ЗАРЕЄСТРОВАНО

Рішенням Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку

№ 521 від «15» липня 2021р.

Голова Комісії

Р.С. Магомедов

ЗАТВЕРДЖЕНО

Рішенням Біржового комітету

ТОВ «Українська енергетична біржа»

Протокол засідання Біржового комітету

№ 996 від «13» липня 2021р.

Голова Біржового комітету

О.Є. Дубовський

ПРАВИЛА провадження клірингової діяльності

Товариства з обмеженою відповідальністю «Українська енергетична біржа»

Київ - 2021

ЗМІСТ

1.	Загальні положення	3
2.	Вимоги до учасників клірингу	5
3.	Порядок, умови допуску зобов’язань до клірингу	7
4.	Права і обов’язки Біржі та учасників клірингу	9
5.	Порядок ведення клірингових рахунків	12
6.	Порядок обліку та припинення прав і зобов’язань за товарними операціями у системі клірингового обліку	13
7.	Порядок надання Біржею учасникам клірингу звітів за результатами клірингу	14
8.	Порядок підготовки, складення та направлення Біржею документів для проведення розрахунків	15
9.	Порядок забезпечення проведення грошових розрахунків за результатами клірингу за товарними операціями	16
10.	Опис системи клірингового обліку	18
11.	Опис системи управління ризиками та гарантій Біржі	20
12.	Опис системи захисту інформації	22
13.	Випадки застосування процедури ліквідаційного неттінгу	25
14.	Заключні положення	27

1. Загальні положення

1.1. Правила провадження клірингової діяльності Товариства з обмеженою відповідальністю «Українська енергетична біржа» (далі – Правила клірингу) розроблені та затверджені відповідно до Господарського кодексу України, Закону України «Про товарні біржі», Закону України «Про ринки капіталу та організовані товарні ринки» (далі – Закон), Закону України «Про державне регулювання ринків капіталу та організованих товарних ринків», нормативно-правових актів Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку (далі – НКЦПФР), якими регулюється провадження професійної діяльності на ринках капіталу – клірингової діяльності, Статуту Товариства з обмеженою відповідальністю «Українська енергетична біржа» (далі – Статут Біржі) та є основним документом, який регламентує порядок надання учасникам клірингу клірингових послуг Товариством з обмеженою відповідальністю «Українська енергетична біржа» (далі – Біржа), а також забезпечення проведення розрахунків за біржовими договорами, укладеними на Біржі.

1.2. Правила клірингу обов'язкові до виконання Біржею та всіма учасниками клірингу, яким Біржа надає клірингові послуги в порядку, передбаченому цими Правилами клірингу, іншими внутрішніми документами Біржі та чинним законодавством України.

1.3. Правила клірингу, а також зміни та доповнення до них затверджуються Рішенням Біржового комітету Біржі та реєструються НКЦПФР в установленому законодавством України порядку.

Біржа доводить до відома осіб, визначених у п. 1.2. цього розділу, Правила клірингу, зміни та доповнення до них, іншу інформацію про свою діяльність, в тому числі про прийняті рішення щодо учасників клірингу, шляхом розміщення таких документів, інформації на офіційному сайті Біржі в мережі Інтернет за адресою: www.ueex.com.ua. Біржа додатково може використовувати інші способи інформування учасників клірингу та інших зацікавлених осіб відповідно до цих Правил клірингу та укладених договорів.

1.4. У разі внесення змін до законодавства України, до приведення цих Правил клірингу у відповідність до законодавства України, ці Правила клірингу застосовуються у частині, що не суперечить законодавству України.

1.5. Біржа здійснює клірингову діяльність з визначення зобов’язань на підставі ліцензії, виданої НКЦПФР. Біржа може здійснювати клірингову діяльність центрального контрагента у порядку та за умов, що визначені чинним законодавством.

1.6. У цих Правилах клірингу наведені нижче терміни вживаються у такому значенні:

внутрішні документи Біржі – акти внутрішнього регулювання Біржі, які є офіційними документами Біржі, що відповідно до цих Правил клірингу, законодавства про товарні біржі та організовані товарні ринки регламентують провадження клірингової діяльності, умови та механізми забезпечення здійснення розрахунків (поставки біржового товару) та інші питання при організації біржових торгів, у том числі у певних секціях Біржі чи за певним біржовим товаром (групою біржових товарів), а також регулюють відносини в межах структури Біржі та між Біржею і учасниками клірингу (їх клієнтами), учасниками торгів (їх клієнтами), уповноваженими Біржею розрахунковими банками, операторами поставки та іншими особами, визначеними внутрішніми документами Біржі;

гарантійний внесок – грошові кошти, що вносяться учасником біржових торгів на поточний рахунок Біржі та обліковуються в системі клірингового обліку на аналітичному рахунку під гарантійні внески такого учасника біржових торгів відповідно до цих Правил клірингу, інших внутрішніх документів Біржі або інші активи, що визнані Біржею, призначені для забезпечення належного виконання зобов'язань учасників торгів;

зареєстровані особи – учасники клірингу та клієнти учасників клірингу;

клірингова сесія – операційні години роботи Біржі для проведення клірингу та виконання процедур у цілях забезпечення здійснення розрахунків і поставки за укладеними біржовими договорами, у тому числі, шляхом обміну інформацією та документами з третіми особами (зокрема, уповноваженими Біржею розрахунковими банками, учасниками клірингу, операторами поставки);

контрагент – це особа, яка є стороною біржового договору, вчиненого з учасником клірингу;

оператор поставки – юридична особа, яка відповідно до закону здійснює зберігання та/або забезпечує транспортування (передачу) активу, що є біржовим товаром, та/або погоджує передачу/набуття/відчуження/здійснює облік передачі такого активу (в тому числі, оператор газотранспортної системи, оператор газосховищ, оператор системи передачі та інші);

рахунок умовного зберігання (ескроу) – рахунок, відкритий учасником біржових торгів у розрахунковому банку на підставі договору умовного зберігання (ескроу), укладеного відповідно до типової форми, визначеної Регламентом провадження клірингової діяльності Біржі або іншими внутрішніми документами Біржі, якими регламентується біржова торгівля у відповідній секції Біржі, з метою запобігання ризику нездійснення розрахунків за біржовими договорами;

реєстр біржових договорів - інформація, що надається Біржею розрахунковому банку учасника клірингу (учасника торгів), визначеному відповідно до цих Правил клірингу, в електронному вигляді у порядку та за формою, що визначені договором умовного зберігання (ескроу);

розрахунковий банк – обслуговуючий банк Біржі/учасника клірингу, у якому відкрито рахунок Біржі/учаснику клірингу як учаснику безготівкових розрахунків та/або який здійснює для такого учасника на договірних умовах будь-яку з операцій чи послуг, передбачених Законом України «Про банки і банківську діяльність»;

система клірингового обліку – внутрішня система обліку Біржі, яка використовується Біржею для відкриття та обслуговування клірингових рахунків, для обліку прав та зобов'язань учасників клірингу та їх клієнтів за товарними операціями, обліку інформації про грошові кошти та інші активи, заблоковані для здійснення розрахунків та/або організації проведення розрахунків за контрактами та правочинами, а також облік, внесків учасників клірингу та гарантійного забезпечення;

фінансове забезпечення під розрахунки – грошові кошти, що попередньо перераховуються учасником біржових торгів на рахунок умовного зберігання (ескроу) такого учасника клірингу (учасника торгів) та обліковуються на відповідних розділах клірингового рахунку в системі клірингового обліку, які призначені для належного виконання учасником клірингу

(учасником торгів) зобов'язань за біржовими договорами відповідно до цих Правил клірингу та інших внутрішніх документів Біржі.

1.7. Інші терміни, що вживаються в цих Правилах клірингу, використовуються відповідно до законодавства України.

2. Вимоги до учасників клірингу

2.1. Учасниками клірингу можуть бути юридичні особи, що набули статусу учасника торгів у певній секції Біржі та/або за певним біржовим товаром (групою біржових товарів), зобов'язання за операціями за якими допущені Біржею до клірингу.

2.2. Біржа надає учаснику клірингу клірингові послуги на підставі укладеного з ним договору про клірингове обслуговування за умови взяття його на облік у порядку, встановленому цими Правилами клірингу та Законом. Особа набуває статусу учасника клірингу з дати набрання чинності договором про клірингове обслуговування.

2.3. Учасник торгів, який має намір стати учасником клірингу, та учасник клірингу повинні відповідати наступним вимогам:

- відкрити в розрахунковому банку рахунок умовного зберігання (ескроу) для здійснення розрахунків у системі клірингового обліку;
- для обліку коштів, призначених для здійснення розрахунків за товарними операціями, використовувати рахунок умовного зберігання (ескроу);
- укласти договір про надання послуг з відповідним Оператором поставки;
- укласти з Біржею договір про клірингове обслуговування шляхом подання заяви про приєднання до цих Правил клірингу за формою, встановленою внутрішніми документами Біржі;
- укласти з Біржею договір доручення (договори доручення) за формою, визначеною внутрішніми документами Біржі, на представництво його інтересів перед Оператором поставки з метою надання Біржі необхідних повноважень для забезпечення виконання біржових договорів, укладених за результатами торгів;
- мати програмне та технічне забезпечення, канали зв'язку з Біржею, які відповідають вимогам внутрішніх документів Біржі.
- не мати визначених внутрішніми документами Біржі та/або чинним законодавством України заборон щодо встановлення з ними ділових відносин.

2.4. Особа, яка має намір стати учасником клірингу для набуття статусу учасника клірингу надає Біржі, окрім документів, наданих для набуття статусу учасника торгів, наступні документи, що підтверджують відповідність вимогам, встановленим пунктом 2.3 цих Правил клірингу:

2.4.1. анкету клірингового (-их) рахунку (-ів) за формою, встановленою внутрішніми документами Біржі;

2.4.2. інформацію про Оператора поставки (повне або скорочене найменування та код за ЄДРПОУ), що здійснює облік, зберігання та/або забезпечує поставку активів, які є предметом біржових договорів, які планує укладати особа, яка має намір стати учасником клірингу;

2.4.3. оригінал або належним чином завірену копію документа, що містить інформацію щодо реквізитів банку, в якому відкрито поточний рахунок, рахунок умовного зберігання (ескроу), та реквізити цих рахунків.

Якщо документи, визначені цим пунктом Правил клірингу, вже подавалися Біржі особою, яка має намір стати учасником клірингу, зокрема, для набуття статусу учасника торгів та отримання допуску до торгів, така особа має право не подавати такі документи повторно, за умови надання заяви, що такі документи подавалися раніше (з зазначенням дати подачі таких документів та ідентифікаційних даних супровідного документа), вони є актуальними та до них не вносилися зміни.

Біржа має право вимагати надання додаткових документів з метою перевірки відповідності особи, яка має намір стати учасником клірингу, цим вимогам.

2.5. Біржа має право встановити окремі процедури допуску учасників клірингу до окремих клірингових операцій, які визначаються внутрішніми документами Біржі.

2.6. Біржовий комітет Біржі може прийняти рішення про тимчасове припинення надання клірингових послуг учаснику клірингу/клієнту учасника клірингу до усунення підстав, що призвели до прийняття такого рішення, яке набуває чинності з наступного дня після його прийняття, якщо інше не зазначено у такому рішенні, за наступних підстав:

- припинення надання доступу до торгів у секціях Біржі та/або за всіма біржовими товарами (групою біржових товарів), які допущені до торгів;

- порушення цих Правил клірингу та/або внутрішніх документів біржі та/або чинного законодавства України, яким регулюється біржова торгівля та надання клірингових послуг, за настання яких внутрішніми документами Біржі передбачено припинення доступу до торгів та надання клірингових послуг на певний час.

2.7. Біржовий комітет Біржі може прийняти рішення про розірвання договору про надання клірингових послуг учаснику клірингу за наступних підстав:

- заява учасника клірингу про припинення статусу учасника клірингу (після виконання ним своїх зобов’язань перед Біржею та іншими учасниками клірингу за біржовими договорами);

- у випадку неусунення порушення щодо якого було прийняте рішення про тимчасове припинення надання клірингових послуг протягом одного календарного року з дати набрання чинності цим рішенням.

З моменту тимчасового припинення надання клірингових послуг учаснику клірингу/його клієнту або розірвання договору про надання клірингових послуг Біржа встановлює обмеження на здійснення операцій такою особою.

2.8. Відновлення надання клірингових послуг учаснику клірингу після тимчасового припинення відбувається за рішенням Біржового комітету Біржі за умови усунення підстав

для тимчасового припинення статусу учасника клірингу. Рішення Біржового комітету набирає чинності у день його прийняття, якщо інше не передбачено самим рішенням.

2.9. Біржа бере на клірингoвий облік клієнтів учасника клірингу на підставі заяви, документів та інформації, наданих учасником клірингу відповідно до вимог внутрішніх документів Біржі.

2.10. Біржа при взятті на клірингoвий облік осіб, що мають намір стати учасником клірингу та/або клієнтом учасника клірингу, присвоює цим особам унікальний ідентифікаційний код (далі – код) у порядку, встановленому її внутрішніми документами, та вносить інформацію про зареєстровану особу до реєстру учасників клірингу.

2.11. Реєстр учасників клірингу має містити наступну інформацію:

повне або скорочене (за наявності) найменування учасника клірингу;

код учасника клірингу;

коди клієнтів учасника клірингу та дати взяття таких клієнтів на облік;

місцезнаходження учасника клірингу;

прізвище, ім'я, по батькові та посаду фізичної особи, що відповідно до установчих документів має право діяти від імені учасника клірингу без довіреності;

контактну інформацію учасника клірингу;

дату взяття на облік учасника клірингу;

інформацію про виключення учасника клірингу з реєстру учасників клірингу.

3. Порядок, умови допуску зобов’язань до клірингу

3.1. Біржа здійснює клірингу тільки тих зобов’язань, які допущені для здійснення клірингу в порядку та на умовах, встановлених цими Правилами клірингу, Законом та нормативно-правовими актами НКЦПФР.

3.2. Біржові товари, за біржовими договорами щодо яких проводяться розрахунки, не повинні мати будь-яких обмежень, які можуть призвести до неможливості виконання розрахунків.

3.3. Для здійснення клірингу Біржею допускаються зобов’язання, які одночасно відповідають наступним вимогам:

3.3.1. виникли за біржовими договорами щодо біржових товарів, які укладені на Біржі, та забезпечення яких підтверджене:

- заблокованими правами на біржовий товар в системі Оператора поставки (за умови надання ним такої можливості) та фінансовим забезпеченням під розрахунки покупців біржового товару на рахунках умовного зберігання (ескроу);
- гарантійним внеском учасника клірингу.

3.3.2. виникли за біржовими договорами, які укладені за результатами торгів на Біржі, та датою розрахунків за якими є поточний операційний день;

3.3.3. оператор поставки підтвердив набуття/відчуження права власності на товар (можливість набуття/відчуження права власності на товар), що є предметом біржового договору.

3.4. Підставами для відмови у допуску до клірингу зобов'язань за біржовими договорами є:

3.4.1. невідповідність розпоряджень, документів та/або інформації, які були подані учасником клірингу як підстава для допуску зобов'язання до клірингу, внутрішнім документам Біржі;

3.4.2. наявність на момент допуску обмежень на здійснення операцій з біржовими товарами, що є предметом біржового договору, накладених судовим рішенням, яке набрало законної сили, рішенням НКЦПФР, розпорядженням або постановою уповноваженої особи НКЦПФР, прийнятим відповідно до встановлених законодавством України повноважень або з інших підстав, визначених законодавством України, інформація про які надана Біржі у встановленому законодавством України порядку;

3.4.3. недотримання вимог, визначених п. 3.3 цих Правил клірингу;

3.4.4. перевищення загального ліміту щодо розміру зобов'язань зареєстрованої особи, кліринг яких може здійснювати Біржа для такої зареєстрованої особи;

3.4.5. відмова Оператора поставки у набутті/відчуженні (можливості набуття/відчуженні) прав власності на товар, що є предметом біржового договору;

3.4.6. дефолт учасника клірингу за будь-якою операцією, кліринг зобов'язань за яким здійснювала Біржа;

3.4.7. інші обґрунтовані підстави, визначені договором про клірингове обслуговування з учасником клірингу.

Наслідки такої відмови визначаються договором про клірингове обслуговування та внутрішніми документами Біржі.

3.5. До здійснення клірингу допускаються зобов'язання, що відповідають наступним вимогам:

3.5.1. біржові договори, за якими виникли зобов'язання, вчинені в інтересах учасників клірингу та / або в інтересах клієнтів учасників клірингу і контрагентів учасника клірингу;

3.5.2. біржові товари, які є предметом зобов'язань, допущені Біржею до біржових торгів та не обмежені в обігу.

3.6. Зобов'язання, які не відповідають зазначеним вище умовам, не допускаються для здійснення клірингу.

3.7. Зобов'язання за біржовим договором вважаються допущеними до клірингу з моменту отримання Біржею підтвердження від Оператора поставки набуття/відчуження (можливості набуття/відчуження) прав власності на біржовий товар.

4. Права і обов’язки Біржі та учасників клірингу

4.1. Учасник клірингу має право:

4.1.1. своєчасно і в повному обсязі отримувати клірингові послуги Біржі в порядку, передбаченому цими Правилами клірингу, іншими внутрішніми документами Біржі та укладеними договорами;

4.1.2. в порядку та формі, передбаченій цими Правилами клірингу, внутрішніми документами Біржі та договорами, укладеними Біржею з учасником клірингу, надавати Біржі інформацію для взяття Біржею на облік учасника клірингу та клієнтів учасників клірингу;

4.1.3. отримувати звіти та / або документи про операції на клірингових рахунках від Біржі у випадках та порядку передбачених цими Правилами клірингу, іншими внутрішніми документами Біржі та укладеними договорами;

4.1.4. отримувати інформацію про перелік послуг, що надаються Біржею учасникам клірингу, порядок та умови їх надання, внутрішні документи Біржі, які регламентують порядок надання послуг, вартість послуг Біржі, іншу інформацію право на отримання якої передбачено законодавством України, внутрішніми документами Біржі та укладеними договорами;

4.1.5. інші права, передбачені законодавством України, цими Правилами клірингу, внутрішніми документами Біржі та договорами, укладеними учасником клірингу з Біржею.

4.2. Учасник клірингу зобов’язаний:

4.2.1. надавати Біржі документи та інформацію в обсязі та порядку, передбаченому законодавством України, цими Правилами клірингу, іншими внутрішніми документами Біржі та укладеними договорами;

4.2.2. відповідати вимогам Біржі до учасників клірингу, які визначені цими Правилами клірингу;

4.2.3. у порядку та у строки, визначені внутрішніми документами Біржі, інформувати Біржу про будь-які зміни у договірних відносинах між учасником клірингу та його клієнтом, на основі яких кліринг зобов’язань клієнта може здійснюватися Біржею, якщо такі зміни можуть вплинути на кліринг зобов’язань такого клієнта, клірингові рахунки такого клієнта учасника клірингу, будь-які дії щодо них та операції за ними, а також гарантійного забезпечення наданого щодо таких клірингових рахунків клієнта;

4.2.4. дотримуватися режиму конфіденційності інформації, яка стає доступною учаснику клірингу у зв’язку з його обслуговуванням Біржею;

4.2.5. своєчасно та в повному обсязі виконувати взяті на себе зобов’язання щодо виконання укладених біржових договорів, зобов’язання за якими допущені до клірингу;

4.2.6. своєчасно оплачувати отримані від Біржі послуги;

4.2.7. дотримуватися положень цих Правил клірингу та інших внутрішніх документів Біржі в частині надання Біржею клірингових послуг;

4.2.8. виконувати інші обов'язки, що виникають відповідно до законодавства України, цих Правил клірингу, інших внутрішніх документів Біржі та випливають з умов відповідних укладених договорів.

4.3. Біржа має право:

4.3.1. збирати, обробляти та зберігати інформацію для ідентифікації, моніторингу та управління ризиками, пов'язаними з клірингом прав та зобов'язань, в тому числі щодо клієнтів учасника клірингу;

4.3.2. отримувати інформацію про правила і процедури взаємодії, які застосовує учасник клірингу до своїх клієнтів для здійснення особою, яка провадить клірингову діяльність, клірингу зобов'язань таких клієнтів;

4.3.3. вимагати від учасників клірингу та їх клієнтів надання всіх необхідних даних (документів) для здійснення клірингу, які повинні розкривати зміст операцій, що мають бути відображені на клірингових рахунках та/або регістрах внутрішнього обліку.

4.3.4. розпоряджатися гарантійним забезпеченням відповідно до внутрішніх документів Біржі, що визначають систему управління ризиками та гарантій;

4.3.6. встановлювати додаткові фінансові, операційні та технічні вимоги, яким повинні відповідати учасники клірингу;

4.3.7. отримувати від учасників клірингу та інших осіб (зокрема, розрахункового банку, Оператора поставки) документи та / або інформацію, необхідні Біржі для здійснення клірингу та / або виконання Біржею вимог законодавства України в порядку та обсязі, передбаченому законодавством України, цими Правилами клірингу, внутрішніми документами Біржі та укладеними договорами;

4.3.8. здійснювати допуск зобов'язань до клірингу на підставі інформації про результати торгів відповідно до цих Правил клірингу та інших внутрішніх документів;

4.3.9. припиняти надання учасникам клірингу послуг у випадках, передбачених цими Правилами клірингу та внутрішніми документами Біржі;

4.3.10. інші права, передбачені законодавством України, Правилами клірингу, внутрішніми документами Біржі та договорами, укладеними Біржею з учасниками клірингу.

4.4. Біржа зобов'язана:

4.4.1. довести до відома/надати інформацію, що міститься у частині другій статті 12 Закону України "Про фінансові послуги та державне регулювання ринків фінансових послуг" (окрім підпункту «д» пункту 3 частини другої цієї статті) особі, яка має намір стати учасником клірингу;

4.4.2. надавати доступ особі, яка має намір стати учасником клірингу до актуальних проектів договорів та інших документів, укладення яких є необхідним для отримання статусу учасника клірингу шляхом розміщення таких проектів договорів та інших документів на сайті Біржі ;

4.4.3. проводити постійний моніторинг відповідності учасника клірингу вимогам до учасника клірингу, встановленим цими Правилами клірингу, іншими внутрішніми документами Біржі та укладеними договорами;

4.4.4. провести ідентифікацію, верифікацію та здійснити інші заходи щодо осіб, з якими встановлюються ділові відносини, а також осіб, що мають повноваження діяти від їх імені, у порядку, установленому законодавством України, у тому числі нормативно-правовими актами НКЦПФР, внутрішніми документами Біржі;

4.4.5. своєчасно і в повному обсязі надавати учасникам клірингу послуги, передбачені цими Правилами клірингу, іншими внутрішніми документами Біржі та укладеними договорами;

4.4.6. здійснювати відкриття та ведення клірингових рахунків учасників клірингу/клієнтів учасників клірингу відповідно до вимог законодавства України, внутрішніх документів Біржі та укладених договорів;

4.4.7. на підставі інформації, наданої учасником клірингу, взяти на облік клієнтів учасника клірингу;

4.4.8. здійснювати облік прав та зобов'язань учасників клірингу / клієнтів учасників клірингу за біржовими договорами, зобов'язання за якими допущені до клірингу, а також коштів, розміщених на рахунках умовного зберігання (ескроу) для забезпечення розрахунків, в порядку, визначеному цими Правилами клірингу та іншими внутрішніми документами Біржі;

4.4.9. надавати учасникам клірингу/клієнтам учасників клірингу послуги, передбачені цими Правилами клірингу на підставі інформації про результати торгів, інформації, отриманої від учасників клірингу, розрахункового банку, Оператора поставки;

4.4.10. при здійсненні клірингової діяльності забезпечувати збереження інформації, що є конфіденційною, не розголошувати і не використовувати її у своїх інтересах або інтересах третіх осіб;

4.4.11. розробити план забезпечення безперервності та дій у разі виникнення надзвичайних ситуацій, який передбачатиме заходи необхідні для збереження функцій Біржі, відновлення безперервності надання послуг та/або виконання зобов'язань ліцензіата у разі виникнення надзвичайних ситуацій;

4.4.12. забезпечити зберігання і доступ осіб, які згідно із законодавством мають на це право, до всіх документів та іншої інформації, передбаченої законодавством, протягом 5 (п'яти) років з дня їх (її) одержання або складання;

4.4.13. створити систему зниження ризиків невиконання або неналежного виконання зобов'язань, що виникають за біржовими договорами відповідно до вимог законодавства України;

4.4.14. виконувати інші обов'язки, що виникають відповідно до законодавства України, цих Правил клірингу, інших внутрішніх документів Біржі та випливають з умов відповідних укладених договорів.

5. Порядок ведення клірингових рахунків

5.1. Після взяття на облік учасника клірингу Біржа відкриває йому в системі клірингового обліку клірингові рахунки учасника клірингу та/або клієнтів учасника клірингу (за заявою учасника клірингу). Біржа може відкривати кілька клірингових рахунків одному учаснику клірингу для ведення обліку прав та зобов'язань клієнтів такого учасника клірингу.

5.2. Біржа відкриває окремі клірингові рахунки кожному учаснику клірингу. Кліринговий рахунок учасника клірингу є окремим рахунком від рахунків клієнтів такого учасника клірингу.

5.3. На клірингових рахунках учасників клірингу та їх клієнтів ведеться облік прав та зобов'язань учасників клірингу та їх клієнтів, а також інформації про гарантійне забезпечення учасників торгів (зокрема, гарантійні внески учасників торгів, фінансове забезпечення під розрахунки), а також про заблокований обсяг біржового товару в системі Оператора поставки (для секцій Біржі, в яких Оператор поставки надає таку можливість).

5.4. Обсяг коштів стовідсоткового фінансового забезпечення під розрахунки та гарантійних внесків учасника клірингу, зарезервований для виконання операцій на клірингових рахунках зареєстрованих осіб, відображається в системі клірингового обліку Біржі аналітичним обліком прав щодо таких коштів.

5.5. При відкритті клірингового рахунку учасникам клірингу та/або клієнтам учасників клірингу Біржа дотримується наступних принципів:

5.5.1. кожному клірингловому рахунку має відповідати тільки один рахунок умовного зберігання (ескроу), відкритий для обліку фінансового забезпечення під розрахунки;

5.5.2. кожному клірингловому рахунку має відповідати тільки один аналітичний рахунок в системі бухгалтерського обліку Біржі, призначений для обліку гарантійного забезпечення учасника клірингу;

5.5.3. кожному клірингловому рахунку має відповідати тільки один аналітичний рахунок у системі обліку Оператора поставки за відповідним видом біржового товару (якщо Оператор поставки надає можливість попереднього блокування біржового товару).

5.6. Обсяг заблокованих/зарезервованих активів в системі Оператора поставки таких активів відображається в системі клірингового обліку Біржі (для секцій Біржі, в яких Оператор поставки надає таку можливість) аналітичним обліком прав щодо цих активів на клірингових рахунках зареєстрованих осіб.

5.7. Інформацію щодо надходження фінансового забезпечення під розрахунки учасника клірингу та інформацію про залишки коштів Біржа отримує від розрахункового банку учасника торгів способом, визначеним в договорі умовного зберігання (ескроу), укладеному між банком, учасником клірингу та Біржею.

5.8. Стан розділу клірингового рахунку, призначеного для обліку фінансового забезпечення під розрахунки учасника клірингу, змінюється на підставі інформації зазначеної в п. 5.7. цих Правил клірингу;

5.9. Інформацію щодо надходження гарантійних внесків учасника клірингу Біржа отримує від розрахункового банку Біржі по мірі їх зарахування на поточний рахунок Біржі в

операційні години роботи банку та оновлює інформацію на аналітичних рахунках у кліринговій системі торгової платформи для обліку гарантійних внесків відповідно до розкладу, визначеного Біржею. Учасник торгів може здійснювати зарахування грошових коштів на поточний рахунок Біржі як до торгів (торгової сесії), так і під час торгів (торгової сесії).

Стан розділу клірингового рахунку, призначеного для обліку гарантійних внесків, змінюється на підставі даних аналітичного обліку грошових коштів, зарахованих на поточний рахунок Біржі у якості гарантійного внеску учасника клірингу.

5.10. Відображення операцій на клірингових рахунках здійснюється Біржею на підставі електронних документів, наданих Біржі розрахунковим банком Біржі, розрахунковим банком учасника клірингу та Оператором поставки, перелік та форми яких визначаються внутрішніми документами Біржі.

5.11. Опис структури та розділів клірингових рахунків, що відкриваються Біржею, встановлюється внутрішніми документами Біржі.

6. Порядок обліку та припинення прав і зобов'язань за товарними операціями у системі клірингового обліку

6.1. Облік прав та зобов'язань учасників клірингу / клієнтів учасників клірингу за правочинами, зобов'язання за якими допущені до клірингу, заблокованих коштів та біржових товарів здійснюється Біржею на відповідних клірингових рахунках, відкритих в системі клірингового обліку Біржі.

6.2. Біржа здійснює облік прав та зобов'язань учасників клірингу / клієнтів учасників клірингу за біржовими договорами на валовій основі та визначає обсяг позиції учасника клірингу та/або клієнта учасника клірингу в грошовому та товарному вираженні за кожним договором окремо.

6.3. Облік прав та зобов'язань учасників клірингу та їх клієнтів здійснюється відокремлено.

6.4. Облік та припинення прав і зобов'язань за товарними операціями здійснюється Біржею шляхом проведення Біржею наступних операцій за кліринговими рахунками:

6.4.1. зарахування/списання зобов'язань та/або прав зі сплати або отримання грошових коштів за біржовими договорами – здійснюється на підставі інформації від розрахункового банку про зарахування/списання на рахунки умовного зберігання (ескроу) учасників клірингу;

6.4.2. зарахування/списання зобов'язань та/або прав за гарантійними внесками – здійснюється на підставі відомості зарахування/списання коштів на аналітичні рахунки, яка формується системою обліку Біржі на підставі інформації про грошові кошти, зараховані учасником клірингу на розрахунковий рахунок Біржі у розрахунковому Банку;

6.4.3. зарахування/списання зобов'язань та/або прав з набуття/відчуження або отримання товарів за біржовими договорами – здійснюється на підставі інформації від Оператора поставки про блокування біржового товару (якщо Оператор поставки надає можливість

такого попереднього блокування) або інформації про здійснення (можливість здійснення) Оператором набуття/відчуження перереєстрації прав власності на біржовий товар;

6.4.4. блокування/відміна блокування зобов'язань та/або прав за біржовими договорами – здійснюється на підставі сформованого Біржею електронного розпорядження за кожним укладеним та розірваним біржовим договором.

6.4.5. інші операції, що передбачені внутрішніми документами Біржі.

6.5. Операції за кліринговими рахунками проводяться Біржею під час клірингових сесій послідовно за кожним з біржових договорів.

6.6. Припинення обліку прав та зобов'язань за біржовими договорами, здійснюється шляхом набуття/відчуження товару та завершення грошових розрахунків за кожним з біржових договорів, а у випадках припинення зобов'язань в результаті припинення біржового договору також шляхом стягненням штрафних санкцій відповідно до внутрішніх документів Біржі, або в інших випадках, визначених законодавством.

7. Порядок надання Біржою учасникам клірингу звітів та інших документів за результатами клірингу

7.1. Біржа надає учасникам клірингу на щоденній основі доступ до інформації про розмір доступного гарантійного забезпечення, договорів та рахунків, сформованих відповідно до укладених біржових угод, а також інших документів та інформації, надання яких передбачено цими Правилами клірингу та внутрішніми документами Біржі у системі клірингового обліку.

7.2. У системі клірингового обліку для учасників клірингу забезпечується формування та завантаження у відповідних форматах наступних документів:

- рахунок для оплати на поповнення рахунку умовного зберігання (ескроу) учасника клірингу;

- рахунок для оплати на поповнення аналітичного рахунку учасника клірингу, призначеного для обліку гарантійного внеску та утримання комісії Біржі;

- обліковий документ на виведення коштів;

- біржовий договір (контракт на поставку товару);

- акти виконаних робіт стосовно списання комісії Біржі;

- загальний звіт списання комісії Біржі.

7.3. Біржею учасникам клірингу засобами програмного продукту, що використовується Біржею для ведення клірингового обліку, надається доступ до інформації про стан клірингових рахунків, операції на клірингових рахунках в розрізі біржових договорів, зобов'язання за товарами та грошовими коштами в розрізі біржових договорів, суму внесеного гарантійного забезпечення, частину гарантійного забезпечення, заблокованого/зарезервованого під біржові торги, недостатність гарантійного забезпечення для забезпечення біржових торгів, кошти, повернуті на поточний рахунок учасника клірингу. Інформація надається станом на відповідну дату та поточний час.

За письмовим зверненням учасника клірингу Біржа має право надати на паперовому носії інформацію, зазначену у п. 7.3., а також іншу інформацію з системи клірингового обліку, що стосується такого учасника клірингу, його клієнта (клієнтів), та його (їх) операцій, якщо надання такої інформації передбачено чинним законодавством України та відповідним договором.

7.4. Внутрішніми документами Біржі можуть бути передбачені інші види документів/звітів учасникам клірингу та порядок їх надання Біржею.

8. Порядок підготовки, складення та направлення Біржою документів для проведення розрахунків

8.1. Документи, які використовуються при провадженні Біржею клірингової діяльності, у тому числі для проведення розрахунків за біржовими договорами, формуються в електронному вигляді засобами програмного продукту, що використовується Біржею для ведення клірингового обліку.

8.2. Процедури оформлення документів, які використовуються при проведенні товарних розрахунків за біржовими договорами, регламентуються укладеними договорами про взаємодію між Біржею та Оператором поставки (з урахуванням положень внутрішніх документів Біржі, якими регламентується біржова торгівля у відповідній секції Біржі).

Під час обміну інформацією з Оператором поставки Біржею передаються торгові сповіщення, узагальнені торгові сповіщення, інші документи (далі разом – повідомлення). Біржа отримує від Оператора поставки відповідну інформацію про учасників клірингу (клієнтів учасників клірингу), які уповноважують Біржу подавати повідомлення, а також результати обробки таких повідомлень.

8.3. Процедури оформлення документів, які використовуються при проведенні грошових розрахунків за біржовими договорами, регламентуються укладеним між Біржею, розрахунковим банком та учасником клірингу договором рахунка умовного зберігання (ескроу), форма якого встановлена внутрішніми документами Біржі та може бути змінена за погодженням з розрахунковим банком учасника клірингу (учасниками торгів), договором про надання послуг (або іншим договором), з урахуванням положень внутрішніх документів Біржі, якими регламентується біржова торгівля у відповідній секції Біржі, та чинним законодавством України.

Під час обміну інформацією з розрахунковим банком Біржа отримує інформацію про стан рахунків умовного зберігання (ескроу) учасників клірингу (клієнтів учасників клірингу), про надходження коштів на аналітичний рахунок Біржі, призначений для обліку гарантійного внеску та утримання комісії Біржі. Біржа передає розрахунковому банку інформацію про банківські перерахування по біржових договорах, виведення коштів учасника з рахунку умовного зберігання (ескроу), виведення коштів учасника з аналітичного рахунку, призначеного для обліку гарантійного внеску та утримання комісії Біржі.

8.4. Створення та зберігання документів, які використовуються при проведенні розрахунків, здійснюється за допомогою програмного продукту, що використовується Біржею для ведення клірингового обліку, у хронологічному порядку.

8.5. Процедура проведення грошових та товарних розрахунків здійснюється під час клірингової сесії та включає наступні етапи:

8.5.1. За результатами торгів засобами програмного продукту, що використовується

Біржею для ведення клірингового обліку, створюється біржовий договір, який сторони підписують шляхом накладання кваліфікованого електронного підпису.

8.5.2. Біржа засобами програмного продукту, що використовується Біржею для ведення клірингового обліку, автоматично формує повідомлення, які містять інформацію про обсяг товару, що є предметом кожного з біржових договорів, та передає їх до Оператора поставки. Зазначені повідомлення подаються Біржею на підставі договору доручення, укладеного між Біржею та учасником клірингу, або Біржею від свого імені та в інтересах учасників клірингу та їх клієнтів, якщо це передбачено чинним законодавством України та договором про взаємодію з Оператором поставки.

Для біржових договорів, укладених на короткостроковому ринку природного газу (ринок «на добу наперед») – торгові сповіщення (узагальнене торгове сповіщення), що сформовані на підставі укладених у торговий день договорів, подаються до оператора газотранспортної системи або оператора газосховищ на початку доби, що є наступною після торгового дня.

8.5.3. Якщо законодавством Оператору поставки надано право відмовити у підтвердженні набуття/відчуження (можливості набуття/відчуження) прав власності на товар за результатом обробки направлених повідомлень, то така відмова має здійснюватися виключно у випадках та на підставах, передбачених чинним законодавством. У разі відмови Оператором поставки у підтвердженні набуття/відчуження (можливості набуття/відчуження) прав власності на товар біржовий договір вважається припиненим, а права та зобов'язання за ним вважаються такими, що не були допущені до клірингу.

8.5.4. Підтвердження Оператором поставки зазначених повідомлень є підтвердженням виконання зобов'язань продавцем за біржовим договором і підставою для Біржі, як довіреної особи покупця, виконати зобов'язання учасника клірингу –покупця щодо оплати придбаного товару з його рахунку умовного зберігання (ескроу).

З моменту отримання Біржею підтвердження від Оператора поставки набуття/відчуження (можливості набуття/відчуження) прав власності на товар, зобов'язання за таким біржовим договором є допущеними до клірингу.

8.5.5. Біржа засобами програмного продукту, що використовується Біржею для ведення клірингового обліку, автоматично формує розпорядження на здійснення оплати за біржовим договором з рахунку умовного зберігання (ескроу) учасника клірингу – покупця на рахунок учасника клірингу – продавця. Направлення такого розпорядження відбувається на підставі, у порядку та за формою, передбаченою тристороннім договором рахунку умовного зберігання (ескроу), укладеним між Біржею, розрахунковим банком та учасником клірингу (його клієнтом).

8.5.6. Після отримання Біржею підтвердження від розрахункового банку учасника клірингу-покупця щодо перерахування грошових коштів учаснику клірингу – продавцю, зобов'язання учасників клірингу за укладеним біржовою договором вважаються виконаними.

9. Порядок забезпечення проведення грошових розрахунків за результатами клірингу за товарними операціями

9.1. Біржа забезпечує проведення грошових розрахунків між сторонами біржового договору шляхом застосування принципу повного попереднього резервування фінансового

забезпечення під розрахунки учасником клірингу – покупцем у сумі, необхідній для оплати за таким договором. Учасник клірингу має право укласти біржову угоду на суму, що не перевищує попередньо зарезервованого ним фінансового забезпечення під розрахунки.

9.2. Для цілей резервування фінансового забезпечення під розрахунки учасники клірингу використовують рахунки умовного зберігання (ескроу), відкриті в розрахунковому банку учасника клірингу. Біржа має право визначити декілька розрахункових банків учасників клірингу.

9.3. З метою забезпечення проведення грошових розрахунків за результатами клірингу за товарними операціями Біржа укладає наступні договори з учасниками клірингу:

9.3.1. тристоронній договір рахунку умовного зберігання (ескроу) між Біржею, учасником клірингу та розрахунковим банком, згідно якого грошові кошти можуть бути перераховані банком на рахунок бенефіціара на підставі отриманого від Біржі Реєстру біржових угод в порядку та за формою, передбаченою Договором, або повернені учаснику клірингу на підставі отриманого від Біржі Реєстру повернення коштів в порядку та за формою, передбаченою зазначеним Договором;

9.3.2. договір доручення, за яким учасник клірингу доручає Біржі представляти його інтереси перед розрахунковим банком з питань фінансового забезпечення та здійснювати всі дії, необхідні для забезпечення розрахунків в повному обсязі за біржовими договорами, а також представляти його інтереси перед учасниками клірингу – продавцями.

9.4. Біржа на підставі укладених договорів з учасником клірингу має наступні повноваження:

9.4.1. отримувати від розрахункового банку інформацію про залишки коштів на рахунку умовного зберігання (ескроу) учасника клірингу;

9.4.2. надавати до розрахункового банку розпорядження на здійснення оплати у формі реєстру біржових угод, на підставі яких повинна здійснюватися оплата за біржовими договорами;

9.4.3. погоджує закриття рахунку умовного зберігання (ескроу) учасника клірингу;

9.4.4. визначає бенефіціара(-ів) учасника клірингу за результатами проведених біржових торгів та ініціює списання коштів з його рахунку умовного зберігання (ескроу);

9.4.5. здійснює перевірку та підтвердження настання підстав для здійснення розрахунковим банком перерахування коштів з рахунку на користь бенефіціара(-ів) або повернення коштів учаснику клірингу.

9.4.6. надає до розрахункового банку реєстр повернення коштів згідно з вимогами договору рахунку умовного зберігання (ескроу) та іншу інформацію згідно з умовами такого договору;

9.4.7. вчинення будь-яких інших дій, необхідних для належного та повного виконання повноважень для забезпечення розрахунків за біржовими договорами в повному обсязі.

9.5. Учасник клірингу може здійснювати зарахування грошових коштів на свій рахунок умовного зберігання (ескроу) протягом операційного дня розрахункового банку. Грошові

кошти, які зараховані на рахунок умовного зберігання (ескроу), можуть бути використані для здійснення розрахунків за біржовими договорами такого учасника клірингу у сумі, необхідній для здійснення повної оплати за таким договором.

10. Опис системи клірингового обліку

10.1. Система клірингового обліку Біржі – це внутрішня система, яка використовується Біржею для ведення клірингових рахунків, обліку прав та зобов'язань учасників клірингу та їх клієнтів за біржовими договорами, обліку інформації про гарантійне забезпечення, та яка ведеться за допомогою програмного продукту, який забезпечує:

- ведення обліку прав та зобов'язань учасників клірингу, клієнтів учасників клірингу за укладеними біржовими договорами;

- ведення обліку інформації про грошові кошти, інші активи, що внесені для здійснення розрахунків або організації проведення розрахунків за біржовими договорами;

- здійснення розрахунків та/або організацію проведення розрахунків за біржовими договорами;

- ведення обліку іншої інформації, визначеної цими Правилами клірингу, внутрішніми документами Біржі та нормативно-правовими актами НКЦПФР.

10.2. Система клірингового обліку Біржі складається з:

- документів, у тому числі електронних документів, які є підставою для проведення клірингу прав та зобов'язань;
- клірингових рахунків;
- регістрів внутрішнього обліку;
- документів, звітів та іншої інформації, що надається учасникам клірингу.

10.3. Біржа здійснює внутрішній облік прав та зобов'язань учасників клірингу/клієнтів учасників клірингу за біржовими договорами, зобов'язання за якими допущені до клірингу, грошових коштів, інших активів, що внесені для здійснення розрахунків або організації проведення розрахунків на відповідних клірингових рахунках, відкритих в системі клірингового обліку.

10.4. Загальні вимоги до відкриття та ведення клірингових рахунків Біржею встановлені розділом 5 цих Правил клірингу. Опис структури та розділів клірингових рахунків, що відкриваються Біржею встановлюються внутрішніми документами Біржі.

10.5. Документи, на підставі яких Біржею здійснюється кліринг зобов'язань та розрахунки за біржовими договорами, а також формуються документи, визначені у розділі 7 та 8 цих Правил клірингу, надаються Біржі у формі електронного документа відповідно до вимог внутрішніх документів Біржі, відповідних договорів про взаємодію з Оператором поставки (з урахуванням положень внутрішніх документів Біржі, якими регламентується біржова торгівля у відповідній секції Біржі), з розрахунковим банком.

10.6. До електронних документів, що надаються Біржі і на підставі яких нею здійснюється кліринг зобов’язань та розрахунки за біржовими договорами, сформованих документів, визначених у розділі 7 та 8 цих Правил клірингу, належать:

10.6.1. електронні документи, що формуються та надаються Біржі учасниками клірингу як підстава для проведення операцій на клірингових рахунках відповідно до внутрішніх документів Біржі;

10.6.2. електронні документи, що формуються та надаються Біржі Операторами поставки відповідно до договорів про взаємодію (з урахуванням положень внутрішніх документів Біржі, якими регламентується біржова торгівля у відповідній секції Біржі);

10.6.3. електронні документи, що формуються та надаються Біржі розрахунковим банком відповідно до договору, укладеного з ним та учасником клірингу.

10.7. Усі документи, що надаються Біржі для здійснення клірингу зобов’язань та розрахунків за біржовими договорами повинні повністю розкривати зміст клірингових операцій, що мають бути відображені на клірингових рахунках та/або регістрах внутрішнього обліку. Якщо зазначені документи не містять всіх необхідних даних для здійснення клірингу зобов’язань, Біржа має право вимагати надання необхідної інформації.

10.8. Учасники клірингу засобами програмного продукту, що використовується Біржею для ведення клірингового обліку надають біржі документи, визначені внутрішніми документами Біржі. У випадках виникнення надзвичайних ситуацій з метою забезпечення безперервності надання послуг документи, що надаються Біржі для здійснення клірингу прав і зобов’язань та розрахунків за біржовими договорами та проведення клірингових операцій, можуть надаватися учасниками клірингу в інший спосіб та в іншій формі, що визначені внутрішніми документами Біржі та відповідним договором.

10.9. У випадках та з підстав визначених у п. 13 цих Правил клірингу, внутрішніми документами Біржі та відповідним договором Біржа здійснює кліринг прав та зобов’язань без подання учасником клірингу певних документів.

10.10. Документи, якими Біржа обмінюється з Операторами поставки та розрахунковим банком при здійсненні клірингу прав та зобов’язань, розрахунків за біржовими договорами, надаються у формі електронних документів. Реквізитний склад, формати та способи обміну такими електронними документами визначаються відповідними договорами.

10.11. До вихідних електронних документів Біржі відносяться:

10.11.1. електронні документи, що формуються та надаються Біржею Операторам поставки;

10.11.2. електронні документи, що формуються та надаються розрахунковому банку;

10.11.3. електронні документи, що формуються та надаються учасникам клірингу.

10.12. Регістри внутрішнього обліку, що використовуються Біржею при провадженні клірингової діяльності, призначені для хронологічного та систематичного відображення інформації про:

10.12.1. стан клірингових рахунків;

10.12.2. зміни, що виникли на клірингових рахунках;

10.12.3. документи, які є підставою для здійснення клірингу прав та зобов'язань та відображення результату клірингу на клірингових рахунках;

10.12.4. документи, що формуються Біржею при провадженні неї клірингової діяльності.

10.13. Регістри внутрішнього обліку забезпечують контроль залишків грошових коштів та біржових товарів на клірингових рахунках, перевірку правильності виконання клірингових операцій в розрізі аналітичних рахунків в системі клірингового обліку.

11. Опис системи управління ризиками та гарантій Біржі

11.1. Система управління ризиками та гарантій Біржі – це комплекс заходів, що здійснюються Біржею та спрямовані на зниження ризиків невиконання або несвоєчасного виконання допущених до клірингу зобов'язань.

11.2. Основними ризиками при провадженні Біржею клірингової діяльності є кредитний ризик та операційний ризик:

11.2.1. кредитний ризик – це ризик неплатоспроможності однієї або обох сторін біржового договору;

11.2.2. операційний ризик – імовірність виникнення збитків або додаткових втрат або недоотримання запланованих доходів унаслідок недоліків або помилок в організації внутрішніх процесів, навмисних або ненавмисних дій працівників Біржі або інших осіб, збоїв у роботі інформаційних систем або внаслідок впливу зовнішніх факторів.

11.3. Для зниження кредитних ризиків невиконання або неналежного виконання зобов'язань, що виникають за біржовими договорами Біржа застосовує наступні механізми (гарантійне забезпечення):

11.3.1. повне попереднє резервування фінансового забезпечення під розрахунки учасником клірингу – покупцем у сумі, необхідній для оплати за біржовим договором. Біржа встановлює ліміт максимальної суми заявки на укладення біржової угоди для кожного учасника клірингу на рівні вільної від зобов'язань суми попередньо внесеного ним фінансового забезпечення під розрахунки;

11.3.2. застосування до обох учасників клірингу, що є покупцем та продавцем за біржовим договором, гарантійного внеску, розмір якого визначається на засіданні відповідної Ради Секції, що здійснює діяльність на підставі Положення про Ради Секцій при товарній біржі – Товариство з обмеженою відповідальністю «Українська енергетична біржа» та затверджується рішенням Біржового комітету Біржі, та який призначений для забезпечення належного виконання зобов'язань такими учасниками клірингу та може бути утриманий з винної сторони у випадку порушення нею вимог внутрішніх документів біржі для виплати компенсації іншій стороні.

11.4. Порядок та термін/строк внесення, поповнення учасниками торгів гарантійних внесків (як і повернення Біржею вільного від зобов'язань залишку учасникам торгів) визначаються внутрішніми документами Біржі, якими регламентується біржова торгівля у конкретних секціях Біржі.

11.5. Гарантійний внесок обліковується на відповідному розділі клірингового рахунку, якому відповідає один аналітичний рахунок (загальний або окремий) учасника клірингу у внутрішній системі бухгалтерського обліку Біржі.

11.6. Учасники клірингу самостійно визначають суму грошових коштів, необхідну для забезпечення виконання біржових договорів, виходячи з умов торгів та встановлених Біржею вимог щодо розміру гарантійного внеску та фінансового забезпечення під розрахунки, а також власних планів щодо товарних операцій, які учасники торгів мають наміри здійснити.

11.7. Порядок та умови повернення Біржею вільного від зобов’язань залишку гарантійного забезпечення учасникам торгів визначаються внутрішніми документами Біржі, якими регламентується біржова торгівля у відповідних секціях Біржі.

11.8. Учасники клірингу, якщо це передбачено внутрішніми документами Біржі, можуть використовувати інші види забезпечення, окрім грошових коштів (банківська гарантія, гарантійний лист тощо). Використання інших видів забезпечення регламентується окремим рішення уповноваженого органу Біржі.

11.9. Використовувана Біржею модель управління кредитним ризиком при провадженні клірингової діяльності не передбачає створення гарантійного фонду та інших форм колективного гарантійного забезпечення.

11.10. З метою зниження кредитного ризику та запобігання невиконанню біржового договору, а також у цілях забезпечення здійснення учасниками торгів грошових розрахунків та поставки товару в повному обсязі, Біржа набуває статусу довіреної особи кожного з учасників клірингу на підставі укладених з Біржею договорів доручення на основі примірних відповідних договорів доручення, що розміщуються на офіційному веб-сайті Біржі www.ueex.com.ua, з оформлення відповідних довіреностей представникам Біржі в двох оригінальних примірниках.

11.11. Для зниження операційних ризиків при провадженні клірингової діяльності Біржа вживає наступні заходи:

- виявлення подій, обставин, факторів, що є (чи можуть стати) причинами правового, операційно-технологічного ризику, ризику персоналу та розрахунок ймовірності їх виникнення;
- розробка системи індикаторів виникнення операційних ризиків та встановлення лімітів щодо їх критичного значення та здійснення їх моніторингу, проведення самооцінки;
- використання надійних технічних, програмних, інформаційних, технологічних систем і засобів комунікації та зв'язку, які відповідають кількості, складності та обсягу операцій Біржі;
- проведення перевірки стійкості Біржі по відношенню до збоїв програмно-технічного забезпечення не рідше одного разу на рік;
- чітке розмежування повноважень та відповідальності між органами управління, посадовими особами, окремими структурними підрозділами та працівниками Біржі, регламентування їх повноважень та обов'язків відповідними положеннями про структурні підрозділи та посадовими інструкціями працівників;
- інші заходи, направлені на зниження правових, операційно-технологічних та ризиків персоналу.

11.12. Для зниження ризиків, пов’язаних з провадженням клірингової діяльності, Біржа

має право встановлювати інші вимоги та запроваджувати інші заходи з управління ризиками щодо учасників клірингу шляхом внесення відповідних змін до цих Правил клірингу та/або внутрішніх документів Біржі.

12. Опис системи захисту інформації

12.1. Біржею створено Комплексну систему захисту інформації (далі – КСЗІ) у відповідності до Закону України «Про захист інформації в інформаційно-телекомунікаційних системах», Закону України «Про захист персональних даних», Правил забезпечення захисту інформації в інформаційних, телекомунікаційних та інформаційно-телекомунікаційних системах, затверджених Постановою Кабінету Міністрів України від 29.03.06 № 373, Концепції технічного захисту інформації в Україні, затвердженої Постановою Кабінету Міністрів України від 8.10.97 №1126, Положення про технічний захист інформації в Україні, затвердженого Указом Президента України від 27.09.99 № 1229/99, а також вимог нормативно-правових актів НКЦПФР щодо захисту інформації при провадженні професійної діяльності.

12.2. Відомості, які створюються, збираються, отримуються, використовуються, поширюються, охороняються та зберігаються Біржею в процесі провадження діяльності, відносяться до інформації з обмеженим доступом, окрім інформації, що відповідно до законодавства є публічною.

12.3. До інформації з обмеженим доступом належать, зокрема, відомості про клірингові рахунки (субрахунки) учасників клірингу, інформація про операції, які були проведені на користь чи за дорученням учасників клірингу, здійснені ними угоди; відомості щодо діяльності та фінансово-економічного стану учасників клірингу тощо.

12.4. Біржа зобов’язана забезпечити захист інформації, в тому числі інформації з обмеженим доступом, шляхом реалізації організаційних та технічних заходів, спрямованих на запобігання втратам, крадіжкам, несанкціонованому знищенню, викривленню, підробленню, копіюванню та неконтрольованому поширенню інформації з обмеженим доступом.

12.5. Завдання керування КСЗІ та здійснення контролю за її функціонуванням, виконання робіт з визначення вимог з захисту інформації в ІТС Біржі, проектування, розроблення і модернізації КСЗІ, а також експлуатації, обслуговування, підтримки працездатності КСЗІ, контролю за станом захищеності інформації покладені на Службу захисту інформації, що є позаштатним підрозділом Біржі.

12.6. Завданнями КСЗІ інформаційно-телекомунікаційної системи (далі – ІТС) Біржі є:

12.6.1. реалізація прийнятої політики безпеки інформації;

12.6.2. забезпечення розмежування доступу користувачів ІТС до функцій ІТС Біржі, а також розмежування доступу користувачів до об’єктів, що містять інформацію, яка підлягає захисту, у відповідності до прийнятої політики безпеки;

12.6.3. забезпечення конфіденційності, цілісності та доступності інформації, яка обробляється в КСЗІ ІТС Біржі;

12.6.4. забезпечення реєстрації дій користувачів ІТС Біржі по відношенню до функцій ІТС та об’єктів, що містять інформацію, яка підлягає захисту;

12.6.5. забезпечення захисту інформації від внесення в ІТС Біржі шкідливого програмного коду (вірусів, троянських програм та ін.);

12.6.6. захист від мережевих атак;

12.6.7. захист інформації, яка обробляється в ІТС Біржі, при її передачі через незахищене середовище;

12.6.8. блокування несанкціонованих дій з інформацією, що потребує захисту, та іншими ресурсами ІТС Біржі, локалізації цих дій та ліквідації їх наслідків;

12.6.9. забезпечення доступності інформації та функцій ІТС Біржі для її користувачів, а також відмовостійкості компонентів ІТС;

12.6.10. забезпечення спостережності за діями користувачів та персоналу, реєстрації, збору, зберігання, обробки даних про події, які мають відношення до безпеки інформації, сповіщення адміністратора безпеки про такі події;

12.6.11. підтримання цілісності критичних ресурсів системи захисту, середовища виконання прикладних програм та інформації в ІТС Біржі, що потребує захисту;

12.6.12. забезпечення управління засобами КСЗІ та контролю за її функціонуванням.

12.7. Заходи попередження реалізації загроз, які є основою Політики безпеки ІТС Біржі, розглядаються в контексті управління ризиками та включають наступні:

12.7.1. визначення та реалізація політики авторизації адміністраторів, користувачів та процесів;

12.7.2. визначення та реалізація політики аудиту подій та моніторингу функціонування системи;

12.7.3. визначення та реалізація політики керування доступом адміністраторів та користувачів;

12.7.4. використання виключно захищених інтерфейсів доступу до компонентів системи;

12.7.5. визначення політики та реалізація заходів із забезпечення відновлюваності обчислювальних ресурсів системи;

12.7.6. впровадження заходів з резервного копіювання інформаційних активів системи;

12.7.7. аналіз даних, які вводяться в додатки системи;

12.7.8. порядок доступу та обміну інформацією системи;

12.7.9. забезпечення заходів контролю фізичного доступу до ресурсів системи;

12.7.10. визначення порядку впровадження та експлуатації засобів захисту;

12.7.11. запровадження системи керування конфігураціями засобів захисту;

12.7.12. робота з персоналом;

12.7.13. організаційні заходи з технічного обслуговування компонентів системи.

12.8. Біржа використовує наступні інструменти для захисту інформації:

12.8.1. Розмежування доступу до ресурсів. Уповноважена особа Біржі здійснює реєстрацію та налаштування повноважень адміністраторів ІТС Біржі. Зміна правил розмежування доступу адміністраторів здійснюється за рішенням керівника Служби захисту інформації (відповідального за КСЗІ).

12.8.2. Криптографічний захист інформації. Для захисту каналів передачі інформації та застосування кваліфікованого електронного підпису використовуються засоби КЗІ, які мають чинні позитивні експертні висновки за результатами державної експертизи в сфері криптографічного захисту інформації. Засоби КЗІ застосовуються у відповідності з вимогами експлуатаційної документації на них.

12.8.3. Антивірусний захист. На серверах і робочих станціях ІТС Біржі використовується ліцензійне програмне забезпечення, регламент роботи якого визначається стандартами інформаційної безпеки Біржі.

Система антивірусного захисту реалізує наступні функції:

- захист серверів і робочих станцій адміністраторів від зараження комп'ютерними вірусами;

- антивірусна перевірка всіх носіїв з інформацією та даними, що надходять від зовнішніх об'єктів;

- реєстрація подій та оповіщення про підозрілу активність;

- забезпечення автоматичного видалення або розміщення у спеціальній директорії, доступній тільки адміністратору, виявлених файлів, заражених невідомими типами шкідливих програм.

12.8.4. Резервне копіювання, підтримання працездатності та керування ІТС. Біржа забезпечує здійснення резервного копіювання, вжиття заходів підтримання працездатності ІТС Біржі та забезпечує зберігання носіїв з еталонними і резервними копіями конфігурації мережевого обладнання, виконує відновлення в разі збоїв.

12.8.5. Забезпечення спостережної ресурсів ІТС. Біржа здійснює аудит подій щодо автентифікації адміністраторів, їх доступу до об'єктів захисту, оброблення та аналіз зареєстрованої інформації про критичні з погляду безпеки події, а також забезпечує проведення періодичних спостережень за роботою програмного забезпечення – перегляд подій, зафіксованих у журналах подій.

12.8.6. Встановлює порядок модернізації ІТС. Проведення у ході експлуатації ІТС Біржі модернізації, пов'язаної з заміною/нарощуванням/модернізацією окремих її компонентів, не повинна призводити до зниження рівня політики безпеки інформації в ІТС.

12.8.7. Встановлює порядок захисту фізичного середовища ІТС. Фізичне середовище функціонування ІТС Біржі обладнане наступним чином:

- вхід до будівлі, де розташовані компоненти ІТС, контролюється охороною;

- доступ до приміщення дозволено тільки особам, які мають на це право. У разі потреби сторонні особи перебувають в приміщеннях тільки у супроводі уповноваженої особи Біржі;

- з метою запобігання несанкціонованому доступу до приміщень, в яких розташовано компоненти ІТС, додатково їх обладнано системою охоронної сигналізації;

- приміщення обладнані системами вентиляції, пожежогасіння та гарантованого безперебійного електроживлення.

12.8.8. Контроль за станом захисту інформації в ІТС. Контроль здійснюється не рідше одного разу на півріччя з метою виявлення та попередження порушенням, які можуть призвести до несанкціонованих дій та впливів, що призводять до витоку, знищення, блокування, порушення цілісності інформації або зміни режиму доступу до неї.

12.9. Календарний план робіт із захисту інформації в ІТС Біржі затверджується виконавчим органом біржі та визначає склад, послідовність та терміни проведення робіт із захисту інформації, що циркулює в ІТС. Календарний план містить наступні розділи:

- організаційні заходи із захисту інформації;
- контрольно-правові заходи;
- профілактичні заходи;
- інженерно-технічні заходи;
- робота з кадрами.

13. Випадки застосування процедури ліквідаційного неттінгу

13.1. У випадку визнання учасника клірингу/клієнта учасника клірингу, як сторони товарної операції, неплатоспроможним у разі набрання щодо нього законної сили рішенням господарського суду, а саме ухвали про відкриття провадження у справі про банкрутство або ухвали про відкриття провадження у справі про неплатоспроможність фізичної особи, фізичної особи – підприємця зобов'язання за біржовими договорами, стороною яких є такий учасник клірингу/клієнт учасника клірингу, припиняються в повному обсязі шляхом застосування на підставі відповідного рішення уповноваженої особи Біржі, цих Правил клірингу та інших внутрішніх документів Біржі процедури ліквідаційного неттінгу з дати оприлюднення відповідного рішення господарського суду (дати ліквідаційного неттінгу).

Датою оприлюднення відповідного рішення господарського суду є момент (дата) надсилання судового рішення Біржі, на її офіційну електронну адресу, зареєстровану в Єдиній судовій інформаційно-телекомунікаційній системі.

13.2. У випадку, передбаченому в п. 13.1. цих Правил клірингу, зобов'язання за біржовими договорами учасника клірингу/ клієнта учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, припиняються шляхом:

13.2.1. здійснення Біржею розрахунку вартості нетто – зобов'язань учасника клірингу/клієнта учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, як сторони біржового договору, за однією товарною операцією або кількома товарними операціями, що існувала (існували) станом на дату ліквідаційного неттінгу та була укладена (були укладені) такими сторонами з посиланням на обов'язковість для процедури ліквідаційного неттінгу.

Розрахунок вартості нетто – зобов'язань учасника клірингу/клієнта учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, здійснюється на дату ліквідаційного неттінгу у розрізі кожного контрагента за біржовими договорами за наступною формулою:

N = ΣВг-ΣЗг+ Σi((ΣВт-ΣЗт)i * Ці), де

N – розрахована вартість нетто-зобов’язання учасника клірингу/клієнта учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу,

Вг – вимога учасника клірингу/клієнта учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, виражена у грошових коштах, за біржовими договорами, де учасник кліринг/клієнт учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, є продавцем,

Зг – зобов’язання учасника клірингу/клієнта учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, виражена у грошових коштах, за біржовими договорами, де учасник клірингу/клієнт учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, є покупцем,

Вт – товарна вимога учасника клірингу/клієнта учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, за біржовими договорами, де учасник клірингу/клієнт учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, є покупцем, за і- м товаром, що обліковується у системі клірингового обліку,

Зт – товарне зобов’язання учасника клірингу/клієнта учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, за біржовими договорами, де учасник клірингу/клієнт учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, є продавцем, за і- м товаром, що обліковується у системі клірингового обліку,

Ц – ціна, що відповідає ціні і-того товару, яка визначається Біржею за результатами біржових торгів на дату ліквідаційного неттінгу або іншу дату на яку Біржею в останнє була визначена така ціна.

Якщо розрахована вартість нетто-зобов’язання учасника клірингу/клієнта учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, є величиною додатною, це означає, що ця сума підлягає сплаті учаснику клірингу/клієнту учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, іншою стороною ліквідаційного неттінгу у розрізі кожного контрагента за біржовими договорами. Якщо розрахована вартість нетто-зобов’язання учасника клірингу/клієнта учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, є величиною від’ємною, то ця сума підлягає сплаті учасником клірингу/клієнтом учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, іншій стороні ліквідаційного неттінгу у розрізі кожного контрагента за біржовими договорами.

13.2.2. припинення Біржею станом на дату ліквідаційного неттінгу всіх існуючих зобов’язань за біржовими договорами, незалежно від їх змісту та/або строку (терміну) виконання, укладеним (укладеними) учасником клірингу/клієнтом учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, з посиланням на обов’язковість проведення ліквідаційного неттінгу для сторін таких біржових договорів, у такій послідовності:

а) заміна відповідно до статті 604 Цивільного кодексу України зобов’язань, які існували станом на дату ліквідаційного неттінгу, новими грошовими зобов’язаннями, сума яких дорівнює вартості зобов’язання, розрахованій відповідно до пп. 13.2.1. цього пункту. При цьому вважається, що строк виконання вимог за такими новими грошовими зобов’язаннями настав;

б) припинення нових грошових зобов’язань, передбачених підпунктом "а" цього підпункту, шляхом зарахування зустрічних однорідних вимог за такими зобов’язаннями.

13.3. Біржа розраховує вартість нетто-зобов’язань учасника клірингу/клієнта учасника клірингу, щодо якого застосовується процедура ліквідаційного неттінгу, у гривні по відношенню до інших учасників клірингу/клієнтів учасника клірингу, які є сторонами біржових договорів, окремо:

13.3.1. За біржовими договорами, укладеними за рахунок учасника клірингу за усіма регістрами;

13.3.2. За біржовими договорами, укладеними за рахунок клієнтів учасника клірингу за усіма регістрами.

13.4. Ліквідаційний неттінг не здійснюється Біржею у таких випадках:

13.4.1. заява учасника клірингу про приєднання до цих Правил клірингу, за формою встановленою внутрішніми документами, не передбачає можливості проведення ліквідаційного неттінгу;

13.4.2. заява про приєднання до цих Правил клірингу надана Біржі після дати прийняття рішення, зазначеного у підпункті 13.1. цього пункту;

13.5. Проведення Біржею ліквідаційного неттінгу та звернення стягнення на предмет обтяження, який забезпечує виконання зобов’язань учасника клірингу/клієнтів учасників клірингу як сторони щодо процедури ліквідаційного неттінгу, щодо якого прийнято рішення, передбачене підпунктом 13.1. цього пункту і, за одною або кількома операціями біржовими договорами здійснюються в позасудовому порядку та не потребують будь-якої згоди та/або затвердження такого учасника клірингу, його клієнта або будь-якої іншої особи.

13.6. Біржа направляє учаснику клірингу, зобов’язання якого припинені за результатами ліквідаційного неттінгу повідомлення про припинення зобов’язань за товарними операціями протягом 3-х робочих днів після дати припинення таких зобов’язань у порядку та формі, передбачених угодою щодо ліквідаційного неттінгу.

13.7. Біржа повідомляє іншу сторону біржових договорів, однією стороною яких є учасник клірингу, зобов’язання якого припинені за результатами ліквідаційного неттінгу, шляхом направлення на їхні електронні поштові скриньки повідомлення про припинення таких зобов’язань протягом 3-х робочих днів після дати припинення таких зобов’язань.

13.8. Грошові кошти, що залишились на рахунку учасника клірингу (його клієнтів/клієнта) після припинення зобов’язань за результатами ліквідаційного неттінгу, підлягають поверненню учаснику клірингу (його клієнту/клієнтам), в порядку передбаченому угодою щодо ліквідаційного неттінгу та/або внутрішніми документами Біржі, якими регламентується біржова торгівля у відповідних секціях Біржі.

14. Заключні положення

14.1. Питання, що стосуються надання Біржею клірингових послуг, які не врегульовані цими Правилами клірингу, регулюються іншими внутрішніми документами Біржі, зокрема, Регламентом провадження клірингової діяльності.

14.2. Договори про клірингове обслуговування укладаються Біржею з особами, що мають намір стати учасниками клірингу, шляхом подання такими особами Біржі Заяви про приєднання до цих Правил клірингу, що мають статус договору приєднання в розумінні статті 634 Цивільного кодексу України.

14.3. Всі дійсні учасники торгів, які допущені до біржової торгівлі на короткостроковому ринку природного газу Біржі вважаються такими, що набули статус учасника клірингу на підставі заяви про приєднання до Правил організації біржової торгівлі природним газом на короткостроковому ринку природного газу на товарній біржі – Товариство з обмеженою відповідальністю «Українська енергетична біржа».

Всього прошнуровано, пронумеровано та скріплено підписом та печаткою на 28 (двадцять вісім) аркушах

Голова Біржового комітету
ТОВ «УЕБ» _____ О. С. Дубовський

