

Изменения в Правила клиринга и Формы и Форматы документов и отчётов

С 26.06.2022 г. вступает в силу новая редакция следующих документов НКЦ:

В части Правил клиринга:

Правила клиринга. Часть I. Общая часть;

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

Правила клиринга. Часть III. Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;

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

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

за исключением:

1. В Правилах клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов:

- норм в отношении Порядка передачи доходов по сделкам РЕПО с Банком России, заключенных без участия центрального контрагента;
- норм в отношении добавления возможности подачи Участником клиринга Намерений на заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагам

о дате вступления в силу которых будет сообщено дополнительно

2. В Правилах клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ:

- норм в отношении частичного метчинга

о дате вступления в силу которых будет сообщено дополнительно

Основные изменения представлены в таблице ниже:

№ п/п	Изменения	Нормы ПК	Описание изменений	Влияние на права и обязанности Участников клиринга
1)	Изменения, направленные на обеспечение возможности заключения отдельных сделок нерезидентами	Ст. 2, п. 10.1, п.п. 13.10-13.13, п.14.20, п. 16.4, пп. 16.10.1, пп.16.16.3, п.17.13, п.17.14, п. 21.4, пп. 27.15.5, пп. 27.16.1, п. 27.19, пп. 39.8.3, п.42.1, п. 42.2, пп.46.3.2, п.47.2, пп. 48.5.1, п.49.2, п.55.8 ОЧПК П. 6.9, п. 7.8, п. 11.10, п. 11.11, п. 12.3, пп. 14.1.1, пп. 14.1.2, п.14.2 ПК ФР	Изменения предполагают: - введение отдельной категории Участников клиринга – лиц, которым открыты ТКС нерезидента; - открытие Участникам клиринга-нерезидентам и Участникам клиринга - резидентам, являющимися стороной сделок, заключенных по поручению клиентов-нерезидентов, РК/ТКС нерезидента 1-го уровня и, при необходимости, 2-го и 3-го уровня; - на Фондовом рынке для таких Участников клиринга формируется отдельный клиринговый пул; - предусмотрена возможность учета обеспечения в российских рублях на клиринговом банковском счете типа «С», открытом Клиринговому центру; - установлено право НКО НКЦ (АО) ограничить перечень сделок и активов, учитываемых на таких ТКС; - предусмотрена возможность установить особенности исполнения обязательств нерезидентами или в их интересах при получении разрешения Банка России или Правительственной комиссии.	Изменения влияют на права и обязанности Участников клиринга-нерезидентов и Участников клиринга - резидентов, становящихся стороной сделок по поручению клиентов-нерезидентов.

2)	Определен порядок передачи доходов по сделкам РЕПО с Банком России, заключенных без участия центрального контрагента	Ст. 1, 47, п. 21.1, 21.3, 41.1 ПК ФР	Изменения предусматривают определение порядка передачи Доходов по сделкам РЕПО, заключенным с Банком России без участия центрального контрагента в отдельных Режимах торгов.	Изменения затрагивают права Участников клиринга по получению Дохода и обязанности по его передаче.
3)	Добавление возможности подачи Участником клиринга Намерений на заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагам	П. 18.5-18.10, 18.12-18.13 ПК ФР	Изменения предусматривают: - формулировку понятия Намерения на заключение Внебиржевых сделок как сообщения, содержащего приглашение делать оферты, которое носит исключительно информационный характер и не является офертой на заключение Внебиржевой сделки с ценными бумагами; - определение обязательных реквизитов Намерения на заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами; - установление порядка подачи Намерения на заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами; - определение порядка проверки возможности регистрации Намерения на заключение Внебиржевых сделок в Клиринговой системе.	Изменения предусматривают возникновение у Участника клиринга права на подачу в Клиринговую систему нового типа сообщений – Намерений на заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами.
4)	Определение порядка взимания платы за услугу Клирингового центра по предоставлению отчетов о Внебиржевых сделках, заключенных в Режиме торгов «Двусторонние сделки с ЦК»	п. 18.25, 48.1, 48.11 ПК ФР	Изменения предусматривают: - раскрытие понятия платы за услугу Клирингового центра по предоставлению отчетов о Внебиржевых сделках, заключенных в Режиме торгов «Двусторонние сделки с ЦК»; - определение порядка взимания Клиринговым центром указанной платы с Участников клиринга.	Изменения предусматривают снятие с Участника клиринга обязанности по осуществлению платежа в счет оплаты услуги по предоставлению отчетов о Внебиржевых сделках, заключенных в Режиме торгов «Двусторонние сделки с ЦК» в связи с тем, что указанная плата будет удерживаться Клиринговым центром с основного Расчетного кода Участника клиринга для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга. Изменения предусматривают возникновение у Участника клиринга обязанности по предоставлению Клиринговому центру реквизитов в системе ЭДО, аккредитованной Федеральной налоговой службой.
5)	Расширен перечень предметов обязательств из сделок с иностранной валютой	Приложение №6 к ОЧПК	Изменения предусматривают добавление новых видов валют (узбекских сум, армянских драмов, дирхамов ОАЭ), являющихся предметом обязательств из сделок с иностранной валютой во временной регламент Клирингового центра.	Изменения наделяют Участников клиринга правами по заключению сделок с новыми видами предметов обязательств.

6)	В отношении юаней изменен временной интервал приема Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов на возврат обеспечения, Запросов на депонирование, а также приема Клиринговым центром от НКО АО НРД Запросов на получение денежных средств	Приложение №6 к ОЧПК	Временной интервал приема Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов на возврат обеспечения, Запросов на депонирование, а также приема Клиринговым центром от НКО АО НРД Запросов на получение денежных средств в отношении юаней продлен до 13.00 Расчетного дня.	Изменения наделяют Участников клиринга правом подавать Запросы на возврат обеспечения в целях возврата денежных средств из Обеспечения / Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс и Запросы на депонирование в отношении юаней до 13.00 Расчетного дня.
7)	Уточнены временные интервалы подачи Предложений / Намерений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами в зависимости от режима	Приложение №2 к ПК ФР	Изменения предусматривают установление различных временных интервалов подачи Предложений / Намерений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами для режимов «Сделки с ЦК», «Встречный аукцион с ЦК», «Двусторонние сделки с ЦК».	Изменения затрагивают права Участников клиринга, связанные с возможностью подачи Предложений / Намерений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами.
8)	Разработан новый Отчет об изменении суммы депозита	п. 35.24, 49.2 ПК ФР	Изменения предусматривают включение в состав документов, удостоверяющих изменение суммы депозита в связи с частичным изъятием суммы депозита, а также содержащих информацию о процентной ставке по депозитному договору, Отчета об изменении суммы депозита.	Изменения не оказывают влияния на права и обязанности Участников клиринга.
9)	Частичный метчинг на рынке СПФИ	п. 13.3, 13.9 ПК СПФИ	Изменения предусматривают возможность заключения Договоров СПФИ на основании Предложений, условия которых могут быть не полностью идентичными по объему.	Изменения оказывают влияние на права и обязанности Участников клиринга: у Участников клиринга появляется новая возможность заключать Договоры СПФИ на основании Предложений, не совпадающих по объему.

С 27.06.2022 г. вступает в силу новая редакция следующих документов НКЦ:

В части Форм и форматов документов и отчётов

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

1. В связи с запуском торгов и расчетов для нерезидентов с использованием счетов типа «С»:
 - 1.1. Внесены изменения в форму Запроса на открытие Расчетного кода (п. 2.7);
 - 1.2. Добавлена форма нового Запроса на присвоение / отмену статуса Расчетного кода нерезидента (п. 2.14);
 - 1.3. Внесены изменения в форму Заявления об использовании Расчетного кода для заключения сделок за счет обеспечения, переданного клиентом в собственность на основании соглашения о передаче прав собственности на обеспечение (п. 2.12);

- 1.4. Внесены изменения в форму Заявления об изменении типа Расчетного кода для заключения сделок за счет обеспечения, переданного клиентом в собственность на основании соглашения о передаче прав собственности на обеспечение» (п. 2.13);
2. Внесены изменения в форму Запроса на возврат обеспечения в иностранной валюте (документ CURRETURN) (п. 5.2.2).
3. Внесено уточнение в форму Постоянного поручения на возврат обеспечения (п. 2.21).
4. Добавлена печатная форма Отчета о Расчетных кодах и реквизитах Участника клиринга (форма ССХ98) (п. 6.8)

Формы и форматы документов и отчётов. Часть II. Формы и форматы на фондовом рынке и рынке депозитов

1. В связи с запуском торгов и расчетов для нерезидентов с использованием счетов типа «С»:
 - 1.1. Внесены изменения в форму Запроса на открытие Торгово-клирингового счета (п. 2.1);
 - 1.2. Добавлена форма нового Запроса на закрытие Торгово-клирингового счета (п. 2.2);
 - 1.3. Внесены уточнения в форму Запроса на открытие торгово-клирингового счета (в файле заданного формата txt) (п. 6.1);
 - 1.4. Внесены уточнения в форму Заявления о соответствии Торгово-клирингового счета (п. 2.10);
 - 1.5. Внесено уточнение в форму Заявления о соответствии Торгово-клиринговых счетов по умолчанию (п. 2.11).
2. Удален раздел 7.2. «Отчеты, предоставляемые Участникам клиринга – Некредитным организациям, не являющимся профессиональными участниками рынка ценных бумаг», отчеты перенесены в раздел 7.1. «Отчеты, предоставляемые Участникам клиринга, Участникам торгов» в связи с допуском профучастников к рынку депозитов.
3. Внесено уточнение в форму Постоянного поручения на возврат обеспечения (п. 2.12).