|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  **Изменения** | **Пункт Правил клиринга** | **Описание изменений** | **Влияние на права и обязанности Участников клиринга** |
| 1. **Заключение внебиржевых сделок с драгоценными металлами**

(ожидается в 2020г) | Пункт 1.1., термин Внебиржевая сделка, статья 25, пункт 50.3 общей части Правил клиринга.По тексту Правил клиринга на валютном рынке | Предусмотрена возможность заключения Внебиржевых сделок с драгоценными металлами с Участниками клиринга / Провайдерами ликвидности. | У Участников клиринга появляется право заключения Внебиржевых сделок с драгоценными металлами. |
| 1. **Контроль за риском концентрации на эмитента**
 | Статья 2,пункты 8.2, 14.8, 22.8, статья 32, пункт 33.7, пункты 34.2-34.7, подпункт 34.8.1, пункт 34.10, статья 38, подпункты 54.2.1, 54.2.3, пункты 54.5, 55.11, подпункт 55.17.1, пункт 56.1 общей части Правил клиринга,пункты 1.7, 5.5 приложения №6 к общей части Правил клиринга | В целях контроля за риском концентрации на эмитента (группу ценных бумаг эмитента) Клиринговый центр каждому Участнику клиринга категории «Б», «В» или «О» открывает Расчетный код для учета Обеспечения под риск концентрации на эмитента, рассчитывает для такого Расчетного кода требование по обеспечению риска концентрации на эмитента, значение Единого лимита по риску концентрации на эмитента и определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования по риску концентрации на эмитента.Определен порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по риску концентрации на эмитента.Определен порядок внесения / возврата Обеспечения, вносимого в целях снижения риска концентрации на эмитента (группу ценных бумаг эмитента) аналогичный порядку внесения / возврата взносов в Гарантийные фонды, и Обеспечения под стресс, Обеспечения. | У участников клиринга возникает обязанность вносить обеспечение в целях снижения риска концентрации на эмитента (группу ценных бумаг эмитента). |
| 1. **Для Участников клиринга – Некредитных организаций предусмотрена возможность возврата драгоценного металла на банковский счет в драгоценных металлах, открытый в Клиринговом центре**
 | Термин «Счет для возврата обеспечения»общей части Правил клиринга | Внесены изменения, в соответствии с которыми Участники клиринга, не являющиеся кредитной организацией, вправе зарегистрировать в качестве Счета для возврата обеспечения в драгоценных металлах банковский счет в драгоценных металлах, открытый в Клиринговом центре. | Участники клиринга, не являющие кредитной организацией, вправе открыть банковский счет в драгоценных металлах в Клиринговом центре и зарегистрировать его в качестве Счета для возврата обеспечения в драгоценных металлах. |
| 1. **СПФС Банка России как еще одна система для обмена электронными документами между Участником клиринга и Клиринговым центром**

(ожидается в 2020г) | Пункты 3.14, 3.16 общей части Правил клиринга | Установлено, что обмен электронными документами между Участником клиринга и Клиринговым центром может осуществляться также посредством системы передачи финансовых сообщений Банка России (СПФС Банка России) в дополнение к ЭДО, Клиринговому терминалу, Web-клирингу, системе S.W.I.F.T. | У участников клиринга появляется возможность обмениваться с Клиринговым центром электронными документами через СПФС Банка России. |
| 1. **Отзыв лицензии на осуществление клиринговой деятельности у участника клиринга категории «О» как основание для приостановления допуска**
 | Пункт 13.2 общей части Правил клиринга | Отзыв (аннулирование) Банком России лицензии на осуществление клиринговой деятельности у Участника клиринга - Резидента, не имеющего лицензии Банка России на осуществление банковских операций (Участника клиринга категории «О») из оснований для прекращения допуска к клиринговому обслуживанию на биржевом рынке переведен в основание приостановления допуска к клиринговому обслуживанию. | Не влияет на права и обязанности участников клиринга. |
| 1. **Открытие собственного Расчетного кода для фондового рынка и рынка депозитов без заявления участника клиринга**
 | Подпункт 14.1.1 общей части Правил клиринга | Установлено, что процедура регистрации Участника клиринга, проводимая после заключения Клиринговым центром с Участником клиринга Договора об оказании клиринговых услуг, предусматривает присвоение (открытие) Участнику клиринга собственного Расчетного кода Участника клиринга для фондового рынка и рынка депозитов (без заявления Участника клиринга). | Данное изменение обеспечит то, что у Участника клиринга всегда будет иметься основной Расчетный код для списания комиссионных вознаграждений, т.к. без заявления Участника клиринга таким Расчетным кодом может быть назначен только собственный Расчетный код. |
| 1. **Внесены уточнения в порядок проведения процедуры передачи обязательств и Обеспечения**
 | Подпункты 14.15.1, 21.1.4, пункты 57.1, 57.2, подпункт 57.5.2, пункты 57.11, 57.12, 57.17-57.19 общей части Правил клиринга, пункт 7 приложения №6 к общей части Правил клиринга | Список оснований в отношении Базового Участника клиринга для осуществления Перевода обязательств и Обеспечения, указываемых в Заявлении на перевод обязательств и Обеспечения, дополнен за счет новых оснований приостановления допуска к клиринговому обслуживанию. Уточнено, что срок Процедуры Перевода обязательств и Обеспечения не может занимать более двух *рабочих* дней со дня ее начала в случае в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по иным основаниям (сейчас – Расчетных). Установлено, что вместо предоставления копии документа, подтверждающего полномочия лица, подписавшего Заявление на перевод обязательств и Обеспечения, предоставляется нотариально заверенное Заявление на перевод обязательств и Обеспечения.Определено, что Клиринговый центр после принятия к исполнению Заявления на перевод обязательств и Обеспечения устанавливает Режим урегулирования по Расчетному коду, открытому для Обособленного клиента, а также особенности установления Режима урегулирования при определенных условиях. Внесены изменения во Временной регламент в части сроков перевода обязательств и Обеспечения.Уточнены сроки передачи Обособленным клиентом Заявления на отзыв заявления на перевод обязательств и Обеспечения и Заявления на перевод обязательств и Обеспечения с указанием наименования нового Участника клиринга – реципиента. Определено, что в случае неполучения Клиринговым центром Согласия на прием обязательств и Обеспечения от Участника клиринга – реципиента, Клиринговый центр снимает Режим урегулирования по Расчетному коду, открытому для Обособленного клиента, без дополнительного заявления от Обособленного клиента. Установлено, что в Запросе на регистрацию Обособленного клиента – нерезидента указываются дополнительно SWIFT BIC-code (при наличии) или наименование (ФИО) и адрес Обособленного клиента.Установлено, что Клиринговый центр вправе отказать в исполнении Заявления на перевод обязательств и Обеспечения, если это приведет к нарушению Клиринговым центром законодательства. | Повышает защищенность Обособленных клиентов за счет:- расширения списка возможных оснований для проведения Процедуры Перевода обязательств и Обеспечения;- снижения рисков при подтверждении полномочий подписанта Заявления на перевод обязательств и Обеспечения.У Обособленного клиента появляется обязанность предоставлять Заявление на перевод обязательств и Обеспечения в более сжатые сроки в случае проведения Процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством.У Участника клиринга появляется обязанность в Запросе на регистрацию Обособленного клиента – нерезидента указывать дополнительную информацию. |
| 1. **Уточнение в порядок возврата обеспечения**
 | Подпункты 31.6.7, 31.6.8 общей части Правил клиринга  | Уточнено, что Запрос на возврат обеспечения, содержащий сумму денежных средств / количество драгоценного металла и содержащий информацию, указывающую на необходимость одновременной передачи Профиля актива, не исполненный сразу после его получения по причине несоблюдения условий для возврата, не выполняется и аннулируется. | Не влияет на права и обязанности участников клиринга. |
| 1. **Определены дополнительные проверки, выполняемые при замене Торгового-клирингового счета в сделках по запросу Участника клиринга**
 | Подпункт 39.8.3 общей части Правил клиринга | Установлены следующие дополнительные правила замены Торгово-клиринговых счетов, при соблюдении которых исполяется Запрос на замену Торгово-клирингового счета:* Торгово-клиринговый счет, указанный в запросе, которому соответствует Торгово-клиринговый счет имущественного пула, может быть заменен только на Торгово-клиринговый счет, которому соответствует Торгово-клиринговый счет имущественного пула, имеющий такой же признак, определяющий соответствующий имущественный пул, как и признак Торгово-клирингового счета имущественного пула, соответствующего Торгово-клиринговому счету, указанному в запросе;
* Торгово-клиринговый счет 1-го уровня, указанный в запросе / соответствующий Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в запросе, в состав которого входит клиентский Расчетный код, в случае если по такому Торгово-клиринговому счету учитываются обязательства по Сделкам с облигациями Банка России, может быть заменен на Торгово-клиринговый счет 1-го уровня / Торгово-клиринговый счет 2-го или 3-го уровня, соответствующий Торгово-клиринговому счету 1-го уровня, в состав которого входит собственный Расчетный код, только в случае, если Участник клиринга является кредитной организацией.
 | Не влияет на права и обязанности участников клиринга, так как данные проверки обеспечивают сохранение действующих ограничений, которые контролируются при подаче заявки и заключении сделки. |
| 1. **Определена обязанность Участника клиринга по возмещению имущественных потерь Клирингового центра при выполнении Клиринговым центром функций налогового агента в отношении такого Участника клиринга и/или его клиентов.**
 | Пункт 41.13 общей части Правил клиринга | Определено, что Участник клиринга обязуется возместить имущественные потери Клирингового центра (включая все применимые налоги, штрафы и пени) в случае, если налоговые органы предъявят к Клиринговому центру требования из-за неудержания (неуплаты) налогов и/или удержания (уплаты) налогов в меньшем размере при выполнении Клиринговым центром функций налогового агента в отношении такого Участника клиринга и/или его клиентов. | У Участника клиринга появляется обязанность возместить имущественные потери Клирингового центра в случае, если налоговые органы предъявят к Клиринговому центру требования из-за неудержания (неуплаты) налогов и/или удержания (уплаты) налогов в меньшем размере при выполнении Клиринговым центром функций налогового агента в отношении такого Участника клиринга и/или его клиентов. |
| 1. **Взимание с Участников клиринга новых комиссионных вознаграждений в пользу Технического центра**
 | Пункты 55.1, 55.4-55.7, 55.9-55.11, подпункт 55.17.1, пункты 55.18, 55.20 общей части Правил клиринга  | Определен порядок взимания следующих новых видов комиссионных вознаграждений, взимаемых Клиринговым центром с Участников клиринга, и порядок их взимания:* в пользу Технического центра на основании договора, заключенного с Техническим центром:
* вознаграждение за технологические услуги, связанные с получением и использованием электронной подписи в соответствии с Условиями участия в системе электронного документооборота ПАО Московская Биржа;
* плата за оказание технологических услуг в соответствии с Правилами оказания услуг в области информационных технологий в Зоне колокации ПАО Московская Биржа, связанные с размещением оборудования клиентов в Зоне колокации Московской Биржи;
* плата за оказание технологических и(или) информационных услуг в соответствии с Условиями оказания услуг информационно-технического обеспечения ПАО Московская Биржа

Вознаграждение Технического центра определяется в дату оказания услуги – для ежедневных комиссионных вознаграждений, в месяц оказания услуг в дату, установленную соответствующими тарифами, - для ежемесячных комиссионных вознаграждений, взимается с Участника клиринга в день его определения. | К новым видам комиссионных вознаграждений применяется действующий для других видов комиссионных вознаграждений, автоматизированный порядок взимания. |
| 1. **Порядок выбора тарифных планов участниками торгов и участниками клиринга**
 | Подпункт 55.15.2 общей части Правил клиринга | Уточнено, что выбор или изменение тарифного плана, предусмотренного Тарифами Биржи, осуществляется Участником торгов, а выбор или изменение тарифного плана, предусмотренного Тарифами Клирингового центра осуществляется Участником клиринга. | Не влияет на права и обязанности участников клиринга. |
| 1. **Дополнительное основание для проведения ликвидационного неттинга по решению Клирингового центра**
 | Пункт 59.5 общей части Правил клиринга  | Установлено, что в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга, допуск к клиринговому обслуживанию которого приостановлен, обязательств по Сделкам, Маржинального требования и/или иных обязательств Участника клиринга, возникших из Правил клиринга, или в случае, если в отношении Участника клиринга, допуск к клиринговому обслуживанию которого приостановлен, имеется информация о наступлении события, которое не позволит Участнику клиринга исполнять указанные обязательства, Клиринговый центр вправе принять решение о проведении процедуры ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга.В случае принятия указанного решения Клиринговым центром обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, следующую за датой принятия указанного решения.Клиринговый центр посредством ЭДО уведомляет Участника клиринга о принятии соответствующего решения не позднее дня принятия указанного решения. | У Клирингового центра появляется право проводить ликвидационный неттинг в отношении Участника клиринга по еще одному основанию.  |

**Изменения в Тарифы**

1. С 01.01.2020 г. изменен порядок взимания комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения в иностранной валюте: вместо эффективной ставки, рассчитываемой НКЦ, установлены ставки комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового / иного обеспечения:

- в евро: ставка ЕЦБ на последний день месяца оказания услуг (в% годовых) + (-0,2%) годовых;

- в швейцарских франках: ставка Нац. Банком Швейцарии на последний день месяца оказания услуг (в % годовых) + (-0,5%) годовых. (Раздел II п.3, сноски 3, 4)

1. Введено комиссионное вознаграждение по сделкам с облигациями федерального займа и еврооблигациями, заключенным в Режиме торгов крупными пакетами ценных бумаг (Раздел III п.3.4)

|  |  |
| --- | --- |
| по 16.06.2020  | 0.001062% \* объем сделки |
| с 17.06.2020 | 0.002125% \* объем сделки |

1. Установлен срок действия маркетингового периода по сделкам спот по инструментам USDRUB\_TDB, USDRUB\_TMB, EURRUB\_TDB и EURRUB\_TMB по сделкам мейкера и по сделкам тейкера: по 01.09.2020 г. (Раздел IV п.1.3, 1.4)
2. Введено комиссионное вознаграждение за клиринг по Внебиржевым сделкам спот с иностранной валютой с Участниками клиринга:

- по сделкам тейкера: в российских рублях, взимается с каждого Участника клиринга - стороны по сделке, в первый рабочий день месяца, следующего за календарным кварталом, в котором Участник клиринга являлся стороной хотя бы по одной сделке тейкера (1 000);

- по сделкам мейкера: в процентах от объема каждой сделки в сопряженной валюте, взимается с каждого Участника клиринга - стороны по сделке, но не менее 0,43 рубля (0,0016). (Раздел IV п.3)

1. Введено комиссионное вознаграждение за клиринг по Внебиржевым сделкам своп с иностранной валютой с Участниками клиринга (в процентах от объема каждой сделки в сопряженной валюте, взимается с Участника клиринга-стороны по сделке, заключившего Внебиржевую сделку своп с иностранной валютой, ставка - в зависимости от срока исполнения сделки своп). (Раздел IV п.4)
2. Введено комиссионное вознаграждение за клиринг при исполнении фьючерсных контрактов, за один контракт:

- на природный газ – 1 руб.

- на ставку RUSFARUSD – 2 руб. (Раздел V п.9)

1. В связи с истечением срока действия исключена премия по фьючерсным контрактам на нефть BRENT и (или) расчетным фьючерсным контрактам на золото. (Раздел V п.6, сноски 1, 2)

**Изменения в Формы и форматы документов и отчетов**

**Часть I. Общая часть**

1. Добавлено описание формата нового отчета – Отчета об Обеспечении под риск концентрации на эмитента (EQM94).
2. В Отчет о Расчетных кодах (CCX98), предоставляемый по запросу, направленному участником по ЭДО или web-клиринг, добавлено 2 поля: обязательное поле «TYPE» - тип Расчетного кода (S, L, D) и необязательное поле «FUND\_NAME» - наименование фонда (заполняется в случае указания участником наименования фонда при открытии Расчетного кода).
3. Описание действующего формата Уведомления о списании и зачислении на Счет обеспечения (CCX97) дополнено отдельным описанием для платежного поручения и для мемориального ордера.
4. Добавлен Запрос на замену Торгово-клирингового счета (формат REPTRA), предоставляемый по ЭДО. В ближайшее время аналогичный запрос будет реализован в web-клиринг. Запрос действует для ТКС Т+ в случае необходимости замены ТКС Т+ в сделке.
5. Запрос о выборе (смене) тарифного плана предусматривает возможность установки отдельных Тарифных планов для Участников клиринга и Участника торгов. (Данный запрос доступен для предоставления на бумаге, формат ЭДО/ подача через web-клиринг будут реализованы позже).

**Часть II. Формы и форматы документов и отчетов на фондовом рынке и рынке депозитов**

1. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06) – для удобства выгрузки информации о сделках в разрезе Расчетных кодов дополнена нодой «SETTLE» - блок информации по Расчетному коду и полем ExtSettleCode - Расчетный код.

В рамках функционала «компрессия депозитов» добавлен InfType «7» - Объединенные заявки на заключение депозитных договоров, внесенные в реестр предложений и в ноду RECORDS добавлено поле «TradeMergeNo» - номер депозитного договора, заключенного на основании объединенных заявок на заключение депозитных договоров, внесенных в реестр предложений. Данные изменения по «компрессии депозитов» также внесены в отчет EQM6C для участников рынка депозитов, являющихся ДУ.

1. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (для номинальных держателей) (EQM6D) – для удобства выгрузки информации о сделках в разрезе Расчетных кодов и/или ТКС дополнена нодой «SETTLE» - блок информации по Расчетному коду и полем ExtSettleCode - Расчетный код, нодой «TRDACC» - блок информации по Торгово-клиринговому счету и полем «TrdAccId» - код Торгово-клирингового счета.

С даты релиза отчет EQM6D доступен для формирования не только по счетам номинального держателя Держателя, но и по счетам номинального держателя Участника клиринга (в случае направления Заявление о предоставлении отчета EQM6D).

1. В связи с отказом от сервиса «Клиринговые банки» исключен отчет EQM6B для Клиринговых банков.
2. В Отчете о маржинальных требованиях (EQM14) предусмотрен новый тип в поле ExtSettleCodeType: «4» – Расчетный код для учета Обеспечения под риск концентрации на эмитента.
3. В случае внесения Обеспечения под риск концентрации на эмитента информация о таком обеспечении будет включена в Отчет об оценке обеспечения (EQM84).

**Часть III. Формы и форматы документов и отчетов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов**

1. В Отчете о Клиринговых идентификаторах (CCX19) информация о допуске к внебиржевым инструментам (поле OTCId) вынесена в отдельную ноду «OTCID» - блок данных о доступе к Внебиржевым сделкам.
2. Выписка из реестра Предложений (CCX122), Выписка из реестра Внебиржевых сделок с иностранной валютой (CCX123) дополнены новым типом TradeGroup «W» – Предложение на заключение Внебиржевой сделки своп/ своп контракта.
3. В рамках запуска проекта «Аукционы RFS» добавлено описание форматов новых отчетов:

- Выписка из реестра незарегистрированных Предложений (CCX124)

- Выписка из реестра Аукционов RFS (CCX125)