

Об утверждении Положения о клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг Российской Федерации

Постановление · № 32/пс · от 14.08.2002 · Федеральная комиссия по рынку ценных бумаг · Действует с изменениями

ПОСТАНОВЛЕНИЕ

Федеральной комиссии по рынку ценных бумаг

от 14 августа 2002 г. N 32/пс

Об утверждении Положения о клиринговой деятельности

на рынке ценных бумаг Российской Федерации

Зарегистрировано Министерством юстиции Российской Федерации

26 сентября 2002 г. Регистрационный N 3816

В соответствии с пунктами 3, 15 статьи 42 Федерального закона от 22 апреля 1996 г. N 39-ФЗ "О рынке ценных бумаг" (Собрание законодательства Российской Федерации, 1996, N 17, ст. 1918; 1998, N 48, ст. 3472; 2001, N 33, ст. 3424) Федеральная комиссия по рынку ценных бумаг постановляет:

1. Утвердить прилагаемое Положение о клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг Российской Федерации.
2. Организациям, имеющим лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление клиринговой деятельности, в течение трех месяцев со дня вступления в силу настоящего постановления привести свою деятельность в соответствие с требованиями Положения о клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг Российской Федерации, утвержденного настоящим постановлением.

П О Л О Ж Е Н И Е

о клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг

Российской Федерации

Утверждено постановлением Федеральной комиссии

по рынку ценных бумаг

от 14 августа 2002 г. N 32/пс

I. Общие положения

- 1.1. Положение о клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг Российской Федерации (далее - Положение) устанавливает обязательные требования, предъявляемые к осуществлению клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг.
- 1.2. Клиринговая деятельность может осуществляться юридическим лицом, имеющим лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление клиринговой деятельности (далее именуется - клиринговая организация) в соответствии с законодательством Российской Федерации о ценных бумагах, настоящим Положением и иными нормативными актами Федеральной комиссии по рынку ценных бумаг (далее именуется - Федеральная комиссия).
- 1.3. Клиринговая организация на основании и в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации и нормативных правовых актов Федеральной комиссии утверждает Условия осуществления клиринговой деятельности, Порядок создания, размещения и использования гарантийного фонда, Внутренний регламент клиринговой организации, Порядок хранения и защиты информации, а также иные внутренние документы, регулирующие деятельность клиринговой организации.
- 1.4. Деятельность клиринговой организации, в том числе в процессе взаимодействия с лицами, в пользу которых на основании заключенных с ними договоров на клиринговое обслуживание осуществляется клиринг (далее именуются - участники клиринга), а также с организатором торговли или фондовой биржей (далее именуются - организаторы торговли), с депозитарием,

осуществляющим расчеты по ценным бумагам по результатам клиринга (далее именуется - расчетный депозитарий), с кредитной организацией, осуществляющей расчеты по денежным средствам по результатам клиринга (далее именуется - расчетная организация), не должна противоречить Условиям осуществления клиринговой деятельности.

1.5. Клиринговая организация осуществляет клиринг по сделкам, расчеты по которым осуществляются за счет участников клиринга или иных лиц, зарегистрированных участником клиринга в клиринговой организации в установленном настоящим Положением порядке (далее - клиенты участника клиринга).

1.6. Клиринговая организация осуществляет клиринг на основании полученных от участников клиринга или от уполномоченных ими организаций поручений (инструкций). Клиринг осуществляется по сделкам, срок исполнения которых наступает не позже начала расчетов по результатам клиринга (далее - сделки клирингового пула).

1.7. Проведение операций с денежными средствами по результатам клиринга осуществляется по счетам участников клиринга и (или) их клиентов (далее - денежные торговые счета) и (или) по счетам клиринговых организаций в расчетной организации на основании поручений и (или) иных документов клиринговой организации в соответствии с требованиями, установленными в документах расчетной организации и в Условиях осуществления клиринговой деятельности. Проведение операций с ценными бумагами по результатам клиринга осуществляется по счетам депо (либо разделам счетов депо) участников клиринга и (или) их клиентов (далее - торговые счета депо) и (или) по счетам клиринговых организаций в расчетном депозитарии на основании поручений и (или) иных документов клиринговой организации в соответствии с требованиями, установленными в документах расчетного депозитария и в Условиях осуществления клиринговой деятельности. Торговый счет депо и денежный торговый счет далее вместе именуются торговыми счетами.

1.8. Определение обязательств участников клиринга может осуществляться в следующем порядке: определение обязательств каждого участника клиринга и расчеты по ценным бумагам и денежным средствам осуществляются по каждой совершенной участником клиринга сделке клирингового пула (далее именуется - простой клиринг); или определение обязательств каждого участника клиринга и расчеты по ценным бумагам и денежным средствам осуществляются по всем совершенным участником клиринга сделкам клирингового пула (далее именуется - многосторонний клиринг).

1.9. В процессе осуществления клиринга клиринговая организация может выступать стороной по обязательствам, вытекающим из сделок клирингового пула (далее именуется - централизованный клиринг).

1.10. Клиринговая организация может предоставить участникам клиринга право совершать сделки: в пределах количества ценных бумаг и денежных средств (далее именуются - лимиты участников клиринга), зачисленных ими на торговые счета либо приобретенных (приобретаемых) ими в процессе торгов через организатора торговли до выставления в торговую систему организатора торговли заявки (далее именуется - клиринг с полным обеспечением); в пределах определенных клиринговой организацией лимитов участников клиринга, которые зависят от установленной клиринговой организацией оценочной стоимости ценных бумаг и от суммы денежных средств, зачисленных ими на торговые счета либо приобретенных (приобретаемых) ими в процессе торгов через организатора торговли до выставления в торговую систему организатора торговли заявки (далее именуется - клиринг с частичным обеспечением); либо без предварительного зачисления на торговые счета ценных бумаг и денежных средств (далее именуется - клиринг без предварительного обеспечения).

1.11. Клиринговая организация, если это предусмотрено Условиями осуществления клиринговой деятельности, может осуществлять контроль наличия на торговых счетах ценных бумаг и денежных средств, необходимых для проведения расчетов по сделкам клирингового пула, в следующем

порядке:

контролировать наличие на торговых счетах ценных бумаг и денежных средств, необходимых для расчета по каждой сделке клирингового пула;

контролировать наличие на торговых счетах ценных бумаг и денежных средств, необходимых для расчета по сделкам клирингового пула, осуществляемых по совокупным обязательствам каждого участника клиринга по всем сделкам клирингового пула.

1.12. Клиринг может осуществляться по следующим сделкам:

сделкам с ценными бумагами, предусматривающим поставку и оплату ценных бумаг в течение не более пяти дней со дня совершения сделки (далее - спот-сделки);

срочным сделкам на рынке ценных бумаг (фьючерсные контракты и опционы), совершаемым в соответствии с нормативными правовыми актами Федеральной комиссии;

сделкам по продаже (покупке) эмиссионных ценных бумаг (первая часть репо) с обязательной последующей обратной покупкой (продажей) ценных бумаг того же выпуска в том же количестве (вторая часть репо) через определенный срок на условиях, установленных при заключении такой сделки (далее - сделки репо);

иным сделкам с ценными бумагами.

1.13. Клиринговая организация осуществляет учет обязательств участников клиринга по сделкам с ценными бумагами, а также учет информации о ценных бумагах и денежных средствах, предназначенных для исполнения обязательств участника клиринга, на специальных регистрах (далее - клиринговый регистр).

II. Требования к клиринговой деятельности

2.1. Условия осуществления клиринговой деятельности и Порядок создания, размещения и использования специального (гарантийного) фонда, а также все изменения и (или) дополнения в указанные документы до их вступления в силу представляются в Федеральную комиссию на согласование. В случае внесения клиринговой организацией изменений и дополнений в указанные в настоящем пункте документы в Федеральную комиссию представляются:

новая редакция документа с внесенными в нее изменениями и (или) дополнениями (в двух экземплярах);

перечень внесенных изменений и дополнений.

Представленные на согласование в Федеральную комиссию документы должны содержать отметку об утверждении данных документов в установленном клиринговой организацией порядке и быть заверены руководителем или иным уполномоченным лицом клиринговой организации, печатью клиринговой организации либо засвидетельствованы в установленном порядке. Каждый документ, занимающий более одного листа, должен быть прошит, его листы должны быть пронумерованы. Федеральная комиссия рассматривает представленные документы с внесенными в них изменениями и дополнениями в срок, не превышающий 30 дней с даты их представления.

Основанием для отказа в согласовании документов является несоответствие их требованиям законодательства Российской Федерации и нормативных правовых актов Федеральной комиссии.

Федеральная комиссия направляет клиринговой организации один экземпляр полученных документов с отметкой о согласовании или письменное уведомление об отказе в согласовании с указанием причин такого отказа не позднее 7 дней после принятия соответствующего решения. Внутренний регламент клиринговой организации, Порядок хранения и защиты информации, а также изменения и дополнения в указанные документы должны быть направлены в Федеральную комиссию в уведомительном порядке не позднее чем за 30 дней до вступления их в силу либо на согласование в порядке, установленном пунктом 2.1 настоящего Положения и иными нормативными правовыми актами Федеральной комиссии.

2.2. Клиринговая организация вправе заключить договор с кредитной организацией об исполнении ею функций расчетной организации только в случае, если указанная кредитная организация

является небанковской кредитной организацией.

2.3. Исполнение обязательств по сделкам клирингового пула может осуществляться в порядке, при котором перечисление ценных бумаг и денежных средств по торговым счетам производится только после проверки и удостоверения (подтверждения) наличия на торговых счетах достаточного количества ценных бумаг и денежных средств, предназначенных для исполнения обязательств по сделкам (далее - поставка против платежа).

2.4. При осуществлении многостороннего, в том числе многостороннего централизованного, клиринга для учета операций с ценными бумагами может использоваться открытый клиринговой организации в расчетном депозитарии отдельный счет депо (либо раздел счета депо), указанный в Условиях осуществления клиринговой деятельности (далее - клиринговый счет депо). Зачисление и списание ценных бумаг с клирингового счета депо может осуществляться только на основании поручений от клиринговой организации, сформированных по итогам клиринга. Зачисление ценных бумаг на клиринговый счет депо не влечет за собой переход их в собственность клиринговой организации.

2.5. При осуществлении многостороннего, в том числе многостороннего централизованного, клиринга для учета операций с денежными средствами может использоваться открытый клиринговой организации в расчетной организации отдельный счет для учета денежных средств участников клиринга и их клиентов, указанный в Условиях осуществления клиринговой деятельности (далее - денежный клиринговый счет).

2.6. Клиринговый счет депо и денежный клиринговый счет далее вместе именуются клиринговыми счетами.

2.7. Клиринговые счета используются для учета в расчетных депозитариях и расчетных организациях расчетов по обязательствам и требованиям участников клиринга по итогам клиринга.

2.8. Клиринговая организация не вправе использовать клиринговый счет для зачисления на него собственных ценных бумаг и денежных средств, а также в процессе осуществления операций, не связанных с осуществлением клиринговой деятельности.

2.9. Клиринговая организация вправе открывать и использовать при осуществлении клиринговой деятельности несколько клиринговых счетов.

2.10. Клиринговая организация, осуществляющая централизованный клиринг, должна исполнить обязательства по сделкам клирингового пула только по отношению к участнику клиринга, исполнившему со своей стороны все свои обязательства по совершенным за его счет и за счет его клиентов сделкам клирингового пула.

2.11. Клиринговая деятельность в соответствии с абзацами 2 и 3 пункта 1.10 настоящего Положения может осуществляться только клиринговой организацией, осуществляющей клиринг по сделкам, совершенным через организатора торговли (далее именуется - клиринговый центр).

2.12. Клиринговая организация должна создать гарантийный фонд и организовать систему управления рисками неисполнения обязательств по сделкам, в отношении которых осуществляется клиринг, в соответствии с требованиями настоящего Положения.

2.13. Клиринговая организация получает от каждого участника клиринга и осуществляет учет идентификационных номеров налогоплательщика (далее именуется - ИНН) участников клиринга, а также ИНН клиентов участников клиринга.

В случае, если клиент участника клиринга является физическим лицом и не имеет ИНН, клиринговая организация получает и осуществляет учет номера бланка паспорта указанного физического лица. В случае, если клиентом участника клиринга является юридическое лицо, являющееся нерезидентом и не имеющее ИНН, клиринговая организация получает и осуществляет учет кода указанного лица, присвоенного ему участником клиринга и отличного от ИНН (кодов) других клиентов данного участника клиринга.

Клиринговая организация присваивает каждому участнику клиринга и всем его клиентам

уникальные коды и информирует об этом участников клиринга. Уникальный код участника клиринга включает ИНН участника клиринга. Уникальный код клиента участника клиринга включает ИНН участника клиринга и ИНН (номер бланка паспорта для физического лица, не имеющего ИНН, либо код, присвоенный участником клиринга, для нерезидента, не имеющего ИНН) клиента участника клиринга.

Клиринговая организация не вправе осуществлять клиринг по сделкам, расчеты по которым осуществляются за счет клиентов, не зарегистрированных клиринговой организацией.

Клиринговый центр, осуществляющий клиринг по сделкам, совершенным через организатора торговли, вправе получать указанную в настоящем пункте информацию по ИНН участников клиринга и их клиентов, а также по кодам участников клиринга и (или) их клиентов, за счет которых осуществляются расчеты по сделкам, от указанного организатора торговли.

2.14. Клиринговая организация должна осуществлять определение и учет обязательств участников клиринга в разбивке по собственным обязательствам участника клиринга и обязательствам его клиентов в порядке и в случаях, указанных в настоящем Положении или в Условиях осуществления клиринговой деятельности.

2.15. Клиринговая организация должна организовать систему контроля (сверки) и на основании полученных от депозитариев и расчетных организаций отчетов осуществлять сверку исполнения ими операций по обязательствам участников клиринга в соответствии с полученными ими от клиринговой организации поручениями и (или) иными документами.

2.16. Клиринговая организация вправе:

2.16.1. Совмещать различные указанные в пунктах 1.8-1.13 настоящего Положения способы осуществления клиринговой деятельности, если такое совмещение не запрещено требованиями нормативных правовых актов Федеральной комиссии.

2.16.2. Для обеспечения исполнения обязательств по сделкам клирингового пула осуществлять перерасчет обязательств и требований участников клиринга путем исключения из расчета необеспеченных сделок в порядке, установленном Условиями осуществления клиринговой деятельности.

2.16.3. В случае осуществления клиринга в соответствии с абзацем 3 пункта 1.11 настоящего Положения определять сделки, подлежащие исключению из расчетов в случае недостаточности у участника клиринга ценных бумаг и (или) денежных средств для исполнения всех сделок клирингового пула, совершенных за счет указанного участника клиринга или его клиентов.

2.16.4. В случае применения многостороннего или централизованного клиринга осуществлять зачет встречных однородных обязательств и требований по ценным бумагам и (или) денежным средствам (далее именуется - неттинг) в соответствии с требованиями настоящего Положения.

III. Требования к клиринговой деятельности, осуществляемой клиринговым центром

3.1. Клиринг по сделкам, совершенным через организатора торговли на рынке ценных бумаг, может осуществляться только клиринговым центром на основании договора с организатором торговли или при совмещении клиринговой деятельности и деятельности по исполнению функций организатора торговли.

3.2. Клиринговый центр должен осуществлять определение обязательств участников клиринга по итогам сделок клирингового пула на основании поручений, отчетов и (или) иных документов, указанных в Условиях осуществления клиринговой деятельности, представленных организатором торговли, участниками клиринга или другой клиринговой организацией.

3.3. Клиринговый центр должен немедленно уведомлять Федеральную комиссию о случаях:

3.3.1. Расхождения данных, обнаруженных при осуществлении сверки информации по сделкам с ценными бумагами или по остаткам ценных бумаг или денежных средств, если это привело к нарушению сроков проведения операций по итогам клиринга более чем на 3 часа.

3.3.2. Недостаточности ценных бумаг и (или) денежных средств для исполнения обязательств по

сделкам клирингового пула, если это привело к нарушению сроков проведения операций по итогам клиринга более чем на 3 часа (за исключением случая осуществления клиринга без предварительного обеспечения).

3.3.3. Использование средств гарантийного фонда.

3.4. Условия осуществления клиринговой деятельности клирингового центра, а также все изменения и дополнения к ним должны быть направлены участникам клиринга не позднее чем за 15 дней до вступления в силу.

3.5. Деятельность клирингового центра, осуществляющего клиринг по срочным сделкам, осуществляется в соответствии с требованиями настоящего Положения и иных нормативных правовых актов Федеральной комиссии в части, не противоречащей требованиям настоящего Положения.

3.6. Клиринговый центр вправе предусмотреть наличие различных категорий участников клиринга с предоставлением каждой категории своих условий обслуживания, единых для всех участников клиринга данной категории.

Отнесение участников клиринга к той или иной категории должно определяться едиными требованиями, раскрываемыми клиринговым центром всем участникам клиринга. Клиринговый центр не вправе по своему выбору предоставлять какому-либо участнику клиринга особые условия обслуживания.

IV. Условия осуществления клиринговой деятельности

4.1. Клиринговая организация разрабатывает и утверждает Условия осуществления клиринговой деятельности, которые должны включать:

4.1.1. Общие положения, включая определение и классификацию порядка осуществления клиринговой деятельности в соответствии с пунктами 1.8-1.13 настоящего Положения. Если клиринг по ценным бумагам и денежным средствам осуществляется различными указанными в пунктах 1.8-1.13 настоящего Положения способами, необходимо указать все способы осуществления клиринга.

4.1.2. Порядок взаимодействия участников клиринга и (или) их клиентов с клиринговой организацией, включая перечень документов, предоставляемых участником клиринга в клиринговую организацию, требования к участникам клиринга и порядок регистрации участников клиринга и их клиентов.

4.1.3. Перечень используемых клиринговых регистров, разделов клиринговых регистров, а также их назначение и порядок использования.

4.1.4. Перечень расчетных депозитариев и расчетных организаций, с которыми клиринговой организацией заключены соответствующие договоры.

4.1.5. Порядок взаимодействия клиринговой организации с расчетными депозитариями, расчетными организациями и (или) клиринговыми организациями в части, касающейся передачи данных о количестве ценных бумаг и денежных средств на торговых счетах и (или) счетах клиринговых организаций, формирования и передачи поручений и (или) иных документов на проведение операций по итогам клиринга по сделкам клирингового пула, а также формирования и передачи отчетов по проведенным операциям, включая реквизиты всех указанных документов.

4.1.6. Порядок получения клиринговой организацией от участников клиринга поручений, отчетов и (или) иных документов, указанных в Условиях осуществления клиринговой деятельности, на осуществление клиринга по сделкам с ценными бумагами.

4.1.7. Порядок проведения клиринговой организацией сверки поручений, отчетов и (или) иных документов, полученных клиринговой организацией от участников клиринга и (или) от уполномоченных ими лиц.

4.1.8. Порядок проверки наличия достаточного количества ценных бумаг и денежных средств для исполнения сделок клирингового пула в случае, если исполнение обязательств по сделкам

клирингового пула осуществляется в порядке, при котором перечисление ценных бумаг и денежных средств по торговым счетам производится только после проверки и удостоверения (подтверждения) наличия на торговых счетах достаточного количества ценных бумаг и денежных средств для осуществления поставки против платежа при исполнении обязательств по сделкам.

4.1.9. Порядок действий клиринговой организации в случае расхождения данных, обнаруженного при осуществлении сверки информации по сделкам с ценными бумагами или недостаточности ценных бумаг и (или) денежных средств для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула.

4.1.10. Порядок определения подлежащих исполнению обязательств клиринговых организаций и (или) участников клиринга (в разбивке по собственным обязательствам участника клиринга и обязательствам его клиентов в порядке и в случаях, указанных в настоящем Положении) по итогам сделок клирингового пула, а также порядок формирования поручений в расчетные депозитории и расчетные организации.

4.1.11. Требования к порядку исполнения расчетным депозитарием и расчетной организацией поручений клиринговой организации по итогам сделок, в отношении которых осуществляется клиринг, включая порядок предоставления отчетов по итогам исполнения поручений от клиринговой организации.

4.1.12. Порядок представления клиринговой организацией участникам клиринга и (или) их клиентам отчетов по итогам клиринга по сделкам клирингового пула.

4.1.13. Порядок и способы обеспечения исполнения обязательств участников клиринга по сделкам с ценными бумагами, а также порядок возмещения убытков в случае непроведения расчетов по итогам совершенных сделок.

4.1.14. Порядок формирования указанных в настоящем Положении реестров.

4.2. Условия осуществления клиринговой деятельности клирингового центра в дополнение к требованиям пункта 4.1 должны содержать:

4.2.1. Информацию об исполнении функций клирингового центра.

4.2.2. Перечень организаторов торговли, с которыми клиринговым центром заключены соответствующие договоры, и (или) указание на совмещение деятельности по организации торговли с клиринговой деятельностью.

4.2.3. Требования к порядку взаимодействия участников клиринга с организатором торговли, расчетным депозитарием и расчетной организацией.

4.2.4. Порядок определения, учета и представления каждому организатору торговли лимитов по каждому участнику клиринга либо порядок контроля за соблюдением лимитов участников клиринга в процессе выставления ими заявок и (или) заключения сделок (в случае применения клиринга в соответствии с абзацами 2 и 3 пункта 1.10 настоящего Положения).

4.2.5. Порядок получения клиринговым центром от организатора торговли или клиринговой организации документов по итогам торгов или клиринга соответственно.

4.2.6. Порядок получения клиринговым центром от участников клиринга поручений и (или) иных документов на осуществление клиринга по сделкам с ценными бумагами, совершенным без участия организатора торговли, либо указание на то, что клиринг по указанным сделкам не осуществляется.

4.2.7. Порядок подтверждения участниками клиринга совершенных в ходе торгов сделок либо указание на то, что все операции производятся на основании документов от организатора торговли или клирингового центра без подтверждений от участников клиринга.

4.2.8. В случае наличия нескольких категорий участников клиринга - требования к участникам клиринга каждой из категорий и особенности обслуживания участников клиринга каждой категории.

4.3. В дополнение к Условиям осуществления клиринговой деятельности клиринговая организация должна утвердить в качестве приложения к ним:

4.3.1. Тарифы клиринговой организации (в случае осуществления клиринговой деятельности на

возмездной основе).

4.3.2. Сроки представления клиринговой организацией документов и сроки получения клиринговой организацией документов в процессе взаимодействия с участниками клиринга, расчетным депозитарием, расчетной организацией и (или) другой клиринговой организацией.

4.3.3. Реквизиты документов, представляемых клиринговой организацией участникам клиринга, клиринговой организации, расчетному депозитарию, расчетной организации и (или) другой клиринговой организации, а также порядок заполнения указанных документов и сроки их предоставления.

4.3.4. Реквизиты документов, получаемых клиринговой организацией от участников клиринга, клиринговой организации, расчетного депозитария, расчетной организации и (или) другой клиринговой организации, а также порядок обработки указанных документов.

4.3.5. Особенности взаимодействия клиринговой организации с каждым расчетным депозитарием, расчетной организацией и (или) клиринговой организацией (при наличии таких особенностей).

4.4. Изменения и дополнения в указанные в пункте 4.3 настоящего Положения документы должны быть направлены в Федеральную комиссию в уведомительном порядке не позднее чем за 30 дней до вступления их в силу либо на согласование в порядке, установленном пунктом 2.1 настоящего Положения и иными нормативными правовыми актами Федеральной комиссии.

4.5. В дополнение к Условиям осуществления клиринговой деятельности и приложениям к Условиям осуществления клиринговой деятельности, указанным в пункте 4.4 настоящего Положения, клиринговый центр должен утвердить в качестве приложения к ним:

4.5.1. Реквизиты документов, представляемых клиринговым центром организатору торговли, и порядок их заполнения.

4.5.2. Реквизиты документов, получаемых клиринговым центром от организатора торговли, и порядок их обработки клиринговым центром.

4.5.3. Сроки представления клиринговому центру документов и сроки получения клиринговым центром документов в процессе взаимодействия с организатором торговли.

4.5.4. Образцы договоров, заключаемых клиринговым центром с участниками клиринга.

4.6. Изменения и дополнения в указанные в пункте 4.5 настоящего Положения документы должны быть направлены в Федеральную комиссию в уведомительном порядке не позднее чем за 30 дней до вступления их в силу либо на согласование в порядке, установленном пунктом 2.1 настоящего Положения и иными нормативными правовыми актами Федеральной комиссии.

4.7. Условия осуществления клиринговой деятельности клиринговой организации могут включать в себя и другие положения, не предусмотренные требованиями настоящего раздела.

4.8. Условия осуществления клиринговой деятельности утверждаются уполномоченным органом клиринговой организации.

V. Внутренний регламент клиринговой организации

5.1. Клиринговая организация разрабатывает и утверждает Внутренний регламент клиринговой организации, который должен включать:

5.2. Порядок взаимодействия структурных подразделений клиринговой организации в процессе обработки отчетов, поручений и (или) иных документов по совершенным сделкам от участников клиринга, организатора торговли или другой клиринговой организации, и проведения операций, включая документооборот и разграничение полномочий между различными структурными подразделениями.

5.3. Порядок взаимодействия структурных подразделений клиринговой организации в случае совмещения клиринговой деятельности с деятельностью организатора торговли, расчетной организации или расчетного депозитария, включая документооборот и разграничение полномочий между различными структурными подразделениями.

VI. Организация системы управления рисками

неисполнения сделок с ценными бумагами

6.1. Для обеспечения исполнения сделок с ценными бумагами, в отношении которых осуществляется клиринг, клиринговая организация формирует гарантийный фонд и разрабатывает систему мер снижения рисков осуществления клиринговой деятельности в соответствии с требованиями Федеральной комиссии.

6.2. Гyarантийный фонд формируется из средств участников клиринга и (или) клиринговой организации.

6.3. Клиринговая организация вправе создавать несколько гарантийных фондов с различными целями и источниками формирования.

6.4. Средства гарантийного фонда размещаются на счетах клиринговой организации в расчетной организации и (или) в расчетном депозитарии и используются с целью обеспечения исполнения обязательств участника клиринга и (или) его клиентов по сделкам клирингового пула в случае недостаточности для этого средств на торговых счетах участника клиринга и (или) клиринговой организации в соответствии с требованиями Условий осуществления клиринговой деятельности и Порядка создания, размещения и использования гарантийного фонда клиринговой организации.

6.5. Средства гарантийного фонда клиринговой организации, осуществляющей клиринг по спот-сделкам с полным обеспечением и (или) без предварительного обеспечения, формируются за счет ежемесячных взносов клиринговой организации в размере не менее 1% от вознаграждения, полученного клиринговой организацией за осуществление клиринговой деятельности, а также за счет иных взносов клиринговой организации и участников клиринга.

6.6. Средства гарантийного фонда клиринговой организации, осуществляющей клиринг по спот-сделкам с частичным обеспечением или клиринг в соответствии с абзацами 3-5 пункта 1.12 настоящего Положения, формируются за счет ежемесячных взносов клиринговой организации в размере не менее 2% от вознаграждения, полученного клиринговой организацией за осуществление клиринговой деятельности, а также за счет иных взносов клиринговой организации и участников клиринга.

6.7. Контроль за формированием, хранением и использованием средств гарантийных фондов осуществляется в соответствии с Условиями осуществления клиринговой деятельности и Порядком создания, размещения и использования гарантийного фонда клиринговой организации.

6.8. Порядок создания, хранения и использования гарантийного фонда должен предусматривать:

6.8.1. Размеры взносов в гарантийный фонд для клиринговой организации и (или) участников клиринга.

6.8.2. Порядок внесения в гарантийный фонд клиринговой организацией и участниками клиринга средств гарантийного обеспечения, в том числе, какие средства и в каком количестве (пропорции) могут быть приняты в качестве гарантийного обеспечения.

6.8.3. Порядок использования средств гарантийного обеспечения в случае недостаточности на торговых счетах участников клиринга и (или) клиринговой организации средств для исполнения обязательств участника клиринга по сделкам клирингового пула.

6.8.4. Порядок информирования участников клиринга об использовании средств гарантийного обеспечения.

6.8.5. Порядок возмещения участником клиринга и (или) клиринговой организацией средств гарантийного обеспечения, использованных в случае недостаточности у участника клиринга средств для исполнения его обязательств по сделкам клирингового пула.

6.9. Для снижения рисков неисполнения обязательств по сделкам с ценными бумагами клиринговые организации вправе предъявлять к участникам клиринга дополнительные требования, в том числе по достаточности собственного капитала и финансовому состоянию участников клиринга. При этом клиринговая организация может устанавливать для участников клиринга ограничения на размер их обязательств по сделкам с ценными бумагами, подлежащим клирингу.

VII. Учет в клиринговой организации

7.1. При осуществлении клиринговой деятельности клиринговая организация ведет клиринговые регистры участников клиринга, а также хранит необходимые документы и иную информацию клирингового учета.

7.2. Клиринговая организация осуществляет хранение и учет в соответствии с требованиями, установленными законодательством Российской Федерации и нормативными актами Федеральной комиссии:

7.2.1. Документов, полученных от организаторов торговли или клиринговых организаций, подтверждающих совершение сделок, по которым должен быть осуществлен клиринг (договоры, протоколы проведенных торгов, реестры совершенных сделок, иные документы).

7.2.2. Документов, полученных от участников клиринга (договоры, поручения, иные документы).

7.2.3. Документов, полученных от расчетных депозитариев, подтверждающих наличие ценных бумаг на счетах клиринговых организаций и (или) на торговых счетах депо участников клиринга и (или) их клиентов.

7.2.4. Документов, полученных от расчетных организаций, подтверждающих наличие денежных средств на счетах клиринговых организаций и (или) на денежных торговых счетах участников клиринга и (или) их клиентов.

7.2.5. Копий поручений клиринговой организации, направленных депозитарию, расчетной организации или клиринговой организации для исполнения сделок с ценными бумагами, в отношении которых осуществляется клиринг.

7.2.6. Информации о ценных бумагах и денежных средствах, которые могут быть использованы в качестве обеспечения при выставлении заявок и (или) заключении сделок.

7.2.7. Информации о ценных бумагах и денежных средствах, которые заблокированы в качестве обеспечения выставленных заявок и (или) заключенных сделок.

7.2.8. Иных документов и информации по усмотрению клиринговой организации.

7.3. Клиринговая организация должна отдельно по каждому участнику клиринга и (или) по клиентам каждого участника клиринга осуществлять на отдельных клиринговых регистрах (разделах клиринговых регистров) учет:

7.3.1. Информации о ценных бумагах и (или) денежных средствах, принадлежащих разным участникам клиринга.

7.3.2. Информации о ценных бумагах и (или) денежных средствах, размещенных на отдельных торговых счетах.

7.3.3. Обязательств каждого из участников клиринга.

7.4. Информация о ценных бумагах и (или) денежных средствах участников клиринга и их клиентов должна учитываться на отдельных клиринговых регистрах или разделах клиринговых регистров (за исключением информации о денежных средствах в случае, когда участник клиринга является кредитной организацией). Информация о ценных бумагах и (или) денежных средствах клиентов участника клиринга может учитываться:

отдельно по каждому клиенту участника клиринга;

совместно по нескольким клиентам участника клиринга.

7.5. Клиринговая организация должна вести:

реестр участников клиринга;

реестр клиентов участников клиринга;

реестр остатков ценных бумаг и денежных средств, размещенных на торговых счетах участников клиринга и (или) их клиентов и (или) клиринговых счетах клиринговой организации;

реестр сделок, по которым осуществлен клиринг;

реестр принятых поручений (в том числе переданных организатором торговли в составе реестра сделок);

реестр поручений, направленных расчетной организации и (или) расчетному депозитарию;
реестр отчетов, направленных участникам клиринга и их клиентам.

Указанные реестры должны позволять составлять списки и выписки из них на любую дату и за любой период.

7.6. Реестр участников клиринга должен содержать следующие сведения:

7.6.1. Полное наименование участника клиринга.

7.6.2. Код участника клиринга, присвоенный клиринговой организацией.

7.6.3. Место нахождения, номер телефона, факса, адрес электронной почты участника клиринга.

7.6.4. ИНН участника клиринга.

7.6.5. Реквизиты денежных торговых счетов участников клиринга и (или) их клиентов и (или) клиринговых организаций (в случае наличия таковых), через которые осуществляются расчеты по итогам клиринга.

7.6.6. Фамилию, имя, отчество и должность руководителя единоличного исполнительного органа участника клиринга и контролера.

7.6.7. Сведения о лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг, включая вид (виды) деятельности, на который выдана лицензия, наименование органа, выдавшего лицензию, номер лицензии, дату выдачи и дату окончания срока действия лицензии.

7.6.8. Дату аккредитации в качестве участника клиринга.

7.6.9. Информацию о принятых клиринговой организацией дисциплинарных мерах по приостановлению проведения клиринга по сделкам участника клиринга или об исключении из списка участников клиринга.

7.7. Реестр клиентов участников клиринга должен содержать следующие сведения:

7.7.1. Код участника клиринга, присвоенный клиринговой организацией.

7.7.2. ИНН клиента участника клиринга (или, в случаях, установленных Положением, номер бланка паспорта либо код, присвоенный участником клиринга).

7.8. Реестр остатков ценных бумаг и денежных средств, размещенных на торговых счетах участников клиринга и (или) их клиентов и (или) счетах клиринговой организации должен содержать следующие сведения:

7.8.1. Дату и номер документа, полученного от расчетного депозитария или от расчетной организации, подтверждающего величину остатка.

7.8.2. Счет депо/денежный счет.

7.8.3. Код ценной бумаги/код валюты.

7.8.4. Количество ценных бумаг/сумма денежных средств.

7.9. Реестр принятых поручений (в том числе переданных организатором торговли реестров сделок) должен содержать следующие сведения:

7.9.1. Идентификационный номер поручения (реестра сделок).

7.9.2. Дату составления поручения.

7.9.3. Код или наименование участника клиринга или организатора торговли, представившего поручение.

7.10. Реестр сделок, по которым осуществлен клиринг, должен содержать следующие сведения:

7.10.1. Идентификационный номер сделки.

7.10.2. Дату и время клиринга по сделке.

7.10.3. Вид сделки.

7.10.4. Дату и номер поручения или иного документа, на основании которого осуществляется клиринг по сделке.

7.10.5. Коды или наименования участников торгов, совершивших сделку.

7.10.6. Коды или наименования участников клиринга, на которых возложены обязательства по исполнению сделки.

- 7.10.7. Коды или наименования клиентов участников клиринга, по поручению и за счет которых должна быть исполнена сделка.
- 7.10.8. Наименование эмитента, вид, категорию (тип), серию ценной бумаги.
- 7.10.9. Цену (стоимость) одной ценной бумаги.
- 7.10.10. Сумму сделки.
- 7.10.11. Количество ценных бумаг.
- 7.10.12. Результат клиринга.
- 7.10.13. Дату и время проведения расчетов по сделке.
- 7.11. Реестр поручений, направленных расчетной организации и (или) расчетному депозитарию, должен содержать следующие сведения:
- 7.11.1. Номер поручения.
- 7.11.2. Коды счетов и (или) лиц, по обязательствам которых должна быть проведена операция.
- 7.11.3. Код валюты/код ценной бумаги.
- 7.11.4. Сумму/количество ценных бумаг.
- 7.11.5. Итоги исполнения операции.
- 7.11.6. Дату поручения.
- 7.12. Реестр отчетов, направленных участникам клиринга и их клиентам, должен содержать следующие сведения:
- 7.12.1. Код или наименование участника клиринга, которому направлен отчет.
- 7.12.2. Дату отправления отчета.
- 7.12.3. Способ направления отчета.
- 7.12.4. Общую сумму обязательств (по каждому виду ценных бумаг и валюты) по сделкам участника клиринга и/или его клиентов.
- 7.13. Клиринговая организация вправе включать в указанные в пункте 7.5 реестры иные сведения, не предусмотренные требованиями настоящего Положения.
- 7.14. Клиринговая организация формирует следующие отчеты:
- 7.14.1. Отчет участнику клиринга по итогам клиринга по собственным сделкам участника клиринга и сделкам его клиентов.
- 7.14.2. Отчет клиенту участника клиринга по итогам клиринга по сделкам указанного клиента (указанные отчеты могут передаваться клиринговой организацией участнику клиринга для передачи их клиентам участника клиринга либо непосредственно клиентам участников клиринга).
- 7.14.3. Отчет организатору торговли (если это предусмотрено договором между организатором торговли и клиринговым центром).
- 7.15. Отчеты, направленные организаторам торговли, участникам клиринга и их клиентам, должны содержать следующие сведения:
- перечень сделок, по которым осуществлен клиринг, с указанием на исполнение либо неисполнение (с указанием причины неисполнения) каждой из сделок;
- объем обязательств и требований по итогам клиринга по каждому торговому счету участника клиринга и (или) его клиента;
- дату и время исполнения указанных обязательств.

VIII. Требования к Порядку хранения и защиты информации

- 8.1. Клиринговая организация должна осуществлять деятельность в соответствии с разработанным в соответствии с требованиями настоящего Положения и утвержденным уполномоченным органом клиринговой организации Порядком хранения и защиты информации.
- 8.2. Порядок хранения и защиты информации предусматривает:
- 8.2.1. Описание информации, связанной с деятельностью клиринговой организации, которая подлежит защите, а также режимы и правила обработки и доступа к указанной информации.
- 8.2.2. Перечень лиц, имеющих доступ к указанной в пункте 8.2.1 настоящего Положения информации.

8.2.3. Описание систем защиты баз данных клиринговой организации от ошибок и несанкционированного доступа, включая:

порядок доступа к базам данных клиринговой организации, в том числе установление ограничений от несанкционированного доступа к базам данных клиринговой организации;

использование паролей и других средств, ограничивающих доступ к базам данных клиринговой организации;

описание мер, предпринимаемых клиринговой организацией и участниками клиринга, направленных на предотвращение сбоев и ошибок в работе клиринговой системы клиринговой организации.

8.3. Клиринговая организация должна осуществлять дублированное хранение информации, содержащейся в указанных в разделе 7 настоящего Положения реестрах.
