Изменения в клиринге на рынке СПФИ с 27.05.2019

НКЦ реализует проект «Единый клиринг на рынке СПФИ», предоставляющий новые возможности для Участников клиринга на рынке СПФИ, включая переводы денежных средств между рынками и включение СПФИ в Единый пул обеспечения.

Изменения в клиринге рынка СПФИ планируется внедрить поэтапно в мае-июле 2019 г.

**Этап 1. Унификация учета обеспечения на рынке СПФИ и других рынках**, единая технология внесения, возврата и перевода денежных средств на всех рынках с 27.05.2019:

1. Изменяются номера счетов для внесения обеспечения
2. Появляется возможность вносить обеспечение в евро
3. Обеспечение в иностранной валюте получает статус «иное обеспечение».
4. Возможность направлять через Web-клиринг запросы, аналогично другим рынкам:

- переводы денежных средств между рынками

- постоянный возврат денежных средств

- запрос выписок

- регистрация реквизитов счетов для возврата

- запросы на возврат обеспечения (сохраняется)

- запрос отчета о Расчетных кодах

- запрос на открытие Расчетного кода

1. Появляются новые отчеты о движении денежных средств

**Основные изменения:**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | **Было** | **Стало** |
| **Валюты в обеспечении** | Рубли, доллары | Рубли, доллары, евро |
| **Реквизиты для зачисления денежных средств** | Отдельные счета для рынка СПФИ | Единые счета для всех рынков, включая СПФИ |
| **Статус обеспечения в валюте** | Индивидуальное клиринговое | Иное |
| **Управление обеспечением\*** | Запросы на возврат обеспечения  | Запросы на возврат, постоянные поручения на возврат, запросы на переводы, выписки и др. запросы (аналогично другим рынкам)  |
| **Способ направления запросов**  | SWIFTУФШWeb-клиринг (возвраты) | SWIFTУФШWeb-клиринг (полный функционал) |
| **Запросы на возврат** | Разовые запросы на возврат в размере указанной суммы, с возможностью AFTERCL | * Разовые запросы на возврат в размере указанной суммы и в максимальном размере
* Постоянные поручения на возврат, исполняются ежедневно после клиринга
 |

\* - для использования новых возможностей по управлению обеспечением необходимо иметь доступ к Web-клирингу. Для получения доступа необходимо обратиться к вашему персональному менеджеру.

Подробное описание изменений в рамках этапа 1 приведено ниже.

**Описание изменений в клиринге рынка СПФИ с 27.05.2019 г.**

* + 1. Изменяются номера счетов для внесения обеспечения.
* **В российских рублях в НКО АО НРД:**

Банк получателя: НКО АО НРД

БИК: 044525505

К\С: 30105810345250000505

Получатель: НКО НКЦ (АО)

№ счета получателя: **30414810000000000911**

ИНН: 7750004023

Назначение платежа: Перечисление средств обеспечения **ОТСХХХХХ**. НДС не облагается

где XXXXX – Расчетный код Участника клиринга*,*

ОТС является кодовым словом рынка СПФИ.

* **В российских рублях в Банке России:**

Банк получателя: Операционный департамент Банка России г. Москва

БИК: 044501002

К\С: 00000000000000000000

Получатель: НКО НКЦ (АО)

№ счета получателя: **30414810700000000001**

ИНН: 7750004023

Назначение платежа: Перечисление средств обеспечения **ОТСХХХХХ**. НДС не облагается

где XXXXX – Расчетный код Участника клиринга

ОТС является кодовым словом рынка СПФИ.

* **В долларах США (JPMorgan):**

400759950 with JPMorgan Chase Bank, New York, USA **(SWIFT: CHASUS33)**

Получатель: CENTRAL COUNTERPARTY NATIONAL CLEARING CENTRE **(SWIFT: NCCBRUMM)**

**Назначение платежа**:

:72:/BNF/PMT FOR FX TRADE SETTLEMENT.

 // CODE OTCXXXXX

где XXXXX – Расчетный код Участника клиринга

* **В долларах США (Bank of New York Mellon):**

8900647310 with The Bank of New York Mellon, New York, USA **(SWIFT: IRVTUS3N)**

Получатель: CENTRAL COUNTERPARTY NATIONAL CLEARING CENTRE **(SWIFT: NCCBRUMM)**

**Назначение платежа**:

:72:/BNF/PMT FOR FX TRADE SETTLEMENT.

 // CODE OTCXXXXX

где XXXXX – Расчетный код Участника клиринга

* **В евро (JPMorgan):**

6231606713 with JPMorgan AG, Frankfurt am Main, Germany **(SWIFT: CHASDEFX)**

**IBAN: DE13501108006231606713**

Получатель: CENTRAL COUNTERPARTY NATIONAL CLEARING CENTRE **(SWIFT: NCCBRUMM)**

**Назначение платежа**:

:72:/BNF/PMT FOR FX TRADE SETTLEMENT.

 // CODE OTCXXXXX

где XXXXX – Расчетный код Участника клиринга

* + 1. Евро учитывается в качестве обеспечения
			1. Реквизиты счета для внесения обеспечения в евро указаны выше.
			2. Для возврата денежных средств в евро необходимо зарегистрировать соответствующие реквизиты.
			3. Обратите внимание: за учет обеспечения в евро предусмотрена комиссия НКЦ. Подробнее [о комиссии за учет обеспечения в иностранной валюте](http://nationalclearingcentre.ru/viewCatalog.do?menuKey=527).
		2. Обеспечение в иностранной валюте получает статус «иное обеспечение».

В соответствии с [Правилами клиринга](http://nationalclearingcentre.ru/viewCatalog.do?menuKey=244) статус Обеспечения в иностранной валюте определяется счетами, предназначенными для внесения Обеспечения:

* Обеспечение в иностранной валюте, являющееся индивидуальным клиринговым обеспечением, вносится на клиринговые банковские счета НКЦ, открытые в НКО АО НРД. Во внутреннем учете НКЦ для учета индивидуального клирингового обеспечения Участнику клиринга открываются балансовые счета №30420.
* Обеспечение в иностранной валюте, являющееся ***иным обеспечением,*** – на корреспондентские счета НКЦ, **открытые в иностранных банках-корреспондентах**. Во внутреннем учете НКЦ для учета иного обеспечения Участнику клиринга открываются балансовые счета **№47405**.

В настоящее время обеспечение в иностранной валюте учитывается Клиринговым центром как индивидуальное клиринговое обеспечение. После перехода на новый клиринг рынка СПФИ иностранная валюта станет учитываться как иное обеспечение, на счетах 47405.

* + 1. Новые возможности направления запросов в НКЦ

У Участника клиринга появляются новые возможности, аналогичные существующим возможностям на фондовом/валютном рынках.

***Внимание***: для использования новых возможностей необходимо иметь доступ к сервису Web-клиринг. Для оформления [доступа к Web-клирингу](http://nationalclearingcentre.ru/viewCatalog.do?menuKey=483) необходимо обратиться к [Вашему персональному менеджеру](https://www.moex.com/ru/personal-managers.aspx). Примеры заполнения форм запросов приведены в презентации [«Web-клиринг в примерах»](http://nationalclearingcentre.ru/UserFiles/File/CK15/WEBclearing.pdf).

* ***Постоянное поручение на возврат обеспечения (ПВДС)*** позволяет на ежедневной основе возвращать денежные средства с Расчетных кодов рынка СПФИ на свои счета. ПВДС направляется через сервис Web-клиринг (или самостоятельно по ЭДО).

В запросе ПВДС указывается:

* Расчетный код;
* валюта;
* свойство суммы запроса – в максимальном размере / в размере нетто-требования / в размере нетто-требования без учета комиссии.

ПВДС начнет выполняться с текущей даты (даты запроса). Возврат осуществляется на заранее зарегистрированный Счет для возврата обеспечения, имеющий признак «Основной».

На основании ПВДС в максимальном размере ежедневно осуществляется возврат денежных средств в размере всей доступной суммы.

Время направления и исполнения ПВДС в максимальном размере:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Валюта | Направление запроса | Исполнение запроса |
| RUB | до 19:30 | 19:40 |
| USD | до 20:00 |  20:00 |
| EUR | до 17:00 |  17:35/18:50 \* |

\* Исполнение по евро осуществляется до 17:35 по реквизитам не в НРД и до 18:50 по реквизитам в НРД.

ПВДС в размере нетто-требования - ежедневно осуществляется возврат денежных средств в размере Итогового нетто-требования (включает комиссию).

ПВДС в размере нетто-требования без учета комиссии – аналогично предыдущему, но за вычетом комиссии.

Такой ПВДС должен быть направлен до 17-00. Исполняется в день направления, и затем ежедневно, непосредственно после клиринга.

* Сохраняется возможность ***возврата денежных средств*** через Web-клиринг. При этом Web-клиринг будет отображать статус исполнения запроса. Если вы не использовали раньше такую возможность: возврат осуществляется через Web-клиринг, аналогично фондовому или валютному рынкам. Описание возврата денежных средств с помощью Web-клиринга приведено в [Памятке по возврату Обеспечения с использованием Web-клиринг и ЭДО](http://nationalclearingcentre.ru/UserFiles/File/CK24/Return_SPFI_Web-clearing%26EDI.pdf).

Запрос на возврат направляется:

|  |  |
| --- | --- |
| Валюта | Направление запроса |
| RUB | до 19:30 |
| USD | до 20:00 |
| EUR | до 17:00 |

Запрос на максимум исполняется незамедлительно, в размере всей доступной суммы с учетом уровня обеспеченности.

Если Уровень обеспеченности позволяет вернуть запрошенную сумму, Запрос в размере конкретной суммы исполняется незамедлительно, в противном случае

запрос будет исполнен после того, как нужная сумма окажется на Расчетном коде. Если после cut-off time по валюте нужной суммы не появится, то запрос будет отклонен, возврат не состоится. Сохраняется возможность направлять сообщения SWIFT для возврата денежных средств. Изменения в формате SWIFT приведены в новой памятке по возврату обеспечения. Памятка будет размещена на сайте НКЦ в разделе [Рынок СПФИ-Операции с обеспечением](http://nationalclearingcentre.ru/viewCatalog.do?menuKey=508).

* ***Переводы денежных средств между рынками***. Становится возможно переводить денежные средства между Расчетными кодами рынка СПФИ и других рынков (фондового, срочного, валютного, товарного). Для перевода нужно направить в НКЦ *Запрос на перевод обеспечения* с помощью Web-клиринга (или самостоятельно по ЭДО). В *Запросе на перевод обеспечения* нужно указать:
* Расчетный код списания;
* Расчетный код зачисления;
* Валюта;
* Количество.

*Запросы на перевод обеспечения* можно направлять до 20-00.

*Запрос на перевод* *обеспечения* исполняется незамедлительно, если уровень обеспеченности позволяет осуществить возврат, в противном случае возврат не осуществляется.

* ***Регистрация реквизитов Счета для возврата обеспечения***. Для регистрации реквизитов счета для возврата денежных средств необходимо направить *Запрос на регистрацию реквизитов счета для возврата обеспечения* через Web-клиринг (или самостоятельно по ЭДО). В Запросе нужно указать:
* Расчетный код, к которому будут привязаны реквизиты Счета для возврата;
* Признак «основной». На основной Счет для возврата будет осуществляться возврат на основании ПВДС (основной Счет для возврата может быть только один для каждого Расчетного кода, в разрезе валюты);
* Валюту;
* Реквизиты Счета для возврата обеспечения.

После регистрации реквизитов Счета для возврата, на такой счет можно возвращать денежные средства.

* ***Запрос отчета о Расчетных кодах***. В отчете о Расчетных кодах теперь будут отражаться также и Расчетные коды рынка СПФИ.

Запрос можно направить через Web-клиринг. Отчет направляется в день получения запроса. В отчете отражаются все Расчетные коды Участника клиринга на всех рынках, а также все зарегистрированные реквизиты Счетов для возврата к каждому Расчетному коду.

* ***Выписка по счету обеспечения***. Через Web-клиринг можно запросить выписку за дату по определенному счету обеспечения на рынке СПФИ. Список всех счетов обеспечения и счетов 30426 отражается в Web-клиринг в разделе «Список выписок». Пример заполнения запроса на выписку в Web-клиринге см. в презентации «Web-клиринг».
* ***Открытие нового Расчетного кода.*** Для открытия нового расчетного кода необходимо направить соответствующий запрос через Web-клиринг. Пример заполнения формы запроса см. в презентации [«Web-клиринг»](http://nationalclearingcentre.ru/UserFiles/File/CK15/WEBclearing.pdf).

Внимание: признак AFTERCL не будет доступен. Для возврата обеспечения после клиринга можно использовать Постоянное поручение на возврат обеспечения.

Все описанные выше запросы направляются через [Web-клиринг](http://nationalclearingcentre.ru/viewCatalog.do?menuKey=483) или самостоятельно по ЭДО. Подробный порядок заполнения запросов в Web-клиринге описан в презентации [«Web-клиринг»](http://nationalclearingcentre.ru/UserFiles/File/CK15/WEBclearing.pdf).

С вопросами по получению доступа к сервису Web-клиринг и работе с ним необходимо обращаться к вашему персональному менеджеру. [Уточнить информацию о Вашем персональном менеджере](https://www.moex.com/ru/personal-managers.aspx).

Если у вас оформлено получение выписок по SWIFT по счетам обеспечения фондового/валютного рынков, то НКЦ будет предоставлять выписки также и по счетам обеспечения рынка СПФИ.

* + 1. Новые отчеты
			1. Отчет CCX99 – «Отчет о движении денежных средств». Выписка по счетам обеспечения (и счетам 30426) за предыдущий расчетный день. Отчет предоставляется до 11:00 текущего расчетного дня. В отчет включена информация об остатках на счетах обеспечения, движении денежных средств, включая зачисления, возвраты, списания и зачисления в результате клиринга, списания комиссий и др.
			2. Отчет CCX97 – «Уведомление о списании и зачислении на Счет обеспечения». Отчет направляется незамедлительно после операции списания или зачисления на счет обеспечения.
			3. Отчет CCX96 – «Отмена уведомления о списании и зачислении». Предоставляется в случае отмены НКЦ операции зачисления.
			4. Отчет CCX98 (не является новым) – «Отчет о Расчетных кодах и реквизитах Участника клиринга». Содержит информацию обо всех Расчетных кодах Участника клиринга на всех рынках, а также о реквизитах счетов для возврата, закрепленных за расчетными кодами. Предоставляется по запросу отчета о Расчетных кодах.
			5. Перечисленные отчеты направляются по почте ЭДО, а также отображаются в Web-клиринге в разделе «Входящие документы – Сообщения», полностью аналогично фондовому и валютному рынкам.