Приложение 1
к Регламенту осуществления клиринговой деятельности
на рынке финансовых инструментов
НКО-ЦК «СПБ Клиринг» (АО)

Временной регламент КЦ

1. Временной регламент проведения клиринга

Далее по тексту используются следующие понятия и термины:

Расчетный день - Расчетный день продолжается в течение временного интервала, начиная с 19 ч. 00 мин. предыдущего Торгового дня до 19 ч. 00 мин. текущего Торгового дня (московское время)

Тм – время начала дополнительной утренней торговой сессии;

То – время начала основной торговой сессии;

Тс – время окончания основной торговой сессии;

Тд – время окончания торгового дня;

Тр – 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	Московское время
1. Операции со Средствами обеспечения	
Прием поручений Участников клиринга на зачисление ценных бумаг на Субсчета депо, открытые в Расчетном депозитарии *	до 17:45 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья) [1]
Прием поручений Участников клиринга на списание ценных бумаг с Субсчетов депо, открытых в Расчетном депозитарии *	с То до 16:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья) [1]
Прием поручений от Участников клиринга на перевод ценных бумаг между Субсчетами депо, открытыми в Расчетном депозитарии *	с То до 16:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья) [1]
Зачисление денежных средств на ТКС Участника клиринга при получении от Расчетной организации информации о зачислении средств на Клиринговый денежный счет в НКО АО НРД	с То до 19:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Зачисление денежных средств на ТКС Участника клиринга при получении от Расчетной организации информации о зачислении средств на Клиринговый денежный счет в ПАО «СПБ Банк»	В течение Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Прием заявлений Участников клиринга на вывод денежных средств, являющихся Средствами обеспечения	с То до 18:45 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья) [2]
Прием заявлений Участников клиринга на отмену ранее поданного заявления на возврат денежных средств индивидуального клирингового обеспечения или коллективного клирингового обеспечения	с То до 18:45 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья) [2]
Прием заявлений Участников клиринга на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения	с То до 16:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья) [1]
Прием заявлений на перевод денежных средств между ТКС Участника клиринга	с То до 18:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья) [2]
Прием уведомлений о переводе долга, уступке требований и передаче имущества, от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга	с То до 16:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья) [1]
Проведение действий по переводу долга/уступке требований и передачи имущества от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга	с (Тс+1) до То следующего Расчетного дня [1]
2. Иные операции, связанные с оказанием клиринговых услуг	
2.1. Прием следующих документов, формы которых установлены Приложением 3 к Регламенту клиринга : • Заявление на изменение порядка удержания сборов за заключение Договоров/ Внебиржевых договоров ОТС • Согласие клиента Участника клиринга, за счет которого исполняются обязательства и (или) обеспечивается исполнение обязательств, на перевод долга, уступку требований и передачу имущества другому Участнику	**Понедельник – пятница:** с То до 19:00 Расчетного дня [1] **Суббота и воскресенье, которые входят в Расчетный день, который продолжается с 19:00 Торгового дня пятницы до 19:00 Торгового дня понедельника:**

клиринга • Согласие Участника клиринга, которому переводится долг, уступаются требования, и передается имущество от другого Участника клиринга • Заявление на регистрацию счета депо для вывода ценных бумаг иностранных эмитентов • Заявление на регистрацию счета депо для вывода ценных бумаг российских эмитентов • Уведомление о коде идентификации юридического лица (LEI) • Заявление о выборе тарифного плана, применяемого за оказание клиринговых услуг и иных связанных с ними услуг при осуществлении НКО-ЦК «СПБ Клиринг» (АО) клиринговой деятельности на рынке финансовых инструментов • Заявление на изменение порядка удержания сборов при проведении клиринга • Согласие на заключение Договоров • Заявление о намерении не пользоваться услугами НКО-ЦК «СПБ Клиринг» (АО), связанными с осуществлением клиринга обязательств, возникших из Договоров, предметами которых являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов «иностранные ценные бумаги» и (или) Внебиржевых договоров ОТС, за исключением Внебиржевых договоров ОТС, предметами которых являются ценные бумаги российских эмитентов и иностранные финансовые инструменты, квалифицированные в качестве облигаций • Заявление об установлении ограничений на заключение Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС по поручению клиентов Участника клиринга • Заявление на приостановление / активацию ТКС • Заявление на перевод заблокированных денежных средств между ТКС Участника клиринга	С Tm до 19-00 календарного дня субботы или воскресения [1]
2.2. Прием следующих документов, формы которых установлены Приложением 3 к Регламенту клиринга, которые обрабатываются автоматически: • Заявление на регистрацию ТКС • Заявление на изменение параметров ТКС • Заявление на удаление ТКС • Заявление на регистрацию счета для вывода денежных средств (в рублях Российской Федерации) • Заявление на регистрацию счета для вывода денежных средств (в иностранной валюте) • Заявление на регистрацию счета для вывода денежных средств к ТКС • Заявление на удаление счета для вывода денежных средств • Заявление о ТКС и объеме средств с целью осуществления действий, направленных на исполнение обязательств Участника клиринга • Заявление на установку лимита для операций урегулирования неисполненных обязательств	**Понедельник – пятница:** с To до 19:00 Расчетного дня **Суббота и воскресенье, которые входят в Расчетный день, который продолжается с 19:00 Торгового дня пятницы до 19:00 Торгового дня понедельника:** С Tm до 19-00 календарного дня субботы или воскресения
3. Операции, связанные с регистраций и идентификацией клиентов Участников клиринга (Субклиентов)	
Прием и обработка заявлений Участников клиринга о регистрации / редактировании клиентов и(или) Субклиентов:	**Понедельник – пятница:** С Тм до Тд Расчетного дня **Суббота и воскресенье, которые**

	входят в Расчетный день, который продолжается с 19:00 Торгового дня пятницы до 19:00 Торгового дня понедельника: С Тт до 00-00 календарного дня субботы или воскресения
Прием и обработка заявлений Участников клиринга о дерегистрации клиентов и(или) Субклиентов	С Тм до Тд Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Прием и обработка документов Участников клиринга, направленных в целях идентификации Участников клиринга, их клиентов и Субклиентов в соответствии с Приложением 9 к Регламенту клиринга	**Понедельник – пятница:** С Тм до Тд Расчетного дня **Суббота и воскресенье, которые входят в Расчетный день, который продолжается с 19:00 Торгового дня пятницы до 19:00 Торгового дня понедельника:** С Тт до 00-00 календарного дня субботы или воскресения
4. Операции, связанные с управлением рисками	
Процедура контроля обеспечения	с Тм до Тд Расчетного дня
Проведение Клиринговой сессии: установление риск-параметров, расчет Гарантийного обеспечения, Дополнительного обеспечения, расчет значений Доступных средств, предъявление Маржинальных требований	11:30 до 11:50 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Срок исполнения Маржинального требования	до 16:00 Расчетного дня, в котором возникло Маржинальное требование
Проведение процедуры принудительного закрытия позиций	С момента окончания срока, отведенного под исполнение Маржинального требования,и до момента прекращения данного требования
5. Операции, связанные с Договорами ПФИ	
Период Расчетного дня, в который устанавливается Время определения объема Вариационной маржи (будние дни и приравненные к ним календарные дни суббота и воскресенье) Период Расчетного дня, в который устанавливается Время определения объема Вариационной маржи (выходные и праздничные дни)	С 14:00 до 16:00 Расчетного дня С 14:00 до 16:00 следующего рабочего дня РФ
Возникновение Основного обязательства по уплате суммы денежных средств в результате исполнения расчетного Опциона	С 14:00 до 16:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Прием от Участников клиринга Обращений на конвертацию	С То до 12:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Исполнение поданных Участником клиринга Обращений на конвертацию	С 12:00 до Тс Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Прием от Участников клиринга Обращений на расчет	С То до 12:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Исполнение поданных Участником клиринга Обращений на расчет	С 12:00 до Тс Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Определение позиции по Опционам нулевого страйка, по которой возникает обязательство по уплате эквивалента Дохода (в случае, если в дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, проводятся Торги Опционом нулевого страйка)	19:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)

6. Операции, связанные с проведением клиринга и расчетов по итогам клиринга	
6.1. Формирование клирингового пула по обязательствам, возникшимиз 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, Внебиржевых договоров ОТС с наступившими датами исполнения	До 16:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по обязательствам, возникшим из Договоров с наступившими Датами исполнения, Внебиржевых договоров ОТС с наступившими датами исполнения	с 16:00 до 22:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Направление добросовестным Участникам клиринга уведомлений о проведении действий по урегулированию ненадлежащего исполнения обязательств в соответствии с п. 30.4.2 Правил клиринга.	с 16:00 до 20:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Проведение расчетов по итоговым нетто-обязательствам и нетто-требованиям, определенным по обязательствам, возникшим из Договоров с наступившими Датами исполнения, Внебиржевых договоров ОТС с наступившими датами исполнения.	с 16:00 до 22:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
6.2. 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 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья) с 20:00 до 00:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
6.3. 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 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
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 (кроме субботы и воскресенья)
6.4. Формирование клирингового пула по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента	
Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по Договорам, в которых указан Код расчетов On и Код расчетов OkOn, с наступившими Датами исполнения, а также по Внебиржевым договорам с наступившими датами исполнения	с 18:30 до Тс Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Срок, предназначенный для урегулирования неисполнения итоговых нетто-обязательств Участниками клиринга контрагентами по Внебиржевым договорам	В течение 10 Расчетных дней (кроме субботы и воскресенья) с даты получения КЦ уведомления о неисполнении
6.5. 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 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)

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 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
6.6. Формирование клирингового пула для расчетов по итогам торгов	
Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по денежным средствам	с 19:00 до 23:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
6.7. Формирование ликвидационного клирингового пула по обязательствам с участием центрального контрагента	При возникновенииоснований, предусмотренных статьей 48 Правил клиринга
6.8. Формирование ликвидационного клирингового пула по обязательствам без участия центрального контрагента	При возникновенииоснований, предусмотренных статьей48 Правил клиринга
7. Направление клиринговых отчетов и уведомлений Участникам клиринга	
Содержат окончательную информацию за расчетный день.	
Направление основной рассылки клиринговых отчетов и уведомлений Участникам клиринга	до 00:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Направление Участникам клиринга уведомлений о проведении действий по определению итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований в соответствии с пунктом 29.12 Правил клиринга	с 16:00 до 00:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Направление Участникам клиринга клиринговых отчетов о Гарантийном обеспечении, Маржинальном требовании и Задолженности (MFB14) по итогам проведенной Клиринговой сессии	с 13:00 до 14:15 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
Направление Участникам клиринга Уведомлений о присвоении Регистрационных кодов / регистрации Кратких кодов клиентов Участника клиринга и (или) Участника клиринга (MFB82)	до 00:00 (кроме субботы и воскресенья)
Направление Участниками клиринга-контрагентами по Внебиржевым договорам Отчетов об исполнении /Уведомлений о неисполнении в КЦ	В течение 10 Расчетных дней (кроме субботы и воскресенья) с даты исполнения / отказа в исполнении итоговых нетто-Обязательств
MFB98A- Уведомление о размере обязательств/требований по передаче Дохода.	с 06:00 до 07:00 Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья)
MFB17F Начисленная комиссия за учет позиций по фьючерсным контрактам MFB18D Отчет о позиции по Фьючерсным контрактам	после 01:00 по итогам Тд (кроме дней, в которые не проводились торги)

[1] - Документы, направленные в субботу или воскресенье, будут приняты в обработку в понедельник
[2] - При направлении в субботу или воскресенье будет направлен отказ в ответном сообщении

* Для **списания ценных бумаг** с Субсчета депо, открытого в Расчетном депозитарии и перевода ценных бумаг между Субсчетами депо, открытыми в Расчетном депозитарии (операция с типом «списание») (в случае если выводимые ценные бумаги должны быть использованы для исполнения обязательств Участника клиринга по итогам клиринга), Участнику клиринга необходимо во временной интервал с То до 18 ч. 00 мин.(московское время) Расчетного дня (кроме субботы и воскресенья), предшествующего планируемой дате вывода, направить в КЦ в свободной форме уведомление о планируемом выводе ценных бумаг, учитываемых в качестве Средств обеспечения, под вывод следующего Расчетного дня, содержащее информацию о количестве выводимых ценных бумаг. Все уведомления, поступившие в КЦ после 18 ч. 00 мин. (московское время) предыдущего Расчетного дня, принимаются в обработку в течение следующего Расчетного дня.

Обработка поручений на зачисление, списание и перевод ценных бумаг осуществляется КЦ в срок, не превышающий 3 (трех) рабочих дней. В связи с недружественными действиями иностранных государств и международных организаций и последовавшими за этими действиями ограничительными мерами в отношении участников клиринга, повлекшими за собой повышение операционной нагрузки на КЦ при осуществлении клиринговой деятельности, срок выполнения операций может быть увеличен.

Обработка вывода денежных средств осуществляется КЦ в срок до 5 (пяти) рабочих дней с даты получения указанного выше уведомления (обработка уведомлений, полученных после 16 ч. 00 мин. (московское время) Расчетного дня, начинается со следующего рабочего дня). В связи с недружественными действиями иностранных государств и международных организаций и последовавшими за этими действиями ограничительными мерами в отношении участников клиринга, повлекшими за собой повышение операционной нагрузки на КЦ при осуществлении клиринговой деятельности, срок выполнения операций может быть увеличен.

Срок обработки заявлений Участников клиринга на **замену валюты денежных средств, учитываемых**

в качестве Средств обеспечения, составляет до 5 (пяти) рабочих дней.

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 (кроме субботы и воскресенья). 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).