

С 10.10.2022 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 VI. Правила клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

Основные изменения представлены в таблице ниже:

№ п/п	Изменения	Нормы ПК	Описание изменений	Влияние на права и обязанности Участников клиринга
1)	<b>Изменение порядка исполнения однодневных расчетных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией</b>	Ст.29, Приложение 1 ПК СР	Изменения предусматривают: - установление порядка исполнения однодневных расчетных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией посредством направления Участником клиринга - Покупателем или Участником клиринга - Продавцом поручения об исполнении расчетного фьючерсного контракта и заключения без дополнительной подачи заявок между Клиринговым центром и Участником клиринга – Покупателем или между Клиринговым центром и Участником клиринга - Продавцом квартального фьючерсного контракта; - установление времени подачи Поручения об исполнении расчетного фьючерсного контракта; - установление времени исполнения расчетных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией.	Изменения влияют на права и обязанности Участников клиринга, поскольку предполагают предоставление Участникам клиринга прав / наделение Участников клиринга обязанностями по исполнению фьючерсных контрактов с автопродлонгацией посредством заключения квартального фьючерсного контракта.
2)	<b>Изменение порядка досрочного прекращения Договоров СПФИ</b>	П.3.2, 10.5,12.2, ст.18, п. 19.4, 22.2.4, 22.3.1, 22.3.5, 28.3, Приложение 1 ПК СПФИ	Изменения предусматривают определение новой процедуры досрочного прекращения Договоров СПФИ, основанной на заключении офсетной сделки, в том числе: - вводят понятие офсетной сделки; - определяют действия НКО НКЦ (АО) при заключении офсетной сделки; - устанавливают порядок прекращения офсетных сделок; - определяют временной интервал передачи Участником клиринга НКО НКЦ (АО) Заявления об изменении условий Договора СПФИ и пр.	Изменения оказывают влияние на права и обязанности Участников клиринга, возникающие при досрочном исполнении Договоров СПФИ.

3)	<b>Уточнение порядка проведения контроля в отношении заявок с отложенной датой активации на условиях «Частичное обеспечение/отступное» со ставкой частичного обеспечения в размере 100%</b>	П. 20.5 ПК ФР	<p>Изменения предполагают следующее уточнение - для заявок на покупку с отложенной датой активации на условиях «Частичное обеспечение/отступное» со ставкой частичного обеспечения в размере 100% осуществляется дополнительная Процедура контроля обеспечения при подаче такой заявки или в иной момент, установленный решением Биржи. При этом указывается, что основная Процедура контроля обеспечения в отношении указанных заявок не производится.</p> <p>В настоящее время для заявок с отложенной активацией на условиях "Частичное обеспечение (отступное)" со ставкой частичного обеспечения 100% предусмотрена дополнительная и основная проверка. Дополнительная проверка производится накануне даты активации заявки. Основная - при активации. После прохождения дополнительной проверки, в результате которой установлено, что обеспечения достаточно для заключения сделки, с Участника клиринга может быть списано комиссионное вознаграждение. В результате такого списания размера обеспечения может стать недостаточно для заключения сделки. Поэтому на следующий день при проведении основной процедуры проверки, заявка Участника клиринга будет отклонена. Чтобы избежать этого, отменили основную проверку достаточности обеспечения. При этом, если обеспечения недостаточно, к активированной заявке Участника клиринга будут применяться меры урегулирования, предусмотренные Правилами клиринга.</p>	<p>Изменения влияют на права Участников клиринга, предоставляя им право заключать сделки по заявкам с отложенной датой активации на условиях «Частичное обеспечение/отступное» со ставкой частичного обеспечения в размере 100% в ситуации нехватки денежных средств.</p>
4)	<b>Уточнение требований к лицам, выдающим гарантию в случае несоответствия Участника клиринга требованиям по наличию действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках и требованиям к размеру собственных средств (капитала)</b>	П.8.3.2 ПК ФР	<p>Изменения предусматривают, что гарантами в случае несоответствия Участника клиринга требованиям по наличию действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках и требованиям к размеру собственных средств (капитала) могут выступать только резиденты РФ.</p>	<p>Изменения влияют на обязанности Участника клиринга по предоставлению гарантии в случае несоответствия Участника клиринга требованиям по наличию действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках и требованиям к размеру собственных средств (капитала).</p>

5)	<b>Уточнение оснований приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга по депозитным договорам</b>	П. 9.3 ПК ФР	Изменения предусматривают возникновение нового основания приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга по депозитным договорам – получении информации о наличии в отношении такого Участника клиринга решения о приостановлении операций по счетам налогоплательщика-организации и/или плательщика, принятого федеральным органом исполнительной власти.	Изменения оказывают влияние на права Участника клиринга по допуску его к клиринговому обслуживанию.
6)	<b>Внесение изменений в порядок расчета Обеспечения под стресс</b>	П. 11.7.1, 16.8, 32.4, Приложение 6 ОЧПК	Изменения предусматривают ежедневный расчет Обеспечения под стресс.	Изменения оказывают влияние на обязанности Участников клиринга по внесению Обеспечения под стресс.
7)	<b>Привлечение средств Федеральным казначейством через РЕПО с ЦК</b>	П. 37.2, 37.3 ПК ФР	Внесены правки, направленные на предоставление возможности Федеральному казначейству привлекать средства через РЕПО с ЦК. В частности изменения предусматривают уточнение размера денежных средств, в котором исполняются постоянные поручения на возврат обеспечения, поданные Федеральным казначейством Участником клиринга категории «К».	Изменения оказывают влияние на права Участника клиринга категории «К» (Федерального казначейства) по заключению с Центральным контрагентом сделок РЕПО.
8)	<b>Уточнение порядка действий в случае включения Доверенного владельца счетов в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму</b>	П. 39.1, 39.2 ПК СР	Изменения предполагают уточнение того, что: - в дату включения в перечень Доверенного владельца счетов, за исключением Доверенных владельцев счетов, являющихся Участниками клиринга, НКО НКЦ (АО) незамедлительно аннулирует статус Доверенного владельца счетов у Участника клиринга; - в дату включения в перечень Доверенного владельца счетов, за исключением Доверенных владельцев счетов, являющихся Участниками клиринга, обязательства Участника клиринга по Срочным контрактам, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих коды Обособленных Брокерских фирм, за которыми закреплен такой Доверенный владелец счетов, прекращаются полностью возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, рассчитываемого в российских рублях как сумма с учетом знака также иных обязательств, учитываемых в соответствии с ПК СР на дату включения Доверенного владельца счетов в перечень по разделам регистра учета позиций Участника клиринга, имеющим коды Обособленных Брокерских фирм, за которыми закреплен такой Доверенный владелец счетов.	Изменения затрагивают права и обязанности Участников клиринга, связанные со статусом Доверенного владельца счетов.

9)	<b>Ограничение на перевод Профилей активов в ценных бумагах эмитентов, аффилированных с Участником клиринга по собственным Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга</b>	П.28.3 ОЧПК	Изменения предусматривают добавление следующего условия исполнения Запроса на передачу Профилей активов - исполнение Запроса на передачу Профилей активов в ценных бумагах, эмитентом которых является лицо, аффилированное с Участником клиринга, по собственным Торгово-клиринговым счетам с признаком «Единый пул», если его исполнение приведет к увеличению по модулю количества ценных бумаг по Торгово-клиринговому счету первого и/или второго биржевого рынка.	Изменение оказывает влияние на права Участников клиринга по переводу Профилей активов в ценных бумагах эмитентов, аффилированных с Участником клиринга.
10)	<b>Определение сферы ответственности Участников клиринга</b>	П. 17.12 ОЧПК	Изменения предусматривают, что Участник клиринга несет ответственность за определение того, является ли Нерезидентом из перечня лицо, в интересах и (или) за счет которого заключаются сделки, стороной по которым становится такой Участник клиринга, а также за соответствие совершаемых в интересах и (или) за счет такого лица операциях и сделках, требованиям нормативных актов, и выбор типа Торгово-клирингового счета и Расчетного кода, открываемого для возможности становиться стороной по сделкам, заключаемым в интересах и (или) за счет такого лица.	Изменение оказывает влияние на обязанности Участника клиринга в сфере идентификации Нерезидентов из перечня.
11)	<b>Изменения в порядок взаимодействия НКО НКЦ (АО) с лицом, с которым заключен договор о ведении клиринговых регистров</b>	П. 4.17, 5.17 ОЧПК	Изменениями предусмотрены: - уточнения в порядок предоставления заверений; - добавление основания прекращения договора о ведении клиринговых регистров: нарушение Участником торгов предусмотренных Правилами клиринга заверений, а также неоднократное нарушение Участником торгов положений Правил клиринга.	Изменения оказывают влияния на права и обязанности Участников клиринга.
12)	<b>Уточнен порядок исполнения постоянных поручений на возврат обеспечения в иностранной валюте / драгоценных металлах</b>	П. 30.7.1 ОЧПК	Изменения предусматривают, что постоянное поручение на возврат обеспечения, поданное Участником клиринга в отношении всех иностранных валют / драгоценных металлов исполняется Клиринговым центром в отношении иностранных валют / драгоценных металлов, в которых Клиринговый центр открывал Счета обеспечения на момент подачи данного Поручения.	Изменения оказывают влияние на права Участников клиринга, связанные с подачей постоянных поручений на возврат обеспечения в иностранной валюте / драгоценных металлах.
13)	<b>Внесены уточнения в порядок регистрации и изменения</b>	П. 23.1, 23.1.1 ОЧПК	Изменениями предусмотрено:	Правки оказывают влияние на обязанности Участников клиринга, связанные с

	<b>сведений об Обособленных клиентах</b>		<ul style="list-style-type: none"> <li>- уточнение перечня реквизитов, указанных в Запросе на регистрацию Обособленного клиента;</li> <li>- определение порядка обновления сведений об Обособленном клиенте – в случае изменения сведений об Обособленном клиенте.</li> </ul>	предоставлением информации об Обособленных клиентах.
<b>14)</b>	<b>Ограничение ответственности НКО НКЦ (АО) в отношении клиентов Участников клиринга</b>	П. 16.10.2 ОЧПК	Изменения предусматривают, что Правила клиринга не регулируют отношения между НКО НКЦ (АО) и клиентами Участников клиринга, иными лицами в интересах и (или) за счет которых действуют Участники клиринга, за исключением случаев, прямо предусмотренных в Правилах клиринга. Ссылка на Правила клиринга в правоотношениях между третьими лицами не влечет возникновение прав и обязанностей НКО НКЦ (АО) в отношении каких-либо третьих лиц. НКО НКЦ (АО) не несет ответственность перед клиентами Участников клиринга, иными лицами в интересах и (или) за счет которых действуют Участники клиринга, в том числе за действия Участников клиринга.	Изменения не оказывают влияния на права и обязанности Участников клиринга, но затрагивают права клиентов Участников клиринга.
<b>15)</b>	<b>Изменения во временные регламенты Правил клиринга (за исключением указанных выше)</b>	Приложение 6 ОЧПК, Приложение 1 ПК ВР	Изменения предусматривают: <ul style="list-style-type: none"> <li>- уточнение времени определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по армянским драмам;</li> <li>- уточнение времени подачи Предложений для заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами.</li> </ul>	Предполагая изменение времени совершения тех или иных операций, а также установление времени для новых видов операций, указанные изменения оказывают влияние на права и обязанности Участников клиринга.
<b>16)</b>	<b>Определение особенностей учета драгоценных металлов на клиентских Расчетных кодах</b>	П. 4.7, ст. 22 ПК ВР	Изменения предусматривают определение особенностей учета драгоценных металлов на клиентских Расчетных кодах, в том числе определяют обязанность Участника клиринга предоставлять Клиринговому центру информацию о клиентах - физических лицах, имущество которых учитывается по клиентскому Расчетному коду физических лиц, при осуществлении процедуры выдачи слитков драгоценных металлов.	Изменения оказывают влияние на права и обязанности Участников клиринга, связанные с открытием отдельных торговых банковских счетов, отдельных клиентских Расчетных кодов для учета драгоценных металлов, переданных Участнику клиринга его клиентами-физическими лицами, являющимися резидентами Российской Федерации.  В том числе изменения оказывают влияние на обязанность Участника клиринга предоставлять Клиринговому центру информацию о клиентах - физических лицах, имущество которых учитывается по клиентскому Расчетному коду физических лиц, при осуществлении процедуры выдачи слитков драгоценных металлов.

### **В части Тарифов:**

1. Изменение тарифов на рынке акций: переход от регрессивной к плоской шкале тарификации и переход от симметричной к асимметричной модели тарификации комиссии по сделкам. Разделение комиссий для мейкеров и тейкеров (п. 1 Раздела III). – *вступают в силу с 01.11.2022 г.*
2. Изменение тарифов на рынке облигаций: введение стимулирующих тарифов для стакана с регрессионной шкалой, повышение маржинальности адресных режимов, увеличение порогов и уменьшение дисконтов за крупные сделки (п. 3 Раздела III). – *вступают в силу с 01.01.2023 г.*
3. Внесение изменений, предполагающих тарификацию в разрезе подгрупп «мелкие лоты» и «крупные лоты» на валютном рынке (п. 2 Раздела IV). – *вступают в силу с 10.10.2022 г.*
4. Введение комиссионного вознаграждения за клиринг при исполнении однодневных расчетных фьючерсных контрактов с автопродлонгацией (п. 9 Раздела V). – *вступают в силу с 10.10.2022 г.*
5. Редакционные правки (Раздел II). – *вступают в силу с 10.10.2022 г.*

### **В части Форм и Форматов документов и отчетов:**

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

Внесены изменения в форму Запроса на открытие Расчетного кода (п. 2.7):

- удален раздел о регистрации на рынке депозитов, поскольку для рынка депозитов используется Расчетный код, открытый на фондовом рынке
- добавлено примечание, что на основании данного Запроса происходит также открытие Торгового-клирингового счета на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

#### **Формы и форматы документов и отчетов. Часть II. Формы и форматы на фондовом рынке и рынке депозитов.**

1. Внесены изменения в форму Запроса на открытие Торгового-клирингового счета, а также в формат электронного документа TCA1ADD: удалена возможность указания в Запросе нового Расчетного кода
2. Внесены изменения в форму Запроса на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула: добавлена сноска, что на основании данного Запроса открывается Расчетный код имущественного пула
3. Запрос на закрытие Торгово-клирингового счета, TCA1DEL переименованы в Запросы на аннулирование связки субсчета и Расчетного кода.

**Формы и форматы документов и отчетов. Часть IV. Формы и форматы на срочном рынке**

Внесены изменения в форматы отчетов, связанные с релизом [Spectra 7.3](#)

**Формы и форматы документов и отчетов. Часть VI. Формы и форматы на рынке Стандартизированных ПФИ**

1. В связи с отсутствием актуальности удалена форма Требования об исполнении опционного договора
2. Внесены изменения в Клиринговый отчет: добавлены отдельные таблицы параметров для поставочных валютных форвардных договоров и для расчетных валютных форвардных договоров.