



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
КЛИРИНГОВЫЙ
ЦЕНТР
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Департамент
Клиринга

Подбор ценных бумаг в обеспечение с использованием СУО НРД

ЧТО ТАКОЕ СУО НРД?

– это автоматизированная система управления обеспечения с использованием электронного документооборота НРД, позволяющая осуществлять подбор ценных бумаг.

СУО НРД используется при обслуживании:

- сделок РЕПО Банка России с корзиной ценных бумаг (клиринг НРД),
- сделок РЕПО Федерального казначейства с корзиной ОФЗ (клиринг НРД),
- иных сделок с расчетами DVP (клиринг НРД),
- подбор ценных бумаг в обеспечение (клиринг НКЦ).

КАК СУО НРД ИСПОЛЬЗУЕТСЯ В НКЦ?

Участник клиринга НКЦ может использовать сервис СУО НРД для подбора ценных бумаг:

- на 36 торговый раздел, входящий в состав ТКС Т+;
- на 31 торговый раздел, входящий в состав ТКС Т0;
- на субсчет депо, входящий в состав ТКС имущественного пула;
- на субсчет депо, входящий в состав ТКС гарантийного фонда;
- на субсчет депо, входящий в состав ТКС обеспечения под стресс

с целью внесения/ замены обеспечения в ценных бумагах, в том числе исполнения маржинальных требований.

ПОЧЕМУ СУО НРД УДОБНА ДЛЯ УЧАСТНИКА КЛИРИНГА НКЦ?

1. Обеспечивает своевременную поставку активов для исполнения маржинальных требований;
2. В качестве источника активов используются все счета депо в НРД;
3. Не нужно подавать депозитарные поручения, тем более, что для перевода на субсчета депо клиринговых счетов депо НКЦ поручения от депонентов НРД не принимаются;
4. Расчет необходимого количества ценных бумаг осуществляется автоматически;
5. Перевод осуществляется в режиме онлайн.

КАК УЧАСТНИКУ КЛИРИНГА НКЦ ПОЛУЧИТЬ УСЛУГУ СУО НРД?

1. Заключение с НРД Договора об оказании клиринговых услуг (если не был заключен ранее);
2. Заключение с НРД Договора об оказании услуг по управлению обеспечением;
3. Маркировать ресурсы для подбора активов, учитываемых в качестве обеспечения в НКЦ, поручением 18/MARK;
4. Подать поручение подбора 18/GET.

ОСОБЕННОСТИ МАРКИРОВАНИЯ 18/MARK ДЛЯ НКЦ

1. Группа сделок «GNCC»
2. Обязательное заполнение субсчета (раздела счета депо), на который будут переводиться подобранные бумаги:
 - Субсчет клирингового счета депо НКЦ;
 - 36 или 31 раздел торгового счета депо.
3. Типы счетов и разделов, с которых возможен подбор активов
 - Торговые счета депо НКЦ, раздела 31 и 36
 - Торговые счета депо НРД, разделы 00, 70, 73
 - Основные счета депо, разделы 00, 70, 73, IN
4. Типы счетов, с которых возможен подбор активов, должны соответствовать типам счетов депо (субсчетов клирингового счета депо НКЦ). Например, для субсчета владельца допустим подбор только со счетов депо владельца, для субсчета номини – только со счетов депо номини.
5. Подача поручения возможна с использованием Web-сервиса (REST) НРД, ПО ЛУЧ и с использованием Торгового терминала фондового рынка.

ОСОБЕННОСТИ ПОДБОРА 18/GET ДЛЯ НКЦ

1. Указывается 36 / 31 раздел торгового счета депо или субсчет депо клирингового счета депо, на который необходимо подобрать ценные бумаги.
2. Подбор по сумме в рублях:
 1. Указывается сумма, на которую нужно подобрать ценные бумаги
 2. Опционально:
 - Указываются ценные бумаги, приоритетные для подбора, с возможностью указания максимально допустимого количества,
 - Возможно исключение ценных бумаг из подбора (в поручении 18/MARK указываются ценные бумаги, которые подбирать не следует).
3. Подбор по количеству:
 1. Указываются ценные бумаги и их количество.
4. Подача поручения возможна с использованием Web-сервиса (REST) НРД, ПО ЛУЧ и с использованием Торгового терминала фондового рынка.
5. Поручение исполняется немедленно, допустимо частичное исполнение.
6. Результат подбора отражается в клиринговом отчете НРД по форме MS18G.
7. Результат переводов отражается в депозитарном отчете по поручению 10/GET, сформированному СУО НРД, по форме MS101.

ПОДБОР ЦЕННЫХ БУМАГ ПО ИНИЦИАТИВЕ НКЦ

В случае если Участником клиринга НКЦ используется сервис подбора обеспечения СУО НРД (подписаны договоры с НРД и подано поручение маркирования 18/MARK), то в соответствии с Договором об оказании услуг по управлению обеспечением подбор ценных бумаг в обеспечение может осуществляться:

- по поручению Участника клиринга (депонента НРД);
- по поручению НКЦ.

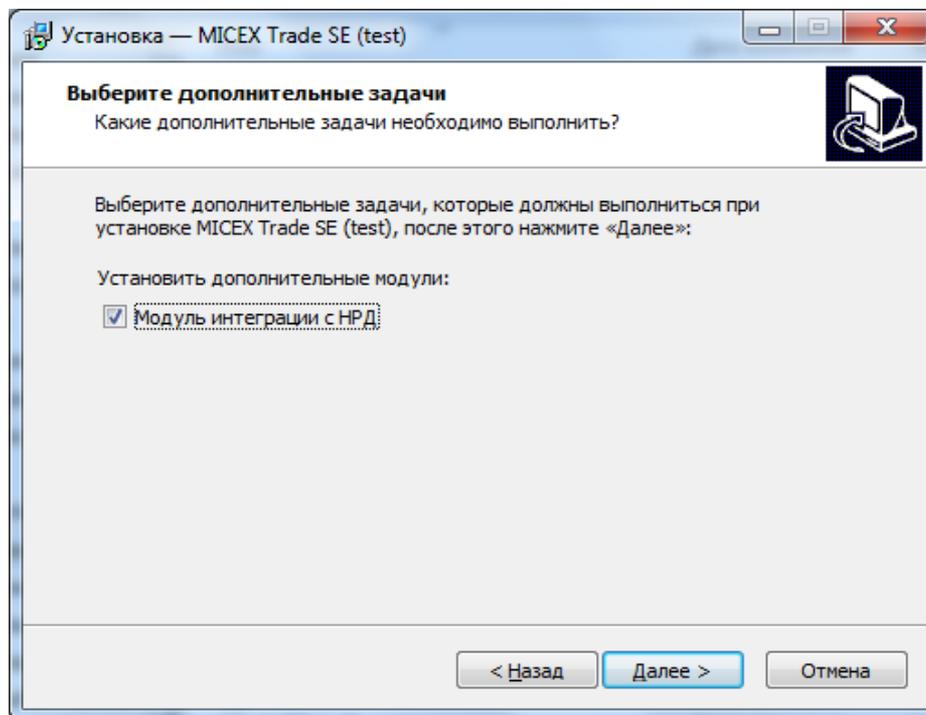
НКЦ направляет в НРД запрос на подбор ценных бумаг на 36 торговый раздел Участника клиринга и/или субсчет депо, обеспечивая своевременную поставку активов Участника в случае:

1. неисполнения Участником клиринга обязательств в ценных бумагах по Сделкам Т+, в том числе обязательств в КСУ;
2. неисполнения участником клиринга Маржинального требования;
3. неисполнения участником клиринга Маржинального требования по пулу.

Последовательность действий НКЦ при направлении в НРД запроса на подбор ценных бумаг в описанных выше случаях приведена в Правилах клиринга на фондовом рынке.

ОБНОВЛЕНИЕ ТОРГОВОГО ТЕРМИНАЛА ФОНДОВОГО РЫНКА

- Для доступа к сервису СУО НРД необходимо обновить Торговый терминал фондового рынка с указанием из программы установки «Модуль интеграции с НРД».
- Внимание: при автоматическом обновлении терминала при подключении к торговой системе данный модуль доступен не будет.



ВКЛАДКА «НРД» В ТЕРМИНАЛЕ ФОНДОВОГО РЫНКА

Тестовый идентификатор 2 - Управляющий фирмы - MICEX Trade SE (тестовая версия)

Сеанс Вид Действие Таблица Запрос НРД Сервис Данные Окно Справка

0 - Сделки

Сделка №	Время	Тип	Заявка №	Партнер	Лоты	Объем	Объем НКД	Торговый счет
* 11 - НРД: Сделки в клиринге - 17:10:48								
Номер	Дата сделки	Номер заявки	Плоск		Полный объем	Объем, исполненный НРД		
1002	25.07.2014	11 485 001 266	МОЕХ					
1004	25.07.2014	11 485 001 267	МОЕХ					
54531920	03.07.2014	67 418 367	МОЕХ					
54531922	03.07.2014	67 418 369	МОЕХ					
55558908	08.07.2014	69 847 226	МОЕХ					
55558910	08.07.2014	69 848 292	МОЕХ					
55558914	08.07.2014	69 849 560	МОЕХ	08.07.2014	10 000 000,00			
56747152	10.07.2014	71 662 243	МОЕХ	10.07.2014	3 000 000,00			
64271980	15.07.2014	74 401 153	МОЕХ	15.07.2014	3 000 000,00			
69528502	28.07.2014	81 407 741	МОЕХ	28.07.2014	3 000 000,00			3 000 000,00
69950001	29.07.2014	81 774 949	МОЕХ	29.07.2014	1 300 000,00			

Меню НРД:

- Анкета маркирования...
- Поручение на замену обеспечения...
- Состояние обеспечения
- Бумаги в обеспечении
- Сделки в клиринге
- Бумаги в обеспечении под сделкой
- Состояние поручений
- Корзины ценных бумаг
- Состав корзин ценных бумаг
- Дисконты и параметры обеспечения
- Остатки бумаг на разделах
- Депозитарные счета
- Торговые банковские счета

АНКЕТА МАРКИРОВАНИЯ

1. В Торговом терминале фондового рынка необходимо выбрать пункт НРД-> Анкета маркирования.
2. Можно изменить строки анкеты, поменяв их местами или исправив любой атрибут, а также добавить строку с выбранными атрибутами.
3. Далее необходимо нажать кнопку «Ввести поручение».

№ п/п	Код инструмента	Инструмент	Группа сделок	Количество	Счет депо	Раздел счета депо	Торговля	Правила	Цена подбора	Дискон
1	MSNG	+МосЭнерго	GNCC	20 000	HS1212115419	36MC0128800000F00	Да		0,8180	45,00%
2	RU000A0JUP14	100 КЖИ, АО ао01	CBR1	Любое	MS100616006A	000000000000000000				0,00%
3			CBR1,GNCC	Любое	HS1212115419	36MC0128800000F00	Да			
4			GNCC	Любое	TS121207032B	000000000000000000	Да			

Счет вывода: Раздел счета: Торговый счет:

Считать указанную в сделке корзину переменной

Ввести поручение Очистить анкету... Загрузить... Сохранить... Закрыть

ВВОД СТРОК АНКЕТЫ МАРКИРОВАНИЯ

- Анкета маркирования определяет правила, с каких разделов счетов депо (группа полей, относящаяся к счетам подбора) на какие разделы счетов депо (группа полей, относящаяся к счетам поставки) может производиться подбор.
- порядок строк в анкете определяет, в какой последовательности эти правила подбора будут выполняться.

Заявка на маркировку

Инструмент: < все инструменты >

Количество: [input]

Стоимость по макс.дисконту: -

Включить в список обеспечения для подбора
 Исключить из списка обеспечения для подбора

Группа сделок: GNCC

Счет депо подбора: HS1512230070

Раздел счета депо подбора: 36MC0128800000F00

Торговый счет подбора: S01+00000F00

Счет депо поставки: HX151102002C

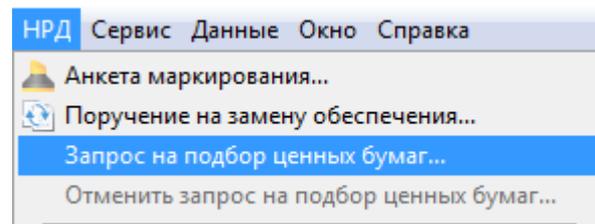
Раздел счета депо поставки: 8SMC0128800000F00

Торговый счет поставки: S01b00000F00

Да Закрыть

ПОДБОР ЦЕННЫХ БУМАГ В ОБЕСПЕЧЕНИЕ С ИСПОЛЬЗОВАНИЕМ СЕРВИСОВ СУО НРД

Для подбора активов в Торговом терминале Фондового рынка необходимо выбрать:
НРД-> Запрос на подбор ценных бумаг



- «Торговый счет для поставки» - необходимое для заполнения поле. Например, для подбора в имущественный пул необходимо указать соответствующий пульный ТКС.
- Также необходимо указать либо сумму (поле «Сумма к подбору») либо ценные бумаги и их количество (поля «Приоритетный инструмент» и «Количество»)
- Можно указать и сумму и количество ценных бумаг к подбору. В этом случае будет подобрано активов не более, чем на указанную сумму, в количестве не превышающем указанное в поручении.

КОНТАКТЫ

Информацию по вопросам СУО НРД Вы можете получить у Вашего персонального менеджера в Отделе по работе с клиентами в **НРД**:

Телефон: +7 (495) 956-27-90, +7 (495) 956-27-91

Дополнительную **информацию по вопросам подписания документов НРД** Вы можете получить в Отделе заключения и сопровождения договоров с клиентами в **НРД**:

Телефон: +7 (495) 956-27-89.

Информацию по общим вопросам клиринга НКЦ Вы можете получить в Отделе взаимодействия с участниками клиринга в **НКЦ**:

Телефон: +7 (495) 363-32-32.

Информацию по операционным вопросам подбора ценных бумаг Участником клиринга или НКЦ Вы можете получить в Отделе клиринга на фондовом рынке в **НКЦ**:

Телефон: +7 (495) 363-32-32.