

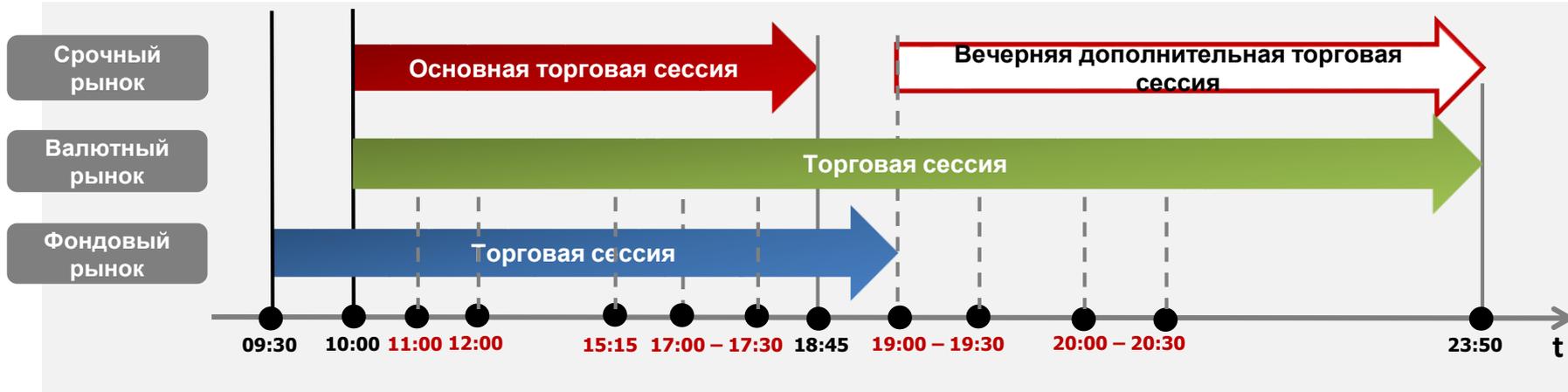


НАЦИОНАЛЬНЫЙ
КЛИРИНГОВЫЙ
ЦЕНТР
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Департамент
Клиринга

**Изменения во временной
регламент исполнения
обязательств в рамках
проекта «Единый пул
обеспечения»**

Временной регламент клиринга для Расчетных кодов Единого пула



- 1 11:00 -** Исполнение обязательств в **тенге**, определенных в Едином клиринговом пуле
- 2 12:00 -** Исполнение обязательств в **юанях, белорусских рублях, гонконгских долларах, швейцарских франках**, определенных в Едином клиринговом пуле
- 3 15:15 -** Исполнение обязательств в **гривнах**, определенных в Едином клиринговом пуле
- 4 17:00 -**
 - Исполнение обязательств в **евро и фунтах стерлингов**, определенных в Едином клиринговом пуле
 - Исполнение обязательств по ценным бумагам, определенных на 1-м этапе формирования Единого клирингового пула
- 5 17:00-17:30-** Заключение с УК сделок РЕПО в случае недостаточности ценных бумаг, определенных на 1-м этапе формирования Единого клирингового пула
- 6 19:00 -** Исполнение обязательств по ценным бумагам, определенных на 2-м этапе формирования Единого клирингового пула
- 7 19:00-19:30-** Заключение с УК сделок РЕПО в случае недостаточности ценных бумаг, определенных на 2-м этапе формирования Единого клирингового пула
- 8 20:00 -** Исполнение обязательств в **долларах США, российских рублях и драг.металлах**, определенных в Едином клиринговом пуле, включая обязательства по уплате комиссионных вознаграждений, штрафов, пеней, неустоек, начисленных в предыдущий Расчетный день
- 9 20:00-20:30-** Заключение сделок своп / РЕПО в случае наличия обязательств по денежным средствам / драг. металлам, для исполнения которых недостаточно денежных средств

Временной регламент клиринга для Расчетных кодов Единого пула¹: денежные средства

Денежные средства	Время определения Итоговых нетто обязательств/ Итоговых нетто-требований (по состоянию на)	Время передачи Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об итоговых нетто-обязательствах/Итоговых нетто-требованиях (EQM13)	Время исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств, определенных в Едином клиринговом пуле ²
1. Российские рубли	19:00	с 19:00 до 19:35 Даты исполнения	до 20:00 Даты исполнения
2. Доллары США	19:00	с 19:00 до 19:35 Даты исполнения	до 20:00 Даты исполнения
3. Евро	По сделкам с наступившей датой исполнения, заключенным до 15:15 – 15:15	Определенных по сделкам, заключенным до 15:15 – с 15:15 до 15:30 Даты исполнения	По сделкам, заключенным до 15:15 - до 17:00 Даты исполнения
	По сделкам с исполнением в дату заключения, заключенным после 15:15 – 19:00	Определенных по сделкам, заключенным после 15:15 – с 19:00 до 19:35 Даты исполнения	По сделкам, заключенным после 15:15 - до 20:00 Даты исполнения
4. Фунты стерлингов	15:15	с 15:15 до 15:30	до 17:00 Даты исполнения
5. Гривны	15:15	с 15:15 до 15:30	до 15:15 Даты исполнения
6. Гонконгские доллары	11:00	с 11:00 до 11:15 Даты исполнения	до 12:00 Даты исполнения
7. Швейцарские франки			до 12:00 Даты исполнения
8. Тенге			до 11:00 Даты исполнения
9. Белорусские рубли			до 12:00 Даты исполнения

! В случае исполнения Итогового нетто-обязательства по денежным средствам с нарушением срока, установленного Временным регламентом Участнику клиринга начисляется штраф



Временной регламент клиринга для Расчетных кодов Единого пула¹: драг.металлы и ценные бумаги (не меняется)

Ценная бумага/ драг. металл	Время определения Итоговых нетто обязательств/ Итоговых нетто-требований	Сроки предоставления отчетов по итогам клиринга	Время исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств, определенных в Едином клиринговом пуле ²
1. Драг. металлы	19:00	с 19:00 до 19:35 Даты исполнения	до 20:00 Даты исполнения
2. Ценные бумаги	По сделкам с наступившей датой исполнения, заключенным до 16:00 – 16:00	с 16:00 до 16:15 Даты исполнения	до 17:00 Даты исполнения
	По сделкам с исполнением в дату заключения, заключенным с 16:00 до 19:00 – 19:00	с 19:00 до 19:15 Даты исполнения	до 19:00 Даты исполнения



Временной регламент клиринга для Расчетных кодов Единого пула¹: заключение сделок урегулирования (не меняется)

Валюта/ ценная бумага/ драг. металл	Сроки заключения сделок урегулирования	Сроки предоставления отчетов
1. Денежные средства	Заключение сделок своп/РЕПО в случае недостаточности денежных средств/драгоценных металлов – с 20:00 до 20:30 Расчетного дня	EQM13 – до 20:45² Расчетного дня (дополнительное время предоставления)
2. Драгоценные металлы		EQM06 – до 20:45² Расчетного дня (предоставляется накопленным итогом)
3. Ценные бумаги	Заключение сделок РЕПО/сделок купли-продажи в случае недостаточности ценных бумаг/отрицательном Едином лимите при исполнении итогового нетто-требования в ценных бумагах, не принимаемых в качестве обеспечения, в 17:00 – с 17:00 до 17:30 Расчетного дня	EQM06 - до 18:00 Расчетного дня
	Заключение сделок РЕПО/сделок купли-продажи в случае недостаточности ценных бумаг/отрицательном Едином лимите при исполнении итогового нетто-требования в ценных бумагах, не принимаемых в качестве обеспечения, в 19:00 – с 19:00 до 19:30 Расчетного дня	EQM06 – до 20:45² Расчетного дня (предоставляется накопленным итогом)



¹ – По Московскому времени

²– при наличии сбоя в платежных системах указанное время может быть продлено по решению Клирингового центра до устранения указанного сбоя

Временной регламент клиринга для Расчетных кодов Единого пула¹: штрафы и комиссионные вознаграждения

Валюта/ ценная бумага/ драг. металл	Исполнение Участниками клиринга обязательств по уплате комиссионных вознаграждений	Исполнение Участниками клиринга обязательств по уплате штрафов, пеней, неустоек	
1. Денежные средства	<p>До 20:00 по сделкам, заключенным:</p> <ul style="list-style-type: none"> • на валютном рынке до 19:00 • на фондовом рынке до 19:00 • по сделкам урегулирования, заключаемым в случае недостаточности ценных бумаг/отрицательном едином лимите • на срочном рынке до 18:45 <p>До 23:50 по сделкам, заключенным:</p> <ul style="list-style-type: none"> • на валютном рынке после 19:00 • на фондовом рынке после 19:00 • по сделкам урегулирования, заключаемым в случае недостаточности денежных средств • на срочном рынке после 19:00 	<p>до 20:00 следующего Расчетного дня</p>	
2. Драгоценные металлы			
3. Ценные бумаги			



Порядок возврата денежных средств по Расчетному коду Единого пула

- Для возврата денежных средств с Расчетного кода Единого пула Участник клиринга подает в НКЦ:
 - **Запрос на возврат обеспечения (разовый) или**
 - **Постоянное поручение на возврат обеспечения**

В Запросе на возврат обеспечения в поле TYPESUMM доступен признак:

1 – возврат средств в размере, указанном в запросе

В Постоянном поручении на возврат в поле TYPESUMM обеспечения доступен признак:

4 - возврат средств в размере Итогового нетто-требования

Запрос на возврат обеспечения или Постоянное поручение на возврат обеспечения необходимо подать:

- по ЭДО фондового рынка или
- с помощью сервиса Web-клиринг

В Запросе на возврат обеспечения по Расчетному коду Единого пула **всегда необходимо указывать сумму.**

Исполнение Постоянного поручения на возврат обеспечения по Расчетному коду Единого пула осуществляется после определения Итоговых нетто-требований до времени cut-off-time, **приведенного ниже** (при условии достаточности Единого лимита).

Денежные средства / драг.металлы	Время исполнения Постоянных поручений на возврат обеспечения, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, для внешних платежей	Время исполнения Постоянных поручений на возврат обеспечения, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, для внутренних платежей
1. Гонконгские доллары	12:45	12:45
2. Белорусские рубли, тенге	13:00	13:00
3. Швейцарские франки	14:00	14:00
4. Юани	14:30	14:30
4. Гривны	16:00	
5. Евро, фунты стерлингов	17:40¹/18:40	19:00¹/20:00
6. Доллары США, российские рубли, драгоценные металлы	20:00	20:00



Особенности использования ранних расчетов на валютном рынке для расчетных кодов Единого пула

Суть изменений: Для Расчетных кодов Единого пула Постоянные поручения на возврат обеспечения будут работать **не в момент ранних расчетов на валютном рынке** (как сейчас), а после **определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований на фондовом рынке**

Описание изменений:

В случае подачи **Запроса на проведение ранних расчетов** или **Постоянного поручения на проведение ранних расчетов**, НКЦ выполняет следующие действия:

1. Определяет Итоговые нетто-обязательства / нетто-требования по сделкам с наступившей датой исполнения, заключенным на валютном рынке
2. После определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований НКЦ прекращает учитывать их в Торгово-клиринговой системе валютного рынка и начинает учитывать в Торгово-клиринговой системе фондового рынка
3. На фондовом рынке НКЦ определяет общее итоговое нетто-обязательство/ нетто-требование с учетом обязательств с трех рынков и после этого исполняет Постоянное поручение на возврат

Подача Запроса на проведение ранних расчетов или Постоянного поручения на проведение ранних расчетов (доступно только на валютном рынке) по Расчетным кодам Единого пула:

- позволит участникам увидеть в терминале фондового рынка нетто-позицию по каждой валюте по обязательствам из сделок, заключенных на трех рынках: фондовом, срочном и валютном рынках,
- даст дополнительное время для обеспечения требуемой суммы на Расчетном коде Единого пула до времени cut-off time.

Также после исполнения Запроса на проведение ранних расчетов или Постоянного поручения на проведение ранних расчетов **на фондовом рынке будет доступен вывод денежных средств с учетом Итоговых нетто-требований по сделкам, заключенным на валютном рынке** (в случае достаточности Единого лимита), на основании Запроса на возврат обеспечения.

7. Изменения в отчетах НКЦ (1/3)

Рынок	Название отчета	Суть изменений
	<p>EQM49 (Отчет о переданных профилях активов на фондовом рынке)</p>	<p>Новый отчет EQM49 будет содержать следующую информацию по каждому Расчетному коду Единого пула:</p> <ul style="list-style-type: none"> - о переданных профилях активов с фондового рынка на валютный и/или срочный рынок; - о значениях Единого лимита на фондовом, валютном и срочном рынках на момент формирования отчета; <p>Отчет будет формироваться по итогам дня, а также будет возможность формировать отчет и по запросу участников в течение дня.</p>
фондовый	<p>EQM99 (Отчет об обеспечении)</p>	<p>В отчет добавлен признак Расчетного кода и ТКС Единого пула. Отчет будет формироваться 2 раза в день: по обычным Расчетным - как в настоящее время, после 20:00, по Расчетным кодам Единого пула - после 23:50.</p> <p>Отчет дополняется следующими обязательствами по Расчетным кодам Единого пула:</p> <ul style="list-style-type: none"> 30 - обязательства по уплате комиссионного вознаграждения на валютном рынке и рынке драгоценных металлов; 31 – обязательства по уплате вариационной маржи на валютном рынке и рынке драгоценных металлов; 32 – обязательства по сделкам с наступившей датой исполнения на валютном рынке и рынке драгоценных металлов; 33 - обязательства по уплате сборов и комиссионного вознаграждения на срочном рынке; 34 - обязательства по уплате вариационной маржи на срочном рынке; 35 – перевод обеспечения между брокерскими фирмами; 36 – зачисление/ списание обеспечения Участнику клиринга-реципиенту/ с Базового Участника клиринга.
	<p>EQM20 (Отчет о Торгово-клиринговых счетах)</p>	<p>В отчет добавляется признак Расчетного кода Единого пула и признак ТКС Единого пула.</p>

* - в случае, если в указанной валюте осуществляются расчеты на фондовом рынке, а также для Расчетных кодов Единого пула



7. Изменения в отчетах НКЦ (2/3)

Рынок	Название отчета	Суть изменений
фондовый	EQM13 (Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях)	По Расчетным кодам Единого пула EQM13 будет формироваться после определения Итоговых нетто-обязательств/ Итоговых нетто-требований: <ol style="list-style-type: none"> 1) в 11:00 (Итоговые нетто-обязательства/ нетто-требования в юанях, белорусских рублях, тенге и гонконгских долларах, швейцарских франках) 2) в 15:15 (Итоговые нетто-обязательства/ нетто-требования в евро, фунтах стерлингов, гривнах) 3) в 16:00 (Итоговые нетто-обязательства/ нетто-требования в ценных бумагах) 4) в 19:00 (Итоговые нетто-обязательства/ нетто-требования в ценных бумагах) 5) в 19:35 (Итоговые нетто-обязательства/ нетто-требования в денежных средствах, включая обязательства/требования по передаче Дохода и обязательства по уплате комиссии по сделкам, заключенным в течение дня на фондовом рынке. Также содержит Итоговые нетто-обязательства/ нетто-требования в евро по сделкам, заключенным после 15:15) 6) в 20:00 для Участников клиринга, с которыми заключались сделки в 3ю сессию
	EQM23 (Отчет по обязательствам T+)	EQM23 будет предоставляться по итогам 2ой клиринговой сессии в 19:35, а для Недобросовестных участников по деньгам – по итогам 3ей клиринговой сессии. Из отчета исключается информация об исполненных Итоговых нетто-обязательствах, вошедшая в EQM13, в отчете отражаются обязательства, по которым не наступила дата исполнения.
валютный	ССХ49 (Отчет о переданных профилях активов на валютном рынке)	Новый отчет ССХ49 будет содержать по каждому Расчетному коду Единого пула информацию о переданных профилях активов с фондового рынка на валютный рынок. Отчет будет формироваться по итогам дня, а также будет возможность формировать отчет и по запросу участников в течение дня.

* - в случае, если в указанной валюте осуществляются расчеты на фондовом рынке, а также для Расчетных кодов Единого пула



7. Изменения в отчетах НКЦ (3/3)

Рынок	Название отчета	Суть изменений
валютный	ССХ84 (Отчет об оценке обеспечения)	Отчет не будет включать Расчетные коды Единого пула. Информация об обеспечении на Расчетных кодах Единого пула будет отражаться в Отчете об оценке обеспечения EQM84, предоставляемом на фондовом рынке
срочный	clientsXX00.csv. (Отчет о разделах клиринговых регистров)	В отчет добавляется информация о признаке Расчетного кода «Единый пул»
	F14_XX00.xls (Сводная финансовая ведомость)	В отчете не будут отражаться средства, учитываемые по Расчетным кодам Единого пула
	daymonXX00.csv. (Предварительный отчет о денежных средствах в рублях РФ, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Обеспечением)	По Идентификатору Участника клиринга (kod XX00000, account «RF») не будут отражаться средства, учитываемые по Расчетным кодам Единого пула. Информация о средствах на account «RF», «CL», «RK» остается без изменений и будет соответствовать лимитам в Торговой системе.
monXX00.csv. (Отчет о денежных средствах в рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Обеспечением)		