Изменения в клиринге на рынке СПФИ с 29.07.2019

НКЦ реализует проект «Единый клиринг на рынке СПФИ», предоставляющий новые возможности для Участников клиринга на рынке СПФИ, включая переводы денежных средств между рынками и включение СПФИ в Единый пул обеспечения.

Изменения в клиринге рынка СПФИ планируется внедрить поэтапно в мае-июле 2019 г.

**Этап 2. Включение рынка СПФИ в Единый пул** с 29.07.2019:

1. Возможность присоедннения Расчетного кода рынка СПФИ к Расчетному коду Единого пула обеспечения, что позволит осуществлять передачу профилей российских рублей, долларов США и евро между рынком СПФИ и всеми другими рынками, включенными в контур проекта «Единый пул обеспечения»: в настоящее время это фондовый, валютный и срочный рынки.

Время исполнения обязательств в иностранных валютах по Расчетным кодам, являющимся Расчетными кодами Единого пула, будет синхронизировано в соответствии с временным регламентом, действующим в настоящее время на других рынках (предусмотренным Приложением 6 к [Общей части Правил клиринга](https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/020415/76)).

При этом время исполнения обязательств по Расчетным кодам, не являющимся Расчетными кодами Единого пула, – сохраняется в соответствии с текущим временным регламентом на рынке СПФИ.

С подробной информацией по работе с Единым пулом обеспечения можно ознакомиться на странице сайта НКЦ, посвящённой проекту [«Единый пул обеспечения»](https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/020902).

1. Проведение клиринговой сессии mark-to-market на рынке СПФИ с 19:00 до 20:00. При этом расчётная клиринговая сессия, проводимая в настоящее время с 17:00 до 18:00, сохраняется.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Клиринговая процедура** | **Расчетная клиринговая сессия в 17:00** | **Клиринговая сессия mark-to-market в 19:00** |
| Определение денежных обязательств, включая обязательства по Вариационной марже и Депозитной марже, процентам по ДМ, комиссии и т.п. | Осуществляется | Нет |
| Перерасчет уровня обеспеченности позиций УК по риск-параметрам, установленным (измененным) в ходе данной клиринговой сессии | Нет | Осуществляется |
| Изменение центральных курсов иностранных валют и ставок риска роста / падения центральных курсов для расчёта уровня обеспеченности позиций УК | Нет | Осуществляется |
| Выставление Маржинальных требований | Нет | Осуществляется |

* При этом время исполнения Маржинальных требований остается без изменений – до 16:00 Расчетного дня, следующего за днём возникновения Маржинального требования.
* Клиринговый отчет будет предоставляться дважды: после 18:00 и после проведения клиринговой сессии mark-to-market. Во втором Клиринговом отчете будет отражена информация о новом размере требования к Обеспечению, о наличии и размере Маржинального требования по итогам клиринговой сессии mark-to-market.
* Указанные изменения не повлияют на бухгалтерский учет Участников клиринга.