

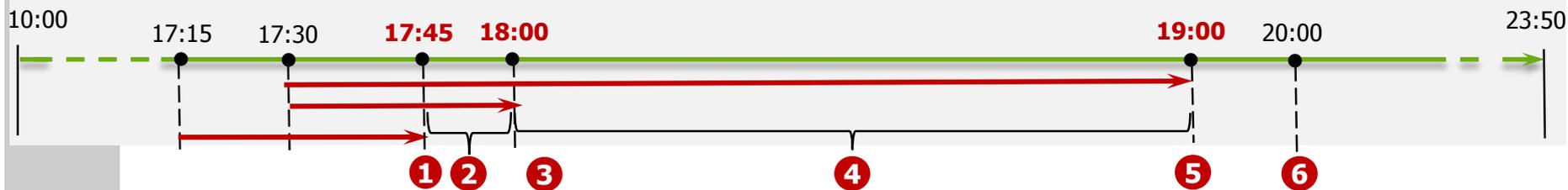


МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

13 декабря 2017
г. Москва

Изменения в торгах и
клиринге на валютном
рынке с 4 декабря 2017 г.

ИЗМЕНЕНИЕ ВРЕМЕНИ ТОРГОВ



- 1 17:45** время окончания торгов в системном режиме по инструментам **USDRUB_TOD**
- 2 17:45 – 18:00** период закрытия позиций, в ходе которого возможно заключение системных сделок своп **TOD/TOM**
- 3 18:00** время окончания торгов в системном режиме по инструментам **USD_TODTOM, GLD_TODTOM и SLVTODTOM**
выдача отчетов об Итоговых нетто-обязательствах/Итоговых нетто-требованиях (биржевых свидетельств) Участникам клиринга, приславшим запрос/постоянное поручение на проведение ранних расчетов в **18:00**
- 4 18:00 – 19:00** период закрытия позиций, в ходе которого возможно заключение внесистемных сделок **TOD** и своп **TOD/TOM**
- 5 19:00** выдача отчетов об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях (биржевых свидетельств) Участникам клиринга, заключившим сделки в период до **19:00**
- 6 20:00** исполнение Участником клиринга итоговых нетто-обязательств в долларах США, российских рублях и драгоценных металлах (время не изменяется)

ПЕРЕРЫВЫ В ТОРГАХ В РАМКАХ ОДНОГО РК

С 18 декабря изменяется регламент перерывов в торгах в рамках одного расчетного кода для инструментов TOD и TOD/ТОМ.



СНИЖЕНИЕ ТАРИФОВ ПО ДЛИННЫМ СДЕЛКАМ ДО 95%

Все валютные пары

Тарифные планы	Ежемесячная фиксированная часть вознаграждения	Сделки своп		Своп контракты					
		1D, 2D	1W	2W	1M, 2M	3M	6M	9M	1Y
SWP_0	---	0,0005%	0,0010%	0,0020%	0,0030%	0,0050%	0,0075%	0,0100%	
SWP_300	300 000 ₽	0,0003%	0,0007%	0,0012%	0,0018%	0,0030%	0,0045%	0,0060%	
SWP_600	600 000 ₽	0,0002%	0,0004%	0,0008%	0,0012%	0,0020%	0,0030%	0,0040%	
SWP_1000	1000 000 ₽	0,00016%	0,00032%	0,00064%	0,00096%	0,00160%	0,00240%	0,00320%	
SWP_1500	1500 000 ₽	0,00014%	0,00028%	0,00056%	0,00084%	0,00140%	0,00210%	0,00280%	
SWP_3500	3500 000 ₽	0,00010%	0,00020%	0,00040%	0,00060%	0,00100%	0,00150%	0,00200%	

Маркетинговый период на 1 год – все ставки равны ставкам по overnight свопам.



ИЗМЕНЕНИЯ В ПОРЯДОК ВОЗВРАТА ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ (1/2)

Описание:

1. Для возврата денежных средств Участник клиринга подает в НКЦ:
 - **Запрос на возврат обеспечения (разовый)** *или*
 - **Постоянное поручение на возврат обеспечения**
- 1.a В **Запросе на возврат обеспечения в поле TYPESUMM** указывается признак:
 - 1** – возврат средств в размере, указанном в запросе *или*
 - 5** – возврат средств в размере всей доступной суммы денежных средств
- 1.6. В **Постоянном поручении на возврат** в поле **TYPESUMM** обеспечения указывается признак:
 - 4** – возврат средств в размере нетто-требования по сделкам (включает задолженность, вар. маржу и обязательства по сделкам. Исполняется после определения Итогового нетто по соответствующей валюте) *или*
 - 5** – возврат средств в размере всей доступной суммы денежных средств (возврат осуществляется в размере расчетной позиции. Исполняется до наступления cut-off time по соответствующей валюте) *или*
 - 6** – возврат средств в размере Итогового нетто-требования (включает задолженность, вар. маржу, обязательства по сделкам и комиссию. Исполняется после определения Итогового нетто по соответствующей валюте, а для российских рублей - после определения обязательств по уплате комиссии по сделкам, заключенным до 19:00)

ИЗМЕНЕНИЯ В ПОРЯДОК ВОЗВРАТА ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ (2/2)

Постоянное поручение на возврат исполняется после определения Итогового нетто-требования до времени cut-off time

Денежные средства/ драг.металлы	Время определения Итоговых нетто обязательств/ Итоговых нетто-требований (по состоянию на)	Время исполнения Постоянных поручений на возврат обеспечения, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств	
		для внешних платежей	для внутренних платежей
1. Гонконгские доллары	11:00	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
5. Евро	По сделкам с наступившей датой исполнения, заключенным до 15:15 – 15:15 По сделкам с исполнением в дату заключения, заключенным после 15:15 – 19:00	17:40 ¹ /18:40	19:00 ¹ /20:00
6. Фунты стерлингов	15:15		
7. Доллары США, российские рубли, драг. металлы		20:00	20:00

ИСПОЛНЕНИЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО УПЛАТЕ КОМИССИИ

Суть изменений:

оборотная комиссия по сделкам учитывается:

- в Едином лимите при выставлении заявки;
- в Итоговых нетто-обязательствах в российских рублях по соответствующему Расчетному коду:
 - по Расчетному коду, входящему в ТКС в сделке (по умолчанию) или
 - по Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений

! Списание оборотной комиссии с одного Расчетного кода доступно с **04.12.17** (в случае предоставления Запроса о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений)

Обязательства по уплате комиссии по сделкам, заключенным до 19:00, необходимо исполнять до 20:00

В случае неисполнения, будет осуществлено урегулирование путем заключения сделок своп

ШТРАФ ЗА CUT-OFF TIME

Суть изменений: штрафа за ненадлежащее исполнение Итоговых нетто-обязательств

Описание изменений: штраф начисляется в случае **исполнения Итогового нетто-обязательства по денежным средствам с нарушением срока**, установленного Временным регламентом.

При возникновении Задолженности пеня на Задолженность начисляться не будет.

Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам/драгоценным металлам на фондовом, срочном и валютном рынках

• в тенге, определенных по сделкам, заключенным до 11:00	до 11:00 Даты исполнения
• в юанях, белорусских рублях, гонконгских долларах, швейцарских франках, определенных по сделкам, заключенным до 12:00	до 12:00* Даты исполнения
• в гривнах, определенных по сделкам, заключенным до 15:15	до 15:15 Даты исполнения
• в евро, фунтах стерлингов, определенных по сделкам, заключенным до 15:15	до 17:00* Даты исполнения
• в долларах США, российских рублях*, драгоценных металлах	до 20:00* Даты исполнения

* - при наличии сбоя в платежных системах указанное время может быть продлено по решению НКЦ до устранения указанного сбоя

Штраф также начисляется в случае невозможности урегулирования неисполненного Итогового нетто-обязательства по денежным средствам путем заключения сделок своп

Штраф за cut-off time по российским рублям будет списываться с 01.01.2018

По умолчанию штраф за cut-off time будет списываться с Расчетного кода, на котором учитывались обязательства, исполненные с нарушением срока, установленного Временным регламентом.

! Участник клиринга может назначить для списания штрафов за cut-off time Расчетный код для списания комиссионных вознаграждений, предоставив в НКЦ Запрос о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений.

Аналогичный подход применяется к комиссии за учет обеспечения.

ИЗМЕНЕНИЯ В ОТЧЕТЫ

ОТЧЕТ	ОПИСАНИЕ ИЗМЕНЕНИЙ
<p>ССХ04 ССХ4P (Отчет об Итоговых нетто-обязательствах/ Итоговых нетто- требованиях)</p>	<p>Наименование отчетов («Биржевое свидетельство», «Предварительное Биржевое свидетельство») меняется на «Отчет об Итоговых нетто-обязательствах/ Итоговых нетто-требованиях».</p> <p>Для денежных средств в российских рублях в ССХ04 указываются нетто-обязательства/ нетто-требования, состоящие из нетто-обязательств/ нетто-требований по сделкам с наступившей датой исполнения, обязательств/ требований по уплате вариационной маржи и непогашенной Задолженности, возникшей в предыдущий Расчетный день.</p> <p>Информация о комиссии предоставляется в отчете ССХ10.</p>

**СПАСИБО
ЗА ВНИМАНИЕ**



**МОСКОВСКАЯ
БИРЖА**