

Изменения в Правила клиринга

С 31.07.2023 г. вступает в силу новая редакция:

Правил клиринга. Часть I. Общая часть;

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

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

Правил клиринга. Часть VI. Правила клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ;

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

Основные изменения представлены в таблице ниже:

№ п/п	Изменения	Нормы ПК	Описание изменений	Влияние на права и обязанности Участников клиринга
1)	Обеспечение возможности устанавливать различные ставки, используемые в сделках переноса и при расчете штрафа за ненадлежащее исполнение денежных обязательств	п. 26.8.1 ОЧ ПК	Изменения предусматривают нормативное разделение ставок за сделки переноса и за штраф за ненадлежащее исполнение денежных обязательств.	Предлагаемые изменения позволяют Участникам клиринга сократить издержки по оплате штрафа в связи с установлением различных ставок, используемых в сделках переноса и при расчете штрафа за ненадлежащее исполнение денежных обязательств.
2)	Введение права НКО НКЦ (АО) своим решением ограничивать перечень валют, ценных бумаг, драгоценных металлов, с которыми возможно заключение сделок переноса	п. 44.7 ОЧ ПК	Введение права НКО НКЦ (АО) своим решением ограничивать перечень иностранных валют, ценных бумаг, драгоценных металлов, с которыми возможно заключение сделок своп и купли-продажи, заключаемых при наличии неисполненного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в денежных средствах.	Предлагаемые изменения косвенно влияют на права и обязанности Участников клиринга, так как часть обеспечения может не использоваться при заключении сделок переноса и приводить к возникновению Задолженности у Участника клиринга.
3)	Предоставление возможности допуска новых Участников клиринга к Депозитам с ЦК	п. 13.9.1, 14.2.4, 14.3, 14.4., Приложение № 4 (п.8), Приложение № 5 к ОЧ ПК дополнено п. 8-10, правка п. 11 ОЧ ПК	Изменения предусматривают: - введение новых категорий Участников клиринга, являющихся резидентами и некредитными организациями: ✓ Организатор торгов, ✓ Клиринговая организация, ✓ Рейтинговое агентство; - введение новых требований к новым категориям Участников клиринга в части допуска к Депозитам с ЦК, таких как: ✓ наличие лицензии на осуществление деятельности, ✓ соблюдение установленных обязательных нормативов достаточности капитала, ✓ нахождение в реестре кредитных рейтинговых агентств.	Изменения влияют на права Участников клиринга, предоставляя право новым юридическим лицам становиться Участниками клиринга с возможностью допуска к Депозитам с ЦК.
4)	Изменение размера штрафа за заключение закрывающих сделок, а также цены сделок переноса РЕПО, заключаемых с недобросовестными Участниками клиринга	п. 26.8.1, 46.3.6, 49.1.5 ОЧ ПК	Изменения предполагают: - корректировку формулы расчета суммы штрафа, взимаемого Клиринговым центром с Участников клиринга при заключении закрывающих сделок: «рыночная» ставка заменяется на фиксированную величину (0,1% от суммы закрывающей сделки). - увеличение на 10% цены сделки переноса РЕПО, заключаемой в случае наличия неисполненных Итоговых нетто-обязательств в ценных бумагах.	Предлагаемые изменения оказывают влияния на права и обязанности Участников клиринга в части изменения размера штрафа за заключение закрывающих сделок, а также цены сделок переноса РЕПО, заключаемых с

				недобросовестными Участниками клиринга.
5)	Установление возможности перевода Участника клиринга из категории «Б2» в категорию «Б» или «О» без заявления Участника клиринга	п. 14.29.5 ОЧ ПК	Изменения предоставляют право Клиринговому центру изменять категорию Участника клиринга с категории «Б2» на категорию «Б» или «О» при соответствии необходимым требованиям без заявления Участника клиринга.	Предлагаемые изменения оказывают влияние на права и обязанности Участников клиринга, предоставляя Клиринговому центру возможность повышать категорию Участника клиринга при соответствии необходимым требованиям без заявления Участника клиринга.
6)	Уточнение срока предоставления обновленного списка аффилированных лиц для определенных Участников клиринга (Корпораций-резидентов и МФО)	Прил. № 5 к ОЧ ПК	Уточнение предполагает, что Участники клиринга (Корпорации-резиденты и МФО) представляют Клиринговому центру справку об аффилированных лицах по форме, установленной Порядком предоставления информации и отчетности, на полугодовой основе, вместо ранее указанного периода – ежеквартально.	Предлагаемые изменения влияют на права и обязанности Участников клиринга ввиду изменения сроков предоставления списка аффилированных лиц.
7)	Введение требований к финансовому состоянию лиц, дающих гарантийное письмо	п. 14.4.8.1 ОЧ ПК	Вводятся требования к финансовому состоянию лиц, дающих гарантийное письмо в отношении недавно образованных Участников клиринга.	Предлагаемые изменения влияют на права и обязанности Участников клиринга, определяя дополнительные требования к финансовому состоянию лиц, дающих гарантийное письмо в отношении недавно образованных Участников клиринга.
8)	Уточнение требований к Участникам клиринга, в состав акционеров которого входят государственные органы / государственные корпорации, прямо или косвенно контролирующие более 50% (плюс одна акция) долей Участника клиринга, либо к Участнику клиринга, имеющему статус государственной корпорации (государственные компании)	п. 14.3.3, 14.3.4, 14.3.5 ОЧ ПК	Изменения распространяют на государственные компании те же требования для допуска к клиринговому обслуживанию, что действуют и для других компаний, не являющихся государственными.	Предлагаемые изменения в отношении повышения требований к Участникам клиринга могут привести к изменению категории Участников клиринга – государственных компаний, что повлияет на их права и обязанности.
9)	Уточнение процедуры дефолт-менеджмента в рамках маржинальных требований по Обеспечению под стресс / Гарантийному фонду	п. 36.9 ОЧ ПК	Уточнение предусматривает, что приоритетный ТКС для исполнения маржинальных требований по Обеспечению под стресс / Гарантийному фонду может иметь тип только собственный.	Предлагаемые изменения влияют на права и обязанности Участников клиринга.
10)	Возможность раскрытия реквизитов для зачисления обеспечения путем уведомления Участников клиринга по ЭДО	п. 3.9 ОЧ ПК	Уточнение предусматривает возможность раскрытия реквизитов счетов Клирингового центра для зачисления обеспечения путем уведомления Участников клиринга по ЭДО.	Предлагаемые изменения не влияют на права и обязанности Участников клиринга.
11)	Уточнение, что согласие лиц, указанных в документах физ. и юр. лиц, направляемых ими в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных	п. 6.8 ОЧ ПК, Прил. № 4 к ОЧ ПК, Прил. № 1 к ПК ФР	Уточнения касаются основанного на нормах законодательства подхода, предусматривающего отсутствие необходимости сбора НКО НКЦ (АО) согласий субъектов персональных данных.	Предлагаемые изменения влияют на права и обязанности Участников клиринга, определяя отсутствие необходимости сбора Клиринговым центром согласий субъектов персональных данных.

	данных, больше не требуется			
12)	Изменения во временные регламенты Правил клиринга (за исключением указанных выше)	Прил. № 6 к ОЧ ПК, Прил. № 2 к ПК ФР, Прил. № 1 к ПК СПФИ	Изменения предусматривают конкретизацию положений о времени подачи Предложений/Намерений и заключения Внебиржевых сделок в определенных режимах и о времени погашения Маржинальных требований на рынке СПФИ, кроме того, продлено время проведения клиринговой сессии mark-to-market до 21.30 (вместо 20:30).	Предлагаемые изменения влияют на права и обязанности Участников клиринга, устанавливая / изменяя время проведения отдельных операций.