пула.

2.20.4.1. В случае, когда при проверке обеспеченности сделок/оферт модули значений нетто-обязательств участников клиринга по денежным средствам и/или ценным бумагам превышают значения клиринговых регистров, содержащих информацию о начальных значениях остатков по денежным средствам и/или ценным бумагам на торговых счетах участников клиринга, СПВБ не осуществляет неттинг по всем сделкам клирингового пула. Клиринговый центр в этом случае выявляет причины отсутствия обеспеченности сделок и осуществляет исключение обязательств по необеспеченным сделкам из клирингового пула. Исключению подлежат только обязательства по сделкам, не образующим полного взаимозачета по встречным однородным обязательствам и относящимся к торговым счетам, в отношении которых выявлен недостаток обеспечения. Обязательства по сделкам исключаются в следующем порядке: а) обязательства по первой части сделки РЕПО; б) обязательства по второй части сделки РЕПО. Исключение указанных сделок из клирингового пула производится таким образом, чтобы в результате был исполнен максимально возможный объем обязательств участника клиринга.

2.20.4.2. В случае, если недостаток обеспечения для исполнения сделок/оферт участника клиринга выявлен перед началом промежуточных расчетов исключенные из клирингового пула обязательства по необеспеченным сделкам/офертам включаются в клиринговый пул, формируемый после окончания торговой сессии. В отношении обеспеченных сделок/оферт формируется новый реестр сделок и оферт в соответствии с настоящими Правилами.

2.20.4.3. В случае, если недостаток обеспечения выявлен перед расчетами после окончания торговой сессии по обязательствам, вытекающим из зарегистрированных Организатором торговли оферт, срок исполнения которых наступил, клиринговый центр исключает обязательства по офертам из клирингового пула и передает информацию о незаключенных сделках РЕПО в торговую систему и участникам клиринга – сторонам незаключенных сделок РЕПО для урегулирования в соответствии с Правилами торговли и/или соглашениями сторон сделок РЕПО.

2.20.4.4. В случае, если недостаток обеспечения выявлен перед расчетами после окончания торговой сессии по вторым частям сделок РЕПО, срок исполнения которых наступил, клиринговый центр исключает обязательства по вторым частям сделок РЕПО из клирингового пула и передает информацию о неисполненных сделках в торговую систему и участникам клиринга – сторонам неисполненных сделок РЕПО для урегулирования в соответствии с Правилами торговли и/или соглашениями сторон сделок РЕПО.

2.20.4.5. В случае, если после исключения необеспеченных обязательств процедура контроля обеспечения успешна, СПВБ вновь формирует реестр сделок и оферт выполняет действия в соответствии с п. 2.9.6.- 2.9.9. настоящих Правил.

2.20.5. В части клиринговых процедур, не описанных в пункте 2.20 применяются процедуры, предусмотренные пп. 2.1 - 2.19 настоящих Правил.

3. Тарифы СПВБ.

Вознаграждение за осуществление клиринговой деятельности по сделкам, заключенным на СПВБ, с участников клиринга не взимается (в связи с совмещением СПВБ клиринговой деятельности с деятельностью фондовой биржи).

4. Список расчетных организаций.

Небанковская кредитная организация ЗАО "Петербургский Расчетный Центр"

Небанковская кредитная организация закрытое акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий».

5. Список расчетных депозитариев.

ЗАО "Депозитарно-Клиринговая Компания".

ЗАО "Санкт-Петербургский Расчетно-Депозитарный Центр".

Небанковская кредитная организация закрытое акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий».

6. Приложения.

6.1. Приложение №1 Договор клирингового обслуживания

г. Санкт-Петербург

" ____ " _____ г.

Закрытое акционерное общество "Санкт-Петербургская Валютная Биржа", действующее в качестве клиринговой организации на основании лицензии № 078-06049-000010 от 07 июня 2002 г., выданной Федеральной комиссией по рынку ценных бумаг, именуемое в дальнейшем "СПВБ", в лице Управляющего А. Ю. Филаретова, действующего на основании Устава, с одной стороны, и _____, именуемое в дальнейшем "Участник клиринга (Участник)", в лице _____, действующего на основании _____, с другой стороны, (далее вместе именуемые Стороны и каждый в отдельности - Сторона) заключили настоящий Договор о нижеследующем.

1. Термины и определения.

1.1. В целях настоящего Договора применяются следующие термины и определения:

Ценные бумаги - ценные бумаги в том смысле, в каком они определяются действующим законодательством, допущенные к торгам на СПВБ.

Правила – документ СПВБ "Правила осуществления клиринговой деятельности СПВБ". Правила являются неотъемлемой частью настоящего Договора.

Правила торговли – документ СПВБ "Правила торговли в фондовой секции ЗАО "Санкт-Петербургская Валютная Биржа".

Участник – лицо, заключившее договор с клиринговой организацией на осуществление клирингового обслуживания по результатам сделок, заключенных на СПВБ.

1.2. Термины, специально не определенные в п.1.1. настоящего Договора, используются в значениях, установленных законами и иными правовыми актами Российской Федерации, Правилами и Правилами торговли.

2. Предмет Договора.

2.1. СПВБ осуществляет клиринговое обслуживание Участника по результатам сделок, заключенных последним на СПВБ.

2.2. Порядок и условия клирингового обслуживания установлены Правилами, Правилами торговли, "Порядком создания, размещения и использования специального (гарантийного) фонда" и настоящим Договором, а также "Положением о клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг Российской Федерации", утвержденным Постановлением Федеральной комиссии по рынку ценных бумаг № 32/пс от 14 августа 2002 года.

2.3. Клиринговое обслуживание по настоящему Договору осуществляется бесплатно.

3. Права и обязанности Сторон.

3.1. СПВБ обязана:

3.1.1. Осуществлять клиринговое обслуживание Участника надлежащего качества.

- 3.1.2. Создавать систему управления рисками ликвидности, системными рисками и рисками неисполнения обязательств, определяемых в процессе проведения клиринга.
- 3.1.3. Своевременно предоставлять Участнику отчеты, сформированные по результатам клиринга.
- 3.1.4. Доводить до сведения Участника изменения и дополнения к Правилам и "Порядку создания, размещения и использования специального (гарантийного) фонда" не позднее, чем за 15 дней до момента введения их в действие.
- 3.2. СПВБ вправе в случае неисполнения Участником в срок обязательств, определенных в результате клиринга, использовать для исполнения таких обязательств полностью или частично средства Гарантийного фонда в порядке, определенном в Правилах и "Порядке создания, размещения и использования специального (гарантийного) фонда".

3.3. Участник обязан:

- 3.3.1. Осуществлять взаимодействие с СПВБ в соответствии с Правилами, "Порядком создания, размещения и использования специального (гарантийного) фонда", Порядком.
- 3.3.2. Выполнить все необходимые требования для исполнения настоящего договора, установленные в Правилах.
- 3.3.3. Предоставлять СПВБ нотариально заверенную копию устава и других учредительных документов в случае внесения изменений и дополнений в указанные документы. Требование данного пункта не распространяется на Банк России.
- 3.3.4. В случае использования для исполнения полностью или частично обязательств Участника, определенных в результате клиринга и не исполненных им в срок, средств гарантийного фонда возмещать средства гарантийного фонда в сумме и порядке, определенных в "Порядке создания, размещения и использования специального (гарантийного) фонда". Требование данного пункта не распространяется на Банк России.

4. Порядок обмена информацией

- 4.1. В рамках Договора об осуществлении клирингового обслуживания по сделкам, заключенным на СПВБ, документооборот между СПВБ и Участником может осуществляться с использованием:
 - электронной связи;
 - факсимильной связи;
 - курьерской связи.
- 4.2. Участнику не позднее, чем через час после окончания торгов в соответствующей Секции, по месту нахождения СПВБ предоставляются отчеты в бумажном виде, сформированные по результатам клиринга в соответствии с формами, приведенными в Правилах. Отчеты клиентам участника клиринга и иные отчеты за предыдущие даты предоставляются по письменному запросу не позднее 3 рабочего дня от даты получения запроса. По соглашению сторон формы (форматы) информации (документов и сообщений), а также способы ее передачи, определяются отдельным соглашением (отдельными соглашениями).
- 4.3. Передача документов по электронной связи.
Передача информации (документов) по электронной связи осуществляется по согласованным Сторонами процедурам.
- 4.4. Передача документов по факсимильной или курьерской связи.

- 4.4.1. Документ, передаваемый по факсимильной или курьерской связи, должен быть заверен подписью ответственного лица отправителя, если формой (форматом) документа не будет предусмотрено иное.
- 4.4.2. Все подлинники документов, а в случае отправки подлинника курьерской связью - заверенные копии документов, отправленных Стороной в адрес другой Стороны настоящего Договора подшиваются и хранятся у отправившей документ Стороны не менее 12 месяцев.
- 4.4.3. Допускается передача курьерской связью нотариально заверенной копии требуемого документа.

5. Конфиденциальная информация.

- 5.1. Информация об Участнике, составляющая служебную или коммерческую тайну участника, и заключенных им на СПВБ сделках, ставшая доступной СПВБ в связи с исполнением обязанностей по настоящему Договору, носит конфиденциальный характер. СПВБ не имеет права передавать эту информацию третьим лицам без письменного согласия Участника за исключением случаев, предусмотренных законодательством.

6. Ответственность Сторон.

- 6.1. За невыполнение или ненадлежащее выполнение обязательств по настоящему Договору Стороны несут ответственность в соответствии с законодательством Российской Федерации и Правилами, если не докажут, что надлежащее исполнение оказалось невозможными вследствие непреодолимой силы, а также если это было вызвано неправомерными действиями (бездействием) другой Стороны.
- 6.2. СПВБ не отвечает за последствия отмены торгов и/или расчетов по основаниям, предусмотренным Правилами торговли и Правилами.
- 6.3. СПВБ не отвечает за убытки, понесенные Участником в результате неисполнения сделок в соответствии с Правилами и Правилами торговли по вине контрагента.
- 6.4. СПВБ не несет ответственности за непроведение расчетов по нетто-обязательствам и нетто-требованиям Участников в случае неисполнения расчетной организацией и/или расчетными депозитариями сводных поручений СПВБ; за действия расчетной организации и/или расчетных депозитариев после передачи им распоряжений на разблокировку денежных средств на денежных торговых счетах и ценных бумаг на торговых счетах депо, соответственно.

7. Порядок заявления претензий.

- 7.1. Стороны обязуются соблюдать претензионный порядок урегулирования споров и разногласий, возникающих из настоящего Договора.
- 7.2. Претензия заявляется в письменном виде и должна быть подписана уполномоченным представителем Стороны. Претензия должна содержать:
 - изложение требований заявителя;
 - указание суммы претензии и ее расчет (если претензия подлежит денежной оценке);
 - изложение обстоятельств, на которых основываются требования заявителя, и доказательства, подтверждающие их, со ссылкой на соответствующие нормы материального права;
 - перечень прилагаемых к претензии документов и других доказательств;
 - иные сведения, необходимые для урегулирования спора.

- 7.3. Претензия направляется заказным или ценным письмом, либо вручается под расписку Стороне, которой заявляется претензия. Претензия может также направляться по факсимильной связи.
- 7.4. Претензия рассматривается в течение десяти рабочих дней со дня ее получения. Если к претензии не приложены документы, необходимые для ее рассмотрения, они запрашиваются у заявителя претензии. При этом указывается срок, необходимый для их представления. В случае неполучения затребованных документов к указанному сроку, претензия рассматривается на основании имеющихся документов.
- 7.5. Ответ на претензию представляется Стороне, заявившей претензию, в письменной форме и подписывается уполномоченным представителем Стороны, отвечающей на претензию. Непредставление ответа на претензию в течение пятнадцати рабочих дней от даты получения претензии рассматривается как отказ в удовлетворении претензии.

8. Порядок разрешения споров.

- 8.1. Все споры и разногласия, вытекающие из настоящего Договора или в связи с ним, в том числе касающиеся его исполнения, нарушения или действительности, решаются Сторонами путем переговоров.
- 8.2. В случае, если в результате переговоров Стороны не пришли к согласию, спор решается в соответствии с действующим законодательством. .

9. Срок действия Договора.

- 9.1. Договор вступает в силу с момента его подписания и действует до 31 декабря 200_ года.
- 9.2. В случае, если ни одна из Сторон не позднее, чем за тридцать рабочих дней до окончания срока действия настоящего Договора не заявила в письменном виде о своем желании расторгнуть Договор, срок действия Договора считается автоматически продленным на каждый следующий календарный год на тех же условиях.
- 9.3. Настоящий Договор может быть расторгнут до окончания срока его действия по письменному заявлению одной из Сторон, направленному в адрес другой Стороны. Договор утрачивает свою силу через пять рабочих дней после получения заявления при условии урегулирования взаимных обязательств Сторон и завершения всех взаимных расчетов.

10. Прочие условия.

- 10.1. Все дополнения и изменения к настоящему Договору действительны в том случае, если они оформлены в письменном виде и подписаны полномочными представителями Сторон.

11. Реквизиты Сторон.

СПВБ:

Наименование: ЗАО "Санкт-Петербургская Валютная Биржа"
Адрес: 191011, г. Санкт-Петербург, Садовая ул. 12/23
ИНН: 7825331045
Код ОКОНХ: 96420
Код ОКПО: 20508373
Банковские реквизиты: р/с 40701810500000000001 в ГРКЦ ГУ ЦБ РФ по С.-Петербургу,
БИК 044030001 г. Санкт-Петербург.

Участник:

Наименование:
Адрес:
Средства связи:
ИНН:
Код ОКОНХ:
Код ОКПО:
Банковские реквизиты:
БИК:

От СПВБ:

Управляющий
А.Ю. Филаретов _____

М.П.

От Участника:

М.П.

Приложение №2. Регламент информационного взаимодействия СПВБ с расчетными депозитариями и расчетными организациями при проведении клиринга и расчетов по результатам сделок с ценными бумагами, заключенных через СПВБ.

№	Время	Документы	Отправитель информации	Получатель информации
1.	8.45-9.00	Отчет об остатках на торговых разделах счетов депо, депонированных на торговых счетах депо и счетах депо поставки участников клиринга.	НРД, РДЦ	СПВБ
2.	9.15-9.30	Денежные средства, зарезервированные на торговых счетах участников клиринга.	ПРЦ	СПВБ
3.	9:40-9:45	Сведения о денежных средствах, зарезервированных на счетах	НРД	СПВБ
4.	10:00-13:20	Информация о зачислении ценных бумаг на торговые разделы счетов депо	НРД	СПВБ
5.	13:20-14:25	Сведения о денежных средствах, зарезервированных на счетах	НРД	СПВБ
6.	13:30-13:35	Сводное платежное поручение, сформированного по итогам первой части торговой сессии, аукциона и погашения.	СПВБ	ПРЦ
7.	13:35-14:00	Ведомость остатков, сформированная по итогам обработки сводного платежного поручения.	ПРЦ	СПВБ
8.	13:30-13:35	Сводное поручение депо, сформированное по итогам первой части торговой сессии, аукциона и погашения.	СПВБ	РДЦ, НРД
9.	13:35-14:00	Отчет об остатках на торговых разделах счетов депо, сформированный по итогам обработки сводного поручения депо.	РДЦ, НРД	СПВБ
10.	14:00	Уведомление о завершении промежуточных расчетов.	СПВБ	НРД, ПРЦ, РДЦ
11.	14:00-14:25	Информация о зачислении ценных бумаг на торговые разделы счетов депо	НРД	СПВБ
12.	14:30-14:45	Сводное поручение депо по итогам аукциона РЕПО	СПВБ	НРД
13.	14:30-14:45	Сводная ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам, сформированная по итогам аукциона РЕПО	СПВБ	НРД
14.	14:45-15:15	Отчет об исполнении Сводного поручения депо и Отчет об остатках на торговых разделах счетов депо (в отношении торговых разделов «Блокировано для торгов на СПВБ. РЕПО с Банком России)	НРД	СПВБ
15.	14:45-15:15	Отчет об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам и Сведения о денежных средствах, зарезервированных на Торговых счетах	НРД	СПВБ

16.	15:20-15:25	Распоряжение на разблокировку денежных средств и ценных бумаг на торговых разделах счетов депо типа ЗВ	СПВБ	НРД
17.	15:25-16:30	Информация о зачислении ценных бумаг на торговые разделы счетов депо	НРД	СПВБ
18.	16:30-16:45	Блокировка счетов депо. Отчет об остатках на торговых разделах.	НРД	СПВБ
19.	16:30-16:45	Информация о зачислении ценных бумаг (для аукциона Т0)	НРД	СПВБ
20.	16:50-16:55	Сводное платежное поручение, сформированного по итогам второй торговой сессии (в дни проведения аукциона) или единой торговой сессии (в обычные дни).	СПВБ	ПРЦ
21.	16:50-16:55	Сводное поручение депо, сформированное по итогам второй торговой сессии (в дни проведения аукциона) или единой торговой сессии (в обычные дни).	СПВБ	РДЦ, НРД
22.	17:00	Сведения о денежных средствах, зарезервированных на Торговых счетах	НРД	СПВБ
23.	16:55-17:20	Ведомость остатков, сформированная по итогам обработки сводного платежного поручения.	ПРЦ	СПВБ
24.	16:55-17:25	Отчет об остатках на торговых разделах счетов депо, сформированный по итогам обработки сводного поручения депо.	РДЦ, НРД	СПВБ
25.	Т	В случае обнаружения расхождений данных при проведении сверки КО, НРД, РДЦ и ПРЦ предпринимают действия, направленные на поиск и выявление причин, приведших к расхождению, и их устранению		
26.	17:30	Распоряжение на разблокировку торговых разделов и ценных бумаг на торговых разделах счетов депо типа ЗА участников клиринга (в случае, если сверка прошла успешно)	СПВБ	НРД
27.	17:30	Поручение на разблокировку денежных торговых счетов участников клиринга (в случае, если сверка прошла успешно)	СПВБ	ПРЦ
28.	17:00	Информация о зачислении ценных бумаг на торговые разделы счетов депо	НРД	СПВБ
29.	17:30	Сводное поручение депо и Сводная ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам по итогам аукциона РЕПО	СПВБ	НРД
30.	17:50	Отчет об исполнении Сводного поручения депо и Отчет об остатках на торговых разделах счетов депо (в отношении торговых разделов «Блокировано для торгов на СПВБ. РЕПО с Банком России)	НРД	СПВБ
31.	17:50	Отчет об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам и Сведенийо денежных средствах, зарезервированных на Торговых счетах	НРД	СПВБ

32.	18:00	Распоряжение на разблокировку денежных средств на Торговых счетах и Распоряжение на разблокировку торговых разделов и ценных бумаг на торговых разделах счетов депо	СПВБ	НРД
-----	-------	---	------	-----

РДЦ - ЗАО "Санкт-Петербургский Расчетно-Депозитарный Центр".

ПРЦ -Небанковская кредитная организация ЗАО "Петербургский Расчетный Центр"

НРД – Небанковская кредитная организация ЗАО «Национальный Расчетный Депозитарий».

Приложение №3. Доверенность на расчеты по торговым счетам депо и счетам депо поставки участника клиринга в расчетном депозитарии.

На бланке депонента - участника клиринга

г. _____

ДОВЕРЕННОСТЬ № _____

(полное фирменное наименование или Ф.И.О Депонента)

адрес местонахождения: _____,

в лице _____, действующего на основании

_____, уполномочивает ЗАО "Санкт-Петербургская Валютная Биржа"

составлять и подписывать поручения депо на списание ценных бумаг с разделов счетов депо

Участника № _____ № _____ № _____, открытых в

_____ (далее – (Депозитарий),

а также подписывать поручения на зачисление ценных бумаг на указанные разделы счетов депо в Депозитарии на основании результатов клиринга, определяемых в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности ЗАО "Санкт-Петербургская Валютная Биржа" (далее - Правила),

включать эти поручения депо в состав сводного поручения депо, составляемого СПВБ по итогам торгов в соответствии с Правилами,

получать информацию об остатках ценных бумаг на указанных счетах депо.

Настоящая Доверенность составлена _____

(дата прописью)

в двух подлинных экземплярах и действует до _____

(дата прописью)

Должность лица,
выдавшего доверенность

Ф.И.О.
Главный бухгалтер

Подпись лица, выдавшего доверенность

Ф.И.О.

Подпись главного бухгалтера

М.П.

6.2. Приложение №4. Доверенность на расчеты по торговым счетам участника клиринга в расчетной организации.

На бланке участника клиринга

Г. _____

ДОВЕРЕННОСТЬ № _____

(полное фирменное наименование организации – участника клиринга)

адрес местонахождения: _____,

в лице _____, действующего на основании

_____, уполномочивает ЗАО “Санкт-Петербургская Валютная Биржа”

(далее - СПВБ), составлять и подписывать платежные поручения на списание денежных средств с торговых счетов Участника № _____, № _____ открытых в

(далее - Расчетная организация), а также на зачисление денежных средств на указанные торговые счета в Расчетной организации на основании результатов клиринга, определяемых в соответствии в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности ЗАО “Санкт-Петербургская Валютная Биржа” (далее - Правила),

включать эти платежные поручения в состав сводного платежного поручения, составляемого СПВБ по итогам торгов в соответствии с Правилами.

Настоящая Доверенность составлена _____
(дата прописью)

в двух подлинных экземплярах и действует до _____
(дата прописью)

Должность лица,

выдавшего доверенность

Ф.И.О.

Подпись лица, выдавшего доверенность

Главный бухгалтер

Ф.И.О.

Подпись главного бухгалтера

М.П.

6.3. Приложение №5. Доверенность на передачу/получение документов

На бланке Участника

г. _____

ДОВЕРЕННОСТЬ № _____

Участник:

(организационно-правовая форма и полное фирменное наименование юридического лица)

уполномочивает

(Фамилия, Имя, Отчество)

проживающего(ую) по адресу:

документ _____ серия _____ № _____ выдан " ____ " _____ г.

(место выдачи)

передавать на СПВБ документы и поручения и получать отчеты по итогам клиринга по сделкам, заключенным на СПВБ.

Настоящая Доверенность составлена

(дата прописью)

и действует до

(дата прописью)

Подпись _____ удостоверяю

Должность лица,
выдавшего доверенность

Подпись / Ф.И.О. _____ /
лица, выдавшего доверенность

М. П.

6.4. Приложение №5А Уведомление участником клиринга о взаимосвязи счета депо и денежного счета

На бланке организации

г. _____

«__» _____ 20__ г.

УВЕДОМЛЕНИЕ

_____ (полное фирменное наименование организации – участника клиринга)

в лице _____, действующего на основании _____, уведомляет ЗАО “Санкт-Петербургская Валютная Биржа”, о взаимосвязи между следующими счетами депо (разделами счета депо) и денежными торговыми счетами

№	Наименование депозитария	Номер (код) счета депо (раздела счета депо)	Наименование депонента	Номер денежного счета

_____ Должность руководителя организации

_____ /Ф.И.О./
Подпись

М.П.

6.5. Приложение №6 Анкета участника клиринга

Анкета Участника		
<i>1. Данные для заполнения Участником:</i>		
1.	Полное наименование Участника	
2.	Код Участника в торговой системе СПВБ (код Дилера)	
3.	Номера денежных торговых счетов Участника в расчетной организации	
4.	Номера торговых счетов депо и счетов депо поставки (разделов счетов) Участника в Расчетных депозитариях	
5.	Адрес местонахождения	
6.	Номер телефона, факса, адрес электронной почты Участника	
7.	Банковские реквизиты (номер расчетного счета в банке, наименование банка, БИК)	
8.	Коды ИНН, КПП, ОКОНХ, ОКПО	
9.	Дата заполнения Анкеты	
10.	Должность, фамилия, имя, отчество, и подпись лица, имеющего право действовать от лица участника без доверенности	
11.	Должность, фамилия, имя, отчество контролера участника клиринга	
12.	Лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг: (вид, номер, наименование органа, выдавшего лицензию, дата выдачи, дата окончания срока действия)	
13.	Печать Участника.	
<i>2. Данные для заполнения сотрудником СПВБ:</i>		
Дата и время приема Анкеты		
Должность, фамилия, имя, отчество и подпись сотрудника СПВБ, принявшего Анкету		
Печать или штамп СПВБ		

От Участника:

6.6. Приложение № 7 Форматы обмена данными с расчетными депозитариями.

А. 599 сообщение - ведомость остатков ценных бумаг, задепонированных на торговых счетах депо и счетах депо поставки Участников клиринга в РД

To:	Адрес СПВБ	
From:	Адрес РД (ЗАО РДЦ)	
Type:	599	
Priority:	Z	
Date/Time :	YYYYMMDD/HHMM	
Tag	Пример заполнения	Пояснения
:20:	SDCYMMDD2280	Номер сообщения-ответа
:21:	XXX	Номер сообщения-запроса
:18A:	1000	Количество значащих строк сообщения
	010100000AT:10000:RU25001A OR	Счет: Количество: Код ЦБ Буквы на конце счета – тип счета и раздела счета депо
	38384888	Контрольная сумма количества ЦБ в сообщении

To:	Адрес СПВБ	
From:	Адрес РД (ДКК)	
Type:	599	
Priority:	Z	
Date/Time :	YYMMDD/HHMM	
Tag	Пример заполнения	Пояснения
20	DCCD000000000015	Номер сообщения-ответа
21	SPEC123456000901	Номер сообщения-запроса (если сообщение сформировано по эл. запросу)
18A	3	Количество значащих строк сообщения
	2418T:0001111:RF0000001677 2418T:0001111:RF0000001677 1613:0000000:NOHOLDGC	СЧЕТ:КОЛИЧЕСТВО:КОД Ц.Б. Буква на конце счета – тип субсчета: Т – участвует в торгах В – заблокировано Если на счете нет ЦБ вообще, то 1. тип счета не указывается, 2. количество = 0 3. код ЦБ = NOHOLDGC
	53054531	Контрольная сумма количества ценных бумаг в сообщении

Информация о состоянии торговых разделов счетов депо НКО ЗАО НРД.

Наименование реквизита	Пояснения	Формат
Тип взаимодействия	NDC_NICEX	11
Тип сообщения	P	1
Номер	Исходящий номер НРД	18
Дата	Дата составления отчета	DD/MM/YYYY
Время	Время составления отчета (Отчет появился в перечне сформированных отчетов)	HH:MM:SS
Код СПВБ	Код СПВБ как Торговой системы по кодификации НРД	12
Количество строк в основном разделе файла	Количество повторяющихся последовательностей	N
Код депозитария	Код НРД	12
Номер счета депо	Номер счета депо в депозитарии	12
Тип счета депо	Владельца – S, эмиссионный – Z, корреспондентский – L, доверительного управляющего – D, Внутренний технологический счет депо НКО ЗАО НРД "Ценные бумаги до выяснения"-B	1
Признак проведения операции	O - ничего не менялось, N - открыт новый раздел, M - произведены изменения, D - раздел закрыт. Признак формируется в сравнении с состоянием на момент предоставления последнего аналогичного отчета	1
Код владельца	Код Депонента НРД	12
Признак резидента	Резидент (Y) или нерезидент (N)	1
Код участника торгов	Торговый идентификатор Члена Секции	12
Тип торговой позиции в Торговой системе СПВБ	Первый символ – всегда "F". Второй символ определяет возможные операции: с разделом: "0, 1, 2, 6" – раздел не допущен к торгам; "3" - операция блокировки для торгов по разделу проведена (раздел допущен к торгам)	2
Тип раздела	3А – торговый раздел "Блокировано для торгов на СПВБ – Фондовая секция" (Для типов счетов депо S,Z,L,D) 3С – торговый раздел "Блокировано для торгов на СПВБ – РЕПО" (Для типов счетов депо S) 2М – торговый раздел "Блокировано для размещения СПВБ" (Для типа счета депо B)	2
Раздел счета депо*	Код индивидуального торгового раздела, содержащий идентификатор, как Члена Секции, так и тип позиции депо	17
Идентификатор раздела счета депо	Внутренний уникальный учетный идентификатор (ID) раздела в депозитарном программном комплексе, используемом НРД	10
Признак юридическое или физическое лицо	P – физическое лицо J – юридическое лицо	1
Название инвестора	Полное название инвестора	120

* - Раздел кодируется последовательно из 17 символов. Символы с 1 по 2 – код типа раздела; символы с 3 по 9 – код участника торгов на СПВБ (например, SPEX001); символы с 10 по 14 – произвольные 5 символов, обозначающие код клиента Депонента; символ 15 – код позиции (F – депонент счета депо – участник торгов, N – депонент счета депо (S или D) – клиент участника торгов; P – депонент – эмитент; A, B, C – депонент - депозитарий, ведущий учет ценных бумаг участников торгов и их клиентов; символы с 16 по 17 – произвольные два символа.

Отчет об остатках на торговых разделах счетов депо НКО ЗАО НРД.

Наименование реквизита	Пояснения	Формат
Тип взаимодействия	NDC_NICEX	9
Тип сообщения	L	1
Номер	Исходящий номер НРД	18
Номер сообщения Р	Исходящий номер НРД, присвоенный Файлу Р	18
Дата	Дата составления отчета	DD/MM/YYYY
Время	Время составления отчета Отчет появился в перечне сформированных отчетов	HH:MM:SS
Код СПВБ	Код СПВБ по кодификации НРД	12
Количество повторяющихся последовательностей	Количество повторяющихся последовательностей по всему файлу (не включая контрольные строки)	N
<i>Содержание (повторяющиеся последовательности данных)</i>		
Идентификатор раздела счета депо	Внутренний уникальный учетный идентификатор (ID) раздела в депозитарном программном комплексе, используемом НРД	N
Код ценной бумаги	Код ценной бумаги в кодировке НРД	12
Количество ценных бумаг	Количество ценных бумаг данного выпуска (в штуках) ¹	N

Б. 572 сообщение - ведомость допоставки ценных бумаг от РД для СПВБ

To:	Адрес СПВБ	
From:	Адрес РД (только РДЦ)	
Type:	572	
Priority:	Z	
Date/Time	YYYYMMDD/HHMM	
:		
Tag	Пример заполнения	Пояснения
:20:	SDCYMMDD2280	Номер сообщения-ответа
:21:	SPEC123456000901	Номер сообщения-запроса
:18A	2	Количество значащих строк сообщения
:		
	010100000AT:20000:RU25001A OR	

В. 580 сообщение - файл сводного поручения депо для РД от СПВБ

To:	Адрес РД (РДЦ)
From:	Адрес КО
Type:	580
Priority:	Z
Date/Time	YYYYMMDD/HHMM
:	
:20:	XXXXYYYYMMDDHHMM

¹ Поле содержит: для всех остатков – количество ценных бумаг на торговом разделе счета депо

далее повторяющиеся группы		
Tag	Пример заполнения	Пояснения
:23:	RECFREE DELFREE	DELFREE – зачисление на счет депо, RECFREE– списание со счета депо,
:35A:	SHS23456	Количество ценных бумаг
:35B:	ISIN RU00000GSP	Код ценных бумаг
:82D:	SPCEX	Внутренний клиринговый счет
:87C:	010100000:AT	Счет депо участника клиринга: тип счета депо участника клиринга
	1 149	Первая строчка поля - порядковый номер транзакции в сессии , вторая – общее количество транзакций в сессии.

To:	Адрес РД (ДКК)
From:	Адрес СПББ
Type:	580
Priority:	Z
Date/Time	YYMMDD/HHMM
:	
20	SPEC00000000777

далее повторяющиеся группы		
Tag	Пример заполнения	Пояснения
23	RECFREE/TRANS// G	RECFREE/TRANS//G RECFREE – зачисление на счет, DELFREE – списание со счета TRANS – транзакция не требует квитанки, G – транзакция с гарантированной поставкой
20		Уникальный номер под которым данная транзакция зарегистрирована у СПББ. Не может повторяться.
35A	SHS23456	Количество ценных бумаг
35B	ISIN RF0000000000	Код ценных бумаг
82D	SPCEX	Идентификатор СПББ
87C	/TROY177T	Счет депо участника клиринга (Т-торговый раздел счета, В блокировочный раздел счета)
26K	22 15 34	Первая строчка поля - номер торговой сессии, вторая - порядковый номер транзакции в сессии, третья - общее количество транзакций в сессии.

Сводное поручение депо НКО ЗАО НРД.

Наименование реквизита	Пояснения	Формат
Тип взаимодействия	NICEX_NDC	9
Тип сообщения	D	1
Номер	Исходящий номер СПББ	18
Номер Файла Р	Исходящий номер НРД, присвоенный Файлу Р	18
Дата	Дата составления	DD/MM/YYYY
Время	Время составления	HH:MM:SS
Код СПББ	Код СПББ по кодификации НРД	12
Количество повторяющихся последовательностей	Количество повторяющихся последовательностей по всему файлу	N
<i>Содержание (повторяющиеся последовательности данных)</i>		
Идентификатор раздела счета депо	Внутренний уникальный учетный идентификатор (ID) раздела в	N

	депозитарном программном комплексе, используемом НРД	
Код ценной бумаги	Код ценной бумаги в кодировке НРД	12
Количество ценных бумаг	Изменения в количестве ценных бумаг данного выпуска (в штуках, +/-).	N

Г. 595 сообщение:

- требование открытия торговой сессии
- требование произвести расчет
- отмена посланного ранее сводного поручения депо
- требование закрытия торговой сессии (в зависимости от времени передачи – уведомление о завершении промежуточных расчетов или распоряжение на разблокировку ценных бумаг на торговых счетах депо) для Депозитария от СПВБ

To:	Адрес РД (РДЦ)	
From:	Адрес СПВБ	
Type:	595	
Priority:	Z	
Date/Time:	YYMMDD/HHMM	
Tag	Пример заполнения	Пояснения
:20:	SPEC123456789012	SPEC123456789012
:75:		
	REQUEST TO ACCOUNT TRADES PLACE SPBEX TRADES DATE 000310/1036 SESSION NUMBER 001628	Требование произвести расчет
	REQUEST TO ESCAPE TRADES PLACE SPBEX TRADES DATE 000310/1036 SESSION NUMBER 001628	Отмена посланного ранее сводного поручения депо
	REQUEST TO CLOSE TRADING SESSION TRADES PLACE SPBEX TRADES DATE 000310/1038 SESSION NUMBER 001628 DELIVER ENABLED RECEIVE ENABLED	Требование закрытия торговой сессии

To:	Адрес РД (ДКК)	
From:	Адрес СПВБ	
Type:	595	
Priority:	Z	
Date/Time:	YYMMDD/HHMM	
Tag	Пример заполнения	Пояснения
20	SPEC123456789012	SPEC123456789012
75	REQUEST TO ACCOUNT TRADES PLACE SPBEX TRADES DATE 000310/1036 SESSION NUMBER 001628	Требование произвести расчет
	REQUEST TO ESCAPE TRADES PLACE SPBEX TRADES DATE 000310/1036 SESSION NUMBER 001628	Отмена посланного ранее сводного поручения депо
	REQUEST TO ROLLBACK TRADES PLACE SPBEX	Требование отката расчета

	TRADES DATE 000310/1036 SESSION NUMBER 001628	
	REQUEST TO CLOSE TRADING SESSION TRADES PLACE SPBEX TRADES DATE 000310/1038 SESSION NUMBER 001628 DELIVER ENABLED RECEIVE ENABLED	Требование закрытия торговой сессии

Д. 596 сообщение:

- подтверждение открытия торговой сессии от РД для СПВБ
- положительный ответ на требование произвести расчет
- отказ в выполнении требования произвести расчет
- положительный ответ на отмену посланного ранее сводного поручения депо
- отказ в отмене посланного ранее сводного поручения депо
- подтверждение закрытия торговой сессии
- отказ закрытия торговой сессии от РД для СПВБ
- Положительный ответ на 580 сообщение
- Отрицательный ответ на 580 сообщение

To:	Адрес СПВБ	
From:	Адрес РД	
Type:	596	
Priority:	Z	
Date/Time:	YYMMDD/HHMM	
Tag	Пример заполнения	Пояснения
:20:	XXXXXXXXYYMMDDHHMM	Номер сообщения-ответа
:21:	SPEC123456000901	Номер сообщения-запроса
:76:	TRADES SESSION IS OPENED TRADES PLACE SPBEX TRADES DATE 000310/1036 SESSION NUMBER 001628 DELIVERY DISABLED RECEIVE DISABLED PARTICIPANTS 100	Подтверждение открытия торговой сессии
	ACCOUNT WAS DONE TRADES PLACE SPBEX TRADES DATE 000310/1036 SESSION NUMBER 001628	Положительный ответ на требование произвести расчет
	ACCOUNT CAN NOT BE DONE ERROR DESCRIPTION	Отказ в выполнении требования произвести расчет
	NETTO ERASING WAS DONE XXX NETTO WAS FOUND YYY NETTO WAS CANCELED	Положительный ответ на отмену посланного ранее сводного поручения депо
	NETTO ERASING CAN NOT BE DONE ERROR DESCRIPTION	Отказ в отмене посланного ранее сводного поручения депо
	TRADES SESSION IS CLOSED TRADES PLACE SPBEX TRADES DATE 000310/1036 SESSION NUMBER 001628	Подтверждение закрытия торговой сессии
	TRADING SESSION CAN NOT BE CLOSED ERROR DESCRIPTION	Отказ в требовании закрытия торговой сессии
	MESSAGE SPEC000000000777 WAS ACCEPTED	Положительный ответ на 580 сообщение
	MESSAGE SPEC000000000777 WAS REJECTED ERROR DESCRIPTION	Отрицательный ответ на 580 сообщение

To:	Адрес СПВБ
-----	------------

From:	Адрес РД (ДКК)	
Type:	596	
Priority:	Z	
Dte/Time:	YYMMDD/HHMM	
Tag	Пример заполнения	Пояснения
20	DCCD000000000015	Номер сообщения-ответа
21	SPEC123456000901	Номер сообщения-запроса
76	TRADES SESSION IS OPENED TRADES PLACE SPBEX TRADES DATE 000310/1036 SESSION NUMBER 001628 DELIVERY DISABLED RECEIVE DISABLED PARTICIPANTS 100	Подтверждение открытия торговой сессии
	ACCOUNT WAS DONE TRADES PLACE SPBEX TRADES DATE 000310/1036 SESSION NUMBER 001628	Положительный ответ на требование произвести расчет
	ACCOUNT CAN NOT BE DONE ERROR DESCRIPTION	Отказ в выполнении требования произвести расчет
	NETTO ERASING WAS DONE XXX NETTO WAS FOUND YYY NETTO WAS CANCELED	Положительный ответ на отмену посланного ранее сводного поручения депо
	NETTO ERASING CAN NOT BE DONE ERROR DESCRIPTION	Отказ в отмене посланного ранее сводного поручения депо
	SESSION ROLLBACK WAS DONE	Положительный ответ на требования отката расчета
	SESSION ROLLBACK CAN NOT BE DONE ERROR DESCRIPTION	Отказ в требовании отката расчета
	TRADES SESSION IS CLOSED TRADES PLACE SPBEX TRADES DATE 000310/1036 SESSION NUMBER 001628	Подтверждение закрытия торговой сессии
	TRADING SESSION CAN NOT BE CLOSED ERROR DESCRIPTION	Отказ в требовании закрытия торговой сессии
	MESSAGE SPEC000000000777 WAS ACCEPTED	Положительный ответ на MT580
	MESSAGE SPEC000000000777 WAS REJECTED ERROR DESCRIPTION	Отрицательный ответ на MT580

Е. Отчет об исполнении сводного поручения депо НКО ЗАО НРД.

Электронный документ представляет собой неразрывную совокупность файлов, указанных в списке, которые собираются в файл с электронным документом путем архивирования с использованием программного обеспечения WinZip версии 6.0 и выше. Файл с электронным документом подписывается ЭЦП НРД.

Список файлов, из значений полей которых формируется документ:

1. reporth.dbf
2. abort.dbf

Наименование реквизита документа в бумажной форме отображения	Наименование файла	Наименование поля в файле	Тип данных, формат
Номер отчета	reporth.dbf	Reg_no	Character(18)
Дата составления отчета	reporth.dbf	Reg_date	Date(8)
Время составления отчета	reporth.dbf	Treg_date	Character(8)
Наименование операции	reporth.dbf	Ord_type_n	Character(80)
Код операции	reporth.dbf	Ord_type_i	Character(8)
Код отправителя отчета	reporth.dbf	Maker_code	Character(12)

Краткое наименование отправителя отчета	reporth.dbf	Maker_name	Character(30)
Код инициатора поручения	reporth.dbf	Person_cod	Character(12)
Краткое наименование инициатора поручения	reporth.dbf	Person_nam	Character(30)
Информация о процессе обработки сводного поручения	abort.dbf	Abort_caus	Character(255)
Поручение депо №	reporth.dbf	Repl_to_no	Character(18)
Дата составления поручения депо	reporth.dbf	Repl_to_da	Date(8)
Рег. № поручения	reporth.dbf	In_reg_no	Character(18)
Дата регистрации поручения	reporth.dbf	In_reg_dat, tin_reg_da	Date(8), Character(8)
Дата принятия на исполнение	reporth.dbf	Accept_dat, taccept_da	Date(8), Character(8)
Отчет №	reporth.dbf	Reg_no	Character(18)
Дата составления отчета	reporth.dbf	Reg_date	Date(8)

Ж.Отчет о неисполнении сводного поручения депо НКО ЗАО НРД

Электронный документ представляет собой неразрывную совокупность файлов, указанных в списке, которые собираются в файл с электронным документом путем архивирования с использованием программного обеспечения WinZip, совместимого с версией 6.0 и выше. Файл с электронным документом подписывается ЭЦП НРД.

Список файлов, из значений полей которых формируется документ:

1. reporth.dbf
2. abort.dbf

Наименование реквизита документа в бумажной форме отображения	Наименование файла	Наименование поля в файле	Тип данных, формат
Номер отчета	reporth.dbf	Reg_no	Character(18)
Дата составления отчета	reporth.dbf	Reg_date	Date(8)
Время составления отчета	reporth.dbf	Treg_date	Character(8)
Наименование операции	reporth.dbf	Ord_type_n	Character(80)
Код операции	reporth.dbf	Ord_type_i	Character(8)
Код отправителя отчета	reporth.dbf	Maker_code	Character(12)
Краткое наименование отправителя отчета	reporth.dbf	Maker_name	Character(30)
Код инициатора поручения	reporth.dbf	Person_cod	Character(12)
Краткое наименование инициатора поручения	reporth.dbf	Person_nam	Character(30)
Дата отказа	reporth.dbf	Operday, toperday	Date(8), Character(8)
Причина отказа	abort.dbf	Abort_caus	Character(255)
Номер операции	reporth.dbf	Depo_oper_	Character(18)
Дата исполнения операции	reporth.dbf	Operday, toperday	Date(8), Character(8)
Поручение депо №	reporth.dbf	Repl_to_no	Character(18)
Дата составления поручения депо	reporth.dbf	Repl_to_da	Date(8)
Рег. № поручения	reporth.dbf	In_reg_no	Character(18)
Дата регистрации поручения	reporth.dbf	In_reg_dat, tin_reg_da	Date(8), Character(8)
Дата принятия на исполнение	reporth.dbf	Accept_dat, taccept_da	Date(8), Character(8)

6.7. Приложение №8. Формат обмена данными с ЗАО ПРЦ

А. Формат ведомости остатков денежных средств, зарезервированных на торговых счетах участников клиринга в расчетной организации (РО).

Имя поля	Описание поля	Формат поля	Длина поля	Точность	Правила заполнения
CURR_CODE	Код валюты	Character	12		Всегда RUR
ACCOUNT	Код торгового счета участника клиринга	Character	25		
REMAINDER	Остаток денежных средств (в коп.)	Character	22		
DEAL	Код Участника клиринга	Character	10		
ACC_CODE	Код счета	Character	5		
DAT	Дата	DATE			
MARKET	Код сектора рынка (S – ОРЦБ, V – валюта, F – срочный рынок)	Character	1		
ACC_NAME	Наименование счета	Character	30		
ACC_TYPE	Тип счета 1 разряд: А – счет собственных средств; В – брокерский счет R – специальный брокерский счет (акции, паи) О - специальный брокерский счет (облигации)	Character	2		

Б. Формат запроса на дозачисление/списание денежных средств

Имя поля	Описание поля	Формат поля	Длина поля	Правила заполнения
Account	Номер счета участника торгов	Character	20	
Sum	Сумма платежного документа (операции)	Numeric	22,2	дозачисления – со знаком "+", списания – "-"
Market	Код сегмента рынка	Character	1	всегда "i"(для фондовой секции СПВБ)
Type	Код типа платежного документа (операции)	Character	1	
Number	Номер платежного документа (операции)	Numeric	10	

В. Формат ответа на запрос на дозачисление/списание денежных средств

Имя поля	Описание поля	Формат поля	Длина поля	Правила заполнения
Number	Номер платежного документа (операции)	Numeric	10	

Result	Код завершения операции	Numeric	1	0 - Операция выполнена успешно -1 Ошибка. Попытка повторно исполнить операцию. -2 Ошибка. Участник не найден. -3 Ошибка. Сумма списания превышает сумму средств на торговом счете участника в ТС. -4 Ошибка. Торги не идут.
--------	-------------------------	---------	---	---

Г. Формат файла сводного платежного поручения, формируемого СПВБ для РО.

Имя поля	Описание поля	Формат поля	Длина поля	Точность	Правила заполнения
DOC_TYPE	Резервное поле	Character	3		(всегда: 002-Банк-банк)
DOCNM_REF	Ссылочный номер документа у отправителя	Character	16		
DOCNMPREV	Резервное поле	Character	16		(всегда: пусто)
PRIORITY	Резервное поле	Character	1		(всегда: 9)
SBANKCODE	Код счета по дебету	Character	12		(@0 либо @09999)
SBANKMCODE	Резервное поле	Character	4		
C_ACC_DEB	Счет по дебету	Character	35		
SBANKNAM1	Наименование банка-плательщика	Character	35		(всегда пусто)
SBANKNAM2	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
SBANKNAM3	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
SBANKNAM4	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
SBANKNAM5	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
RBANKCODE	Код счета по кредиту	Character	12		(@0, @00100, @09999, @00000)
RBANKMCODE	Резервное поле	Character	4		
C_ACC_CRED	Счет по кредиту	Character	35		Счет РО
RBANKNAM1	Наименование банка - получателя	Character	35		(код банка получателя)
RBANKNAM2	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
RBANKNAM3	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
RBANKNAM4	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
RBANKNAM5	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
PAY_DATE	Дата	Character	8		(dd.mm.yy - дата из заголовка файла)
EXT_DATE	Резервное поле	Character	8		(всегда пусто)
CURR_CODE	Код валюты	Character	3		всегда RUR
SUM_DEB	Сумма дебет (в коп.)	Character	22		(различные суммы)
SCLIENTN1	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)

SCLIENTN2	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
SCLIENTN3	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
SCLIENTN4	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
SC_CODE	Резервное поле	Character	12		(всегда пусто)
ACC_DEB	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
RCLIENTN1	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
RCLIENTN2	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
RCLIENTN3	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
RCLIENTN4	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
ACC_CRED_1	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
ACC_CRED_2	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
SP_CODE	Резервное поле	Character	2		(всегда пусто)
SPECIF_1	Назначение платежа	Character	35		(всегда: различные спецификации)
SPECIF_2	Назначение платежа	Character	35		(всегда пусто)
SPECIF_3	Назначение платежа	Character	35		(всегда пусто)
SPECIF_4	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
SPECIF_5	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
SPECIF_6	Резервное поле	Character	35		(всегда пусто)
SEND_TYPE	Резервное поле	Character	10		(всегда пусто)
SERVDATE	Резервное поле	Character	8		(всегда пусто)
OP_TYPE	Резервное поле	Character	5		(всегда пусто)
SDFLAGS	Резервное поле	Character	5		(всегда пусто)
ACC_DATE	Резервное поле	Character	8		(всегда пусто)
DOC_RESULT	Резервное поле	Character	2		(всегда пусто)
IMP_RESULT	Результат обработки	Character	3		(ОК, если файл обработан в РО)

Д. Формат файла подтверждения переводов из РО для СПББ

Формат файла идентичен формату файла (В). При успешной обработке строки в последнем столбце файла ставится значение "ОК!".

Е. Формат файла остатков денежных средств, зарезервированных на торговых счетах участников клиринга, формируемого РО после обработки сводного платежного поручения КО.

Формат файла идентичен формату файла остатков денежных средств, зарезервированных на торговых счетах участников клиринга, (А).

Ж. Формат файла поручения на разблокировку торговых счетов участников клиринга, формируемого КО для РО

Название поля	Описание поля	Формат поля	Длина поля	Точность	Правила заполнения
CURR_CODE	Код валюты	Character	12		Всегда SUR

ACCOUNT	Код торгового счета участника клиринга	Character	35		
LOCKTYPE	Всегда пусто	Character	3		

6.8. Приложение №9. Формат обмена данными с НКО ЗАО НРД

Перечень полей заголовка сообщения:

№	Информация	Содержимое
1.	Дата обработки сообщения	Формат даты: ГГГГММДД
2.	Отправитель сообщения	SPCE/MIRP
3.	Получатель сообщения	MIRP/SPCE
4.	Сектор	
5.	Тип сообщения	NNNN – числовой код сообщения
6.	Системный идентификатор исходящего сообщения	XXXXXXXXXX – числовой идентификатор сообщения
7.	Системный идентификатор входящего сообщения (используется, только если присутствует входящее сообщение)	YYYYYYYYYY – числовой идентификатор сообщения
8.	Повторяющиеся последовательности	N – количество повторяющихся последовательностей
9.	Код результата обработки	Обязательное поле для ответных сообщений. Имеет значение “-“ “OK” “NO” – консолидированная ошибка обработки тела сообщения
10.	Комментарий	Краткое описание действия (необязательное поле)

Формат Запроса о денежных средствах

Заголовок документа:

Формат данных буфера повторяющихся последовательностей:

Имя поля	Длина	Пояснение
CURR_CODE	003	Код валюты: Всегда «RUB»
ACCOUNT	035	Номер торгового счета
LOCKTYPE	003	Признак блокировки торгового счета. Всегда «Д**»

Формат Сведений о денежных средствах, зарезервированных на торговых счетах

Заголовок документа:

Формат данных буфера повторяющихся последовательностей

Имя поля	Длина	Пояснение
CURR_CODE	003	Код валюты: Всегда «RUB»
ACCOUNT	035	Номер торгового счета
REMAINDER	022	Сумма зарезервированных денежных средств в копейках
IMP_RESULT	003	Результат исполнения: "OK!" или код результата обработки

Формат Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам по итогам торгов

Заголовок сообщения:

Формат буфера данных повторяющихся последовательностей:

Имя поля	Длина	Пояснение
DOCNM_REF	016	<YYYYMMDD> <номер повторяющейся последовательности>, где YYYY – год; MM – месяц; DD – день с ведущим 0. <номер повторяющейся последовательности> означает номер повторяющейся последовательности в символьном формате с ведущими 0, длиной 5
PRIORITY	002	Очередность (приоритет) исполнения платежа. По умолчанию – «06»
SBANKCODE	012	Код торгового счета (6 цифр: ведущий 0 и пять последних цифр номера торгового счета) или «0»
C_ACC_DEB	035	Номер Клирингового счёта или номер торгового счета
RBANKCODE	012	«0» или код торгового счета (6 цифр: ведущий 0 и пять последних цифр номера торгового счета)
C_ACC_CRED	035	Номер торгового счета или номер Клирингового счёта
PAY_DATE	008	Дата платежа: «DD.MM.YY», где DD – день, MM – месяц, YY – год
CURR_CODE	003	Код валюты: Всегда «RUB»
SUM_DEB	022	Абсолютное значение нетто-обязательства (нетто-требования) в копейках
SUM_NDS	022	"0" (ноль)
SPECIF_1	098	Расчеты по итогам клиринга на СПББ за DD.MM.YY

Формат Отчета об исполнении/неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам по итогам торгов

Заголовок документа:

Формат буфера данных повторяющихся последовательностей:

Имя поля	Длина	Пояснение
DOCNM_REF	016	<YYYYMMDD> <номер повторяющейся последовательности>, где YYYY – год; MM – месяц; DD – день с ведущим 0. <номер повторяющейся последовательности> означает номер повторяющейся последовательности в символьном формате с ведущими 0, длиной 5
PRIORITY	002	Очередность (приоритет) исполнения платежа. По умолчанию – «06»
SBANKCODE	012	Код торгового счета (6 цифр: ведущий 0 и пять последних цифр номера торгового счета) или «0»

C_ACC_DEB	035	Номер торгового счета или номер Клирингового счёта
RBANKCODE	012	«0» или код торгового счета (6 цифр: ведущий 0 и пять последних цифр номера торгового счета)
C_ACC_CRED	035	Номер Клирингового счета или номер торгового счета
PAY_DATE	008	Дата платежа: «DD.ММ.YY», где DD – день, ММ – месяц, YY – год
CURR_CODE	003	Код валюты: Всегда «RUB»
SUM_DEB	022	Абсолютное значение нетто-обязательства (нетто-требования) в копейках
SUM_NDS	022	"0" (ноль)
SPECIF_1	098	Расчеты по итогам клиринга на СПББ за DD.ММ.YY
IMP_RESULT	003	Результат исполнения: ОК! или код результата обработки

Примечание:

Если во всех полях «IMP_RESULT» указано значение «ОК!», данный ЭД является Отчетом об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам по итогам торгов.

Если хотя бы в одном поле «IMP_RESULT» не указано значение «ОК!», данный ЭД является Отчетом о неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам по итогам торгов.

Формат Распоряжения на разблокировку денежных средств на торговых счетах

Заголовок документа:

Формат буфера данных повторяющихся последовательностей:

Имя поля	Длина	Пояснение
CURR_CODE	003	Код валюты: Всегда «RUB»
ACCOUNT	035	Номер торгового счета
LOCKTYPE	003	Признак разблокировки торгового счета. Всегда «---»

Отчет об исполнении /неисполнении Распоряжения на разблокировку денежных средств на торговых счетах

Заголовок документа:

Формат буфера данных повторяющихся последовательностей:

Имя поля	Длина	Пояснение
CURR_CODE	003	Код валюты: Всегда «RUB»

ACCOUNT	035	Номер торгового счета
LOCKTYPE	003	Признак разблокировки торгового счета. Всегда « --- »
IMP_RESULT	003	Результат исполнения: «ОК!» или код результата обработки

Примечание:

Если во всех полях «IMP_RESULT» указано значение «ОК!», данный ЭД является Отчетом об исполнении Распоряжения на разблокировку Счетов.

Если хотя бы в одном поле «IMP_RESULT» не указано значение «ОК!», данный ЭД является Отчетом о неисполнении Распоряжения на разблокировку Счетов.

Формат Распоряжения на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам по итогам торгов

Заголовок документа:

Формат буфера данных повторяющихся последовательностей:

Имя поля	Длина	Пояснение
DOCNM_REF	016	<YYYYMMDD> <номер повторяющейся последовательности>, где YYYY – год; MM – месяц; DD – день с ведущим 0. <номер повторяющейся последовательности> означает номер повторяющейся последовательности в символьном формате с ведущими 0, длиной 5
PRIORITY	002	Очередность (приоритет) исполнения платежа. По умолчанию – «06»
SBANKCODE	012	Код торгового счета (6 цифр: ведущий 0 и пять последних цифр номера торгового счета) или «0»
C_ACC_DEB	035	Номер торгового счета или номер Клирингового счёта
RBANKCODE	012	«0» или код торгового счета (6 цифр: ведущий 0 и пять последних цифр номера торгового счета)
C_ACC_CRED	035	Номер Клирингового счёта или номер торгового счета
PAY_DATE	008	Дата платежа: «DD.MM.YY», где DD – день, MM – месяц, YY – год
CURR_CODE	003	Код валюты: Всегда «RUB»
SUM_DEB	022	Абсолютное значение нетто-обязательства (нетто-требования) в копейках
SUM_NDS	022	"0" (ноль)
SPECIF_1	098	Отмена расчетов за DD.MM.YY

Формат Отчета об исполнении/неисполнении Распоряжения на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам по итогам торгов

Заголовок документа:

Формат буфера данных повторяющихся последовательностей:

Имя поля	Длина	Пояснение
DOCNM_REF	016	<YYYYMMDD> <номер повторяющейся последовательности>, где YYYY – год; MM – месяц; DD – день с ведущим 0. <номер повторяющейся последовательности> означает номер повторяющейся последовательности в символьном формате с ведущими 0, длиной 5
PRIORITY	002	Очередность (приоритет) исполнения платежа. По умолчанию – «06»
SBANKCODE	012	Код торгового счета (6 цифр: ведущий 0 и пять последних цифр номера торгового счета) или «0»
C_ACC_DEB	035	Номер торгового счета или номер Клирингового счёта
RBANKCODE	012	«0» или код торгового счета (6 цифр: ведущий 0 и пять последних цифр номера торгового счета)
C_ACC_CRED	035	Номер Клирингового счёта или номер торгового счета
PAY_DATE	008	Дата платежа: «DD.MM.YY», где DD – день, MM – месяц, YY – год
CURR_CODE	003	Код валюты: Всегда «RUB»
SUM_DEB	022	Абсолютное значение нетто-обязательства (нетто-требования) в копейках
SUM_NDS	022	"0" (ноль)
SPECIF_1	098	Отмена расчетов за DD.MM.YY
IMP_RESULT	003	Результат исполнения: «OK!» либо код результата обработки

Примечание:

Если во всех полях «IMP_RESULT» указано значение «OK!», данный ЭД является Отчетом об исполнении Распоряжения на отмену Сводной Ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам по итогам торгов.

Если хотя бы в одном поле «IMP_RESULT» не указано значение «OK!», данный ЭД является Отчетом о неисполнении Распоряжения на отмену Сводной Ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам по итогам торгов.

6.9. Приложение №10. Форматы файлов обмена данными между системой торгов и клиринговой системой

А. Формат файла реестра сделок.

Название поля	Формат поля	Примечание
Дата и время сделки	DateTime	
Дата и время исполнения	DateTime	
Финансовый инструмент	Char (12)	
Номер сделки	Numeric (20)	
Номер связанной сделки	Numeric (20)	
Продавец-дилер	Char (4)	
Продавец-инвестор	Char (5)	
Продавец денежный счет	Char (25)	
Продавец счет депо	Char (25)	
Покупатель-дилер	Char (4)	
Покупатель-инвестор	Char (5)	
Покупатель денежный счет	Char (25)	
Покупатель счет депо	Char (25)	
Цена сделки	Numeric (12,4)	
Объем сделки	Numeric (20)	
Сумма сделки	Numeric (20,2)	
Задаток	Numeric (20,2)	
Ставка комиссии продавца	Numeric (12,4)	
Ставка комиссии покупателя	Numeric (12,4)	
Комиссия продавца	Numeric (20,2)	
Комиссия покупателя	Numeric (20,2)	
Комиссия РДЦ продавца	Numeric (20,2)	
Комиссия РДЦ покупателя	Numeric (20,2)	
Ставка НКД	Numeric (12,4)	
НКД	Numeric (20,2)	
Обеспечение	Char (1)	
Сектор рынка	Char (1)	
Секция рынка	Char (1)	ЦБ, валюта, срочный рынок

Режим торгов	Char (1)	Торги, аукцион и т.п.
Состояние торгов в сегменте	Char (1)	есть/нет
Дата, время клиринга по сделке	DateTime	
Результат клиринга	Char (1)	сделка исполнена/неисполнена

Б. Формат ведомости остатков денежных средств, учитываемых в клиринговом регистре.

Имя поля	Описание поля	Формат поля	Длина поля	Точность	Правила заполнения
CURR_CODE	Код валюты	Character	12		Всегда RUR
ACCOUNT	Код торгового счета участника клиринга	Character	35		
REMAINDER	Остаток денежных средств	Character	22		

В. Формат ведомости остатков ценных бумаг, учитываемых в клиринговых регистрах.

Имя поля	Тип	Длина поля	Описание поля
ISIN	Символьный	12	Код ценной бумаги
DEAL	Символьный	4	Участник клиринга
INV	Символьный	5	Инвестор (для собственных бумаг участника клиринга 00000)
QUANT	Числовой	10	Количество ценных бумаг
DAT	Дата	8	Дата торгов
DEPO_TYPE	Символьный	2	Тип счета депо в торговой системе
CL_NAM	Символьный	30	Краткое название участника клиринга
SECTOR	Символьный	1	Код Сектора: С - СГО, К – Омск, О - Оренбург, М – МКО, R – Репо. 5-акции.
ACCOUNT	Символьный	12	Код счета депо

6.10. Приложение №11. Формы отчетов для участника клиринга

А. Расчетный лист _____ (дата, время)

Код участника клиринга:

Наименование участника клиринга :

Код ценной бумаги	Номер сделки	Вид сделки (К/П)	Дата заключения сделки	Дата исполнения сделки	Кол-во, шт.	Цена, руб.	Сумма сделки, руб.	Комиссия ОТ, руб.	Предоплата, руб.	Сумма обязательств, руб.	Статус сделки	Код контракта
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)	(13)
Итого:												

Подпись уполномоченного сотрудника СПВБ _____

Б. Расчетный лист РЕПО _____ (дата, время)

Код участника клиринга:

Наименование участника клиринга :

№	№ сделки РЕПО	Дата заключения сделки РЕПО	Дата исполнения 1-ой части РЕПО	Дата исполнения 2-ой части РЕПО	Направление сделки	Ставка РЕПО, %	Срок РЕПО, дн.	Стоимость обеспечения, руб.	Стоимость 1-ой части РЕПО, руб.	Стоимость 2-ой части РЕПО, руб.	Статус сделки
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)
					Итого:						

Подпись уполномоченного сотрудника СПВБ _____

В. Отчет по нетто-позиции РЕПО _____ (дата, время)

Код участника клиринга:

Наименование участника клиринга:

№	Дата	Код контрагента	Обязательства по денежным средствам, руб.	Требования по денежным средствам, руб.	Нетто-позиция по денежным средствам, руб.	Стоимость передаваемого обеспечения, руб.	Стоимость принимаемого обеспечения, руб.	Нетто-позиция по обеспечению, руб.
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)
Итого								

Г. Отчет по нетто-позиции _____ (дата, время)

Код участника клиринга:

Наименование участника клиринга:

№	№ сделки	Дата сделки	Дата расчета	Код ЦБ	Покупка		Продажа		Исполнение		Статус сделки (исполнена/не исполнена)
					Кол-во	Сумма	Кол-во	Сумма	Кол-во	Сумма	
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

Д. Отчет по сделкам с ценными бумагами _____ (дата, время)

Код участника клиринга:

Наименование участника клиринга :

Код ценной бумаги

№ пп.	№ сделки	время	тип	кол-во	цена, руб	код трейдера	Незаявки	код счета депо	код клиента	комментарий	сумма сделки	комиссия	НКД	вид	счет
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)	(13)	(14)	(15)	(16)

Подпись уполномоченного сотрудника СПВБ _____

Е. Обязательства Участника клиринга по итогам торгов _____ (дата, время)

Код участника клиринга:

Наименование участника клиринга :

№ пп	Код средств	Тип счета	Сумма	Оборот (дебет)	Оборот (кредит)	Комиссия	НДС в составе комиссии
(1)	(2)		(4)	(5)	(6)	(7)	(8)
1	Код ценной бумаги						
	код счета депо		K/D				

2	RUR						
	номер денежного счета		K/D				

Подпись уполномоченного сотрудника СПВБ _____

Ж. Отчет о заключенных сделках РЕПО _____ (дата, время)

Код участника клиринга:

Наименование участника клиринга:

№	Номер сделки РЕПО	Номер заявки	Спецификация	Направление сделки	Код контрагента	Код клиента	Срок РЕПО, дн.	Ставка РЕПО, %	Вид обеспечения по сделке РЕПО	Дата исполнения 1-ой части сделки РЕПО	Дата исполнения 2-ой части сделки РЕПО	Сумма РЕПО, руб.	Стоимость обратного выкупа, руб.	Сумма комиссии, руб.
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)	(13)	(14)	(15)

Подпись уполномоченного сотрудника СПВБ _____

3. Отчет об исполненных сделках РЕПО _____ (дата, время)

Код участника клиринга:

Наименование участника клиринга:

№	Номер сделки РЕПО	Часть РЕПО	Направление сделки	Код контрагента	Код клиента	Срок РЕПО, дн.	Ставка РЕПО, %	Вид обеспечения по сделке РЕПО	Дата исполнения 1-ой части сделки РЕПО	Дата исполнения 2-ой части сделки РЕПО	Сумма РЕПО, руб.
(1)	(2)	(3)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)	(13)

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

И. Отчет о неисполненных сделках РЕПО _____ (дата, время)

Код участника клиринга:

Наименование участника клиринга:

№	Номер сделки РЕПО	Дата заключения сделки РЕПО	Код Обеспечения	Направление сделки	Код контрагента	Код клиента	Часть РЕПО	Дата исполнения 1-ой части сделки РЕПО	Дата исполнения 2-ой части сделки РЕПО	Сумма неисполненной части сделки РЕПО	Причина неисполнения
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)
										Итого	

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

К. Отчет о предварительных договорах РЕПО _____ (дата, время)

Код участника торгов:

Наименование участника торгов:

№	Номер предварительного договора РЕПО	Спецификация	Дата исполнения 1-ой части сделки РЕПО	Дата исполнения 2-ой части сделки РЕПО	Срок сделки РЕПО, дн.	Ставка РЕПО, %	Код контрагента	Код клиента	Направление сделки	Код обеспечения по сделке РЕПО	Сумма РЕПО, руб.
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

Л. Отчет по неисполненным предварительным договорам РЕПО _____ (дата, время)

Код участника торгов:

Наименование участника торгов:

№	№ предварительного договора	Дата заключения предварительного договора	Направление	Код Обеспечения	Код контрагента	Код Спецификации	Дата исполнения 1-ой части РЕПО	Дата исполнения 2-ой части РЕПО	Ставка РЕПО	Сумма РЕПО	Стоимость обратного выкупа по сделке РЕПО	Причина неисполнения
(1)	(2)	(7)	(3)	(4)	(5)	(6)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)	(13)
										Итого:	Итого:	

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

М. Отчет об обеспечении по первым частям сделок РЕПО _____ (дата, время)

Код участника клиринга:

Наименование участника клиринга:

№	Номер сделки РЕПО	Код обеспечения по сделке РЕПО	Стоимость обеспечения, руб.	Состав обеспечения						
				Торговый код ценной бумаги	ISIN ценной бумаги	Цена, руб.	Количество, шт.	НКД, руб.	Стоимость ценных бумаг, руб.	Дисконт, %
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

Н. Отчет об обеспечении по вторым частям сделок РЕПО _____ (дата, время)

Код участника клиринга:

Наименование участника клиринга:

№	Номер сделки РЕПО	Код обеспечения по сделке РЕПО	Стоимость обеспечения, руб.	Состав обеспечения					
				Торговый код ценной бумаги	ISIN ценной бумаги	Цена, руб.	Количество, шт.	НКД, руб.	Стоимость ценных бумаг, руб.
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

П. Отчет об обязательствах по ценным бумагам _____ (дата, время)

Код участника клиринга:

Наименование участника клиринга:

№	Дата	Код контрагента	Номер торгового раздела счета депо	Торговый код ценной бумаги	ISIN ценной бумаги	Обязательства, шт.	Требования, шт.	Нетто-позиция, шт.
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

Р. Отчет по обязательствам по денежным средствам _____ (дата, время)

Код участника клиринга:

Наименование участника клиринга:

№	Дата	Код контрагента	Номер денежного счета	Обязательства, руб.	Требования, руб.	Нетто-позиция, руб.
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

6.11. Приложение №12. Формы реестров

А: Реестр участников клиринга:

№	Наименование УК	Код УК	Адрес места нахождения	тел, факс, эл. почта	ИНН	Денежные торговые счета	Ф.И.О., должность руководителя	Серия, номер, квалификация аттестата руководителя	Ф.И.О., должность контролера	Серия, номер и квалификация аттестата контролера	Лицензии: вид, №, кем, и когда выдана, дата окончания	Дата аккредитации	Информация о дисциплинарных мерах

Б: Реестр клиентов участника клиринга.

№	Код (коды) участника клиринга	Код (коды) клиента участника клиринга

В: Реестр остатков ценных бумаг

№	Депозитарий	№ отчета	Дата, время	Номер счета	количество ЦБ	Код ЦБ

Г: Реестр остатков денежных средств

№	№ отчета	Дата, время	Код валюты	Номер счета	остаток
			RUR		

Д: Реестр принятых поручений(договоров клирингового обслуживания)

№	№ договора	Дата вступления в силу	Дата окончания действия	Наименование УК	Код УК

Е: Реестр поручений СПВБ

№	№ поручения	Дата, время составления

Ж: Реестр сделок, по которым осуществлен клиринг

№ сделки	Дата, время клиринга по сделке	Код расчетов	Вид сделки (адр./безадр)	Финансовый инструмент	Цена сделки	Сумма сделки	Объем сделки	Продавец ец-УК	Продавец ец-клиент	Покупатель-УК	Покупатель - клиент	Результат клиринга	Дата, время расчетов	Дата, номер реестра сделок

З: Реестр поручений, направленных расчетному депозитарию

№ поручения	Дата поручения	счет депо	код ЦБ	количество ЦБ	отметка об исполнении поручения

И: Реестр поручений, направленных расчетной организации

№ поручения	Дата поручения	денежный счет	код валюты	сумма	отметка об исполнении поручения
			RUR		

К: Реестр отправленных отчетов

Код УК	Дата	Способ направления	Сумма обязательств УК

Л: Журнал регистрации входящих документов

Номер записи (сквозной)	Дата и время внесения записи	Наименование документа	Номер и дата составления документа	Количество экземпляров	Наименование передающей стороны	ФИО доверенного лица передающей стороны	Подпись сотрудника передающей стороны	ФИО сотрудника КО	Подпись сотрудника КО