

УТВЕРЖДЕНО
Приказом Президента
Акционерного общества
«Клиринговый центр МФБ»
№ 212/1 от 26 марта 2020 года

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

МОСКВА
2020 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.....	4
Статья 5. Формы/форматы документов, используемых при взаимодействии КЦ и Участника клиринга при осуществлении клиринга и взаимодействии с Расчетным депозитарием	5
Статья 6. Клиринговые отчеты и уведомления КЦ	7
Статья 7. Перечни ценных бумаг, в отношении которых могут направляться Оферты ОТС.	8
Приложение № 1	9
Приложение № 2	12
Приложение № 3	20
Приложение № 4	68
Приложение № 5	101

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 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 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/или договор об оказании клиринговых услуг, и/или опросный лист юридического лица на основании доверенности, 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 Участником клиринга, Депозитарием, клиентом или клиентом клиента Участника клиринга в Расчетный депозитарий или в КЦ для дальнейшей передачи в Расчетный депозитарий для открытия Субсчета депо Участнику клиринга, Депозитарию, клиенту или клиенту клиента Участника клиринга:
 - Комплект документов, необходимый в соответствии с Условиями осуществления депозитарной деятельности, утвержденными Расчетным депозитарием для открытия Субсчета депо юридическому или физическому лицу;
 - Заявление о присоединении к Условиям осуществления депозитарной деятельности и открытию субсчетов депо по форме, установленной Приложением № 4 к Регламенту клиринга.
- 3.2. Для открытия второго и последующих Субсчетов депо в Расчетном депозитарии, при условии наличия действующего Субсчета депо в Расчетном депозитарии, Участнику клиринга, Депозитарию, клиенту или клиенту клиента Участника клиринга необходимо предоставить в Расчетный депозитарий или в КЦ для дальнейшей передачи в Расчетный депозитарий Заявление о присоединении к Условиям осуществления депозитарной деятельности и открытии субсчетов депо по форме, установленной в Приложении № 4 к Регламенту клиринга. Предоставление иных документов, указанных в п.3.1, не требуется при условии, что такие документы не были изменены, в данных анкеты Участника клиринга, Депозитария, клиента или клиента клиента Участника клиринга не произошли изменения или срок анкеты не истек.
- 3.3. Зачисление / списание ценных бумаг на / с Субсчет (а) депо осуществляется посредством перевода ценных бумаг со / на счет (а) депо номинального держателя, открытого (ый) Расчетному депозитарию,

- по реквизитам, опубликованным на Сайте КЦ.
- 3.4. Для зачисления/списания ценных бумаг на/с Субсчета (ов) депо, открытые (ых) Расчетным депозитарием, со/на счетов (а) депо, открытых (ые) в другом депозитарии, или с/на лицевых (ые) счетов (а) у регистратора Участники клиринга или Депозитарии должны подать в КЦ поручения на внешнее зачисление/списание ценных бумаг в виде Электронных документов в формате XML, подписанных Электронной подписью, которые должны соответствовать PP61B.xsd схеме при зачислении и списании ценных бумаг российских и иностранных эмитентов. Формы/форматы, используемые при направлении поручения, установлены Приложением № 4 к Регламенту клиринга.
 - 3.5. Для совершения операций по зачислению/списанию ценных бумаг на/с Субсчета (ов) депо, открытые (ых) Расчетным депозитарием в рамках Клирингового счета депо, Участники клиринга или Депозитарии должны подавать поручения в КЦ на внутренний перевод ценных бумаг в виде Электронных документов в формате XML, подписанных Электронной подписью, которые должны соответствовать PP61B.xsd схеме, если операции производятся между Субсчетами депо, открытыми в Расчетном депозитарии. Формы/форматы, используемые при направлении поручения, установлены Приложением № 4 к Регламенту клиринга.
 - 3.6. Для отмены поручений по зачислению и списанию ценных бумаг российских и иностранных эмитентов на / с Субсчета (ов) депо, открытые (ых) Расчетным депозитарием, с/на счетов(а) депо, открытых (ые) в другом депозитарии или для отмены операций по списанию/зачислению ценных бумаг с/на Субсчетов (а) депо, открытых (ые) Расчетным депозитарием в рамках Клирингового счета депо, Участники клиринга и Депозитарии должны подавать поручение на отмену операции в КЦ в виде Электронного документа в формате XML, подписанного Электронной подписью, который должен соответствовать PP61B.xsd схеме. Формы/форматы, используемые при направлении поручения, установлены Приложением № 4 к Регламенту клиринга.
 - 3.7. Поручения, указанные в пунктах 3.4-3.6 настоящего Регламента клиринга подаются Участником клиринга / Депозитарием в адрес КЦ «MFBIM@DEPO».
 - 3.8. 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 с использованием адреса «MFBIM@DEPO».

Статья 4. Зачисление денежных средств на Клиринговый денежный счет/ возврат денежных средств с Клирингового денежного счета/ перевод денежных средств между ТКС / разделами клиринговых регистров

- 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);
 - вид Гарантийного фонда (для коллективного клирингового обеспечения);
 - 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;

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:

- Для зачисления денежных средств в рублях Российской Федерации:

«Взнос в Гарантийный фонд участников / специальный Гарантийный фонд по договору об оказании клиринговых услуг № ____¹ от ДД.ММ.ГГГГ / по договору № ____² от ДД.ММ.ГГГГ, FIRM: ____³, НДС не облагается.»

¹ - номер договора между КЦ и Участником клиринга;

² - номер договора между КЦ и Гарантом;

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

- Для зачисления денежных средств в иностранной валюте:

«Payment in Default fund of clearing members / special Default fund under the clearing agreement № ____¹ dated DD.MM.YYYY. / under agreement № ____² dated DD.MM.YYYY., FIRM: ____³. Payer _____. VAT exempt.»

¹ - номер договора между КЦ и Участником клиринга;

² - номер договора между КЦ и Гарантом;

³ - 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 в виде Электронного документа по форме, указанной в Приложении № 3 к Регламенту клиринга, направляемого в адрес «MFBIM@REGISTER».
- 4.6. Перевод денежных средств между ТКС/разделами клиринговых регистров Участника клиринга осуществляется на основании заявления в виде Электронного документа «Сообщение TRANSFER_SETTLE» по форме указанной в Приложении № 3 к Регламенту клиринга, направляемого в адрес «MFBIM@REGISTER».

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, используемые при взаимодействии КЦ и Участников 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.

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 отчеты / уведомления / выписки:

- 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 по Договорам (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга);
- MFB76 Отчет о взносах в Гарантийный фонд;
- MFB82 Уведомление о зарегистрированных кодах/кратких кодах клиентов Участника клиринга и (или) 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, выписок и уведомлений установлены в Приложении № 5 к Регламенту клиринга.

6.7. Указанные в настоящей статье отчеты, выписки и уведомления направляются КЦ Участникам клиринга с использованием адреса «MFBIM@REPORT».

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.