

## **Изменения в Правила клиринга и Формы и форматы документов и отчётов, вступающие в силу с 25.04.2022 г.**

С 25.04.2022 г. вступают в силу новые редакции следующих документов НКЦ.

### **В части Правил клиринга**

1. Правила клиринга. Часть I. Общая часть (далее – Часть I),
2. Правила клиринга. Часть II. Правила клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (далее – Часть II),
3. Правила клиринга. Часть III. Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (далее – Часть III),
4. Правила клиринга. Часть IV. Правила клиринга на срочном рынке (далее – Часть IV Правил клиринга),
5. Правила клиринга. Часть VI. Правила клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ (далее – Часть VI Правил клиринга),
6. Правила клиринга. Часть VII. Уровни защиты центрального контрагента и меры, направленные на ограничение размера ответственности Клирингового центра (далее – Часть VII Правил клиринга).

### **за исключением:**

1. В Части I
  - пунктов 30.7, 30.11,  
продолжают действовать, соответственно, пункты 32.7, 32.11 Правил клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть I. Общая часть, утвержденных Наблюдательным советом НКО НКЦ (АО) от 13.04.2020 г. (Протокол № 17).
2. В Части II
  - пункта 7.3 (исключение не распространяется на подпункты 7.3.1-7.3.3, вступающие в силу с 25.04.2022), пункта 11.3,  
продолжают действовать пункты 7.3 и 11.3 Правил клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Правила клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, утвержденных решением Наблюдательного совета НКО НКЦ (АО) от 16.12.2021 г. (Протокол № 15).
  - пунктов 22.2, 27.14, 43.15, статьи 35,  
о дате вступления в силу которых будет сообщено дополнительно,
  - пункта 33.5

продолжает действовать пункт 33.5 Правил клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Правила клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, утвержденных решением Наблюдательного совета НКО НКЦ (АО) от 26.06.2020 г. (Протокол № 22)

- статьи 35, пункта 43.15,  
о дате вступления в силу которых будет сообщено дополнительно,

- пункта 48.9,  
продолжает действовать пункт 48.9 Правил клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Правила клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, утвержденных решением Наблюдательного совета НКО НКЦ (АО) от 16.12.2021 г. (Протокол № 15)

### 3. В Части IV

- пунктов 30.10-30.12, 31.14-31.15,  
о дате вступления в силу которых будет сообщено дополнительно.

Изменения	Пункт Правил клиринга	Описание изменений	Влияние на права и обязанности Участников клиринга
1) <b>Ответственность Участника клиринга за выбранный режим учета средств, переданных в доверительное управление (ДУ) на Срочном рынке</b>	Пункт 21.10, подпункт 16.9.1 Общей части Правил клиринга	<p>При открытии отдельного Расчетного кода ДУ на Срочном рынке Участник клиринга вправе указать на наличие или отсутствие у него права использовать в собственных интересах переданные ему денежные средства учредителя (учредителей) доверительного управления и (или) использовать указанные денежные средства для обеспечения исполнения собственных обязательств или обязательств третьих лиц.</p> <p>При этом Участник клиринга несет ответственность за соблюдение выбранного им режима учета денежных средств</p>	Участники клиринга обязаны по требованию Клирингового центра открыть отдельный Расчетный код ДУ для заключения сделок за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, за исключением Обособленных клиентов и сделок, заключенных за счет денежных средств Доверенных владельцев счетов, и для учета их в качестве Обеспечения по таким сделкам, в случае, если законодательством РФ и нормативными актами Банка России не предусмотрено право использования Участником клиринга денежных средств, переданных ему в доверительное управление, в собственных интересах, в том числе его клиентом, действующим в качестве ДУ, и (или) использования указанных денежных средств для обеспечения исполнения собственных обязательств или обязательств третьих лиц.
2) <b>Изменения в порядок исполнения НКЦ Заявления на приостановление / возобновление допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию</b>	Подпункты 15.1.25, 15.15.1, пункты 15.16, 15.17 Общей части Правил клиринга	<p>Заявление на приостановление / возобновление допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию разделено на два заявления: о приостановлении допуска и о возобновлении допуска.</p> <p>Сроки исполнения Клиринговым центром Заявлений зависят от времени его получения Клиринговым центром (если более поздняя дата не указана в самом Заявлении)</p>	Участники клиринга при подаче указанных Заявлений обязаны ориентироваться на сроки исполнения Клиринговым центром указанных Заявлений, установленные Правилами клиринга.
3) <b>Дополнение Правил клиринга еще одним основанием прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг</b>	Подпункт 15.18.13	В случае отзыва Банком России лицензии на осуществление страховой деятельности у Участника клиринга – Некредитной организации, являющейся страховой организацией или обществом взаимного страхования, в связи с нарушением таким Участником клиринга требований, установленных Банком России, Клиринговый центр прекращает действие Договора об оказании клиринговых услуг (ранее было закреплено <u>право</u> Клирингового центра прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех биржевых рынках).	Изменения влияют на права и обязанности Участников клиринга: в случае отзыва Банком России лицензии на осуществление страховой деятельности у Участника клиринга – Некредитной организации, являющейся страховой организацией или обществом взаимного страхования, в связи с нарушением таким Участником клиринга требований, установленных Банком России, действие Договора об оказании клиринговых услуг будет прекращено.

<p><b>4) Уменьшены требования к размеру собственных средств (капитала) для допуска к клиринговому обслуживанию на валютном рынке и рынке депозитов Участников клиринга, не являющихся кредитными организациями, категории «В»</b></p>	<p>Подпункты 4.4.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, 8.3.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов</p>	<p>Размер собственных средств (капитала) для допуска Участников клиринга - корпоратов категории «В» к клиринговому обслуживанию на валютном рынке и рынке депозитов, уменьшен вдвое и составляет 500 000 000 российских рублей.</p>	<p>В Правилах клиринга закреплены более лояльные по сравнению с ранее действовавшими требования в отношении размера собственных средств (капитала) для допуска Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, категории «В» к клиринговому обслуживанию на валютном рынке и рынке депозитов.</p>
<p><b>5) Расширен перечень требований для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из биржевых рынков Участника клиринга категории «Б»</b></p>	<p>Пункт 14.3.3 Общей части Правил клиринга</p>	<p>Участник клиринга категории «Б», за исключением национальных (центральных) банков стран – членов ЕврАзЭС/ЕАЭС, в дополнение к текущим требованиям к допуску к клиринговому обслуживанию на любом из биржевых рынков должен предоставить в НКЦ квартальную финансовую отчетность, подготовленную в соответствии с требованиями к основному виду деятельности, не менее, чем за 5 (пять) квартальных отчетных дат.</p>	<p>Участники клиринга, за исключением национальных (центральных) банков стран – членов ЕврАзЭС/ЕАЭС, для получения допуска к клиринговому обслуживанию на любом из биржевых рынков в категории «Б» должен осуществлять деятельность не менее 5 кварталов.</p>
<p><b>6) Определено количество отчетных периодов, за которые должна быть предоставлена отчетность для новообразованных и вновь созданных юридических лиц</b></p>	<p>Пункт 8 Раздела I, пункт 14 Раздела IV приложения № 4 к Общей части Правил клиринга</p>	<p>Правилами клиринга предусмотрена возможность предоставления Участниками клиринга финансовой отчетности за меньшее количество отчетных периодов, в случае, если такие Участники клиринга являются новообразованными юридическими лицами. В случае если вновь созданное юридическое лицо образовано в результате реорганизации (за исключением преобразования) Клиринговый центр вправе запросить квартальную отчетность за 5 (пять) последних отчетных дат правопреемников.</p>	<p>Участники клиринга имеют право предоставления финансовой отчетности за меньшее количество отчетных периодов, в случае, если такие Участники клиринга являются новообразованными юридическими лицами.</p>
<p><b>7) Уточнен состав отчетности, предоставляемый Участником клиринга Клиринговому центру</b></p>	<p>Приложение 5 к Общей части Правил клиринга</p>	<p>Уточнен состав отчетности, предоставляемый Участником клиринга Клиринговому центру:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• исключена ежеквартальная форма отчета о движении денежных средств (форма 0710005);</li> <li>• изменена периодичность предоставления формы 0420455 (Расчет показателя достаточности капитала) с ежемесячной на ежеквартальную.</li> </ul>	<p>Участники клиринга обязаны предоставлять Клиринговому центру состав отчетности в соответствии с новыми требованиями Правил клиринга.</p>
<p><b>8) Добавлена возможность заключения внебиржевых сделок с ЦК с облигациями, допущенными к РЕПО с ЦК, но не прошедшими листинг</b></p>	<p>Пункты 18.4, 18.8, 18.9 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов</p>	<p>Предусмотрена возможность заключения внебиржевых сделок с частичным исполнением Предложений в новом режиме заключения внебиржевых сделок.</p>	<p>Участники клиринга получают право заключать внебиржевые сделки с ценными бумагами с центральным контрагентом с облигациями, допущенными к РЕПО с ЦК.</p>

<p><b>9) Изменение порядка расчета Дохода по сделкам РЕПО по облигациям американских эмитентов, депозитарным распискам и ETF, выпущенным на иностранные ценные бумаги</b></p>	<p>Пункты 46.3, 46.5, 46.7, 46.8., Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов</p>	<p>Из формулы расчета налоговой базы по Доходу по облигациям, депозитарным распискам и ETF, базовой ценной бумагой по которым являются ценные бумаги иностранных эмитентов, подлежащему налогообложению как доход от источника в США и/или приравненному к нему доходу исключен показатель Т – налоговая ставка.</p>	<p>Из формулы расчета размера передаваемого по сделке РЕПО Дохода, по облигациям, депозитарным распискам и ETF, базовой ценной бумагой по которым являются ценные бумаги иностранных эмитентов и/или приравненного к нему дохода, подлежащего налогообложению как доход от источника в США, исключается составляющая, соответствующая налоговой ставке, применяемой в отношении выплат по ценной бумаге в соответствии с налоговым законодательством страны резидентства эмитента ценной бумаги.</p>
<p><b>10) Право НКЦ взыскать с Участника клиринга расходы по оплате депозитарных комиссий</b></p>	<p>Пункты 46.10 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов</p>	<p>Установлено, что Участник клиринга обязан возместить Клиринговому центру расходы по оплате депозитарных комиссий, уплаченных Клиринговым центром в связи с депозитарным обслуживанием субсчета депо, открытого для Участника клиринга или клиента Участника клиринга.</p>	<p>У Участников клиринга появляется новая обязанность возместить расходы по оплате комиссионных вознаграждений депозитария, произведенных Клиринговым центром в связи с депозитарным обслуживанием субсчета депо, открытого для Участника клиринга или клиента Участника клиринга.</p>
<p><b>11) Возможность открытия Обособленному клиенту на рынке СПФИ Расчетного кода ДУ и регистра учета позиций ДУ</b></p>	<p>Пункт 8.1. Правил клиринга на рынке СПФИ</p>	<p>Предусмотрена возможность открытия Обособленному клиенту на рынке СПФИ Расчетного кода ДУ и регистра учета позиций ДУ.</p>	<p>Участнику клиринга предоставлено право открыть для Обособленного клиента клиентский регистр учета позиций ДУ и Расчетный код ДУ.</p>
<p><b>12) Изменение времени подачи требования об исполнении опционного контракта / заявления об отказе от исполнения опционного контракта</b></p>	<p>Приложение 1 к Правил клиринга на срочном рынке</p>	<p>Уточнено, что после окончания Основной Торговой сессии на срочном рынке Участники клиринга лишаются возможности заявить об исполнении / отказе от исполнения опциона.</p>	<p>Участники клиринга лишаются права заявить об исполнении / отказе от исполнения опциона после окончания Основной Торговой сессии.</p>
<p><b>13) Изменение в порядок отмены доверенностей</b></p>	<p>Пункт 4.17 Общей части Правил клиринга</p>	<p>Установлено, что Участник клиринга / Участник торгов, заключивший договор о ведении клиринговых регистров, обязан уведомить Клиринговый центр об отмене доверенности, выданной Участником клиринга / Участником торгов, заключившим договор о ведении клиринговых регистров, для представления его интересов перед Клиринговым центром путем направления соответствующего сообщения Клиринговому центру не позднее 1 (одного) рабочего дня с даты принятия решения об отмене доверенности, но не позднее рабочего дня, следующего за днём отмены такой доверенности.</p>	<p>У Участников клиринга появляется обязанность У Участника клиринга / Участника торгов, заключившего договор о ведении клиринговых регистров, появляется обязанность уведомить НКЦ об отмене доверенности, выданной Участником клиринга / Участником торгов, заключившим договор о ведении клиринговых регистров, для представления его интересов перед НКЦ.</p>

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

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

1. Внесены изменения в форму Заявления о приостановлении допуска к клиринговому обслуживанию (п. 2.3) в связи с выделением отдельной формы Заявления о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию (п. 2.4).
2. Добавлена новая форма: Заявление о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию (п. 2.4).
3. Внесены изменения в форму Запроса на открытие Торгово-клирингового счёта для уплаты налогов (п. 2.16): добавлена сноска «Торгово-клиринговый счет для уплаты налогов открывается только для Участника клиринга–Нерезидента».
4. Внесены изменения в форму Заявления на перевод обязательств и обеспечения (п. 3.1): добавлены опции выбора основания для перевода обязательств и обеспечения Обособленного клиента к Участнику клиринга-реципиенту.
5. Добавлен формат нового отчёта ССХ51 «Доходы, выплачиваемые Участнику клиринга-нерезиденту»:

### **Формы и форматы документов и отчётов. Часть II. Фондовый рынок, рынок кредитов и рынок депозитов.**

1. Внесены изменения в форму Запроса на открытие Торгового-клирингового счета (п. 2.1): удалён столбец для указания идентификационных данных в связи с принадлежностью идентификационных данных клиента к сущности Расчётного кода, но не Торгово-клирингового счёта.
2. Удалена форма Постоянного поручения на ограничение времени начала заключения сделок с Клиринговым центром (п. 2.15) в связи с реализацией подачи поручения через системы Web-клиринг и Клиринговый терминал.

### **Формы и форматы документов и отчётов. Часть III. Срочный рынок.**

1. Внесены изменения в Заявление на открытие Брокерской фирмы (п. 2.1): добавлено поле о наличии/отсутствии у Участника клиринга права использовать в собственных интересах переданные ему средства учредителя ДУ в связи с внесением изменений в Правила клиринга. Часть I. Общая часть пп. 16.9.1 и 21.10.