

Изменения в клиринге на рынке СПФИ

С 21.12.2020г. в клиринге на рынке СПФИ осуществлены изменения, связанные с технологией «Единый пул обеспечения» и предоставляющие новые возможности для участников рынка.

Все Расчетные коды, открытые на рынке СПФИ, получили статус Расчетных кодов Единого пула обеспечения.

Для этого автоматически, без каких-либо действий со стороны Участника клиринга, в отошении каждого Расчетного кода на рынке СПФИ:

- на фондовом рынке был открыт Расчетный код с номером, соответствующим номеру Расчетного кода на рынке СПФИ;
- открытому на фондовом рынке Расчетному коду был присвоен признак Единого пула и было распространено его действие на рынок СПФИ.

❖ Порядок начисления процентов на обеспечение по такому Расчетному коду описан в разделе **Начисление процентов на обеспечение**

Также у Участников клиринга на рынке СПФИ появилась возможность вносить ценные бумаги в обеспечение и управлять Единым пулом обеспечения

Для того, чтобы воспользоваться всеми преимуществами технологии Единого пула:

- а. Использовать единый счет на разных рынках,
- б. Использовать единое обеспечение,
- с. Использовать ценные бумаги и другие активы, принимаемые в обеспечение, для обеспечения сделок на рынке СПФИ,
- д. Осуществлять неттинг при проведении расчетов на всех рынках по Расчетному коду Единого пула,

а также для возможности вносить в качестве обеспечения ценные бумаги необходимо открыть 36-ой торговый раздел и зарегистрировать на фондовом рынке ТКС, в состав которого будет входить такой торговый раздел и соответствующий Расчетный код Единого пула.

Подробное описание преимуществ и порядка использования технологии Единого пула приведено на сайте НКЦ в разделе [«Клиринг. Клиринговые технологии. Единый пул обеспечения»](#), включая методичку [«Как работать с Единым пулом обеспечения»](#).

Основные изменения, затрагивающие всех участников клиринга рынка СПФИ

❖ Учет обеспечения

Обеспечение учитывается на Расчетном коде Единого пула в Торгово-клиринговой системе фондового рынка, при этом в Торгово-клиринговую систему рынка СПФИ передается часть Единого лимита с фондового рынка в виде *профиля актива*.

Внесение, перевод и возврат обеспечения

Реквизиты счетов НКЦ для внесения обеспечения в денежных средствах на рынок СПФИ не меняются. Порядок действий участника клиринга для внесения, перевода и возврата обеспечения не меняется.

В случае указания в назначении платежа рынка ОТС в соответствии с действующим порядком (п.8.3.6, 8.3.7 методички [«Как работать с Единым пулом обеспечения»](#)). Обеспечение вносится на Расчетный код Единого пула и учитывается в Торгово-клиринговой системе фондового рынка, одновременно на рынок СПФИ передается профиль актива.

Перевод обеспечения с РК списания на РК зачисления на рынке СПФИ, где учитывается только профиль активов, осуществляется через Торгово-клиринговую систему фондового рынка (п.11. методички [«Как работать с Единым пулом обеспечения»](#)).

Возврат обеспечения осуществляется с фондового рынка. При возврате обеспечения необходимо указать рынок СПФИ, тогда профиль актива сначала будет передан с Расчетного кода Единого пула на рынке СПФИ на Расчетный код Единого пула на

фондовом рынке, и с фондового рынка будет произведен возврат обеспечения (п.9 методички «[Как работать с Единым пулом обеспечения](#)»).

❖ **Начисление процентов на обеспечение**

Алгоритм начисления процентов не меняется, однако проценты на обеспечение начисляются только при одновременном выполнении следующих условий:

- Расчетный код используется только для рынка СПФИ;
- Расчетный код Единого пула не входит в состав Торгово-клирингового счета для заключения депозитных договоров;
- Участник клиринга не имеет возможности вносить в Обеспечение ценные бумаги, т.е. в состав ТКС Единого пула не входит 36-ой торговый раздел.

Начисление и выплата процентов осуществляется, как и прежде, только на обеспечение в Российских рублях.

Информация о начисленных процентах на обеспечение отражается в **Отчете о движении денежных средств (ССХ99_EQ1)**, предоставляемом по фондовому рынку каждый Расчетный день после 23:50.

Внимание: в Клиринговом отчете рынка СПФИ проценты на обеспечение больше не отражаются.

❖ **Исполнение обязательств**

Исполнение обязательств осуществляется в Торгово-клиринговой системе фондового рынка. Время исполнения обязательств не меняется и соответствует Временному регламенту (Приложение №6 к [Правилам клиринга](#), Общая часть). В случае неисполнения Итоговых нетто-обязательств с участником будут заключаться сделки урегулирования своп и/или РЕПО.

Информацию по Итоговым нетто-обязательствам Участник клиринга будет получать в Отчете об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях (EQM13), предоставляемом в соответствии с приведенным выше Временным регламентом. (п.12 методички «[Как работать с Единым пулом обеспечения](#)»).

❖ **Маржинальные требования**

Порядок выставления и исполнения маржинальных требований не меняется.

❖ **Отчеты**

В связи с включением рынка Стандартизированных ПФИ в контур Единого пула участники клиринга на рынке СПФИ также получают клиринговые отчеты фондового рынка:

- ✓ Отчет о переданных профилях активов на фондовом рынке (EQM49);
- ✓ Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях (EQM13);
- ✓ Отчет о Торгово-клиринговых счетах (EQM20).

Полный список отчетов фондового рынка приведен на сайте НКЦ в разделе «Клиринг. Клиринговые отчеты».

Отчет о движении денежных средств (ССХ99) по Расчетным кодам Единого пула будет формироваться на фондовом рынке и включать обязательства/ требования, переданные в Торгово-клиринговую систему фондового рынка с рынка СПФИ.

С форматами отчетов можно ознакомиться на сайте НКЦ по ссылке

<https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/020416>.