



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
КЛИРИНГОВЫЙ
ЦЕНТР
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Департамент
Клиринга

Разделение статусов Участников торгов и Участников клиринга на Фондовом рынке



г. Москва

Разделение статусов Участника торгов и Участника клиринга в Торгово-клиринговой системе фондового рынка



Участник торгов:

принимает участие в торгах

(подает заявки и совершает иные действия, направленные на заключение сделок)



Участник клиринга:

является стороной по сделкам, заключенным на основании заявок, поданных Участником торгов



НКЦ:

- **является стороной по сделкам, заключенным с центральным контрагентом**
- **осуществляет клиринг только в отношении Участника клиринга**

(включая учет обеспечения, контроль достаточности обеспечения и прекращения обязательств по сделкам)

На фондовом рынке реализуются две юридические модели разделения статусов УК и УТ

Модель 1: договор поручения

Участник торгов может заключать сделки от имени и в интересах Участника клиринга



Ограничения: невозможно заключение сделок за счет иных клиентов Участника торгов или клиентов Участника клиринга

При подаче заявки Участником торгов 'Details' клиента **должны совпадать** с ИНН Участника клиринга

Модель 2: клиринговый брокер

Участник клиринга становится стороной по сделкам, заключенным Участником торгов не в интересах Участника клиринга



Ограничения: невозможно заключение сделок за счет Участника клиринга

При подаче заявки Участником торгов 'Details' клиента **НЕ должны совпадать** с ИНН Участника клиринга



Один Участник клиринга:

- может использовать разные юридические модели по разным Расчетным кодам
- может являться Участником торгов и Участником клиринга одновременно по другим Расчетным кодам

Категории Участников клиринга на фондовом рынке

Категории*:

Общий Участник клиринга:

«О»

- имеет допуск к клирингу с частичным обеспечением
- может являться стороной по Сделкам, заключенным более, чем двумя Участниками торгов, включая самого Участника клиринга (в случае если он равен Участнику торгов)**

Индивидуальный Участник клиринга:

«Б»

- имеет допуск к клирингу с частичным обеспечением
- может являться стороной по Сделкам, заключенным не более, чем двумя Участниками торгов, включая самого Участника клиринга (в случае если он равен Участнику торгов)**

Индивидуальный Участник клиринга:

«В»

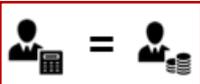
- НЕ имеет допуск к клирингу с частичным обеспечением
- может являться стороной по Сделкам, заключенным не более, чем двумя Участниками торгов, включая самого Участника клиринга (в случае если он равен Участнику торгов)**

* - на фондовом рынке также существуют категории: «А» – Банк России, «К» - Федеральное казначейство

** - и/или стороной по Сделкам, заключенным им как Участником клиринга от своего имени не на организованных торгах

Требования к категориям Участников клиринга на фондовом рынке





Торгово-клиринговая система Фондового рынка

Участник клиринга = Участник торгов



Особенности

- К одному **ПК 1-го уровня** могут быть открыты несколько **ПК 2-го уровня**
- Участник клиринга **может** открыть **ТКС 2-го уровня** и **ТКС 3-го уровня** для заключения сделок за свой счет или за счет своих клиентов
- Участник клиринга может указывать в заявках **ТКС 1-го, 2-го** или **3-го уровня**
- При открытии Участником клиринга **ТКС 3-го уровня** услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Участнику клиринга
- Идентификационные данные клиентов могут быть привязаны к **ПК 1-го, 2-го и 3-го уровней**
- Для Обособленного клиента должен быть открыт отдельный **ПК 1-го уровня**

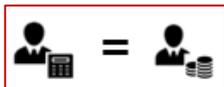
Участник клиринга ≠ Участник торгов



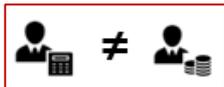
Особенности

- На **ПК 1-го уровня** учитывается признак, указывающий на юридическую модель использования РК
- К одному **ПК 1-го уровня** могут быть открыты несколько **ПК 2-го уровня**
- Для заключения сделок Участником торгов Участник клиринга **обязан** открыть **ТКС 2-го уровня** для такого Участника торгов
- Разные **ПК 2-го уровня**, открытые для одного Участника торгов, могут соответствовать **ПК 1-го уровня** разных Участников клиринга (один Участник торгов может обслуживаться у разных Участников клиринга)
- Участник торгов:
 - может открыть **ТКС 3-го уровня** (*В таком случае Участнику торгов необходимо подписать с НКЦ Договор о ведении клиринговых регистров*)
 - может указывать в заявках **ТКС 2-го** или **3-го уровня**
- Идентификационные данные клиентов могут быть привязаны к **ПК 1-го, 2-го и 3-го уровней**
- Для Обособленного клиента должен быть открыт отдельный **ПК 1-го уровня**

Открытие Расчетных кодов и Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня



Участник клиринга, совпадающий в одном лице с Участником торгов, **может** открыть **ТКС 2-го уровня** для заключения сделок за свой счет или за счет своих клиентов



Для заключения сделок Участником клиринга, не совпадающим в одном лице с Участником торгов клиринга, **Участник клиринга обязан** открыть **ТКС 2-го уровня** для такого Участника торгов



Участник клиринга:

- направляет в НКЦ  **Запрос на открытие ТКС 2-го уровня** (через web-клиринг или клиринговый терминал)

ТКС 2-го уровня может быть открыт только к ТКС Т+ 1-го уровня, в состав которого входит 36-й раздел счета депо и РК

- вправе предоставить НКЦ **Запрос на изменение параметров Торгово-клирингового счета 2-го уровня, указав в нем**



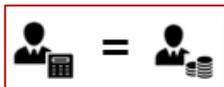
Идентификационные данные Клиента Участника клиринга

В этом случае при выставлении заявок в Торговой системе фондового рынка с указанием такого Торгово-клирингового счета (**ТКС 2-го уровня**), производится проверка соответствия **Идентификационных данных** Клиента Участника клиринга, указанных в Запросе и **Идентификационных данных**, закрепленных за Кодом клиента, указанным в заявке.

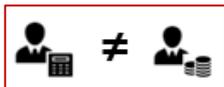


При несоответствии заявки не принимаются

Открытие Расчетных кодов и Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня



Участник клиринга, совпадающий в одном лице с Участником торгов, может открыть ТКС 3-го уровня. В этом случае услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Участнику клиринга



Участник торгов, не совпадающий в одном лице с Участником клиринга и заключивший с НКЦ договор о ведении клиринговых регистров, может открыть ТКС 3-го уровня. В этом случае услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Участнику торгов



Участник клиринга/Участник торгов:

- направляет в НКЦ  **Запрос на открытие ТКС 3-го уровня** (через web-клиринг или клиринговый терминал)
- вправе предоставить НКЦ **Запрос на изменение параметров Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указав в нем**



Идентификационные данные Клиента Участника клиринга / Участника торгов

В этом случае при выставлении заявок в Торговой системе фондового рынка с указанием такого Торгово-клирингового счета (**ТКС 3-го уровня**), производится проверка соответствия **Идентификационных данных** Клиента Участника клиринга, указанных в Запросе и **Идентификационных данных**, закрепленных за Кодом клиента, указанным в заявке.

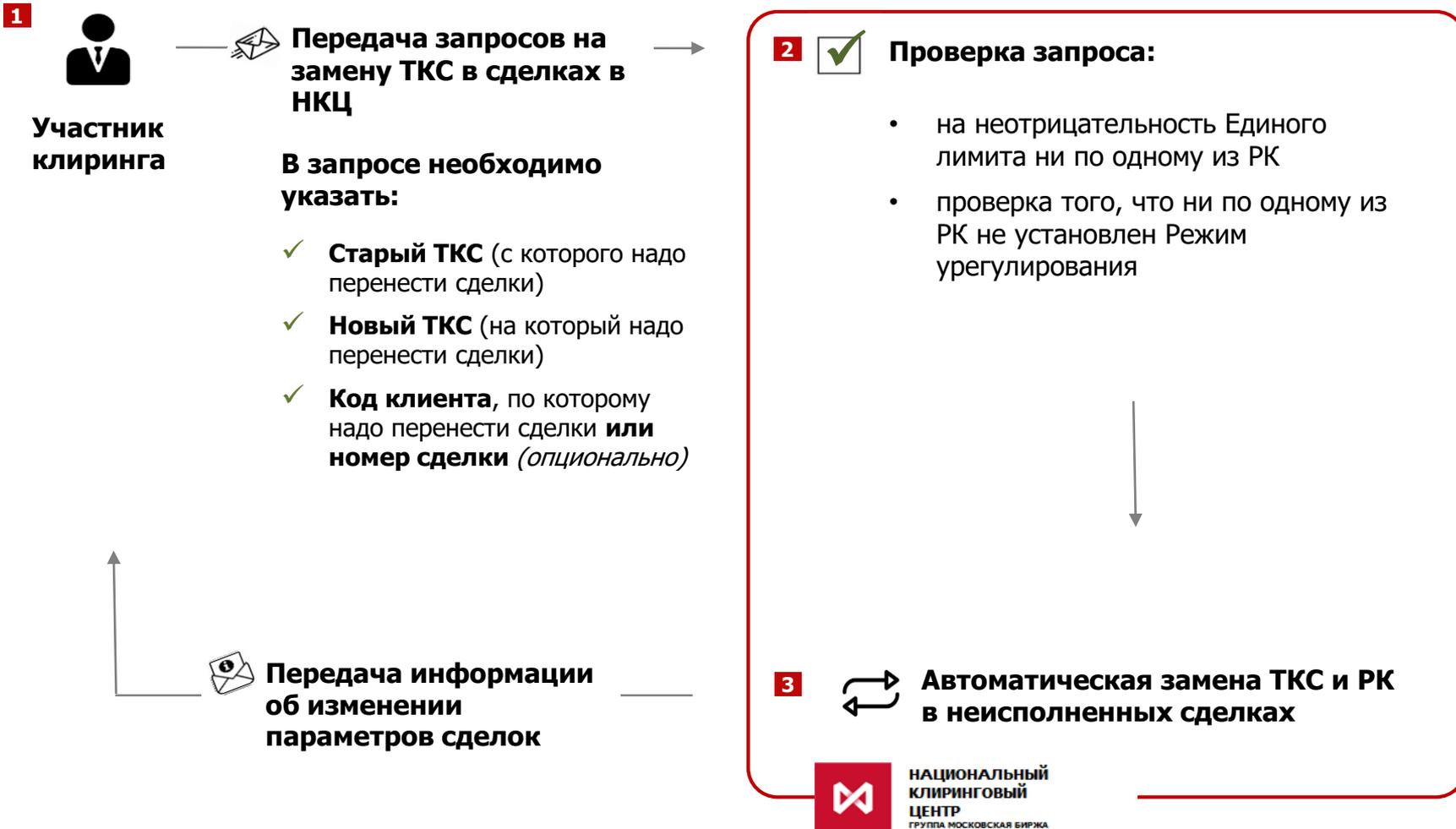


При несоответствии заявки не принимаются

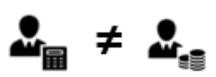
Особенности открытия РК и ТКС 1-го, 2-го и 3-го уровня к РК Единого пула

1. При открытии РК и ТКС 1-го и/или 2-го и/или 3-го уровня к Расчетным кодам Единого пула, такие РК и ТКС 1-го, 2-го и/или 3-го уровня **становятся доступными** как в Клиринговой системе фондового рынка, так и в Клиринговой системе валютного рынка:
 - а) **если** область действия РК ЕП **уже** распространена на валютный рынок
 - б) **при распространении** области действия РК ЕП на валютный рынок
2. РК и ТКС 1-го и/или 2-го и/или 3-го уровня, уже открытые в Клиринговой системе валютного рынка к Расчетному коду Единого пула **на момент запуска проекта** по разделению статусов УТ и УК на фондовом рынке, **НЕ переоткрываются** и **НЕ передаются** в Клиринговую систему фондового рынка
3. При присоединении РК валютного рынка, к которому открыты РК и ТКС 2-го и/или 3-го уровня, к РК Единого пула, такие РК и ТКС **НЕ переоткрываются** в Клиринговой системе фондового рынка
4. Участник клиринга может заменить старые ТКС 2-го и 3-го уровня в сделках валютного рынка **на вновь открытые** (порядок замены ТКС в сделкам – см. слайд 11)

Порядок замены ТКС в сделках*



* - Запросы на замену ТКС в сделках могут подаваться Участником клиринга в НКЦ через Web-клиринг или Клиринговый терминал



Особенности оказания услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня

Клиринговые регистры 3-го уровня всегда открываются:



по запросу **Участника торгов**, для этого:



Участник торгов должен заключить с НКЦ **Договор о ведении клиринговых регистров**



Участнику клиринга по умолчанию **НЕ** доступна информация о клиентах Участника торгов в сделках

Однако Участник клиринга **СМОЖЕТ** видеть информацию о клиентах в сделках **В СЛЕДУЮЩИХ СЛУЧАЯХ:**

1. если Участник торгов **открывает** ему эту информацию
(направив в НКЦ *Запрос о предоставлении Участнику клиринга доступа к информации о клиентах Участника торгов**)
2. если Участник торгов **делегирует** ему полномочия по ведению клиринговых регистров 3-го уровня
(направив в НКЦ соответствующий *Запрос** в НКЦ, при этом **Участник клиринга вправе отказаться** от предоставления ему услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня путем предоставления соответствующего *Запроса**)

Услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня включают в себя:



Отражение информации об обеспечении по клиринговым регистрам 3-го уровня



Лимитирование операций по клиринговым регистрам 3-го уровня

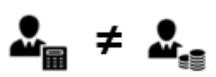


Отражение прекращения обязательств по сделкам, заключенным с указанием клиринговых регистров 3-го уровня



Предоставление отчетов по клиринговым регистрам 2-го и 3-го уровня

* - через web-клиринг или Клиринговый терминал



Список запрещенных клиентов¹



Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру **Список запрещенных клиентов²**

(запрет на подачу Участником торгов заявок и заключение сделок, стороной по которым является Участник клиринга, за счет клиентов из этого Списка):

- Список хранится в привязке к Участнику клиринга
- Запрет действует в случае:
 - а) если услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Участнику клиринга
 - б) на РК 2-го уровня стоит признак «раскрывать Участнику клиринга информацию о клиентах»
- Исключение клиентов из Списка запрещенных клиентов осуществляется на основании запроса Участника клиринга

Комментарий

Опция нужна для защиты Участника клиринга - нерезидента, которому в соответствии с локальным законодательством запрещено работать с клиентами из stop-листа.

Если Участник клиринга обнаруживает, что в нарушение условий соглашения Участник торгов обслуживает клиента из stop-листа, то Участник клиринга может:

- *самостоятельно убедить Участника торгов не заключать сделки за счет такого клиента, или*
- *установить через НКЦ запрет на заключение Участником торгов сделок за счет такого клиента.*

¹ - информация о клиентах (идентификационные данные), за счет которых Участники торгов не вправе заключать сделки, стороной по которым должен стать Участник клиринга

² - через web-клиринг или Клиринговый терминал



По ТКС и РК 1-го уровня:

- ✓ **учитывается Обеспечение** Участника клиринга
- ✓ **учитываются обязательства по сделкам**
(заключенным с указанием **ТКС 1-го уровня** и **ТКС 2-го и 3-го уровня**, соответствующих **ТКС 1-го уровня**)
- ✓ **осуществляется контроль достаточности обеспечения** и режимов полного обеспечения по заявкам, поданным с указанием **ТКС 1-го уровня** и **ТКС 2-го и 3-го уровня**, соответствующих **ТКС 1-го уровня**
- ✓ **выставляется Маржинальное требование**
- ✓ **осуществляется прекращение обязательств** по сделкам между НКЦ и Участником клиринга
- ✓ **осуществляется урегулирование неисполненных обязательств** по сделкам между НКЦ и Участником клиринга
- ✓ **осуществляется списание комиссионных вознаграждений**, в пользу НКЦ и Биржи
- ✓ **осуществляется передача профилей активов**

По ТКС и РК 2-го уровня / 3-го уровня:

- ✓ **учитывается информация об Обеспечении**, внесенном с указанием **ТКС** или **РК 2-го уровня / 3-го уровня**

С учетом информации об Обеспечении :

- в денежных средствах, учитываемой по такому **РК 2-го / 3-го уровня**
- в ценных бумагах, учитываемой по **ТКС 2-го / 3-го уровня**, в состав которого входит такой **РК 2-го / 3-го уровня**

рассчитывается Единый лимит по **РК 2-го / 3-го уровня**

Проверка Единого лимита по **РК 2-го / 3-го уровня** осуществляется по умолчанию при подаче заявки. Участник может снять/поставить признак «Осуществить проверку Единого лимита по соответствующему уровню» через Торгово-клиринговую систему фондового рынка

- ✓ **учитывается информация об обязательствах** по сделкам, заключенным с указанием **ТКС 2-го уровня** и **ТКС 3-го уровня**, соответствующего **ТКС 2-го уровня**
- ✓ **осуществляется контроль достаточности обеспечения** по заявкам, поданным с указанием **ТКС 2-го уровня** и **ТКС 3-го уровня**, соответствующего **ТКС 2-го уровня** (в случае установки соответствующего признака)
- ✓ **учитывается информация о прекращении обязательств** по сделкам, заключенным с указанием **ТКС 2-го уровня** и **ТКС 3-го уровня**, соответствующего **ТКС 2-го уровня / ТКС 3-го уровня** и обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений в пользу НКЦ и Биржи
- ✓ **НЕ выставляется Маржинальное требование** в случае недостаточности обеспечения
- ✓ **НЕ осуществляется передача профилей активов**

Порядок зачисления/списания Обеспечения

По РК и ТКС 1-го уровня:

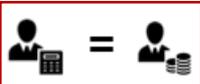
обеспечение Участника клиринга зачисляется/списывается **стандартным образом**

По РК и ТКС 2-го / 3-го уровня:

- a) путем указания в назначении платежа при зачислении денежных средств номера **РК 2-го / 3-го уровня**
 - b) путем непосредственного изменения информации об Обеспечении в денежных средствах / ценных бумагах, учитываемом по **ТКС / РК 2-го / 3-го уровня**, средствами Торгово-клиринговой системы фондового рынка (с помощью транзакции TRAN)
-

- ✓ Изменение информации об Обеспечении, учитываемой по **ТКС / РК 2-го / 3-го уровня** осуществляется независимо от наличия или отсутствия средств, учитываемых по таким **ТКС / РК**
 - ✓ Проверки на отрицательность Единого лимита:
 - **не осуществляются** при изменении информации об Обеспечении, учитываемой по **ТКС / РК 2-го / 3-го уровня** через внешнее зачисление / списание
 - **осуществляются*** при изменении информации об Обеспечении, учитываемой по **ТКС / РК 2-го / 3-го уровня** средствами Торгово-клиринговой системы фондового рынка
-

* - при наличии признака проверки Единого лимита по РК 2-го/3-го уровня. Дополнительно в транзакции TRAN, соответствующей такому изменению, участником может быть указан специальный признак, означающий, что такое изменение должно быть сделано без проверки на неотрицательность Единого лимита (безусловно)



Участник клиринга = Участник торгов

	по РК и ТКС 1-го уровня	по РК и ТКС 2-го уровня	по РК и ТКС 3-го уровня
Выставление: <ul style="list-style-type: none">• внутреннего ограничения на позиции• режима полного обеспечения по активу, допущенного к торгам с частичным обеспечением• индивидуальных риск-параметров• признак «Неприем актива в обеспечение»	✓*	✓	✓
Выставление индивидуальных риск-параметров	✓*	✓	✓
Изменение информации об Обеспечении	✓*	✓	✓
Выставление внутреннего ограничения на Единый лимит и Торговый лимит	✓*	✓	✓

Участник клиринга = Участник торгов подает Отчеты на исполнение по заключенным сделкам, а также выполняет иные действия, связанные с исполнением обязательств по сделкам без ЦК

* - возможность выставления ограничений Участником клиринга по РК и ТКС 1-го уровня будет закрыта ориентировочно через 2-3 месяца после запуска проекта по разделению статусов Участников торгов и Участников клиринга на фондовом рынке



Полномочия Участника клиринга (услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Участнику торгов)

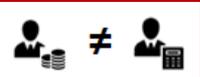
Участник клиринга

	по РК и ТКС 1-го уровня	по РК и ТКС 2-го уровня	по РК и ТКС 3-го уровня
Выставление: <ul style="list-style-type: none">внутреннего ограничения на позициирежима полного обеспечения по активу, допущенного к торгам с частичным обеспечениеминдивидуальных риск-параметровпризнак «Неприем актива в обеспечение»	✓*	✓	✗
Выставление индивидуальных риск-параметров	✓*	✓	✗
Изменение информации об Обеспечении	✓*	✓	✗
Выставление внутреннего ограничения на Единый лимит и Торговый лимит	✓*	✓	✗

Участник клиринга ≠ Участник торгов имеет возможность подает Отчеты на исполнение по сделкам, заключенным Участником торгов, а также выполняет иные действия, связанные с исполнением обязательств по сделкам без ЦК

* - возможность выставления ограничений Участником клиринга по РК и ТКС 1-го уровня будет закрыта ориентировочно через 2-3 месяца после запуска проекта по разделению статусов Участников торгов и Участников клиринга на фондовом рынке



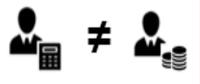


Полномочия Участника торгов (услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Участнику торгов)

Участник торгов

	по РК и ТКС 1-го уровня	по РК и ТКС 2-го уровня	по РК и ТКС 3-го уровня
Выставление: <ul style="list-style-type: none">• внутреннего ограничения на позиции• режима полного обеспечения по активу, допущенного к торгам с частичным обеспечением• индивидуальных риск-параметров• признак «Неприем актива в обеспечение»	✘	✘	✓
Выставление индивидуальных риск-параметров	✘	✘	✓
Изменение информации об Обеспечении	✘	✘	✓
Выставление внутреннего ограничения на Единый лимит и Торговый лимит	✘	✘	✓





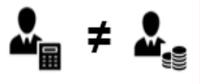
Полномочия Участника клиринга (услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Участнику клиринга)

Участник клиринга

	по РК и ТКС 1-го уровня	по РК и ТКС 2-го уровня	по РК и ТКС 3-го уровня
Выставление: <ul style="list-style-type: none">• внутреннего ограничения на позиции• режима полного обеспечения по активу, допущенного к торгам с частичным обеспечением• индивидуальных риск-параметров• признак «Неприем актива в обеспечение»	✓*	✓	✓
Выставление индивидуальных риск-параметров	✓*	✓	✓
Изменение информации об Обеспечении	✓*	✓	✓
Выставление внутреннего ограничения на Единый лимит и Торговый лимит	✓*	✓	✓

* - возможность выставления ограничений Участником клиринга по РК и ТКС 1-го уровня будет закрыта ориентировочно через месяц 2-3 месяца после запуска проекта по разделению статусов Участников торгов и Участников клиринга на фондовом рынке





Полномочия Участника торгов (услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Участнику клиринга)

Участник торгов

	по РК и ТКС 1-го уровня	по РК и ТКС 2-го уровня	по РК и ТКС 3-го уровня,
Выставление: <ul style="list-style-type: none">• внутреннего ограничения на позиции• режима полного обеспечения по активу, допущенного к торгам с частичным обеспечением• индивидуальных риск-параметров• признак «Неприем актива в обеспечение»	x	x	x
Выставление индивидуальных риск-параметров	x	x	x
Изменение информации об Обеспечении	x	x	x
Выставление внутреннего ограничения на Единый лимит и Торговый лимит	x	x	x

Процедура прекращения обязательств и урегулирование неисполненных обязательств по сделкам

Расчетный код и ТКС 1-го уровня:

Процедура прекращения обязательств проводится **в стандартном порядке**

Расчетный код и ТКС 2-го/3-го уровня:

Процедура прекращения обязательств проводится **в информационных целях**

Процедура прекращения обязательств проводится всегда только безусловно:

- обязательства, учитываемые по таким ТКС и РК, всегда прекращаются полностью, вне зависимости от информации об Обеспечении в активах, необходимых для исполнения таких обязательств, учитываемой по соответствующему ТКС и РК.

НКЦ осуществляет урегулирование неисполненных обязательств по сделкам только по **Расчетным кодам 1-го уровня** и не осуществляет по Расчетным кодам 2-го и 3-го уровня

Участник клиринга ≠ Участник торгов (использующий модель «Клиринговый брокер») может подать в НКЦ

 **Запрос на заключение сделки за счет Участника торгов / клиента Участника торгов**

в целях урегулирования неисполненных обязательств Участника торгов перед Участником клиринга по сделкам, заключенным «внутри» одного ТКС 1-го уровня

Участник клиринга ≠ Участник торгов (использующий модель «Клиринговый брокер») в целях устранения необеспеченности позиций имеет возможность инициировать снятие заявок, поданных Участником торгов:

- для это реализуется новая транзакция  **«Запрос на проверку достаточности обеспечения»**, которую может подавать:
 - по РК 2-го уровня - Участник клиринга, открывший такой РК 2-го уровня;
 - по РК 3-го уровня - Участник клиринга, которому оказываются услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня

При обработке данного запроса в случае:

- **отрицательного Единого лимита** по РК 2-го / РК 3-го уровня, снимаются все заявки по всем ТКС 2-го / ТКС 3-го уровня, включающим такой РК 2-го / РК 3-го уровня.
- **неотрицательного Единого лимита** по РК 2-го / РК 3-го уровня никаких действий не осуществляется

При этом установление нулевых или отрицательных значений Обеспечения, учитываемых по ТКС и РК 2-го / ТКС и РК 3-го уровня, осуществляется Участником клиринга самостоятельно, отдельной транзакцией

Регистрация Обособленного клиента

Осуществляется на основании



Запроса на регистрацию Обособленного клиента, подаваемого Участником клиринга

В Запросе среди прочего Участник клиринга указывает:



Расчетный код, открытый под Обособленного клиента



Идентификационные данные Обособленного клиента

При выставлении заявок в Торговой системе фондового рынка с указанием Расчетного кода, открытого под Обособленного клиента, производится проверка соответствия **Идентификационных данных** Обособленного клиента, указанных в Запросе и **Идентификационных данных**, закрепленных за Кодом клиента, указанным в заявке. **При несоответствии заявки не принимаются**



Необходимость защиты денежных средств Обособленного клиента (*признак устанавливается по желанию Участника клиринга*)

Защита денежных средств включает:

- возврат денежных средств осуществляется **только** по реквизитам зарегистрированного в НКЦ Счета для возврата Обеспечения, владельцем которого является Обособленный клиент
- перевод денежных средств может быть **только** между Расчетными кодами, закрепленными за данным Обособленным клиентом, на одном или разных рынках



Участник клиринга уплачивает следующие виды комиссионного вознаграждения:

- **За услуги технического доступа в пользу Технического центра (пологинка)**
- **За клиринговое обслуживание в пользу Клирингового центра**
- **За открытие клиринговых регистров 3-го уровня (в случае если Участник клиринга = Участнику торгов) ^{NEW}** – 120 рублей, взимается не позднее рабочего дня, следующего за днём открытия ТКС 3-го уровня и учитывается по основному РК для списания комиссии
- **За ведение клиринговых регистров 3-го уровня ^{NEW} (услуги по ведению клиринговых регистров оказываются УК)** – 120 рублей, взимается в 1-й рабочий день отчетного месяца за каждый открытый ТКС 3-го уровня и учитывается по основному РК для списания комиссии

Размер постоянной и оборотной части комиссионного вознаграждения за клиринг определяется выбранным Участником клиринга тарифным планом



Участник торгов уплачивает следующие виды комиссионного вознаграждения:

- **За услуги технического доступа в пользу Технического центра (пологинка)**
- **За организацию торгов в пользу Биржи**
- **За открытие клиринговых регистров 3-го уровня ^{NEW}** – 120 рублей, взимается не позднее рабочего дня, следующего за днём открытия ТКС 3-го уровня и учитывается по основному РК для списания комиссии
- **За ведение клиринговых регистров 3-го уровня ^{NEW} (услуги по ведению клиринговых регистров оказываются УТ)** – 120 рублей, взимается в 1-й рабочий день отчетного месяца за каждый открытый ТКС 3-го уровня и учитывается по основному РК для списания комиссии

Размер постоянной и оборотной части комиссионного вознаграждения за организацию торгов определяется выбранным Участником торгов тарифным планом

Клиринговые отчеты для Участника клиринга и Участника торгов ¹

Код отчета	Наименование отчета	УК	УТ
EQM05	Выписка из протокола исполнения сделок, обязательств по внесению компенсационных взносов и уплате отступного	✓	✗
EQM06	Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг	✓	✓
EQM08	Выписка из реестра неисполненных сделок	✓	✗
EQM12	Уведомление о замене торгово-клирингового счета	✓	✗
EQM13	Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях	✓	✗
EQM14	Отчет о маржинальном требовании	✓	✗
EQM15	Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению	✓	✓
EQM20	Отчет о Торгово-клиринговых счетах	✓	✓
EQM22	Требование о погашении задолженности	✓	✗
EQM23	Отчет об обязательствах по Сделкам Т+	✓	✗
EQM24	Выписка из протокола внесения компенсационных взносов и исполнения обязательств по уплате отступного	✓	✗
EQM30	Отчет о Клиринговых идентификаторах	✓	✓
EQM45	Отчет об имуществе, внесенном в имущественные пулы	✓	✗
EQM46	Отчет о нормативной стоимости клиринговых сертификатов участия	✓	✗
EQM84	Отчет об оценке обеспечения	✓	✗
EQM97	Отчет о премии	✓	✓
EQM92/ EQM93	Отчет о гарантийных фондах / Отчет об Обеспечении под стресс	✓	✗
EQM98	Отчет об обязательствах по передаче/ требованиям по получению Дохода	✓	✗
EQM99	Отчет об обеспечении (для УТ по РК и ТКС 2-го и 3-го уровня)	✓	✓

¹ – отчеты предоставляются **Участнику торгов** в случае заключения с НКЦ договора о ведении клиринговых регистров

