



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
КЛИРИНГОВЫЙ
ЦЕНТР
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Департамент
Клиринга

**1-й релиз
фондового рынка 2017г**

1 Комиссия по сделкам в иностранной валюте

1. **Оборотная комиссия по сделкам в иностранной валюте** по умолчанию списывается с Расчетного кода / Счета обеспечения T0, входящего в состав ТКС T+ / ТКС T0, по которому заключена сделка.



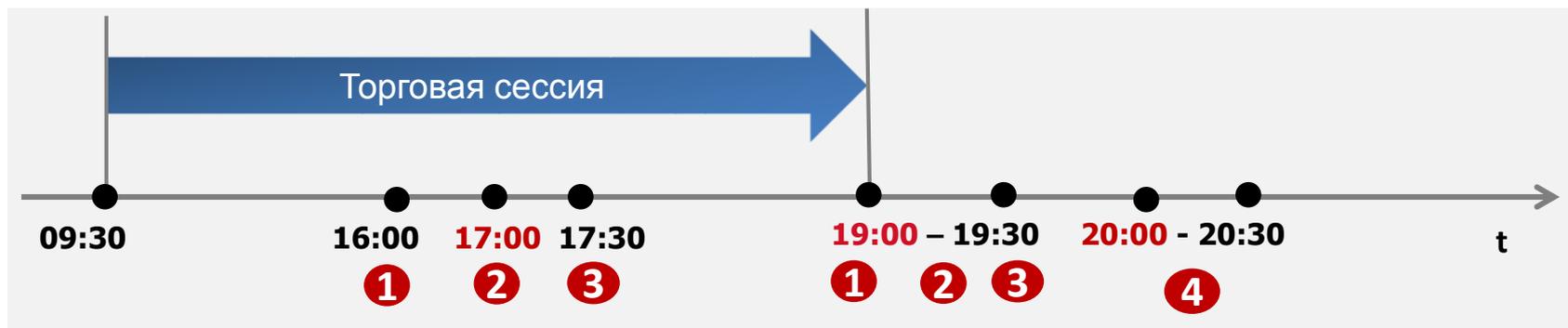
2. Если в качестве счета для возмещения и комиссии выбран Расчетный код, то Участнику клиринга доступна опция списания оборотной комиссии со Счета для возмещения и комиссии.

Для этого в Заявлении о счете для возмещения и комиссии необходимо указать:

С указанного Расчетного кода **взимать оборотную часть комиссионного вознаграждения:**

- по сделкам с расчетами в иностранной валюте

2 Время расчетов по Сделкам Т+



- 1 16:00, 19:00** Определение Итоговых нетто-обязательств/Итоговых нетто-требований по Сделкам Т+ с наступившей датой исполнения. Отправка отчета EQM13.
- 2 16:00-17:30/
19:00-19:30** Исполнение обязательств по ценным бумагам и денежным средствам, определенных в **1-м*** / **2-м Клиринговом пуле**.
Внимание ! В случае если у всех Участников клиринга обеспечены Итоговые нетто-обязательства по ценным бумагам, то НКЦ может осуществить расчеты, начиная с 16:00.
- 3 17:00 - 17:30
19:00 - 19:30** Заключение с Участниками клиринга сделок РЕПО **при недостаточности ценных бумаг** в **17:00 / 19:00**.
- 4 20:00-20:30** Заключение с Участниками клиринга сделок своп и сделок РЕПО **при недостаточности денежных средств** по обязательствам, определенным в 16:00 и 19:00.

Подача **Запросов на вывод денежных средств**, а также подача заявок на заключение Сделок T0 возможны **в размере Расчетной позиции**:

**Расчетная позиция
по денежным
средствам**

(рубли и ин. валюта)

=

Плановая позиция

(средства на счете в
текущий момент с учетом
выставленных заявок T0)

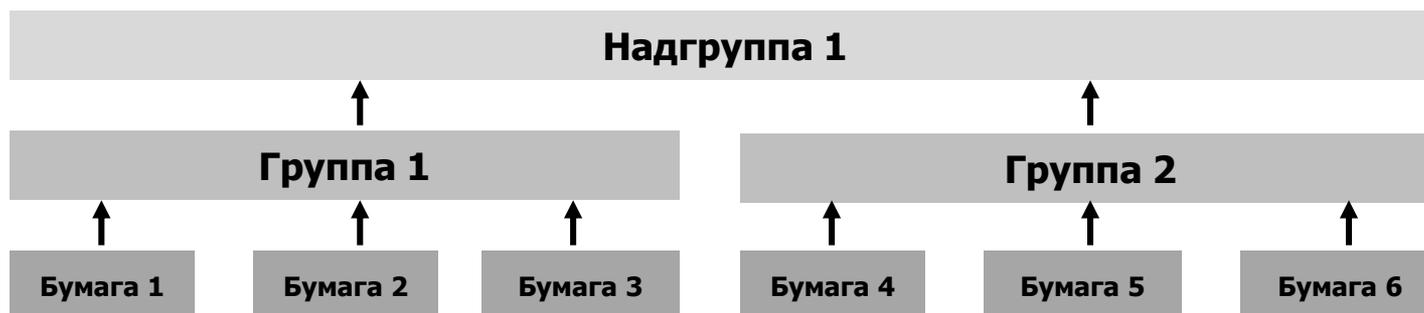
+

**Текущая позиция под исполнение
по Сделкам T+**

(Итоговые нетто-обязательства (со знаком минус)/
Итоговые нетто-требования (со знаком плюс) с
наступившей датой исполнения)

4 Изменения в клиринговые отчеты

1. В Отчет о маржинальных требованиях (EQM14) включена информация о всех возможных маржинальных требованиях:
 - маржинальном требовании,
 - маржинальном требовании по пулу,
 - маржинальном требовании по фондам,
 - маржинальном требовании по Обеспечению под стресс.
2. Отчет о Торгово-клиринговых счетах (EQM20) предоставляется дополнительно утром, до 9:00, Участникам клиринга, у которых утром были зарегистрированы и/или изменены Торгово-клиринговые счета.
3. В печатной форме отчета «Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг» (EQM06) в колонках «Обязательство/ требование по денежным средствам» и «Обязательство/ требование по ЦБ» обязательства указываются со знаком «минус».
4. Для Недобросовестных участников клиринга, не обеспечивших денежные средства до 20:00, следующие клиринговые отчеты предоставляются после 20:00 :
 - Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06, EQM6C)
 - Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению (EQM15)
 - Отчет об обязательствах по Сделкам T+ (EQM23)



- **Одна ценная бумага** может входить только в **одну группу** по межпродуктовому спреду
- **Одна группа** ценных бумаг может входить в **одну надгруппу**

1. В рамках каждой **надгруппы**:

- устанавливаются единые ставки скидки за межпродуктовый спред
- скидка за межпродуктовый спред может возникнуть при наличии разнонаправленных рыночных рисков по группам ценных бумаг

2. В рамках каждой **группы**:

- устанавливаются единые ставки скидки за межпродуктовый спред
- скидка за межпродуктовый спред может возникнуть при наличии разнонаправленных рыночных рисков по ценным бумагам

3. По каждой **группе и надгруппе**:

- плановое значение Единого лимита Участника клиринга по анализируемому Расчетному коду увеличивается на сумму минимумов скидок за межпродуктовый спред, рассчитанных на основе плановых сценариев BUY и плановых сценариев SELL