|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Изменения** | **Пункт  Правил клиринга** | **Описание изменений** | **Влияние на права и обязанности  Участников клиринга** |
| 1. **Автоматизация процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, замены Торгово-клирингового счета** | Подпункт 40.8.3, пункты 58.13, 58.16-58.18, 58.22 общей части Правил клиринга, пункт 7.5 приложения 6 к общей части Правил клиринга. | Изменения касаются автоматизации процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, замены Торгово-клирингового счета.  В действующей редакции правил клиринга определено, что при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, Клиринговый центр устанавливает Режим урегулирования по Расчетному коду Базового Участника клиринга. Новой редакцией определено, что в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по поручению Базового Участника клиринга, Клиринговый центр устанавливает Режим урегулирования также и по Расчетному коду Участника клиринга – реципиента.  Определены случаи, при которых процедура Перевода обязательств и Обеспечения не проводится (п.58.16).  Установлено, что в случае если процедура Перевода обязательств и Обеспечения проводится при банкротстве или отзыве лиценции и Дата исполнения обязательства приходится на период проведения указанной процедуры, Дата исполнения обязательства изменяется (п.58.18).  Условия исполнения Запроса на замену Торгово-клирингового счета дополнены тремя новыми условиями (п.40.8.3.).  Определено, что после проведения процедуры портабилити Участник клиринга – реципиент вправе предоставить информацию о кратком коде клиента в сделках (п.58.22). | Установлены случаи, при которых процедура Перевода обязательств и Обеспечения не проводится.  Участнику клиринга – реципиенту предоставлено право предоставить информацию о кратком коде клиента в сделках, обязательства по которым были переведены такому Участнику клиринга - реципиенту. |
| 1. **Изменения, связанные с развитием сервиса «Единый счет НКЦ и НРД» (в части депо счетов)** | Пункты 32.2, 32.12, 32.13, 55.9 общей части Правил клиринга. | Порядок обработки получаемых НКЦ от НРД запросов согласия Клирингового центра на списание ценных бумаг с Разделов изменен таким образом, чтобы НКЦ не давал согласие на списание ценных бумаг, которые необходимы для исполнения Сделок Т+ с наступившей Датой исполнения. | У Участников клиринга появляется возможность использовать сервисы по подбору ценных бумаг в НРД по торговым счетам депо, клиринг с использованием которых осуществляет НКЦ, без риска списания с этих торговых счетов ценных бумаг, необходимых для исполнения обязательств по сделкам с наступившей датой исполнения и, как следствие, без риска неисполнения обязательств перед НКЦ. |
| 1. **Определение порядка изменения даты исполнения обязательств по сделкам с ЦК в случае принятия Правительством РФ постановления о переносе нерабочих (праздничных) и выходных дней** | Пункт 40.5 общей части Правил клиринга.  Пункт 27.14 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.  Пункт 16.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов. | В действующей редакции правил клиринга порядок изменения даты исполнения обязательств по сделкам с ЦК определен для валютного рынка, но не определен для фондового рынка.  В новой редакции правил клиринга определен порядок изменения даты исполнения обязательств по сделкам с ЦК, а также иных условий сделок с ЦК на фондовом рынке, порядок изменения даты исполнения обязательств по сделкам с ЦК на валютном рынке унифицирован с порядком, реализуемым на фондовом рынке. | У Участников клиринга появляется информация, как изменятся условия сделок с ЦК в случае принятия Правительством РФ постановления о переносе нерабочих (праздничных) и выходных дней. |
| 1. **Изменение порядка исполнения Постоянного поручения на возврат обеспечения в размере нетто-требования**   **О технической готовности будет сообщено дополнительно** | Пп. 32.7, 32.7.3 – 32.7.6, 32.11 общей части Правил клиринга. | В настоящее время Постоянное поручение на возврат обеспечения в размере нетто-требования на фондовом рынке исполняется в размере нетто-требования, которое рассчитывается с учетом только Сделок Т+, и не учитывает Сделки Т+ и сделки без ЦК, исполненные путем подачи отчетов на исполнение. В отдельных случаях это приводит к тому, что сначала на основании такого поручения Участинку клиринга возвращаются денежные средств, после чего у Участника клиринга может стать недостаточно денежных средств для исполнения Сделок Т+.  Порядок исполнения поручения изменен таким образом, чтобы учитывать все обязательства и требования Участника клиринга с наступившей Датой исполнения, на фондовом и валютном рынках. | Исключается возникновение у Участника клиринга недостаточности денежных средств для исполнения Постоянного поручения на возврат обеспечения в размере нетто-требования. |
| 1. **Уточнение условий, необходимых для возврата Обеспечения, отменена заключения сделок РЕПО переноса в случае недостаточности Единого лимита** | Пп. 32.11, 32.12 общей части Правил клиринга, пп.44.1.5 общей части Правил клиринга исключен, п.44.1.5 общей части Правил клиринга, пп. 45.4, 47.3.2, 47.4.5, 47.6.2 общей части Правил клиринга исключены, п.47.8 общей части Правил клиринга, пп.3.1, 5.1, 5.6, 5.7, 6.3 приложения 6 общей части Правил клиринга. | Изменены условия, необходимые для возврата Обеспечения: возврат не осуществляется, если Единый лимит отрицательный или станет отрицательным в результате возврата Обеспечения.  Отменено заключение сделок РЕПО переноса в случае если у Участника клиринга имеется Итоговое нетто-требование по ценным бумагам, не принимаемым в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, и в результате исполнения (прекращения) указанного Итогового нетто-требования по ценным бумагам Единый лимит станет отрицательным. | Порядок и условия заключения сделок урегулирования становятся более прозрачными для Участников клиринга.  Участнику клиринга гарантируется получение по сделке ценных бумаг, в т.ч. не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств, при наличии у такого Участника клиринга необходимых денежных средств. |
| 1. **Возможность перевода всех Расчетных кодов рынка СПФИ в Расчетные коды Единого пула** | Пункты 2.4, 2.5, подпукнт 21.2.8 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, пункты 3.12, 20.1, 20.2, 20.2.1, 25.1.1, 51.3-51.4, 51.12-51.14, 51.19, 51.21 общей части Правил клиринга. | В рамках задачи по автоматизации дефолт-менеджмента на рынке СПФИ с даты, установленной отдельным решением НКЦ, всем Расчетным кодам, открытым для рынка СПФИ, будет присвоен признак «Единый пул». **(О точной дате будет сообщено дополнительно, планируемая дата – 01.12.20)**  Правила клиринга дополнены положениями, в соответствии с которыми, если Расчетный код является Расчетным кодом Единого пула и уровни защиты центрального контрагента используются в случае возникновения у Участника клиринга Маржинального требования, то Обеспечение, Обеспечение под стресс и взнос в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга используется, в первую очередь, на том рынке, на котором возникло Маржинальное требование, а выделенный капитал центрального контрагента и средства Гарантийных фондов из взносов Добросовестных участников клиринга используются на том биржевом рынке, на котором возникло Маржинальное требование. | Не влияет на права и обязанности Участников клиринга. |
| 1. **Предоставление Участникам клиринга, не допущенным к клирингу на фондовом рынке, доступа к Единому пулу обеспечения**   **О полной технической готовности сервиса, включая НРД, будет сообщено дополнительно** | П.15.11 общей части Правил клиринга, п.16.1.1 общей части Правил клиринга исключен, пп.16.2-16.3, 16.6, 20.8 общей части Правил клиринга, пп.11.2, 11.2.1, 11.2.2, 11.3, 11.3.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов исключены, п.11.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов . | В общую часть Правил клиринга из фондовой части перенесен порядок отрытия Торгово-клиринговых счетов, в состав которых не входит торговый раздел счета депо, и которые могут быть использованы для заключения сделок за счет Единого пула обеспечения Участниками клиринга, не допущенными к клирингу на фондовом рынке.  Определено, что объединение рынков в Единый пул обеспечения выполняется при условии совпадения категории Участника клиринга на объединяемых рынках.  **Вниманию участников рынка депозитов:** предусмотрена возможность внесения ценных бумаг в Обеспечение, Обеспечение под стресс и в Гарантийный фонд (после технической готовности со стороны НРД). | У Участников клиринга, не допущенных к клирингу на фондовом рынке, появляется возможность использовать Единый пул обеспечения. |
| 1. **Определение порядка проверки возможности регистрации заявок с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит Раздел на эмиссионном счете или казначейском счете депо** | Пункт 19.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. | Правилами клиринга установлено, что необходимым условием регистрации заявки, поданной с указанием Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Раздел на эмиссионном счете или казначейском счете депо, является:  владелец эмиссионного счета или казначейского счета депо (по информации о владельце эмиссионного счета или казначейского счета депо, полученной от Расчетного депозитария) является эмитентом ценной бумаги, указанной в заявке,  или  от Участника клиринга получено уведомление о проведении выкупа, в котором Участник клиринга указан как покупатель при осуществлении выкупа. | Освобождает Участников клиринга от необходимости подачи заявлений при размещении и выкупе ценных бумаг в случае, если Клиринговый центр может самостоятельно идентифицировать владельца раздела как эмитента ценной бумаги. |
| 1. **Уточнение статуса Обеспечения в иностранной валюте на валютном рынке и рынке драгоценных металлов** | Подпункт 3.5.3 общей части Правил клиринга.  Пункт 2.8 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов. | В целях унификации формулировок Правил клиринга, касающихся описания статуса Обеспечения в иностранной валюте на разных рынках, определение иного обеспечения перенесено из Правил клиринга на валютном рынке в общуй часть Правил клиринга, в Правила клиринга на валютном рынке включено положение, явно устанавливающее, что Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, учитываемое по Расчетным кодам, открытым для валютного рынка и рынка драгоценных металлов и не являющимся Расчетными кодами Единого пула, является иным обеспечением (указанное положение не меняет существующий статус Обеспечения в иностранной валюте на валютном рынке и рынке драгоценных металлов). | Не влияет на права и обязанности Участников клиринга. |
| 1. **Изменения, связанные с продлением торгов TOD отдельными валютами до 12:00** | Приложение 6 к общей части Правил клиринга. | Временной регламент изменен с учетом продления до 12:00 времени торгов инструментами TOD по швейцарским франкам, юаням, турецким лирам, белорусским рублям, тенге. | Не влияет на права и обязанности Участников клиринга. |
| 1. **Уточнение временного регламента** | Приложение 6 к общей части Правил клиринга. | Установлено время передачи профилей – с 9:05 до 23:50 Расчётного дня.  Уточнено время исполнения Постоянных поручений на возврат обеспечения для внутренних платежей по российским рублям – 19:45. | Не влияет на права и обязанности Участников клиринга, поскольку фиксирует в Правилах клиринга действующий временной регламент. |
| 1. **Уточнение порядка определения суммы, на которую заключается депозитный договор** | Пп. 34.6.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. | Уточнен порядок определения суммы, на которую заключается депозитный договор в иностранной валюте: учтены округления, возникающие при расчете суммы. | Не влияет на права и обязанности Участников клиринга. |
| 1. **Изменение порядка закрытия Расчетных кодов Участника клиринга, уточнение условий прекращения допуска к клиринговому обслуживанию на основании заявления Участника клиринга** | Пп.14.16, 14.19, 15.19 – 15.21 общей части Правил клиринга. | Изменен порядок закрытия Расчетных кодов Участников клиринга: закрытие осуществляется НКЦ при прекращении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на соответствующем рынке или по запросу Участника клиринга. Запрос Участника клиринга исполняется при условии отсутствия у Участника клиринга неисполненных обязательств и Обеспечения, учитываемых по такому Расчетному коду.  В связи с изменением порядка закрытия Расчетных кодов Участников клиринга переформулированы условия прекращения допуска к клиринговому обслуживанию на основании заявления Участника клиринга. | Для исполнения Запроса на закрытие Расчетного кода Участнику клиринга нужно предварительно вывести Обеспечение, учитываемое по такому Расчетному коду. |
| 1. **Уточнение формулировки случая, при котором НКЦ не вправе принять решение о проведении ликвидационного неттинга в случае назначения временной администрации по управлению Участником клиринга – Кредитной организацией** | П.14.17.1, 60.4 общей части Правил клиринга. | В случае назначения временной администрации по управлению Участником клиринга – Кредитной организацией в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации, Клиринговый центр вправе, начиная с даты назначения временной администрации, принять решение о проведении в отношении такого Участника клиринга ликвидационного неттинга, за исключением случая публичного заявления Банка России об оказании финансовой поддержки такому Участнику клиринга – Кредитной организации в целях обеспечения непрерывности его деятельности. | Не влияет на права и обязанности Участников клиринга. |
| 1. **Устранение дублирующих положений о прекращении Договора об оказании клиринговых услуг и прекращении допуска к клиринговому обслуживанию** | Пункты 4.11, 14.15, 14.17-14.18 общей части Правил клиринга. | В действующей редакции правил клиринга три основания являются одновременно и основаниями прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, и основаниями прекращения допуска к клиринговому обслуживанию.  В новой редакции правил клиринга это дублирование устранено, формулировки оснований прекращения допуска к клиринговому обслуживанию приведения в соответствие формулировкам оснований проведения ликвидационного неттинга. | Не влияет на права и обязанности Участников клиринга. |

**Правила клиринга вступают в силу, за исключением:**

1. в **Части I** Правил клиринга:

* **пунктов 32.7, 32.11,**

В связи с технической неготовностью реализации задачи по изменению порядка исполнения Постоянного поручения на возврат обеспечения в размере Итогового нетто-требования, будут действовать пункты 32.7 и 32.11 из предыдущей редакции Части I Правил клиринга.

* **подпункта 1) пункта 33.6,**

В связи с планируемой реализацией задачи по предоставлению корпоратам доступа к Единому пулу обеспечения которая позволяет Участнику клиринга, не имея допуск к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, получить доступ к сервисам Единого пула обеспечения, и возможности внесения с 28.09.20 ценных бумаг в обеспечение, подпункт 1) пункта 33.6 будет исключен из ближайшей следующей редакции Части I Правил клиринга.

* **пунктов 41.8, 41.9.**

Реализация задачи «Ранние расчеты на ФР с возможностью возврата обеспечения» не включена в релиз ФР и ВР 28 сентября 2020 г.

Вступление в силу пунктов 32.7, 32.11, 41.8, 41.9 будет определено отдельным решением Правления.

1. в **Части II** Правил клиринга:

* **пунктов 22.2, 27.14, статьи 35.**

Реализация задачи Т-1461 «Досрочный возврат депозитов с ЦК», не включена в релиз ФР и ВР 28 сентября 2020 г.

Вступление в силу пунктов 22.2, 27.14, статьи 35 будет определено отдельным решением Правления.

1. в **Части VI** Правил клиринга:

* **пунктов 4.5, 4.6.**

Вступление в силу пунктов 4.5, 4.6, устанавливающих допуск корпоративных клиентов и страховых компаний на рынок СПФИ, будет определено отдельным решением Правления.