



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
КЛИРИНГОВЫЙ
ЦЕНТР
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Департамент
Клиринга

Изменения в клиринге во II этапе релизов рынков 2017

Перечень изменений

- 1. Внедрение технологии TRAN**
- 2. Изменения в порядок возврата денежных средств**
- 3. Исполнение обязательств по уплате комиссии до 20:00. Учет комиссии в Едином лимите**
- 4. Введение штрафа за cut-off time**
- 5. Повышение взноса в гарантийные фонды**
- 6. Перевод ИКО в иное обеспечение**
- 7. Расширение списка активов принимаемых в обеспечение на ФР**
- 8. Изменения в отчетах НКЦ**



1. Внедрение технологии TRAN

Суть изменений: Любое изменение позиции по денежным средствам / ценным бумагам / профилям денежных средств и ценных бумаг оформляется транзакциями TRAN

Описание изменений:



Транзакции TRAN отражаются с режимом торгов TRAD в шлюзовой таблице TRADES.



Если участник не планирует обрабатывать транзакции TRAN, то ему необходимо исключить указанные борды из процедуры обработки таблицы TRADES.



Транзакциями TRAN будут отражаться операции, приведенные в Приложении №1.



В таблице TRADES в поле TRANINFO будет отражаться дополнительная информация об операции (в случае наличия), например, назначение платежа.



Для Транзакции TRAN, изменяющей позицию по денежным средствам на фондовом рынке в качестве ТКС списания/ТКС зачисления будет использоваться специальный технический ТКС. Данные ТКС заводятся в автоматическом режиме для каждого активного Расчетного кода, за исключением Расчетных кодов Гарантийного фонда, Обеспечения под стресс, имущественного пула. В состав технических ТКС не будет входить торговый раздел счета депо. Для транзакций TRAN, связанных с переводом средств с T0 на T+, передачей Дохода по сделкам РЕПО с ЦК, технические ТКС будут использоваться только если невозможно выбрать ТКС списания/ ТКС зачисления. Технические ТКС будут отражаться в отчете EQM20.



Обязательства по транзакциям TRAN проходят проверку на обеспеченность, изменяют соответствующие позиции и исполняются в зависимости от указанного кода расчетов.



Информация о передаче дохода по сделкам РЕПО с ЦК будет передаваться транзакциями TRAN. Также информация о передаче дохода остается в одном борде RFND (вместо RFND, RFNU, RFNE). В поле SecurityID вместо бумаги будет отражаться валюта – RUB, EUR, USD, UAH.

2. Изменения в порядок возврата денежных средств (1/2)

Суть изменений: на фондовом рынке реализован постоянный возврат денежных средств (ПВДС) в размере Итогового нетто-требования

Описание изменений:

1. Для возврата денежных средств с фондового и валютного рынка Участник клиринга подает в НКЦ:
 - **Запрос на возврат обеспечения (разовый)** *или*
 - **Постоянное поручение на возврат обеспечения**
- 1.a В **Запросе на возврат обеспечения в поле TYPESUMM** указывается признак:
 - 1** – возврат средств в размере, указанном в запросе *или*
 - 5** – возврат средств в размере всей доступной суммы денежных средств
- 1.6. В **Постоянном поручении на возврат** в поле **TYPESUMM** обеспечения указывается признак:
 - 4** – возврат средств в размере нетто-требования по сделкам (актуально для валютного рынка, включает задолженность и вар. маржу) *или*
 - 5** – возврат средств в размере всей доступной суммы денежных средств (возврат осуществляется в размере расчетной позиции) *или*
 - 6** – возврат средств в размере Итогового нетто-требования

Внимание

! В связи с реализацией ПВДС на фондовом рынке отменяется автоматический возврат денежных средств **со счетов Т+ на счета Т0 в размере нетто-требования** по итогам исполнения обязательств. Для сохранения такого перевода необходимо в качестве реквизитов для возврата для соответствующего Расчетного кода зарегистрировать счет 30411 и предоставить с помощью web-клиринг или по ЭДО ПВДС с указанием этого счета.

При возврате с **Расчетного кода Единого пула** в Запросе на возврат обеспечения и в Постоянном поручении на возврат обеспечения **не доступен признак «5»**

2. Изменения в порядок возврата денежных средств (2/2)

Описание изменений:

При указании в **Постоянном поручении на возврат** признака «возврат средств в размере Итогового нетто-требования» НКЦ осуществит вывод в размере Итогового нетто требования, рассчитанного с учетом:

Для валютного рынка	Для фондового рынка
<ul style="list-style-type: none">• непогашенных Задолженностей Участника клиринга в российских рублях, возникших в предыдущий Расчетный день• обязательств/требований по сделкам, заключенным на валютном рынке• обязательств по уплате комиссии по сделкам, заключенным на валютном рынке• обязательств/ требований по уплате вариационной маржи, рассчитанной на валютном рынке	<ul style="list-style-type: none">• непогашенных Задолженностей Участника клиринга в российских рублях, возникших в предыдущий Расчетный день• обязательств/требований по Сделкам Т+ и РЕПО с ЦК, заключенных на фондовом рынке• обязательств по передаче / требования по получению Дохода по сделкам РЕПО с ЦК• обязательств Участника клиринга по уплате штрафов, пеней, неустоек, отступного, определенных в соответствии с общей частью Правил клиринга и Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов• обязательств по уплате комиссии по сделкам, заключенным на фондовом рынке• обязательств/требований по сделкам, заключенным на валютном рынке*• обязательств по уплате комиссии по сделкам, заключенным на валютном рынке*• обязательств/ требований по уплате вариационной маржи, рассчитанной на валютном рынке*• обязательств по уплате комиссии по сделкам, заключенным на срочном рынке*• обязательств/ требований по уплате вариационной маржи, рассчитанной на срочном рынке*



2. Изменения в порядок возврата денежных средств (3/2)

Постоянное поручение на возврат исполняется после определения Итогового нетто-требования до времени cut-off time

Денежные средства/ драг.металлы	Время определения Итоговых нетто обязательств/ Итоговых нетто-требований (по состоянию на)	Время исполнения Постоянных поручений на возврат обеспечения, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств	
		для внешних платежей	для внутренних платежей
1. Гонконгские доллары	11:00	12:45	12:45
2. Белорусские рубли, тенге		13:00	13:00
3. Швейцарские франки		14:00	14:00
4. Юани		14:30	14:30
5. Евро	По сделкам с наступившей датой исполнения, заключенным до 15:15 – 15:15 По сделкам с исполнением в дату заключения, заключенным после 15:15 – 19:00	17:40¹/18:40	19:00¹/20:00
6. Фунты стерлингов	15:15		
7. Доллары США, российские рубли, драг. металлы		20:00	20:00



3. Исполнение обязательств по уплате комиссии до 20:00

Суть изменений:

оборотная комиссия по сделкам будет учитываться:

- в Едином лимите при выставлении заявки;
- в Итоговых нетто-обязательствах в российских рублях по соответствующему Расчетному коду:
 - по Расчетному коду, входящему в ТКС в сделке (по умолчанию) или
 - по Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений (в случае предоставления Запроса о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений)

Обязательства по уплате комиссии по сделкам, заключенным до 19:00, необходимо исполнять до 20:00 на всех рынках.

В случае неисполнения, на **фондовом** и **валютном** рынках будет осуществлено урегулирование путем заключения сделок своп или РЕПО, на **срочном** рынке с 01.01.2018 будет взиматься штраф за cut-off time.

На фондовом рынке комиссия будет входить в Итоговые нетто-обязательства в российских рублях, включенные в отчет EQM13, предоставляемый по денежным средствам после 19:00.

4. Введение штрафа за cut-off time

Суть изменений: введение штрафа за ненадлежащее исполнение Итоговых нетто-обязательств на всех рынках

Описание изменений: штраф начисляется в случае **исполнения Итогового нетто-обязательства по денежным средствам с нарушением срока**, установленного Временным регламентом.

При возникновении Задолженности пеня на Задолженность начисляться не будет.

Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам/драгоценным металлам на фондовом, срочном и валютном рынках

• в тенге, определенных по сделкам, заключенным до 11:00	до 11:00 Даты исполнения
• в юанях, белорусских рублях, гонконгских долларах, швейцарских франках, определенных по сделкам, заключенным до 12:00	до 12:00* Даты исполнения
• в гривнах, определенных по сделкам, заключенным до 15:15	до 15:15 Даты исполнения
• в евро, фунтах стерлингов, определенных по сделкам, заключенным до 15:15	до 17:00* Даты исполнения
• в долларах США, российских рублях*, драгоценных металлах	до 20:00* Даты исполнения

* - при наличии сбоя в платежных системах указанное время может быть продлено по решению НКЦ до устранения указанного сбоя

Для товарного рынка и рынка Стандартизированных ПФИ в соответствии с временным регламентом, действующим на каждом рынке, время cut-off time соответствует 17:00

штраф также начисляется в случае невозможности урегулирования неисполненного Итогового нетто-обязательства по денежным средствам путем заключения сделок своп или РЕПО

Штраф за cut-off time по российским рублям будет списываться с 01.01.2018

По умолчанию штраф за cut-off time будет списываться с Расчетного кода, на котором учитывались обязательства, исполненные с нарушением срока, установленного Временным регламентом.



Участник клиринга может назначить для списания штрафов за cut-off time Расчетный код для списания комиссионных вознаграждений, предоставив в НКЦ Запрос о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений.

Аналогичный подход применяется к комиссии за учет обеспечения.

5. Повышение взноса в гарантийные фонды

Суть изменений: НКЦ устанавливает единые требования к размеру взноса в гарантийные фонды на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, фондовом рынке и срочном рынке

Рынок	Минимальный размер взноса в Гарантийный фонд, руб.
Валютный рынок и рынок драгоценных металлов	10 000 000
Срочный рынок *	10 000 000
Фондовый рынок	10 000 000
Рынок депозитов	1 000 000
Товарный рынок	1 000 000
Рынок Стандартизированных ПФИ	1 000 000

* - на срочном рынке взнос 10 000 000 млн. руб. независимо от секции

Перечень иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых в качестве взносов в гарантийные фонды, остается без изменений, опубликован на сайте НКЦ в разделе «Клиринг. Документы».

6. Перевод ИКО в иное обеспечение

Суть изменений: Участник клиринга может предоставить в НКЦ Заявление об изменении статуса обеспечения на фондовом и срочном рынке с индивидуального клирингового обеспечения (ИКО) на иное обеспечение

Описание изменений:

Вид обеспечения	Куда вносится	Где учитывается	Статус
Обеспечение: <ul style="list-style-type: none">• в российских рублях• в иностранной валюте (на фондовом и срочном рынке)	На счета НКЦ, открытые в НРД	Балансовый счет 30420 в НКЦ	Индивидуальное клиринговое обеспечение (ИКО)
Обеспечение в иностранной валюте (на валютном рынке)	На корреспондентские счета в иностранных банках	Балансовый счет 47405 в НКЦ	Иное обеспечение

Участник клиринга может предоставить в НКЦ **Заявление об изменении статуса обеспечения** на фондовом и срочном рынке, исполнение которого позволит **зачислять иностранную валюту в обеспечение на фондовый и срочный рынки напрямую на корреспондентские счета НКЦ в иностранных банках**, также, как и на валютном рынке

Для исполнения такого заявления НКЦ после учета всех клиринговых и иных операций текущего Расчетного дня:

- для каждого Расчетного кода откроет балансовые счета № 47405
- переведет Обеспечение в иностранной валюте с балансового счета № 30420 (30421) на балансовый счет № 47405
- закроет балансовые счета № 30420 (30421)

Примечание: после перевода ИКО в иное, обратный перевод недоступен

7. Расширение списка активов принимаемых в обеспечение на ФР

Суть изменений: НКЦ в качестве обеспечения на фондовом рынке будет принимать иностранную валюту и драгоценные металлы*

№	Наименование актива принимаемого в обеспечение
1	USD (доллар США)
2	EUR (евро)
3	CNY (юань)
4	GBP (фунт стерлингов)
5	CHF (швейцарский франк)
6	HKD (гонконгский доллар)
7	BYN (белорусский рубль)
8	GLD (золото)
9	SLV (серебро)

* - на первом этапе по Расчетным кодам Единого пула

8. Изменения в отчетах НКЦ (1/8)

Название отчета	Суть изменений
EQM13 (Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях)	<p>Вводится единое время определения Итоговых нетто-обязательств/ Итоговых нетто-требований на фондовом и валютном рынке.</p> <p>На фондовом рынке отчет EQM13 будет формироваться после определения Итоговых нетто-обязательств/ Итоговых нетто-требований:</p> <ol style="list-style-type: none">1) в 11:00 (Итоговые нетто-обязательства/ нетто-требования в юанях, белорусских рублях, тенге и гонконгских долларах, швейцарских франках)*2) в 15:15 (Итоговые нетто-обязательства/ нетто-требования в евро, фунтах стерлингов, гривнах)*3) в 16:00 (Итоговые нетто-обязательства/ нетто-требования в ценных бумагах)4) в 19:00 (Итоговые нетто-обязательства/ нетто-требования в ценных бумагах)5) в 19:35 (Итоговые нетто-обязательства/ нетто-требования в денежных средствах, включая обязательства/требования по передаче Дохода и обязательства по уплате комиссии по сделкам, заключенным в течение дня на фондовом рынке. Также содержит Итоговые нетто-обязательства/ нетто-требования в евро по сделкам, заключенным после 15:15)6) в 20:00 для Недобросовестных участников клиринга, с которыми заключались сделки в 3ю сессию
EQM23 (Отчет об обязательствах по Сделкам Т+)	<p>Отчет будет предоставляться по итогам 2ой клиринговой сессии в 19:35, а для Недобросовестных участников по деньгам – по итогам 3ей клиринговой сессии.</p> <p>Исключается информация об исполненных Итоговых нетто-обязательствах, вошедшая в EQM13, в отчете будут отражаться только обязательства, по которым не наступила дата исполнения.</p>
EQM15 (Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению)	<p>В отчете меняется нумерация и виды комиссии (соответствуют транзакциям TRAN) (приведены в Приложении №2), так же добавляется поле с описанием комиссии.</p>

* - в случае, если в указанной валюте осуществляются расчеты на фондовом рынке, а также для Расчетных кодов Единого пула

7. Изменения в отчетах НКЦ (2/8)

Название отчета	Суть изменений
EQM99 (Отчет об обеспечении)	Отчет дополняется новыми типами операций и полем «Дополнительная информация по операции», содержащим дополнительную информацию, например, назначение платежа.
ССХ04 ССХ4P (Отчет об Итоговых нетто-обязательствах/ Итоговых нетто-требованиях)	Наименование отчетов («Биржевое свидетельство», «Предварительное Биржевое свидетельство») меняется на «Отчет об Итоговых нетто-обязательствах/ Итоговых нетто-требованиях». Для денежных средств в российских рублях в ССХ04 будут указаны нетто-обязательства/ нетто-требования, состоящие из нетто-обязательств/ нетто-требований по сделкам с наступившей датой исполнения, обязательств/ требований по уплате вариационной маржи и непогашенной Задолженности, возникшей в предыдущий Расчетный день. Информация о комиссии предоставляется в отчете ССХ10.
clientsXX00.csv. (Отчет о разделах клиринговых регистров)	В отчет добавляется информация о признаке Расчетного кода «Единый пул»



Приложение № 1: операции, отражаемые транзакциями TRAN

- Обязательства по передаче доходов по сделкам РЕПО
- Переводы денежных средств и ценных бумаг между ТКС
- Зачисление, списание денежных средств и ценных бумаг
- Обязательства по уплате комиссии/штрафа/отступного
- Обязательства/требования по уплате вариационной маржи на валютном рынке
- Передача обязательств/требований по Расчетным кодам Единого пула с валютного и срочного рынков на фондовый рынок
- Передача профилей активов между Торгово-клиринговыми системами по Расчетным кодам Единого пула
- Прекращение обязательств и перевод активов по Сделкам с наступившей датой исполнения

Приложение № 2: изменение нумерации и видов комиссии в отчете EQM15

Номер операции	Описание
21	Комиссии ИТС, МБ ДКС, (счет T0)
23	Комиссии ИТС, МБ оборотная часть, (счет T0)
24	Комиссии ИТС, МБ постоянная часть, (счет T0)
26	Комиссии ИТС, Тарифный план размещение-фиксированный, (счет T0)
27	Комиссии НКЦ, МБ оборотная часть, (счет T0)
28	Комиссии НКЦ, МБ постоянная часть, (счет T0)
30	Комиссии НКЦ, Тарифный план размещение-фиксированный, (счет T0)
31	Выплаченные проценты за обеспечения под стресс
32	Комиссии биржи, МБ абонентская плата, (счет T0)
33	Комиссии биржи, МБ оборотная часть, (счет T0)
34	Комиссии биржи, МБ постоянная часть, (счет T0)
36	Комиссии биржи, Тарифный план размещение-фиксированный. (счет T0)
37	Комиссии ИТС, МБ ДКС, (счет T+)
39	Комиссии ИТС, МБ оборотная часть, (счет T+)
40	Комиссии ИТС, МБ постоянная часть, (счет T+)
41	Комиссия НКЦ: Комиссия по сделкам переноса, заключенным в третью клиринговую сессию
42	Комиссии ИТС, Тарифный план размещение-фиксированный, (счет T+)
43	Комиссии НКЦ, МБ оборотная часть, (счет T+)
44	Комиссии НКЦ, МБ постоянная часть, (счет T+)
45	Комиссия ИТС: Комиссия по сделкам переноса, заключенным в третью клиринговую сессию
46	Комиссии НКЦ, Тарифный план размещение-фиксированный, (счет T+)
48	Комиссии биржи, МБ абонентская плата, (счет T+)
49	Комиссии биржи, МБ оборотная часть, (счет T+)
51	Неустойка (штраф) за необеспеченность заявки с указанием реквизита «дата активации» (в пользу Биржи)
52	Неустойка за Неисполнение на Аукционе
73	Комиссии биржи, МБ постоянная часть, (счет T+)
75	Комиссии биржи, Тарифный план размещение-фиксированный, (счет T+)
76	Комиссии биржи, МБ Комиссия по сделкам переноса, заключенным в третью клиринговую сессию
77	Комиссия за клиринговую услугу по предоставлению возможности заключения депозитного договора – взимается с Расчетного кода ТКС T+ в случае незаключения депозитного договора
78	Отступное за отказ от заключения депозитного договора