

Приложение № 1

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

Временной регламент КЦ

1. Временной регламент проведения клиринга

Далее по тексту используются следующие понятия и термины:

To – время начала основной торговой сессии;

Tc – время окончания основной торговой сессии;

Tr – время окончания периода заключения Договоров в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп, установленное Организатором торговли.

| НАИМЕНОВАНИЕ ОПЕРАЦИИ | ВРЕМЯ (МСК) |
|---|---|
| 1. Операции со средствами клирингового обеспечения | |
| Прием поручений Участников клиринга на зачисление ценных бумаг на Субсчета депо, открытые в Расчетном депозитарии | В течение Расчетного дня ¹ |
| Прием поручений Участников клиринга на списание ценных бумаг с Субсчетов депо, открытых в Расчетном депозитарии | с To до 16:00 |
| Прием поручений от Участников клиринга на перевод ценных бумаг между Субсчетами депо, открытыми в Расчетном депозитарии | с To до 16:00 |
| Зачисление денежных средств на ТКС Участника клиринга при получении от Расчетной организации информации о зачислении средств на Клиринговый денежный счет | В течение Расчетного дня |
| Прием поручений Участников клиринга на вывод денежных средств, являющихся Средствами обеспечения* | с To до 16:00 |
| Прием поручений Участников клиринга на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения | с To до 16:00 |
| Прием уведомлений о переводе долга, уступке требований и передаче имущества, от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга | с To до 16:00 |
| Прием поручений Участников клиринга на регистрацию счетов для вывода денежных средств и ценных бумаг | с To до 18:00 |
| Проведение действий по переводу долга/уступке требований и передачи имущества от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга | с (Tc+1) до To следующего Расчетного дня |
| 2. Операции, связанные с управлением рисками | |
| Процедура контроля обеспечения | с To до Tc |
| Проведение клиринговой сессии: установление риск-параметров, расчет Гарантийного обеспечения, расчет значений Доступных средств, предъявление Маржинальных требований | с Tc до (Tc+1) |
| Срок исполнения Маржинального требования | до 17:00 Расчетного дня, следующего за днем возникновения Маржинального требования |
| Проведение процедуры принудительного закрытия позиций | С момента окончания срока, отведенного под исполнение Маржинального требования, и до момента прекращения данного требования |

¹ Расчетный день продолжается в течение временного интервала, начиная с 19 ч. 00 мин. предыдущего Торгового дня до 19 ч. 00 мин. текущего Торгового дня

| | |
|---|--|
| 3. Операции, связанные с проведением клиринга и расчетов по итогам клиринга | |
| 3.1. Формирование клирингового пула по обязательствам, возникшим из Договоров, Внебиржевых договоров ОТС, Внебиржевых договоров репо ОТС и Пар договоров, и формирование расчетного клирингового пула | |
| Предоставление Участниками клиринга ценных бумаг/денежных средств, необходимых для исполнения обязательств, возникших из Договоров с наступившими Датами исполнения, Конверсионных договоров, Внебиржевых договоров ОТС с наступившими датами исполнения | До 16:00 |
| Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по обязательствам, возникшим из Договоров с наступившими Датами исполнения, Конверсионных договоров, Внебиржевых договоров ОТС с наступившими датами исполнения | с 16:00 до 22:00 |
| Направление Участникам клиринга уведомлений о проведения действий по определению итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований в соответствии с пунктом 22.12 Правил клиринга | с 16:00 до 17:00 |
| Проведение расчетов по итоговым нетто-обязательствам и нетто-требованиям, определенным по обязательствам, возникшим из Договоров с наступившими Датами исполнения, Конверсионных договоров, Внебиржевых договоров ОТС с наступившими датами исполнения. Подача Поручений на клиринг внебиржевых договоров по Конверсионным договорам | с 16:00 до 22:00 |
| 3.2. Формирование клирингового пула по внутриброкерским Договорам | |
| Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по Внутриброкерским Договорам с наступившими Датами исполнения | с 18:30 до 20:00 с 20:00 до 00:00 |
| 3.3. Формирование клирингового пула по Договорам размещения и выкупа | |
| Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по Договорам, в которых указан Код расчетов X0 и Код расчетов W0, с наступившими Датами исполнения | с Тр до 18:00 |
| Проведение расчетов по итоговым нетто-обязательствам и нетто-требованиям по Договорам, в которых указан Код расчетов X0 и Код расчетов W0, с наступившими Датами исполнения | с (Тр+2) до 10:00 следующего Расчетного дня |
| 3.4. Формирование клирингового пула по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента | |
| Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по Договорам, в которых указан Код расчетов Оп и Код расчетов OkOp, с наступившими Датами исполнения, а также по Внебиржевым договорам с наступившими датами исполнения | с 18:30 до Тс |
| Срок, предназначенный для урегулирования неисполнения итоговых нетто-обязательств Участниками клиринга контрагентами по Внебиржевым договорам | В течение 10 Расчетных дней с даты получения КЦ уведомления о неисполнении |
| 3.5. Формирование клирингового пула по Договорам с полным обеспечением с ЦК и клирингового пула по Договорам с полным обеспечением без ЦК | |
| Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по Договорам, в которых указан Код расчетов Y0, и Договорам, в которых указан Код расчетов U0, с наступившими Датами исполнения | с 16:00 до 22:00 |
| Проведение расчетов по итоговым нетто-обязательствам и нетто-требованиям по Договорам, в которых указан Код расчетов Y0, и Договорам, в которых указан Код расчетов U0, с наступившими Датами Исполнения | с 16:00 до 22:00 |
| 3.6. Формирование клирингового пула для расчетов по итогам торгов | |

| | |
|---|---|
| Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по денежным средствам | с 19:00 до 23:00 |
| 4. Направление клиринговых отчетов и уведомлений Участникам клиринга | |
| Направление клиринговых отчетов и уведомлений Участникам клиринга | до 00:00 |
| Направление Участникам клиринга отчетов об итоговых нетто-обязательствах/нетто-требованиях, возникших по итогам формирования расчетного клирингового пула | с 16:00 до 16:30; |
| Направление Участникам клиринга уведомлений о проведения действий по определению итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований в соответствии с пунктом 22.12 Правил клиринга | с 16:00 до 17:00 |
| Направление Участниками клиринга-контрагентами по Внебиржевым договорам Отчетов об исполнении /Уведомлений о неисполнении в КЦ | В течение 10 Расчетных дней с даты исполнения / отказа в исполнении итоговых нетто-обязательств |

* При подаче в КЦ поручений на вывод денежных средств, являющихся Средствами обеспечения, на сумму, превышающую 700 000 (Семьсот тысяч) долларов США и (или) 2 000 000 (Два миллиона) рублей в течение одного Расчетного дня, Участнику клиринга необходимо во временной интервал с То до 16 ч.00 мин. Расчетного дня, предшествующего такому выводу, направить в КЦ уведомление о планируемом выводе денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, в свободной форме под вывод следующего Расчетного дня, содержащее информацию о сумме выводимых средств. Все уведомления, поступившие в КЦ после 16 ч.00 мин. предыдущего Расчетного дня принимаются в обработку в течение следующего Расчетного дня.

Поручения и иные необходимые по операциям документы представленные в КЦ после времени, указанного в настоящем Временном регламенте, могут быть приняты КЦ в обработку и переданы вышестоящим организациям на исполнение в течение следующего Расчетного дня. При этом сроки исполнения операций вышестоящими организациями определяются внутренними документами вышестоящих организаций.

Все иные операции по передаче/получению документов, предусмотренных Правилами клиринга, но не упомянутых в таблице, приведенной выше, передаются в КЦ и/или предоставляются со стороны КЦ в рабочие дни с То до (Тс-1 час) по московскому времени.

Поручения/отчеты, полученные от Участников клиринга/Расчетного депозитария/Расчетной организации в установленные выше сроки, обрабатываются КЦ в течение текущего Расчетного дня, если иное не установлено внутренними документами КЦ.

2. Временной регламент заключения Внебиржевых договоров ОТС

Участник клиринга вправе направлять Оферты ОТС в течение базового или расширенного периода времени в зависимости от выбранного Участником клиринга тарифного плана.

Базовый и расширенный периоды времени, в течение которых Участником клиринга могут направляться Оферты ОТС, определяются КЦ и публикуются на Сайте КЦ.