

Изменения	Пункт Правил клиринга	Описание изменений	Влияние на права и обязанности Участников клиринга
1) Допуск Некредитных организаций ЕврАзЭС/ЕАЭС к клиринговому обслуживанию рынку депозитов	<p>Термин «Некредитная организация ЕврАзЭС/ЕАЭС» статьи 2, подпункт 12.9.3, пункты 13.3, 13.4, 60.8 общей части Правил клиринга;</p> <p>Пункты 8.4, 8.6, 8.7 Правил клиринга на фондовом рынке.</p>	<p>НКЦ предоставит допуск к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Участникам клиринга-Некредитным организациям ЕврАзЭС/ЕАЭС. При этом наличие действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга, не будет являться обязательным условием такого допуска.</p> <p>Установлены требования для допуска к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов с категорией «Б» Участника клиринга – Некредитной организации ЕврАзЭС/ЕАЭС и Участника клиринга – Банка ЕврАзЭС/ЕАЭС, не являющегося национальным (центральным) банком страны ЕврАзЭС/ЕАЭС.</p>	<p>У Участников клиринга - Некредитных организаций ЕврАзЭС/ЕАЭС появляется возможность получить допуск к клиринговому обслуживанию на рынке депозитов.</p>
2) Допуск Федерального казначейства к сделкам РЕПО с центральным контрагентом	<p>Пункт 32.14, подпункт 47.3.6, пункт 49.4 общей части Правил клиринга.</p> <p>Подпункт 20.1.16, пункты 37.2, 37.3 Правил клиринга на фондовом рынке.</p>	<p>Участнику клиринга категории «К» предоставляется возможность подачи заявок на заключение сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Ym/Yn, с учетом следующих особенностей:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) Клиринговый центр не вправе заключить Сделки РЕПО Клирингового центра (в целях исполнения обязательств по Сделкам, а также в иных целях, предусмотренных Правилами клиринга) на основании безадресных заявок с Участником клиринга категории «К». 2) Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга категории «К» Обеспечения в ценных бумагах не осуществляется (если иное не установлено решением Клирингового центра). 3) Стоимость обратного выкупа (сумма второй сделки купли-продажи ценных бумаг) для Участника клиринга категории «К» равна Сумме РЕПО (сумме первой сделки купли-продажи ценных бумаг). <p>Клиринговый центр в Дату исполнения обязательства по</p>	<p>Участнику клиринга категории «К» предоставляется право подачи заявок на заключение сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Ym/Yn.</p>

		второй части сделок РЕПО, стороной по которым является Участник клиринга категории «К» осуществляет возврат Обеспечения в денежных средствах Участнику клиринга категории «К» в сумме дохода по сделкам РЕПО, без подачи поручений / запросов Участником клиринга категории «К».	
3) Расширен перечень оснований, в соответствии с которыми Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», «Б» или «В»	Подпункт 14.1.26 общей части Правил клиринга.	<p>Добавлено основание, по которому НКЦ вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», категории «Б» или категории «В» на одном или нескольких биржевых рынках по всем Сделкам, или по отдельным видам Сделок, или по Сделкам с отдельной ценной бумагой / иностранной валютой / драгоценным металлом / инструментом / Срочным контрактом / Договором СПФИ / Договором, базисным активом которых является товар, а также по отдельным Режимам торгов:</p> <p>в случае возникновения у Клирингового центра подозрения, что какие-либо операции осуществляются (совершаются) Участником клиринга или клиентом Участника клиринга в целях легализации (отмывания) доходов, полученных преступным путем, или финансирования терроризма, или являются сомнительными, или каким бы то ни было иным образом связаны с легализацией (отмыванием) доходов, полученных преступным путем, или финансированием терроризма.</p>	Не влияет на права и обязанности Участников клиринга.
4) Расширен перечень оснований, в соответствии с которыми Клиринговый центр вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех биржевых рынках	Подпункт 14.17.3 общей части Правил клиринга.	<p>Добавлено основание, по которому НКЦ вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех биржевых рынках:</p> <p>в случае получения информации Банка России или уполномоченного государственного органа об отнесении какой-либо операции Участника клиринга или клиента Участника клиринга к подозрительной и/или применение к Участнику клиринга и к клиенту Участника клиринга органом, уполномоченным в сфере ПОД/ФТ, мер воздействия за нарушение законодательства в сфере ПОД/ФТ.</p>	Не влияет на права и обязанности Участников клиринга.

<p>5) Обозначена необходимость предоставления Участником клиринга Анкеты выгодоприобретателя в отношении регистрируемого Обособленного клиента</p>	<p>Пункт 22.1 общей части Правил клиринга.</p>	<p>Внесено уточнение в порядок регистрации Обособленных клиентов Участников клиринга:</p> <p>в случаях, когда Клиринговый центр осуществляет идентификацию выгодоприобретателя в соответствии с требованиями законодательства по противодействию легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем и финансированию терроризма для регистрации Обособленного клиента Участник клиринга должен предоставить Анкету выгодоприобретателя в отношении регистрируемого Обособленного клиента. В случае непредоставления Анкеты выгодоприобретателя в отношении регистрируемого Обособленного клиента Клиринговый центр не регистрирует Обособленного клиента.</p>	<p>У Участника клиринга появляется обязанность предоставления Анкеты выгодоприобретателя в отношении регистрируемого Обособленного клиента.</p>
<p>6) Установление Клиринговым центром периода действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге</p>	<p>Подпункт 23.2.5, пункты 32.11, 32.13 общей части Правил клиринга;</p> <p>Подпункт 20.1.11, пункты 24.7, 29.4, 36.3</p>	<p>В дополнение к существующему механизму запрета коротких продаж для неликвидных бумаг добавляется новый функционал для периода действия признака «запрета коротких продаж». Основная идея изменения - позиции Участников клиринга не должны ухудшаться по сравнению с позициями, сформированными перед установкой данного периода.</p> <p>В случае установления Клиринговым центром периода действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге на период, в котором определены дата начала периода действия и дата окончания периода действия признака, в дату окончания периода действия признака по Сделкам с такой ценной бумагой для Даты исполнения, приходящейся на дату окончания периода действия признака осуществляется клиринг с полным обеспечением по такой ценной бумаге; проверка возможности исполнения иных операций, проводимая при наличии признака «запрет коротких продаж» по такой ценной бумаге, проводится только для Даты исполнения, приходящейся на дату окончания периода действия признака.</p> <p>В случае установления Клиринговым центром периода действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге на период, в котором определена только дата начала</p>	<p>В случае установки «запрета коротких продаж» с периодом действия у участников ограничиваются возможности открытия коротких позиций с датами исполнения в данном периоде времени.</p>

		<p>действия признака, начиная с пятого Расчетного дня периода по Сделкам с такой ценной бумагой осуществляется клиринг с полным обеспечением по такой ценной бумаге; проверка возможности исполнения иных операций, проводимая при наличии признака «запрет коротких продаж» по такой ценной бумаге, проводится для всех Дат исполнения, начиная с пятого Расчетного дня периода.</p>	
<p>7) Изменены сроки предоставления отчетности, предоставляемой Участниками клиринга клиринговому центру</p>	<p>Пункт 11.7 общей части Правил клиринга; Пункт 8) приложения №4 к общей части Правил клиринга; пункты 4-6), 9-11) приложения №5 к общей части Правил клиринга.</p>	<p>Определено, что в случае изменения установленных законами, нормативными актами Банка России и иными нормативными актами Российской Федерации сроков подготовки форм отчетности, указанных в приложении № 5 к общей части Правил клиринга, Участник клиринга вправе предоставить отчетность в сроки, отличные от перечисленных в приложении № 5 к общей части Правил клиринга, предварительно уведомив Клиринговый центр о соответствующих изменениях.</p> <p>Уточнено, что:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Некредитные организации, являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг/ являющиеся акционерными инвестиционными фондами, управляющими компаниями инвестиционного фонда, паевого инвестиционного фонда и негосударственного пенсионного фонда/ являющиеся страховыми организациями и обществами взаимного страхования/ являющиеся негосударственными пенсионными фондами предоставляют месячные формы отчетности – за пять последних отчетных дат (по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября, 31 декабря); • Региональные органы предоставляют годовые формы отчетности на последнюю отчетную дату. 	<p>Меняются сроки предоставления отчетности, предоставляемой Участниками клиринга Клиринговому центру.</p> <p>Участникам клиринга в случае изменения установленных законами, нормативными актами Банка России и иными нормативными актами Российской Федерации сроков подготовки форм отчетности предоставляется право предоставить отчетность в иные сроки, предварительно уведомив Клиринговый центр о соответствующих изменениях.</p>

<p>8) Изменен порядок уплаты отступного и комиссионного вознаграждения на рынке депозитов по Расчетным кодам ДУ</p>	<p>Подпункты 34.6.3, 34.11.1 Правил клиринга на фондовом рынке.</p>	<p>В настоящее время Правилами клиринга определено, что комиссионное вознаграждение, взимаемое Клиринговым центром с Участника клиринга за обеспечение возможности заключения депозитного договора в следующий Расчетный день, определяемое в плановую дату заключения депозитного договора, и обязательство по уплате отступного учитываются по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений.</p> <p>Новой редакцией Правил клиринга устанавливается иной порядок, в соответствии с которым указанное выше комиссионное вознаграждение и отступное учитываются по:</p> <ul style="list-style-type: none"> • основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, в случае если Расчетный код, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений является Расчетным кодом ДУ, • Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, в случае если Расчетный код, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений не является Расчетным кодом ДУ. 	<p>Не влияет на права и обязанности Участников клиринга.</p>
<p>9) В Правила клиринга перенесены положения Правил заключения внебиржевых сделок НКО НКЦ (АО)</p>	<p>Пункты 10.4, 11.9 Правил клиринга на валютном рынке, Приложение № 2 к Правилам клиринга на валютном рынке.</p>	<p>В Правила клиринга перенесены положения Правил заключения внебиржевых сделок НКО НКЦ (АО), являющихся на текущий момент отдельным документом.</p>	<p>Не влияет на права и обязанности Участников клиринга.</p>

10) Участники клиринга категории «В» не могут становиться сторонами Внебиржевых сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом в Режиме «Аукцион RFS».	Пункт 4.2 Правил клиринга на валютном рынке.	Установлено, что Участники клиринга категории «В» не могут становиться сторонами Внебиржевых сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом в Режиме «Аукцион RFS».	Участники клиринга категории «В» теряют право заключения Внебиржевых сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом в Режиме «Аукцион RFS». Фактически такие сделки сейчас не заключаются
11) Отмена комиссии по сделкам урегулирования на срочном рынке (вместо нее вводится штраф за заключение закрывающих сделок)	Пункт 24.10, подпункт 26.6.1 Правил клиринга на срочном рынке.	Отменяется взимание комиссионного вознаграждения за заключение закрывающих сделок с Недобросовестными участниками клиринга и балансирующих сделок с Добросовестными участниками клиринга. За заключение закрывающих сделок с Недобросовестными участниками клиринга будет взиматься штраф. Сумма штрафа при заключении закрывающей сделки равна сумме 5 биржевых сборов, установленных ПАО Московская Биржа, и 5 комиссионных вознаграждений за клиринг, установленных Клиринговым центром для Срочного контракта, заключения закрывающей сделки.	Не влияет на права и обязанности Участников клиринга.

<p>12) Дополнены условия исполнения Участником клиринга Обязательства по поставке по поставочным фьючерсным контрактам на пшеницу</p>	<p>Пункт 34.3 Правил клиринга на срочном рынке.</p>	<p>Необходимыми условиями исполнения Участником клиринга Обязательства по поставке по поставочным фьючерсным контрактам на пшеницу дополнены следующим условием:</p> <p>в случае если Участник клиринга является Продавцом по поставочным фьючерсным контрактам на пшеницу, учитываемым на разделе регистра учета позиций Участника клиринга, лицо, чьи идентификационные данные указаны при открытии такого раздела регистра учета позиций, является Участником торгов АО НТБ, имеющим статус «Продавец», допущенным АО НТБ к организованным торгам товарами на спот-рынке АО НТБ.</p>	<p>В случае несоответствия участника торгов в интересах которого заключен поставочный фьючерсный контракт на пшеницу установленному требованию, обязательства Участника клиринга по поставочному фьючерсному контракту на пшеницу прекращаются уплатой неустойки.</p>
<p>13) Определены сроки исполнение фьючерсных контрактов на инвестиционные паи SPDR S&P 500 ETF Trust</p>	<p>Пункт 4 раздела 4 Приложения № 1 к Правилам клиринга на срочном рынке.</p>	<p>Временной регламент дополнен операцией - исполнение фьючерсных контрактов на инвестиционные паи SPDR S&P 500 ETF Trust (в ходе дневной клиринговой сессии дня исполнения контракта).</p>	<p>Не влияет на права и обязанности Участников клиринга.</p>
<p>14) Определено право Участника закрепить за Обособленным клиентом Расчетный код ДУ (Брокерскую фирму ДУ), в т.ч изменить тип Брокерской фирмы ДУ на Обособленную Брокерскую фирму</p>	<p>Пункт 22.1 общей части Правил клиринга.</p> <p>Пункты 7.6, 8.1 Правил клиринга на срочном рынке.</p> <p>Пункт 13.1 Правил клиринга на фондовом рынке.</p>	<p>Уточнено, что Участник клиринга помимо открытия для обособленного клиента клиентского Расчетного кода, вправе открыть Расчетный код ДУ, а также вправе изменить тип Брокерской фирмы ДУ на Обособленную Брокерскую фирму при условии, что такая Брокерская фирма ДУ связана с отдельным Расчетным кодом ДУ.</p> <p>Уточнено, что помимо отдельного Расчетного кода ДУ Участник клиринга должен открыть для Обособленного клиента отдельную Брокерскую фирму ДУ и связать такую Брокерскую фирму и такой Расчетный код на основании Запроса на регистрацию Обособленного клиента.</p>	<p>Участнику клиринга предоставляется право закрепить за Обособленным клиентом Расчетный код ДУ (Брокерскую фирму ДУ), изменить тип Брокерской фирмы ДУ на Обособленную Брокерскую фирму при условии, что такая Брокерская фирма ДУ связана с отдельным Расчетным кодом ДУ.</p>

Вступают в силу Правила клиринга

1. Часть I. Общая часть (далее – Часть I),
2. Правила клиринга. Часть II. Правила клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (далее – Часть II),
3. Правила клиринга. Часть III. Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (далее – Часть III),
4. Правила клиринга. Часть IV. Правила клиринга на срочном рынке (далее – Часть IV),
5. Правила клиринга. Часть VI. Правила клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ (далее – Часть VI)

за исключением:

1. В Части I:

- пунктов 32.7, 32.11,
продолжают действовать пункты 32.7, 32.11 Правил клиринга НКО НКЦ (АО). Часть I. Общая часть, утвержденных Наблюдательным советом НКО НКЦ (АО) от 13.04.2020 г. (Протокол № 17)
- подпунктов 32.11.2, 32.13.2,
- пунктов 41.9, 41.10,
о дате вступления в силу которых будет сообщено дополнительно.

2. В Части II:

- пунктов 22.2, 27.14,
- пункта 33.5, 42.14
продолжает действовать пункт 33.5 Правил клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Правила клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, утвержденных решением Наблюдательного совета НКО НКЦ (АО) от 26.06.2020 г. (Протокол № 22),
- пунктов 42.14, 45.14,
о дате вступления в силу которых будет сообщено дополнительно.

3. В Части IV:

- пунктов 32.10-32.12, 33.13-33.14, о дате вступления в силу которых будет сообщено дополнительно.

4. В Части VI:

- пунктов 4.5, 4.6.
- Статьи 14.

о дате вступления в силу которых будет сообщено дополнительно.

Изменения в Тарифы

1. Вступает в силу пункт 4.5 Раздела III, определяющий тарификацию по операциям Федерального казначейства на рынке РЕПО с ЦК.

Изменения в Формы и форматы документов и отчетов.

Изменения в Формы и форматы документов и отчетов. Часть I. Общая часть

1. Добавлен Запрос на изменение Расчетного кода (в части информации о наименовании фонда) (п. 2.8).
2. Внесены изменения в форму Заявления на регистрацию Обособленного клиента (п. 2.21).
3. Внесены изменения в следующие формы: Письмо-подтверждение о наличии фактического права на получаемый доход (п. 2.25), Письмо-подтверждение об отсутствии фактического права на получаемый доход (п. 2.26), Письмо-подтверждение о наличии у фактического получателя дохода фактического права на получаемый доход (п. 2.27), Анкета для налоговых целей (без применения ДИДН) (п. 2.28) и Анкета для налоговых целей (с применением ДИДН) (п. 2.29).
4. Добавлены форматы электронных документов запросов на открытие/закрытие Расчетного кода 2-го и 3-го уровней (п. 6.21-6.23).

Изменения в Формы и форматы документов и отчетов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов. Часть II.

1. Заявление об изменении статуса обеспечения перенесено из Общей части Форм и форматов документов и отчетов
2. Внесены изменения в форматы и бумажную версию отчета о премии EQM97 (п. 7.1.20 и п. 8.21 соответственно).

3. Добавлен новый код имущественного пула КСУ «GCMetal» (п. 2.4 и п. 6.2).

Изменения в Формы и форматы документов и отчетов на срочном рынке. Часть IV.

1. Внесены изменения в Заявление на открытие Брокерской фирмы (для Участника торгов), Заявление на открытие Обособленной Брокерской фирмы и Заявление на изменение типа брокерской фирмы (п. 2.2, 2.3 и 2.4 соответственно).
2. Добавлена новая форма Уведомления продавца о намерении поставки (на спот-рынке АО НТБ) (п. 2.35).
3. Удалено Заявление о соответствии Брокерской фирмы Торгово-клиринговому счету валютного рынка.
4. Внесены изменения в Отчет о заключенных Сделках (п. 3.1).
5. Внесены изменения в Отчет о заключенных опционных контрактах (п. 3.2).
6. Внесены изменения в Отчет о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Обеспечением, а также в Предварительный отчет о денежных средствах в рублях РФ, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Обеспечением (п. 3.7 и 3.8 соответственно).
7. Удален отчет о соответствии Брокерской фирмы Торгово-клиринговому счету валютного рынка.

Новые **XSLT-стили** и **XSD-стили** отчетов с тегом «28062021» доступны по ссылке [Торговые и клиринговые XML-отчеты](#)