Допуск к рынку депозитов с ЦК

ПАО Московская Биржа

(Кредитные Организации)

Оглавление

[Оглавление 1](#_Toc141783475)

[Общие положения 2](#_Toc141783476)

[Требования к кандидату 3](#_Toc141783477)

[Допуск к торгам и клиринговому обслуживанию 4](#_Toc141783478)

[Доступ к платформе MOEX Treasury 4](#_Toc141783479)

[Оформление технического доступа 4](#_Toc141783480)

[Клиринговый терминал 5](#_Toc141783481)

[Затраты по подключению и работе на рынке 7](#_Toc141783482)

[Операции с денежными средствами 8](#_Toc141783483)

[Внесение денежных средств 8](#_Toc141783484)

[Вывод денежных средств на Рынке депозитов 8](#_Toc141783485)

[Перевод денежных средств 8](#_Toc141783486)

[Оплата комиссионных вознаграждений 8](#_Toc141783487)

[Штрафы за неисполнение обязательств и перенос позиций 8](#_Toc141783488)

[Рынок депозитов 8](#_Toc141783489)

[Штраф за cut-off time 9](#_Toc141783490)

[Комиссионное вознаграждение за учет Обеспечения 9](#_Toc141783491)

[Торговые и клиринговые отчеты 9](#_Toc141783492)

Общие положения

* **Кандидаты - кредитные организации**, имеющие действующую лицензию на осуществление банковских операций, выданную Банком России и не являющиеся Участниками торгов фондового рынка ПАО Московская Биржа;
* Центральный контрагент - Небанковская кредитная организация-центральный контрагент «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).
* **Валюта депозита – рубли, юани.**
* Для работы на Рынке депозитов с ЦК кандидату **необходимо получить допуск к торгам (Московская Биржа) и клиринговому обслуживанию (НКЦ).**

**Нормативная база:**

Допуск к торгам и порядок проведения на Рынке депозитов с Центральным контрагентом регулируются Правилами допуска к участию в торгах, Правилами проведения организованных торгов и Правилами клиринга. Все документы раскрываются на сайте Московской Биржи и НКЦ.

1. Правила допуска к участию в торгах на рынке депозитов <https://www.moex.com/s182>
2. Правила организованных торгов – <https://www.moex.com/s182>
3. Правила клиринга - <https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/0204/>

Требования к кандидату

|  |
| --- |
| **Требования для работы с полным депонированием (категория «В»)** |
| * Иметь **действующую лицензию на осуществление банковских операций**, выданную Банком России
* Соответствие требованиям к финансовой устойчивости
 |
| **Частичное депонирование (категория «Б/Б2»)** |
| **Взнос в Гарантийный фонд** для данной категории |  1 000 000 ₽ |
| **Финансовое состояние организации** | В деятельности кандидата должны **отсутствовать факты ухудшения финансового состояния** и/или должна отсутствовать информация, дающая основание считать возможными ухудшение финансового состояния организации. Должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) |
| **Внесение взноса в обеспечение по стресс** |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Условия** | **Категория Б** | **Категория Б2** | **Категория В** |
| Допуск к клирингу с частичным обеспечением | Да | Да | Нет |
| Внесение взноса в ГФ | Требуется | Требуется\* | Нет |
| Внесение взноса в Обеспечение под стресс\*\* | Требуется для определенных УК | Требуется для всех УК  | Нет  |

\*Размер взноса в Гарантийный фонд для Участников клиринга категории Б2 равен размеру взноса в Гарантийный фонд для Участников клиринга категории Б, предусмотренного Правилами клиринга.\*\*Подробная информация об Обеспечении под стресс, в том числе о порядке внесения взноса в ОПС, размещена на сайте [НКЦ | Гарантийные фонды. Обеспечение под стресс. Обеспечение под риски концентрации на эмитентов (nationalclearingcentre.ru)](https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/020804). Порядок определения минимального размера ОПС установлен в соответствии с документом [НКЦ | Методика определения размера обеспечения под стресс (nationalclearingcentre.ru)](https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/0302/304). |

Допуск к торгам и клиринговому обслуживанию

|  |  |
| --- | --- |
| **№** | **Наименование документа** |
| **1** | [Договор об оказании клиринговых услуг](https://www.nationalclearingcentre.ru/connector?cmd=file&target=B_L0NsZWFyaW5nL9Ca0LDQuiDRgdGC0LDRgtGMINCj0Jov0JQt0YLRiyDQtNC70Y8g0YDQtdC30LjQtNC10L3RgtCwL0RvZ292b3Igb2Igb2themFuaWkga2xpcmluZ292eWtoIHVzbHVnIChwcmlsb3poZW5pZSAyOSApLmRvYw_E_E) (если не был заключен ранее) 2 экз. – без указания даты |
| **2** | [Договор об оказании услуг по проведению организованных торгов (Приложение 01 к Правилам допуска)](http://fs.moex.com/files/2267) (если не был заключен ранее) 2 экз. - без указания даты |
| **3** | [Договор о предоставлении интегрированного технологического сервиса](https://fs.moex.com/files/8882) (если не был заключен ранее) 2 экз. - без указания даты |
| **4** | [Заявление о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию](https://www.nationalclearingcentre.ru/connector?cmd=file&target=B_L0NsZWFyaW5nL9CU0L7QutGD0LzQtdC90YLRiy_SQpNC_P0YDQvNGLINC4INGE0L7RgNC80LDRgtGLINC00L7QutGD0LzQtdC90YLQvtCyL9Cn0LDRgdGC0YwgMSDQvtCx0YnQsNGPINGH0LDRgdGC0YwvMDEt0JfQsNGP0LLQu9C10L3QuNC1INC_PINC_S0YDQtdC00L7RgdGC0LDQstC70LXQvdC40Lgg0LTQvtC_S0YPRgdC60LAg0Log0LrQu9C40YDQuNC90LPQvtCy0L7QvNGDINC_P0LHRgdC70YPQttC40LLQsNC90LjRji5kb2N4) |
| **5** | [Запрос на открытие Торгово-клирингового счета для заключения депозитных договоров](https://www.nationalclearingcentre.ru/connector?cmd=file&target=B_XENsZWFyaW5nXNCU0L7QutGD0LzQtdC90YLRi1zQpNC_P0YDQvNGLINC4INGE0L7RgNC80LDRgtGLINC00L7QutGD0LzQtdC90YLQvtCyINC4INC_P0YLRh9C10YLQvtCyXNCn0LDRgdGC0YwgMiDQpNC_P0L3QtNC_P0LLRi9C5INGA0YvQvdC_P0Log0Lgg0LTQtdC_S0L7Qt9C40YLRi1wyLjYg0JfQkNCf0KDQntChINCd0JAg0J7QotCa0KDQq9Ci0JjQlSDQotCe0KDQk9Ce0JLQni3QmtCb0JjQoNCY0J3Qk9Ce0JLQntCT0J4g0KHQp9CV0KLQkCDQlNCb0K8g0JfQkNCa0JvQrtCn0JXQndCY0K8g0JTQldCf0J7Ql9CY0KLQndCr0KUg0JTQntCT0J7QktCe0KDQntCSIC5kb2N4&_t=1724660651)  (для рынка депозитов) |
|  **6** | [Заявление о предоставлении технического доступа](https://fs.moex.com/files/8883) |
| **7** | [Заявление о предоставлении допуска к участию в торгах ПАО Московская Биржа (п. 4.1 Форм документов)](http://fs.moex.com/files/9798/) |

Документы по п.4-7 можно направить с ЭЦП через ЛКУ(вход [по ссылке](https://lkk.moex.com/lku/senddocuments/send_docs)). Договоры (п.1-3) направляются в оригинале на бумажном носителе.

Доступ к платформе MOEX Treasury

Оформление технического доступа

Для получения технического доступа воспользуйтесь порталом самообслуживания в ЛКУ «Управление идентификаторами».

[Руководство пользователя раздела «Управление идентификаторами» Личного кабинета Участника](https://fs.moex.com/files/26669/49377)

За информацией по способам и протоколам технического подключения, а также необходимым для приобретения информационным лицензиям рекомендуем обратиться в Управление прямых продаж департамента биржевой информации и технологических услуг по Т +7 (495) 363-32-32, доб. 5656 или Е itsales@moex.com

Информация по Схемам подключения к Торговым системам размещена на сайте: <https://www.moex.com/s154>

За уточнением комплекта документов для подключения необходимо обратиться в отдел организации технического доступа (+7 (495) 363-32-32, доб. 3377 или help@moex.com)

Тарифы за техническое подключение <https://fs.moex.com/files/9206>

Клиринговый терминал

Клиринговый терминал — это веб приложение, предназначенное для управления различными объектами Участника клиринга, такими как Расчетные коды, Торгово-клиринговые счета, счета обеспечения, реквизиты счетов для возврата обеспечения, Брокерские фирмы, Разделы клирингового регистра, и т.д. Управление объектами осуществляется путем защищенной передачи запросов к учетным системам НКЦ и отображения информации об объектах.

**Реализовано большинство запросов**, направляемых в НКЦ: запросы на возврат обеспечения, перевод обеспечения, передача профилей активов, ранние расчеты, получение выписки по счетам и другие запросы. Полный список приведен в [Руководствe пользователя](https://www.nationalclearingcentre.ru/connector?cmd=file&target=B_L0NsZWFyaW5nL9Cj0YfQsNGB0YLQvdC40LrRgyDQutC70LjRgNC40L3Qs9CwL1dlYi3QutC70LjRgNC40L3Qsy7QmtCiL9Cg0YPQutC_P0LLQvtC00YHRgtCy0L4g0L_SQvtC70YzQt9C_P0LLQsNGC0LXQu9GPINCa0KIucGRm).

Характеристики:

* адаптивный пользовательский интерфейс
* принцип двойного контроля "maker-checker"
* двухфакторная аутентификация
* гибкая система [ролей доступа](https://www.nationalclearingcentre.ru/connector?cmd=file&target=B_L0NsZWFyaW5nL9Cj0YfQsNGB0YLQvdC40LrRgyDQutC70LjRgNC40L3Qs9CwL1dlYi3QutC70LjRgNC40L3Qsy7QmtCiL9Cg0L7Qu9C10LLQsNGPINC80L7QtNC10LvRjCDQmtCiLnBkZg_E_E)
* интерфейс на русском и английском языках
* ограничения по Расчетным кодам: Участник клиринга может задать список Расчетных кодов доступных пользователю
* удобная работа с выписками по счетам
* модифицирована регистрации реквизитов счета для возврата обеспечения
* средства фильтрации и сортировки, экспорт в форматах Excel и Pdf

Для подключения к Клиринговому терминалу необходимо заполнить следующее Заявление:
[Запрос о доступе к Клиринговому терминалу](https://www.nationalclearingcentre.ru/connector?cmd=file&target=A_XNCd0L7QstCw0Y_SQn9Cw0L_SQutCwXNCX0LDQv9GA0L7RgSDQviDQtNC_P0YHRgtGD0L_SQtSDQuiDQmtC70LjRgNC40L3Qs9C_P0LLQvtC80YMg0YLQtdGA0LzQuNC90LDQu9GDLmRvY3g_E&_t=1680595456)

Заполненное заявление необходимо подписать ключом ЭП сотрудника, на которого в НКО НКЦ (АО) предоставлена [Доверенность на подписание электронной подписью электронных документов](http://fs.moex.com/files/14535/) и направить через ЛКУ в разделе [Отправка сообщений/документов (moex.com)](https://lkk.moex.com/lku/senddocuments/send_docs)

Пользователем может быть сотрудник, зарегистрированный в Moex Passport: [https://passport.moex.com](https://passport.moex.com/login?return_to=https%3A%2F%2Fpassport.moex.com%2F)

[Клиринговый терминал в примерах (Презентация)](https://www.nationalclearingcentre.ru/connector?cmd=file&target=B_L0NsZWFyaW5nL9Cj0YfQsNGB0YLQvdC40LrRgyDQutC70LjRgNC40L3Qs9CwL1dlYi3QutC70LjRgNC40L3Qsy7QmtCiL9Ca0KJf0L_SRgNC40LzQtdGA0YsucGRm)

Затраты по подключению и работе на рынке

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Затраты** |  **Рынок депозитов**  | **Информация об оплате**  | **Периодичность**  | **Порядок оплаты** |
| **Взнос в Гарантийный Фонд для категории Участника клиринга «Б/Б2».** (частичное предварительное депонирование средств)Сумма является возвратной. | 1 000 000 ₽ | Допуск к торгам и клиринговому обслуживанию в категории Б/Б2 предоставляется только после внесения ГФ |  Разовый платеж | Внесение ГФ не позднее чем за 1 день до предоставления допуска к клиринговому обслуживанию |
| **Взнос в Гарантийный Фонд для категории Участника клиринга «В».**(полное предварительное депонирование средств) | Отсутствует  | - | - | - |
| **Минимальная оборотная комиссия за совершение сделок.** | Отсутствует  | В случае отсутствия денежных средств на РК обязательства переносятся на следующий день со штрафом (по рублям 2 ставки RUSFAR) | ежеквартально | Списание производится с основного РК рынка депозитов/валютного рынка (взимается только когда оборотная комиссия меньше 60 000 р) |
| **Оборотная комиссия за сделки** | [Тарифы по депозитам с Центральным контрагентом — Московская Биржа | Рынки](https://www.moex.com/s2313) | В случае отсутствия денежных средств на РК обязательства переносятся на следующий день со штрафом (по рублям 2 ставки RUSFAR) | ежедневно | Списание производится с основного РК рынка депозитов/валютного рынка |
| **Технический доступ:*** Плата за регистрацию идентификатора технического доступа
* Абонентская плата за идентификатор технического доступа
 |  10000 ₽  | В случае отсутствия денежных средств на РК обязательства переносятся на следующий день со штрафом (по рублям 2 ставки RUSFAR) | Разовый платеж | списывается с основного РК ФР, не позднее 5-ого числа месяца, следующего за отчетным |
| 10000 ₽ |
| ежемесячно |
| **Услуги, связанные с использованием токенов[[1]](#footnote-1)** | Плата за токен | Абонентское обслуживание | В случае отсутствия денежных средств на РК обязательства переносятся на следующий день со штрафом (по рублям 2 ставки RUSFAR) | ежемесячно | списывается с основного РК ФР не позднее 5-го числа месяца, следующего за отчетным |
| * Аппаратный токен
 | 2 300 ₽ (единоразово) | 500 р |
| * Программный токен
 | отсутствует | 500 ₽ |
| **Электронный документооборот (ЭДО):*** Абонентская плата
* Изготовление ключа (единовременно)
 | 2 300 ₽  | В случае отсутствия денежных средств на РК обязательства переносятся на следующий день со штрафом (по рублям 2 ставки RUSFAR) | ежемесячно | списывается с основного РК ФР, не позднее 5-ого числа месяца, следующего за отчетным |
| 5 300 ₽ | - | ежегодно | счет на оплату |

Операции с денежными средствами

Учет денежных средств участников клиринга осуществляется на Расчетных кодах, регистрируемых в рамках клиринговых счетов НКЦ.

Внесение денежных средств

Денежные средства на счета НКЦ можно перечислять на Расчетные коды с любого счета в любом банке. Денежные средства в валютах, принимаемых НКЦ в качестве Обеспечения, перечисляются Участниками клиринга на соответствующие счета НКЦ **с обязательным указанием в назначении платежа ключевого слова и Расчетного кода Участника клиринга**.

По ссылкам ниже вы найдете:

* [Реквизиты для зачисления денежных средств на всех рынках](https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/02080304)

<https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/02080304>

* Более подробную информацию по внесению обеспечения

<https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/02080301>

Вывод денежных средств на Рынке депозитов

Возврат денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения по Расчетному коду Участника клиринга, осуществляется на основании Клирингового терминала.

Возврат денежных средств на фондовом рынке осуществляется в размере расчетной позиции.

Подача поручений через торговую систему возможна до 19:00, с помощью запросов, сформированных с использованием сервиса Клиринговый терминал и/или с помощью запроса по системе [SWIFT](http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=23) – по долларам США до 20:00, а по рублям до 19:30).

Вывод осуществляется на заранее зарегистрированный к Расчетному коду Счет для возврата. https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/0208030301

Перевод денежных средств

Перевод денежных средств между Расчетными кодами рынка депозитов осуществляется с помощью Клирингового терминала.

[Клиринговый терминал в примерах (Презентация)](https://www.nationalclearingcentre.ru/connector?cmd=file&target=B_L0NsZWFyaW5nL9Cj0YfQsNGB0YLQvdC40LrRgyDQutC70LjRgNC40L3Qs9CwL1dlYi3QutC70LjRgNC40L3Qsy7QmtCiL9Ca0KJf0L_SRgNC40LzQtdGA0YsucGRm)

Оплата комиссионных вознаграждений

Для оплаты комиссионных вознаграждений за услуги ПАО Московская Биржа и НКО НКЦ (АО) Участнику клиринга после заключения Договора об оказании клиринговых услуг будет присвоен (открыт) собственный Расчетный код на фондовом рынке (без заявления Участника клиринга) не зависимо от того, на какой рынок осуществляется допуск.

Штрафы за неисполнение обязательств и перенос позиций

Рынок депозитов

Участник клиринга должен обеспечить в день размещения средств в депозит до 20.00 на своем Расчетном коде наличие всей суммы размещаемых в этот день депозитов, а также обязательства по уплате комиссионного вознаграждения в этот день.

В случае отсутствия требуемых денежных средств в дату размещения депозита, сделка заключается на сумму, доступную на Расчетном коде (за вычетом комиссии, подлежащей уплате в данный день). Для сделок с кодами расчетов, отличных от Y0/Y1 и Y1/Y2, предоставляется возможность исполнения обязательств на следующий расчетный день на сумму неисполненных в прошлый день обязательств, при этом на довнесенные денежные средства будет заключена еще одна депозитная сделка (с той же ставкой, датой возврата, но, соответственно, меньшим сроком). С Участника клиринга взимаются средства за перенос возможности заключения депозита на другой день в размере, зависящем от срока такого переноса, суммы невнесенных средств, разницы штрафной ставки НКЦ и ставки депозита. Такой перенос возможен не более чем один раз для данного депозита (предложения).

Для депозитных договоров с кодом расчетов Y0/Y1, Y1/Y2 в случае отсутствия требуемых денежных средств в дату размещения депозита НКЦ взимает отступное за ту часть обязательств, которые не были исполнены. Кроме того, отступное взимается и по сделкам с иными кодами расчетов в случае, если недостающие денежные средства не были довнесены в следующий расчетный день (при вышеописанном переносе возможности довнести средства). После взимания отступного у Участника клиринга прекращается возможность внести недостающие средства и заключить по ним депозитный договор в следующие дни.

Отступное рассчитывается в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и зависит от суммы невнесенных средств, оставшегося срока депозита (предложения), разницы штрафной ставки НКЦ и ставки депозита.

Штраф за cut-off time

С января 2018 года введен штраф за исполнение Итогового нетто-обязательства по денежным средствам с нарушением срока, установленного Временным регламентом.

<https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/020801>

[[Значения штрафных ставок за cut-off time](https://nationalclearingcentre.ru/rates/currMarketRates/).](https://new.nationalclearingcentre.ru/rates/currMarketRates/)

Комиссионное вознаграждение за учет Обеспечения

Комиссионное вознаграждение за учет Обеспечения в иностранной валюте (в евро) возникает у Участников клиринга в случае внесения указанного обеспечения на счета НКЦ. Взимание указанного комиссионного вознаграждения предусмотрено [Правилами клиринга НКО НКЦ (АО)](https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/0204): РАЗДЕЛ V. Общей части Правил клиринга, а также п. 3 Раздела II [Тарифы](https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/0204/106). (в соответствии со ставками иностранных банков, в которых у НКЦ открыты счета в евро и швейцарских франках). Точная сумма комиссии, подлежащей списанию, отражается в Отчете о комиссионных вознаграждениях EQM15.

Торговые и клиринговые отчеты

На Рынке депозитов с Центральным контрагентом Участнику направляются торговые и клиринговые отчеты:

Рынок депозитов:

* Торговые отчеты - <https://fs.moex.com/files/943>
* Клиринговые отчеты - <https://www.moex.com/s1266>
1. Тарифы указаны без учета НДС. НДС взимается дополнительно. [↑](#footnote-ref-1)