

## Изменения в Правила клиринга и Формы и Форматы документов и отчётов

С 26.06.2022 г. вступает в силу новая редакция следующих документов НКЦ:

### В части Правил клиринга:

Правила клиринга. Часть I. Общая часть;

Правила клиринга. Часть II. Правила клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;

Правила клиринга. Часть III. Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;

Правила клиринга. Часть IV. Правила клиринга на срочном рынке;

Правила клиринга. Часть VII. Уровни защиты центрального контрагента и меры, направленные на ограничение размера ответственности Клирингового центра

### за исключением:

1. В Правилах клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов:

- норм в отношении Порядка передачи доходов по сделкам РЕПО с Банком России, заключенных без участия центрального контрагента;
- норм в отношении добавления возможности подачи Участником клиринга Намерений на заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагам

*о дате вступления в силу которых будет сообщено дополнительно*

2. В Правилах клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ:

- норм в отношении частичного метчинга

*о дате вступления в силу которых будет сообщено дополнительно*

Основные изменения представлены в таблице ниже:

№ п/п	Изменения	Нормы ПК	Описание изменений	Влияние на права и обязанности Участников клиринга
1)	<b>Изменения, направленные на обеспечение возможности заключения отдельных сделок нерезидентами</b>	Ст. 2, п. 10.1, п.п. 13.10-13.13, п.14.20, п. 16.4, пп. 16.10.1, пп.16.16.3, п.17.13, п.17.14, п. 21.4, пп. 27.15.5, пп. 27.16.1, п. 27.19, пп. 39.8.3, п.42.1, п. 42.2, пп.46.3.2, п.47.2, пп. 48.5.1, п.49.2, п.55.8 ОЧПК  П. 6.9, п. 7.8, п. 11.10, п. 11.11, п. 12.3, пп. 14.1.1, пп. 14.1.2, п.14.2 ПК ФР	Изменения предполагают: - введение отдельной категории Участников клиринга – лиц, которым открыты ТКС нерезидента; - открытие Участникам клиринга-нерезидентам и Участникам клиринга - резидентам, являющимися стороной сделок, заключенных по поручению клиентов-нерезидентов, РК/ТКС нерезидента 1-го уровня и, при необходимости, 2-го и 3-го уровня; - на Фондовом рынке для таких Участников клиринга формируется отдельный клиринговый пул; - предусмотрена возможность учета обеспечения в российских рублях на клиринговом банковском счете типа «С», открытом Клиринговому центру; - установлено право НКО НКЦ (АО) ограничить перечень сделок и активов, учитываемых на таких ТКС; - предусмотрена возможность установить особенности исполнения обязательств нерезидентами или в их интересах при получении разрешения Банка России или Правительственной комиссии.	Изменения влияют на права и обязанности Участников клиринга-нерезидентов и Участников клиринга - резидентов, становящихся стороной сделок по поручению клиентов-нерезидентов.

2)	<b>Определен порядок передачи доходов по сделкам РЕПО с Банком России, заключенных без участия центрального контрагента</b>	Ст. 1, 47, п. 21.1, 21.3, 41.1 ПК ФР	Изменения предусматривают определение порядка передачи Доходов по сделкам РЕПО, заключенным с Банком России без участия центрального контрагента в отдельных Режимах торгов.	Изменения затрагивают права Участников клиринга по получению Дохода и обязанности по его передаче.
3)	<b>Добавление возможности подачи Участником клиринга Намерений на заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагам</b>	П. 18.5-18.10, 18.12-18.13 ПК ФР	Изменения предусматривают: - формулировку понятия Намерения на заключение Внебиржевых сделок как сообщения, содержащего приглашение делать оферты, которое носит исключительно информационный характер и не является офертой на заключение Внебиржевой сделки с ценными бумагами; - определение обязательных реквизитов Намерения на заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами; - установление порядка подачи Намерения на заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами; - определение порядка проверки возможности регистрации Намерения на заключение Внебиржевых сделок в Клиринговой системе.	Изменения предусматривают возникновение у Участника клиринга права на подачу в Клиринговую систему нового типа сообщений – Намерений на заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами.
4)	<b>Определение порядка взимания платы за услугу Клирингового центра по предоставлению отчетов о Внебиржевых сделках, заключенных в Режиме торгов «Двусторонние сделки с ЦК»</b>	п. 18.25, 48.1, 48.11 ПК ФР	Изменения предусматривают: - раскрытие понятия платы за услугу Клирингового центра по предоставлению отчетов о Внебиржевых сделках, заключенных в Режиме торгов «Двусторонние сделки с ЦК»; - определение порядка взимания Клиринговым центром указанной платы с Участников клиринга.	Изменения предусматривают снятие с Участника клиринга обязанности по осуществлению платежа в счет оплаты услуги по предоставлению отчетов о Внебиржевых сделках, заключенных в Режиме торгов «Двусторонние сделки с ЦК» в связи с тем, что указанная плата будет удерживаться Клиринговым центром с основного Расчетного кода Участника клиринга для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга. Изменения предусматривают возникновение у Участника клиринга обязанности по предоставлению Клиринговому центру реквизитов в системе ЭДО, аккредитованной Федеральной налоговой службой.
5)	<b>Расширен перечень предметов обязательств из сделок с иностранной валютой</b>	Приложение №6 к ОЧПК	Изменения предусматривают добавление новых видов валют (узбекских сум, армянских драмов, дирхамов ОАЭ), являющихся предметом обязательств из сделок с иностранной валютой во временной регламент Клирингового центра.	Изменения наделяют Участников клиринга правами по заключению сделок с новыми видами предметов обязательств.

6)	<b>В отношении юаней изменен временной интервал приема Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов на возврат обеспечения, Запросов на депонирование, а также приема Клиринговым центром от НКО АО НРД Запросов на получение денежных средств</b>	Приложение №6 к ОЧПК	Временной интервал приема Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов на возврат обеспечения, Запросов на депонирование, а также приема Клиринговым центром от НКО АО НРД Запросов на получение денежных средств в отношении юаней продлен до 13.00 Расчетного дня.	Изменения наделяют Участников клиринга правом подавать Запросы на возврат обеспечения в целях возврата денежных средств из Обеспечения / Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс и Запросы на депонирование в отношении юаней до 13.00 Расчетного дня.
7)	<b>Уточнены временные интервалы подачи Предложений / Намерений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами в зависимости от режима</b>	Приложение №2 к ПК ФР	Изменения предусматривают установление различных временных интервалов подачи Предложений / Намерений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами для режимов «Сделки с ЦК», «Встречный аукцион с ЦК», «Двусторонние сделки с ЦК».	Изменения затрагивают права Участников клиринга, связанные с возможностью подачи Предложений / Намерений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами.
8)	<b>Разработан новый Отчет об изменении суммы депозита</b>	п. 35.24, 49.2 ПК ФР	Изменения предусматривают включение в состав документов, удостоверяющих изменение суммы депозита в связи с частичным изъятием суммы депозита, а также содержащих информацию о процентной ставке по депозитному договору, Отчета об изменении суммы депозита.	Изменения не оказывают влияния на права и обязанности Участников клиринга.
9)	<b>Частичный метчинг на рынке СПФИ</b>	п. 13.3, 13.9 ПК СПФИ	Изменения предусматривают возможность заключения Договоров СПФИ на основании Предложений, условия которых могут быть не полностью идентичными по объему.	Изменения оказывают влияние на права и обязанности Участников клиринга: у Участников клиринга появляется новая возможность заключать Договоры СПФИ на основании Предложений, не совпадающих по объему.

С 27.06.2022 г. вступает в силу новая редакция следующих документов НКЦ:

### **В части Форм и форматов документов и отчётов**

#### **Формы и форматы документов и отчётов. Часть I. Общая часть.**

1. В связи с запуском торгов и расчетов для нерезидентов с использованием счетов типа «С»:
  - 1.1. Внесены изменения в форму Запроса на открытие Расчетного кода (п. 2.7);
  - 1.2. Добавлена форма нового Запроса на присвоение / отмену статуса Расчетного кода нерезидента (п. 2.14);
  - 1.3. Внесены изменения в форму Заявления об использовании Расчетного кода для заключения сделок за счет обеспечения, переданного клиентом в собственность на основании соглашения о передаче прав собственности на обеспечение (п. 2.12);

- 1.4. Внесены изменения в форму Заявления об изменении типа Расчетного кода для заключения сделок за счет обеспечения, переданного клиентом в собственность на основании соглашения о передаче прав собственности на обеспечение» (п. 2.13);
2. Внесены изменения в форму Запроса на возврат обеспечения в иностранной валюте (документ CURRETURN) (п. 5.2.2).
3. Внесено уточнение в форму Постоянного поручения на возврат обеспечения (п. 2.21).
4. Добавлена печатная форма Отчета о Расчетных кодах и реквизитах Участника клиринга (форма ССХ98) (п. 6.8)

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

1. В связи с запуском торгов и расчетов для нерезидентов с использованием счетов типа «С»:
  - 1.1. Внесены изменения в форму Запроса на открытие Торгово-клирингового счета (п. 2.1);
  - 1.2. Добавлена форма нового Запроса на закрытие Торгово-клирингового счета (п. 2.2);
  - 1.3. Внесены уточнения в форму Запроса на открытие торгово-клирингового счета (в файле заданного формата txt) (п. 6.1);
  - 1.4. Внесены уточнения в форму Заявления о соответствии Торгово-клирингового счета (п. 2.10);
  - 1.5. Внесено уточнение в форму Заявления о соответствии Торгово-клиринговых счетов по умолчанию (п. 2.11).
2. Удален раздел 7.2. «Отчеты, предоставляемые Участникам клиринга – Некредитным организациям, не являющимся профессиональными участниками рынка ценных бумаг», отчеты перенесены в раздел 7.1. «Отчеты, предоставляемые Участникам клиринга, Участникам торгов» в связи с допуском профучастников к рынку депозитов.
3. Внесено уточнение в форму Постоянного поручения на возврат обеспечения (п. 2.12).