

УТВЕРЖДЕНО
Приказом Президента
Акционерного общества
«Клиринговый центр МФБ»
№ 224 от 31 августа 2018 года

Регламент осуществления
клиринговой деятельности
на рынке ценных бумаг
Акционерного общества
«Клиринговый центр МФБ»

МОСКВА
2018 г.

ОГЛАВЛЕНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	3
Статья 1. Общие положения.....	3
Статья 2. Перечень форм документов для регистрации в качестве Участника клиринга.....	3
РАЗДЕЛ II. ОСОБЕННОСТИ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЦ И УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА В ПРОЦЕССЕ КЛИРИНГОВОГО ОБСЛУЖИВАНИЯ.....	3
Статья 3. Особенности открытия и проведения операций по Субсчетам депо.....	3
Статья 4. Зачисление денежных средств на Клиринговый денежный счет/ возврат денежных средств с Клирингового денежного счета.....	5
Статья 5. Формы/форматы документов, используемых при взаимодействии КЦ и Участника клиринга при осуществлении клиринга и взаимодействии с Расчетным депозитарием.....	6
Статья 6. Клиринговые отчеты и уведомления КЦ	8
Статья 7. Перечни ценных бумаг, в отношении которых могут направляться Оферты ОТС.	9
Приложение 1.Временной регламент КЦ.....	11
Приложение 2.Формы документов, предоставляемых в КЦ для заключения договора об осуществлении клирингового обслуживания	14
Приложение 3.Спецификация документов, используемых в документообороте между КЦ и Участниками клиринга при осуществлении клиринга по Договорам и Конверсионным договорам	22
Приложение 4. Формы/форматы документов, используемых в документообороте между КЦ и Участниками клиринга при взаимодействии с Расчетным депозитарием	68
Приложение 5. Формы отчетов, предоставляемых КЦ	116

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Статья 1. Общие положения

- 1.1. Настоящий Регламент осуществления клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг Акционерного общества «Клиринговый центр МФБ» (далее – Регламент клиринга) разработан в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг Публичного акционерного общества «Клиринговый центр МФБ» (далее – Правила клиринга).
- 1.2. Регламент клиринга устанавливает расписание операционного дня Акционерного общества «Клиринговый центр МФБ» (далее - КЦ) (включая время проведения операций, осуществляемых в соответствии с Правилами клиринга), сроки подачи в КЦ и получения от КЦ документов в процессе взаимодействия с Участниками клиринга в соответствии с Правилами клиринга, формы/форматы документов, используемых в документообороте между Участниками клиринга и КЦ, а также иные положения, за исключением тех положений, которые в соответствии с требованиями Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и принятых в соответствии с ним нормативных актов должны содержаться в Правилах клиринга.
- 1.3. КЦ вправе в одностороннем порядке вносить изменения в Регламент клиринга. Раскрытие информации о внесении изменений в Регламент клиринга, в том числе о принятии Регламента клиринга в новой редакции, осуществляется путем размещения указанных изменений или новой редакции на Сайте КЦ. Регламент клиринга и вносимые в него изменения вступают в силу после раскрытия информации об этом в соответствии с настоящим пунктом Регламента клиринга в дату, определяемую КЦ.
- 1.4. Термины и определения, используемые в настоящем Регламенте клиринга, применяются в значениях, установленных Правилами клиринга, а также Федеральным законом «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и принятыми в соответствии с ним нормативными актами.

Статья 2. Перечень форм документов для регистрации в качестве Участника клиринга

- 2.1. Для регистрации лица в качестве Участника клиринга используются следующие формы документов:
 - Анкета участника клиринга по форме, установленной в Приложении №2 к Регламенту клиринга;
 - Согласие на обработку персональных данных лица, подписавшего от имени Заявителя анкету и договор об оказании клиринговых услуг, по форме, установленной в Приложении №2 к Регламенту клиринга;
 - Договор об оказании клиринговых услуг по форме, установленной в Приложении №2 к Регламенту клиринга.

РАЗДЕЛ II. ОСОБЕННОСТИ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЦ И УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА В ПРОЦЕССЕ КЛИРИНГОВОГО ОБСЛУЖИВАНИЯ

Статья 3. Особенности открытия и проведения операций по Субсчетам депо

- 3.1. Перечень документов, предоставляемых в бумажном виде Участником клиринга и Депозитарием в КЦ для дальнейшей передачи в Расчетный депозитарий для открытия Субсчета депо:
 - Комплект документов, необходимый в соответствии с Условиями осуществления депозитарной деятельности, утвержденными Расчетным депозитарием, для открытия счета депо российскому юридическому лицу, за исключением заявления на открытие счета депо и депозитарного договора;
 - Заявление на открытие Субсчета депо по форме К1, установленной в Приложении № 4 к Регламенту клиринга. Указанное заявление предоставляется для каждого открываемого Субсчета депо. Указанное заявление представляется в 2 (двух) оригинальных экземплярах в случае открытия Субсчета депо Депозитарию;
 - Заявление об используемых адресах в Системе электронного документооборота для взаимодействия с Расчетным депозитарием по форме К3, установленной в Приложении №4 к Регламенту клиринга.

- 3.2. Перечень документов, предоставляемых в бумажном виде Участником клиринга в КЦ для дальнейшей передачи в Расчетный депозитарий для открытия Субсчета депо клиенту Участника клиринга:
- Комплект документов, необходимый в соответствии с Условиями осуществления депозитарной деятельности, утвержденными Расчетным депозитарием, для открытия счета депо, за исключением заявления на открытие счета депо и депозитарного договора;
 - Заявление на открытие Субсчета депо по форме К1, установленной в Приложении № 4 к Регламенту клиринга. Указанное заявление предоставляется для каждого открываемого Субсчета депо;
 - Поручение о внесении информации о назначении лица, которое вправе в соответствии с законодательством Российской Федерации представлять интересы лица, которому открыт Субсчет депо по форме К-5, указанной в Приложении №4 к Регламенту клиринга;
 - Комплект документов, необходимый в соответствии с Условиями осуществления депозитарной деятельности, утвержденными Расчетным депозитарием, для назначения лица, которое вправе в соответствии с законодательством Российской Федерации представлять интересы лица, которому открыт Субсчет депо.
- 3.3. Для открытия второго и последующих Субсчетов депо и при условии наличия действующего Субсчета депо, Участнику клиринга, Депозитарию и (или) клиенту Участника клиринга необходимо предоставить в КЦ в бумажном виде заявление на открытие Субсчета депо по форме К1, установленной в Приложении №4 к настоящему Регламенту, без предоставления документов, перечисленных в пп. 3.1. и 3.2. Регламента клиринга.
- 3.4. Зачисление/списание ценных бумаг российских эмитентов на/с Субсчет(а) депо осуществляется посредством перевода ценных бумаг на/со счет(а) депо номинального держателя ЗАО «СПб РДЦ» в НКО АО НРД по следующим реквизитам:
- Депонент: ЗАО «СПб РДЦ»
Номер счета депо: PL9905180156
Номер раздела: 000000000000000000
Основания:
- междепозитарный договор №800/ДМС-2 от 14.05.1999,
- договор о депозитарном обслуживании клирингового счета депо Д-1798 от 30.05.2013 года,
- договор об осуществлении клирингового обслуживания № ____ от ____¹.
¹ -номер и дата Договора между КЦ и Участником клиринга.
- 3.5. Зачисление/списание ценных бумаг иностранных эмитентов на/с Субсчет(а) депо осуществляется посредством перевода ценных бумаг на/со счет(а) депо номинального держателя ЗАО «СПб РДЦ»:
- в Банк ВТБ (ПАО) по следующим реквизитам:
Депонент: ЗАО «СПб РДЦ»
Номер счета депо: 7985, раздел: основной
Основания:
- договор о междепозитарных отношениях № 7985/МД от 05.07.2013,
- договор о депозитарном обслуживании клирингового счета депо Д-1798 от 30.05.2013 года,
- договор об осуществлении клирингового обслуживания № ____ от ____¹.
¹ -номер и дата Договора между КЦ и Участником клиринга.
 - в ПАО «Бест Эффортс Банк» по следующим реквизитам:
SWIFT Банка: RTSBRUMM
Депонент: ЗАО «СПб РДЦ»

Номер счета депо: K60000900003

Основания:

- договор о междепозитарных отношениях № MD090 от 22.06.2016,
- договор о депозитарном обслуживании клирингового счета депо Д-1798 от 30.05.2013 года,
- договор об осуществлении клирингового обслуживания № ____ от _____¹.

¹ -номер и дата Договора между КЦ и Участником клиринга.

- 3.6. Для зачисления ценных бумаг на Субсчет депо со счета депо, открытого в другом депозитарии, или с лицевого счета у регистратора Участник клиринга и Депозитарий должен подать в КЦ поручение на зачисление ценных бумаг по форме ПЗ-01 в бумажном виде или в виде Электронного документа в формате XML, подписанного Электронной подписью, который должен соответствовать схеме MF010.xsd при зачислении ценных бумаг российских эмитентов, либо схеме PP61F.xsd или PP61B.xsd при зачислении ценных бумаг иностранных эмитентов. Формы/форматы, используемые при направлении поручения, установлены Приложением №4 к Регламенту клиринга.
- 3.7. Для списания ценных бумаг с Субсчета депо на счет депо, открытый в другом депозитарии, или на лицевой счет у регистратора, Участник клиринга и Депозитарий должен подать в КЦ поручение на списание ценных бумаг по форме ПС-01 в бумажном виде или в виде Электронного документа в формате XML, подписанного Электронной подписью, который должен соответствовать схеме MF010.xsd при списании ценных бумаг российских эмитентов, либо схеме PP61F.xsd или PP61B.xsd при списании ценных бумаг иностранных эмитентов. Формы/форматы, используемые при направлении поручения, установлены Приложением №4 к Регламенту клиринга.
- 3.8. Для совершения операций по списанию/зачислению ценных бумаг с/на Субсчета депо, открытые в рамках Клирингового счета депо, Участники клиринга и Депозитарии должны подавать поручения в КЦ на перечисление ценных бумаг по форме ПП-01 в бумажном виде или в виде Электронного документа в формате XML, подписанного Электронной подписью, который должен соответствовать схеме PP02Q.xsd. Формы/форматы, используемые при направлении поручения, установлены Приложением №4 к Регламенту клиринга.
- 3.9. Для уведомления о статусе исполнения поручения или сообщения о мотивированном отказе КЦ отправляет Участникам клиринга сообщение MT596 в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, в формате, установленном Приложением №4 к Регламенту клиринга.

Статья 4. Зачисление денежных средств на Клиринговый денежный счет/ возврат денежных средств с Клирингового денежного счета

- 4.1. Зачисление денежных средств на Клиринговый денежный счет осуществляется путем перевода средств на Клиринговые денежные счета по реквизитам, опубликованным на Сайте КЦ.
- 4.2. Поле «назначение платежа» при зачислении денежных средств на Клиринговый денежный счет должно включать в себя:
- однозначное указание на эти средства как средства индивидуального клирингового обеспечения или коллективного клирингового обеспечения Участника клиринга;
 - номер и дату договора об оказании клиринговых услуг между КЦ и Участником клиринга;
 - номер и дату договора между КЦ и Гарантом (для коллективного клирингового обеспечения, формируемого за счет средств Гарантов);
 - ТКС (для индивидуального клирингового обеспечения)
 - Пятибуквенный Код фирмы
- 4.3. Пример назначения платежа для зачисления денежных средств индивидуального клирингового обеспечения Участника клиринга на Клиринговый денежный счет:
- Для зачисления денежных средств в рублях Российской Федерации:
«Индивидуальное клиринговое обеспечение по договору об оказании клиринговых услуг

№ ___¹ от ДД.ММ.ГГГГ. ТКС: ___², FIRM: ___³. НДС не облагается.»

¹ -номер Договора между КЦ и Участником клиринга.

² - код ТКС.

³ - FIRM (Пятибуквенный код фирмы, латинскими буквами, присвоенный при регистрации в качестве участника клиринга)

«Для зачисления денежных средств в иностранной валюте:

«Individual collateral under the Clearing agreement № ___¹ dated DD.MM.YYYY. TCA: ___², FIRM: ___³
. Payer _____. VAT exempt.»

¹ -номер Договора между КЦ и Участником клиринга. (буква «К» латинская)

² - код ТКС.

³ - FIRM (Пятибуквенный код фирмы, латинскими буквами, присвоенный при регистрации в качестве участника клиринга)

- 4.4. Пример назначения платежа для зачисления денежных средств коллективного клирингового обеспечения на Клиринговый денежный счет:

«Взнос в Гарантийный фонд по договору № ___¹ от ДД.ММ.ГГГГ, FIRM: ___². НДС не облагается.»

¹ -номер Договора между КЦ и Участником клиринга.

² - FIRM (Пятибуквенный код фирмы, латинскими буквами, присвоенный при регистрации в качестве участника клиринга)

- 4.5. Возврат денежных средств, перечисленных на Клиринговый денежный счет, осуществляется путем подачи Участником клиринга в КЦ поручения на возврат денежных средств по форме, указанной в Приложении № 3 к Регламенту клиринга.

Статья 5. Формы/форматы документов, используемых при взаимодействии КЦ и Участника клиринга при осуществлении клиринга и взаимодействии с Расчетным депозитарием

- 5.1. Формы/форматы документов приведены в Приложении №3 к Регламенту клиринга.
- 5.2. Документы, используемых при взаимодействии КЦ и Участника клиринга при осуществлении клиринга по Договорам, Конверсионным договорам, Внебиржевым договорам и взаимодействию с Расчетным депозитарием, предоставляются Участниками клиринга в КЦ в виде Электронных документов, подписанных Электронной подписью.
- 5.3. Для взаимодействия между КЦ и Участниками клиринга при осуществлении клиринга обязательств, возникших из Конверсионных договоров и Внебиржевых договоров, используются следующие документы:

5.3.1. Поручение на клиринг внебиржевых договоров для целей осуществления клиринга обязательств, возникших из Конверсионных договоров (формируется и предоставляется Участниками клиринга в КЦ посредством Системы в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью), которое содержит следующую информацию:

- предмет Конверсионного договора (наименование иностранной валюты);
- дата и время подачи Поручения на клиринг внебиржевых договоров;
- дата исполнения Конверсионного договора;
- Идентификатор Участника клиринга, подавшего поручение на клиринг внебиржевых договоров;

- Идентификатор Участника клиринга, являющегося контрагентом по Конверсионному договору;
- направление Конверсионного договора;
- ТКС/Аналитический ТКС;
- краткий код клиента Участника клиринга, если Конверсионный договор был заключен за счет и по поручению клиента Участника клиринга;
- количество валюты по Конверсионному договору;
- сопряженная валюта Конверсионного договора;
- цена единицы валюты Конверсионного договора;
- сумма Конверсионного договора в сопряженной валюте.

5.3.2. Поручение на клиринг внебиржевых договоров для целей осуществления клиринга обязательств, возникших из Внебиржевых договоров (формируется и предоставляется Участниками клиринга в КЦ посредством Системы в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью), которое содержит следующую информацию:

- предмет Внебиржевого договора;
- дата и время подачи Поручения на клиринг внебиржевых договоров;
- Идентификатор Участника клиринга, подавшего поручение на клиринг внебиржевых договоров;
- Идентификатор Участника клиринга, являющегося контрагентом по Внебиржевому договору;
- направление Внебиржевого договора;
- ТКС/Аналитический ТКС;
- краткий код клиента Участника клиринга, если Внебиржевой договор был заключен за счет и по поручению клиента Участника клиринга;
- наличие/отсутствие проверки достаточности Доступных средств при приеме Поручения на клиринг внебиржевых договоров;
- цена одной ценной бумаги/цена единицы валюты, являющейся предметом Внебиржевого договора (в отношении Договора купли-продажи);
- цена одной ценной бумаги/единицы валюты по первой части Внебиржевого договора репо/своп (в отношении Договора репо/своп);
- цена одной ценной бумаги/единицы валюты по второй части Внебиржевого договора репо/своп (в отношении Договора репо/своп);
- ставка репо/своп (в отношении Договора репо/своп);
- дата исполнения Внебиржевого договора (в отношении договора купли-продажи);
- дата исполнения первой части Внебиржевого договора репо/своп (в отношении договора репо/своп);
- дата исполнения второй части Внебиржевого договора репо/своп (в отношении договора репо/своп);
- валюта цены/сопряженная валюта Внебиржевого договора;
- количество ценных бумаг в лотах/валюты, являющейся предметом Внебиржевого договора;
- размер лота (для ценных бумаг);
- сумма Внебиржевого договора в валюте цены (в отношении договора купли-продажи);
- сумма первой части Внебиржевого договора репо/своп в валюте цены (в отношении договора репо);
- сумма второй части Внебиржевого договора репо/своп в валюте цены (в отношении договора репо);
- размер/порядок расчета штрафа за неисполнение обязательств по Внебиржевому договору;

- реквизиты денежного счета для исполнения обязательств по Внебиржевому договору (при необходимости), которые могут включать: наименование банка-получателя, БИК банка, номер корреспондентского счета, номер расчетного счета, валюта счета (для рублевых расчетов); SWIFT банка-получателя, SWIFT банка-корреспондента, счет получателя, валюта счета (для расчетов в иностранной валюте);
- реквизиты счета депо для исполнения обязательств по Внебиржевому договору (при необходимости), которые могут включать: наименование депозитария, номер счета депо получателя, номер раздела счета депо.

5.4. Оферта ОТС, направляемая для целей заключения Внебиржевых договоров ОТС и Пар внебиржевых договоров ОТС (формируется и предоставляется Участниками клиринга в КЦ посредством Системы в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью), содержит следующую информацию:

- Идентификационный код ценной бумаги, являющейся предметом Внебиржевого договора ОТС или Пары внебиржевых договоров ОТС;
- дата и время подачи Оферты ОТС;
- Идентификатор Участника клиринга, направившего Оферту ОТС;
- Идентификатор Участника клиринга, направление связанной Оферты ОТС которым является условием заключения Внебиржевого договора ОТС или Пары внебиржевых договоров ОТС между КЦ и Участником клиринга, направившим Оферту ОТС;
- направление Внебиржевого договора ОТС или Пары внебиржевых договоров ОТС;
- ТКС/Аналитический ТКС;
- краткий код клиента Участника клиринга, если Внебиржевой договор ОТС или Пара внебиржевых договоров ОТС подлежит заключению за счет и по поручению клиента Участника клиринга;
- цена одной ценной бумаги, являющейся предметом Внебиржевого договора купли-продажи ОТС;
- цена одной ценной бумаги по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару внебиржевых договоров ОТС;
- Ставка репо;
- дата исполнения Внебиржевого договора купли-продажи ОТС;
- дата исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС или Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС;
- дата исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС или Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС;
- валюта цены Внебиржевого договора ОТС или Пары внебиржевых договоров ОТС;
- валюта расчетов Внебиржевого договора ОТС или Пары внебиржевых договоров ОТС;
- количество ценных бумаг в лоте;
- размер лота;
- сумма Внебиржевого договора купли-продажи ОТС в валюте цены;
- сумма репо Внебиржевого договора репо ОТС или сумма Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, в валюте цены;
- сумма второй части Внебиржевого договора репо ОТС или сумма Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, в валюте цены.

5.5. Формы/форматы документов, используемых в документообороте между КЦ и Участником клиринга при взаимодействии с Расчетным депозитарием, установлены в Приложении №4 к Регламенту клиринга.

Статья 6. Клиринговые отчеты и уведомления КЦ

6.1. КЦ формирует и направляет Участникам клиринга следующие клиринговые отчеты:

- MFB06. Отчет об обязательствах, допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг);
 - MFB13. Отчет об итоговых нетто-обязательствах/нетто-требованиях;
 - MFB23. Отчет об обязательствах по договорам;
 - MFB99. Отчет об обеспечении.
- 6.2. Дополнительная информация предоставляется КЦ Участникам клиринга в виде ежедневных уведомлений и/или уведомлений, формируемых при наступлении события, повлекшего за собой необходимость направления соответствующей информации.
- 6.3. Ежедневно КЦ формирует и направляет Участникам клиринга следующие уведомления:
- MFB06С. Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга);
 - MFB14. Отчет о Гарантийном обеспечении, Маржинальном требовании и Задолженности;
 - MFB20. Уведомление о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга;
 - MFB23С. Уведомление об обязательствах, определенных по итогам клиринга (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга);
 - MFB76. Отчет о взносах в Гарантийный фонд;
 - MFB82. Уведомление о кодах/кратких кодах клиентов Участника клиринга и (или) о кодах/кратких кодах Участника клиринга.
- 6.4. Дополнительно КЦ формирует и направляет Участникам клиринга:
- MFB15. Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению: предоставляется ежедневно с момента возникновения у Участника клиринга обязательств по уплате сумм торгового, клирингового и технического сборов до исполнения этих обязательств и/или в дату удержания этих сумм из средств индивидуального клирингового обеспечения Участника клиринга;
 - MFB21. Уведомление о счетах для вывода денежных средств Участника клиринга: предоставляется ежедневно при наличии у Участника клиринга хотя бы одного зарегистрированного счета для вывода средств обеспечения;
 - MFB22. Отчет о требованиях по погашению задолженности по денежному регистру: предоставляется ежедневно с момента возникновения у Участника клиринга задолженности по денежному регистру до ее погашения;
 - MFB98. Отчет о глобальных операциях и об обязательствах/требованиях по передаче Дохода: предоставляется ежедневно с момента возникновения у Участника клиринга обязательств по передаче Дохода до момента исполнения этих обязательств, а также с момента заключения Участником клиринга Договора, порядок исполнения обязательств по которому подлежит изменению в связи с реорганизацией эмитента ценных бумаг, конвертацией и (или) дроблением ценных бумаг, проводимой без реорганизации эмитента ценных бумаг, или иных действия, влияющих на исполнение обязательств по Договору, до момента исполнения обязательств по данному Договору;
 - MFB98А. Уведомление о размере обязательств/требований по передаче Дохода: предоставляется одновременно при определении обязательств Участников клиринга по передаче Дохода.
- 6.5. КЦ формирует и направляет уведомления Участникам клиринга одновременно с предоставлением клиринговых отчетов.
- 6.6. Формы и форматы клиринговых отчетов и уведомлений установлены в Приложении №5 к Регламенту клиринга.

Статья 7. Перечни ценных бумаг, в отношении которых могут направляться Оферты ОТС.

- 7.1. Участник клиринга вправе направлять Оферты ОТС в отношении ценных бумаг, включенных в базовый или расширенный перечень ценных бумаг в зависимости от выбранного Участником клиринга тарифного плана.
- 7.2. Базовый и расширенный перечни ценных бумаг, в отношении которых Участником клиринга могут направляться Оферты ОТС, определяются КЦ и публикуются на Сайте КЦ.

