

Методические рекомендации по управлению Единым пулом обеспечения

РАЗДЕЛ I. Переход на технологию Единого пула обеспечения

1. Шаг1: Выбрать Расчетный код

- 1.1. Выберите Расчетный код на фондовом рынке, который вы планируете сделать Расчетным кодом Единого пула. Это может быть уже существующий Расчетный код, либо можно открыть новый Расчетный код на фондовом рынке стандартным образом.
- 1.2. Выбранный Расчетный код должен быть зарегистрирован в составе какого-либо ТКС Т+. Другими словами, должен существовать ТКС Т+, в состав которого входит выбранный вами Расчетный код. Если такого ТКС нет, его нужно зарегистрировать стандартным образом.
- 1.3. Выбранный Расчетный код может быть собственным, клиентским или ДУ
- 1.4. Если вы планируете объединить несколько Расчетных кодов, входящих в состав разных ТКС Т+, в Единый пул, то сначала необходимо заменить в каждом таком ТКС Т+ Расчетный код на выбранный Расчетный код, который станет Расчетным кодом Единого пула, и только после этого переходите к шагу 2.
- 1.5. Объединяемые Расчетные коды должны быть одного типа (отдельно собственные, отдельно клиентский и отдельно ДУ).
- 1.6. На фондовом рынке Расчетный код Единого пула будет входить в состав одного или нескольких ТКС. Все такие ТКС называются ТКС Единого пула.

2. Шаг 2: Присвоить Расчетному коду признак Единого пула

- 2.1. На втором шаге выбранному Расчетному коду нужно присвоить признак «Расчетный код Единого пула». Для этого направить в НКЦ [Запрос на присвоение Расчетному коду признака Единый пул \(CODETM\)](#). В запросе необходимо указать Расчетный код, открытый на фондовом рынке. На основании данного запроса указанный в запросе Расчетный код получает признак «Расчетный код Единого пула».
- 2.2. **Внимание:** после отправки запроса CODETM запускается процедура присвоения Расчетному коду признака Единый пул (закрываются старые счета 30420, открываются счета 47405 и т.п.), отозвать запрос невозможно и отменить выполненные действия также невозможно! Поэтому перед переходом на технологию Единого пула предварительно рекомендуется пройти тестирование или потренироваться на бою на новом или не самом активном Расчетном коде. Также для предотвращения ошибочного направления запроса CODETM данный запрос доступен в ограниченном режиме, в связи с чем необходимо связаться с вашим персональным менеджером для снятия блокировки с запроса (только для первого запроса).
- 2.3. Способы направления данного запроса.

Способ 1: направить запрос с использованием сервиса Web-клиринг.

Порядок действий:

- Меню «Единый пул обеспечения»
- Новый документ
- Выбрать «CODETM Запрос на присвоение Расчетному коду признака Единый пул»
- Заполнить в открывшейся форме поле «Расчетный код»

CODETM Запрос на присвоение Расчетному коду признака «Единый пул»

No 7 × от 01/06/2017

Расчетный код 03631

Исполнить Сохранить с кодом

Способ 2: сформировать запрос в соответствии с форматом CODETM и направить в НКЦ по ЭДО. Необходимая документация:

- Спецификация формата CODETM и порядок направления запросов в НКЦ по ЭДО приведены в документе [Формы и Форматы документов и отчетов. Часть I. Общая часть.](#)
- 2.4. Признак «Расчетный код Единого пула» можно присвоить неограниченному количеству Расчетных кодов.
- 2.5. Запрос исполняется в день получения после окончания торгов на фондовом рынке. В результате исполнения запроса:
- 2.5.1. Указанному в запросе Расчетному коду присваивается признак «Расчетный код Единого пула»;
 - 2.5.2. Открываются новые счета обеспечения 47405 для учета иностранной валюты на фондовом рынке (во всех валютах, торгуемых на ВР). Обеспечение в иностранной валюте, учитываемое по уже имеющимся счетам 30420 на фондовом рынке, переводится на соответствующие новые 47405, после чего данные счета 30420 закрываются.
 - 2.5.3. Открывается новый счет обеспечения 30420 для учета обеспечения в рублях, старый счет 30420 закрывается, а обеспечение переводится со старого счета на новый. Счета 30420 для учета обеспечения в рублях, соответствующие ТКС T0, не изменяются.
 - 2.5.4. Со следующего дня иностранную валюту необходимо вносить на корреспондентские счета НКЦ в иностранных банках. Реквизиты счетов размещены на сайте НКЦ в разделе [Реквизиты НКЦ для внесения обеспечения.](#)
- 2.6. Обратите внимание, что присвоение признака Единого пула не приводит автоматически к объединению данного Расчетного кода с другими рынками. Для этого необходимо выполнить следующий шаг.

3. Шаг 3: изменить область действия Расчетного кода Единого пула

3.1. Чтобы Расчетный код Единого пула появился на других рынках (валютном, срочном, рынке стандартизированных ПФИ (далее - рынке СПФИ)) необходимо направить в НКЦ специальный запрос – [Запрос на изменение области действия Расчетного кода Единого пула \(CODEEA\)](#).

3.2. В этом запросе нужно указать:

- Расчетный код Единого пула (который уже имеет признак Единого пула);
- На какой рынок нужно распространить Расчетный код Единого пула: валютный, срочный или рынок СПФИ;
- Расчетный код на валютном, срочном рынке или рынке СПФИ, присоединяемый к Расчетному коду Единого пула (обязательно для срочного рынка, необязательно для валютного рынка). Присоединяемый Расчетный код должен быть того же типа, что и Расчетный код Единого пула (собственный, клиентский или ДУ).

3.3. На основании этого запроса осуществляются следующие действия:

- На указанном рынке (валютном, срочном или рынке СПФИ) появляется Расчетный код Единого пула;
- Если указан валютный рынок и не указан расчетный код на валютном рынке, то других действий не осуществляется;
- Если присоединяется Расчетный код на валютном рынке, то
 - все обеспечение, учитываемое по присоединяемому Расчетному коду, переводится на Расчетный код Единого пула;
 - профили активов, аналогичные переданному обеспечению, передаются на валютный рынок (обратно), по Расчетному коду Единого пула;
 - все заключенные, но неисполненные сделки по присоединяемому Расчетному коду переносятся на Расчетный код Единого пула;
 - присоединяемый Расчетный код на валютном рынке закрывается.
- Если присоединяется Расчетный код на срочном рынке, то
 - все брокерские фирмы открепляются от присоединяемого Расчетного кода и привязываются к Расчетному коду Единого пула;
 - осуществляются действия, описанные в предыдущем пункте (аналогично присоединению Расчетного кода валютного рынка);
 - если к присоединяемому Расчетному коду привязаны разделы FORTS, то они будут закрыты, а вам нужно самостоятельно перевести бумаги на ТКС фондового рынка.
- Если присоединяется Расчетный код на рынке СПФИ, то:
 - все обеспечение, учитываемое по присоединяемому Расчетному коду, переводится на Расчетный код Единого пула;
 - профили активов, аналогичные переданному обеспечению, передаются на рынок СПФИ (обратно), по Расчетному коду Единого пула;
 - все заключенные, но неисполненные сделки по присоединяемому Расчетному коду переносятся на Расчетный код Единого пула;

- присоединяемый Расчетный код на рынке СПФИ закрывается.
- 3.4. Запрос на присоединение валютного рынка можно направить в тот же день, что и Запрос на присвоение Расчетному коду признака «Расчетный код Единого пула». Запрос на присоединение Расчетного кода Срочного рынка можно направить не раньше следующего дня. Запрос на присоединение рынка СПФИ можно направить также не ранее следующего дня.
- 3.5. Направить запрос на передачу профилей активов по Расчетному коду Единого пула можно не ранее следующего дня после направления Запроса на изменение области действия Расчетного кода Единого пула.
- 3.6. Способы направления данного запроса.

Способ 1: направить запрос с использованием сервиса Web-клиринг.

Порядок действий:

- Меню «Единый пул обеспечения»
- Новый документ
- Выбрать «CODEEA Запрос на изменение области действия Расчетного кода Единого пула»
- Заполнить в открывшейся форме поля:
 - Расчетный код единого пула,
 - Рынок,
 - Присоединяемый Расчетный код (поле является обязательным в случае указания срочного рынка, и необязательным в случае валютного рынка).
- Обратите внимание, что не существует обратной операции. Если вы уверены в выбранных Расчетных кодах и действительно хотите изменить область действия Расчетного кода Единого пула свяжитесь с вашим персональным менеджером для снятия блокировки с запроса (только для первого запроса).

The screenshot shows a web application interface. On the left is a blue sidebar menu with the following items: 'Авторизация', 'Документы на подпись', 'Операции с ДС' (expanded), 'Расчетные коды' (expanded), and 'Свернуть | Развернуть'. Under 'Операции с ДС' are: 'Возврат средств', 'Счет для возврата (платежные реквизиты)', 'Постоянный возврат обеспечения', 'Запрос на перевод обеспечения', 'Запрос на депонирование', and 'Постоянное поручение на депонирование'. Under 'Расчетные коды' are: 'Запрос на открытие Расчетного кода' and 'Действия с расчетными кодами'. At the bottom of the sidebar is '© компания ИНИСТ 1998-2017'. The main content area has a title bar 'CODEEA Запрос на изменение области действия Расчетного кода Единого пула' with a dropdown arrow. Below the title bar are input fields: 'No 9' and 'от 02/06/2017'. There are three rows of data entry: 'Расчетный код единого пула' with value '03631', 'Рынок' with value 'CU - Валютный' (dropdown), and 'Присоединяемый Расчетный код' with value '04856'. At the bottom of the form are three buttons: 'Исполнить', 'Сохранить', and 'с кодом' followed by an empty input field.

Способ 2: сформировать запрос в соответствии с форматом CODEEA и направить в НКЦ по ЭДО. Спецификация формата CODEEA и порядок направления запросов в НКЦ по ЭДО приведены в документе [Формы и Форматы документов и отчетов. Часть I. Общая часть.](#)

4. Шаг4: передать профили активов с фондового рынка на другие рынки (валютный, срочный, рынок СПФИ)

- 4.1. Для того, чтобы начать использовать Расчетный код Единого пула на валютном, срочном рынке и/или рынке СПФИ, на этих рынках должно появиться обеспечение, учитываемое по Расчетному коду Единого пула. Для этого необходимо передать на валютный, срочный рынок и/или рынок СПФИ профиль актива – обеспечение, учитываемое в торгово-клиринговых системах валютного, срочного рынка или рынка СПФИ по Расчетному коду Единого пула. Направить запрос на передачу профилей активов по Расчетному коду Единого пула можно не ранее следующего дня после направления Запроса на изменение области действия Расчетного кода Единого пула. Варианты передачи профилей описаны в следующем разделе.

5. Шаг 5: при необходимости оформить доступ к Клиринговому терминалу

- 5.1. Для управления обеспечением, учитываемым по Расчетным кодам Единого пула, возможно использовать сервис Web-клиринг, либо подавать поручения через торговые терминалы. Для доступа к функционалу торговых терминалов, позволяющему осуществлять перевод обеспечения между обычными Расчетными кодами и/или передачу профилей активов по Расчетным кодам Единого пула, необходимо получить доступ к сервису Клиринговый терминал, направив в НКЦ [Заявление о доступе к Клиринговому терминалу](#).

РАЗДЕЛ II. Операции с обеспечением по Расчетным кодам Единого пула

6. Общая информация

- 6.1. Все активы, принимаемые в обеспечение и учитываемые по Расчетному коду Единого пула, учитываются в торгово-клиринговой системе фондового рынка. При этом в торгово-клиринговые системы валютного, срочного рынков и/или рынка СПФИ передается часть Единого лимита с фондового рынка в виде **профиля актива**. Переданные профили активов учитываются в торгово-клиринговой системе валютного/срочного рынка/рынка СПФИ по Расчетному коду Единого пула и учитываются при расчете Единого лимита на соответствующем рынке.
- 6.2. В качестве профиля актива на валютный рынок можно передавать любой актив, торгуемый и принимаемый в обеспечение на валютном рынке (российские рубли, валюту и драгоценные металлы), на срочный рынок в качестве профиля актива можно передавать российские рубли и перечень ценных бумаг и иностранных валют, размещенный на сайте НКЦ (в разделе «Клиринг. Участнику клиринга. Единый пул обеспечения»); на рынок СПФИ в качестве профиля актива можно передавать российские рубли, доллары США и Евро.
- 6.3. Для управления профилями активов используются специальные запросы, направляемые в НКЦ, описание см. ниже.
- 6.4. Исполнение обязательств с наступившей датой исполнения по Расчетному коду Единого пула всегда происходит в торгово-клиринговой системе фондового рынка. При этом передача обязательств для исполнения с валютного / срочного рынка/ рынка СПФИ осуществляется НКЦ автоматически. Обязательства с

наступившей датой исполнения – это обязательства по сделкам, по уплате / получению вариационной маржи и по уплате комиссий.

- 6.5. При передаче обязательств для исполнения на фондовый рынок автоматически в Торговую систему валютного / срочного рынка/ рынка СПФИ НКЦ передает профили активов, являющиеся требованиями Участника клиринга на соответствующем рынке, таким образом компенсируя Единый лимит на этом рынке.

7. Передача профиля актива по Расчетному коду Единого пула

- 7.1. Для передачи профиля актива по Расчетному коду Единого пула между торгово-клиринговыми системами разных рынков можно использовать два варианта:

- направить в НКЦ Запрос на передачу профилей активов MTRPA,
- использовать функционал Торгового терминала.

7.2. Запрос на передачу профилей активов (по ЭДО или через Web-клиринг)

7.2.1. В запросе нужно указать:

- ТКС Единого пула;
- Список изменений профиля:
 - Код передаваемого актива;
 - Рынок, на который (или с которого) передается профиль актива;
 - Клиринговый регистр:
 - на срочном рынке – код раздела регистра, обязательное поле,
 - на валютном рынке – Расчетный код 2-го уровня, необязательное поле);
 - на фондовом рынке и рынке СПФИ поле не заполняется.
 - Сумма передаваемого профиля со знаком:
 - со знаком «плюс», если профиль передается на указанный рынок;
 - со знаком «минус», если профиль передается с указанного рынка.

7.2.2. ТКС Единого пула указываются один раз в одном запросе, а рынок, код актива, регистры и суммы могут быть указаны группой, несколько раз в одном запросе.

7.2.3. В результате исполнения такого запроса внутри одного Расчетного кода Единого пула произойдет передача профилей активов в указанные торговые системы.

7.2.4. Общая сумма по каждому активу должна быть равна 0 (т.е. сумма переданного профиля должна быть равна сумме принятого профиля).

7.2.5. Нельзя передавать профиль с фондового рынка на фондовый рынок.

7.2.6. Способы направления Запроса на передачу профилей активов:

Способ 1: направить запрос с использованием сервиса Web-клиринг.

Порядок действий:

- Меню «Единый пул обеспечения»

- Новый документ
- Выбрать «Запрос на передачу профилей активов»
- Заполнить в открывшейся форме поля в соответствии с описанием в пункте 7.2.1
Поле ТКС Единого пула, поле Клиринговый регистр и суммы заполняются вручную, остальные поля выбираются из выпадающего списка.

Код актива	Рынок	Клиринговый регистр	Изменение профиля актива
RUB	EQ	L701001	200.00
RUB	FU	L701001	-150.00
RUB	FU	L701002	-50.00

В результате выполнения приведенного примера по Расчетному коду Единого пула, соответствующему ТКС L01+0000F10, будет переданы следующие профили активов: на фондовый рынок будет зачислено 200 руб., со срочного рынка будет списано 200 руб., из них 150 руб. будет списано с раздела L701001 и 50 руб. будет списано с раздела L701002.

Способ 2: сформировать запрос в соответствии с форматом MTRPA и направить в НКЦ по ЭДО. Спецификация формата MTRPA и порядок направления запросов в НКЦ по ЭДО приведены в документе [Формы и Форматы документов и отчетов. Часть I. Общая часть.](#)

7.3. Передача профилей активов с использованием функционала торговых систем валютного или фондового рынков:

- 7.3.1. Выбрать пункт меню «НКЦ», затем «Передача профилей активов».
- 7.3.2. В открывшейся форме заполнить поля:
 - Торговый счет: ТКС Единого пула (выбрать из списка ТКС)
 - Первый рынок: рынок, с которого передается профиль актива, по умолчанию – фондовый рынок;
 - Нажать «Добавить изменение», в открывшемся окне заполнить:
 - код актива,
 - клиринговый регистр (обязательно на срочном рынке, необязательно на валютном рынке),
 - сумма передаваемого профиля (со знаком минус, если передается с первого рынка и со знаком плюс, если передается на первый рынок)

- Второй рынок: рынок, на который передается профиль актива;
- Нажать «Добавить изменение», в открывшемся окне заполнить:
 - код актива (выбирается из списка),
 - клиринговый регистр (обязательно на срочном рынке, необязательно на валютном рынке),
 - сумма передаваемого профиля (со знаком плюс, если передается на второй рынок и минус, если передается со второго рынка);
- нажать «ОК».

7.3.3. Список изменений может включать более одного изменения профиля актива по каждому рынку.

7.3.4. В качестве клирингового регистра указываются:

- на валютном рынке – расчетный код 2-го уровня (необязательное поле),
- на срочном рынке – код раздела регистра (обязательное поле);
- на фондовом рынке и рынке СПФИ поле не заполняется.

Запрос на передачу профилей активов

Дата документа: 22.03.2017 Номер запроса: 923631489

Торговый счет: N35+00000N34 Код участника клиринга: 0174700000

Расчетный код: 00886

Первый рынок: Срочный

Список изменений

Клиринговый регистр:	Актив:	Изменение позиции:	
K700000	RUB	10,00	x

[Добавить изменение](#)

Второй рынок: Валютный

Список изменений

Клиринговый регистр:	Актив:	Изменение позиции:	
	RUB	0	x

[Добавить изменение](#)

ОК Отмена

7.4. Передача профилей активов с использованием функционала торговой системы SPECTRA:

7.4.1. Выбрать пункт меню «Администрирование», затем «Поручения на перевод профилей позиций»

7.4.2. В открывшейся форме заполнить поля:

- Дата, Время, Номер поручения и Идентификатор Участника клиринга на фондовом рынке заполняются автоматически.
- ТКС Единого пула (выбрать из списка ТКС). Расчетный код подставится автоматически
- Сектор отправителя: рынок, с которого передается профиль актива, по умолчанию – фондовый рынок;
- Сектор получателя: рынок, на который передается профиль актива;
- Далее построчно формируется таблица переводов, в которой необходимо указать:
 - клиринговый регистр первого рынка (обязательно на срочном рынке, необязательно на валютном рынке),
 - код актива,
 - сумма передаваемого профиля (передавать можно как положительное, так и отрицательное значение, знак минус означает, что передается профиль отрицательной позиции)
 - клиринговый регистр второго рынка (обязательно на срочном рынке, необязательно на валютном рынке),
- Нажать «+» и добавить выбранные параметры в таблицу для перевода профилей,
- При необходимости добавить следующую строку,
- После того, как таблица сформирована, нажать «Перевести».

7.4.3. В качестве клирингового регистра указываются:

- на валютном рынке – Расчетный код 2-го уровня (необязательное поле),
- на срочном рынке – код раздела регистра (обязательное поле);
- на фондовом рынке и рынке СПФИ поле не заполняется.

Идентификационные параметры поручения

Дата: 22.03.2017 Время: 16:47:42 Номер: 164742479

Ид. участника клиринга: MC0174700000

ТКС Единого Пула: N35+00000N34

Расчетный Код: 00886

Сектор отправителя: EQ Фондовый Сектор получателя: FU Срочный

RUB Российские руб 60 K700000

Код актива	Кол-во	Кл. регистр
RUB	40,00	K700001
RUB	60,00	K700002

Перевести Отмена

7.5. Для возможности операций с Расчетными кодами Единого пула с использованием Торговых терминалов необходимо иметь доступ к Клиринговому терминалу, см. Шаг 5 РАЗДЕЛА I.

8. Зачисление денежных средств на Расчетный код Единого пула

8.1. Зачисление денежных средств на Расчетный код Единого пула осуществляется в два этапа:

- зачисление денежных средств стандартным образом на Расчетный код Единого пула на фондовый рынок;
- перевод профиля актива на рынок, указанный Участником клиринга в назначении платежа (если указан фондовый рынок, то профиль не передается, средства остаются на фондовом рынке).

8.2. Порядок действий для зачисления денежных средств на расчетный код Единого пула:

8.2.1. Перечислить денежные средства по обычным реквизитам. Реквизиты приведены на странице: [Реквизиты НКЦ для внесения обеспечения.](#)

8.2.2. В назначении платежа указать кодовое слово того рынка, на который одновременно будет переведен профиль актива. Для срочного рынка нужно указать стандартное назначение платежа с номером договора ДКУ.

Внимание: для передачи профиля актива **в иностранной валюте** на валютный рынок нужно указать кодовое слово **UVRUP** (в т.ч. для передачи профиля актива на Расчетные коды 2-го уровня).

8.2.3. Если не требуется передавать профиль актива, то в назначении платежа укажите кодовое слово фондового рынка **ФРОПК / SMCSC**.

- 8.2.4. В назначении платежа указать Расчетный код Единого пула (стандартным образом).

8.3. Примеры

- 8.3.1. Для зачисления рублей на Расчетный код Единого пула XXXXXX с одновременной передачей профиля актива на валютный рынок, назначение платежа:

Перечисление средств обеспечения **ОРКXXXXXX**. НДС не облагается.

- 8.3.2. Для зачисления иностранной валюты на Расчетный код Единого пула XXXXXX с одновременной передачей профиля актива на валютный рынок, назначение платежа:

72:/BNF/PMT FOR FX TRADE SETTLEMENT

// CODE UVRUPXXXXXX

где **UVRUP** – кодовое слово, предназначенное для перечисления профиля валюты на валютный рынок.

- 8.3.3. Для зачисления рублей на Расчетный код Единого пула с одновременной передачей профиля актива на срочный рынок:

Перечисление средств гарантийного обеспечения по договору N ДКУ/*****/** от DD.MM.YYYY. Код раздела клирингового регистра RRRRRRRR. НДС не облагается.

- 8.3.4. Для зачисления иностранной валюты на Расчетный код Единого пула XXXXXX с одновременной передачей профиля актива на срочный рынок:

:72:/BNF/FORTSRRRRRRR UNDER AGR DKU/XXX

//XX/XX FROM DD.MM.YYYY

где:

RRRRRRRR – код раздела клирингового регистра, на который должны быть зачислены средства

DKU – ДКУ (кодовая идентификация типа договора)

/XXXXX/XX – номер договора об оказании клиринговых услуг

DD.MM.YYYY – день, месяц и год заключения договора об оказании клиринговых услуг

- 8.3.5. Для зачисления иностранной валюты на Расчетный код Единого пула XXXXXX с одновременной передачей профиля актива на валютный рынок на Расчетный код 2-го уровня, назначение платежа:

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

// CODE UVRUPM2XXXXXXYYYYYY

где:

M2XXXXXXYYYYYY – Расчетный код 2-го уровня, соответствующий Расчетному коду Единого пула XXXXXX;

UVRUP – кодовое слово, предназначенное для перечисления профиля валюты на валютный рынок.

8.3.6. Для зачисления рублей на Расчетный код Единого пула с одновременной передачей профиля актива на рынок СПФИ, назначение платежа:

Перечисление средств обеспечения **ОТСXXXXXX**. НДС не облагается.

Где:

XXXXXX – Расчетный код Участника клиринга, ОТС является кодовым словом рынка СПФИ.

8.3.7. Для зачисления иностранной валюты на Расчетный код Единого пула с одновременной передачей профиля актива на рынок СПФИ, назначение платежа:

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

// CODE ОТСXXXXXX

где:

XXXXXX – Расчетный код Участника клиринга

9. Возврат обеспечения с Расчетного кода Единого пула

9.1. Возврат обеспечения с Расчетного кода Единого пула осуществляется в два этапа:

- Передача профиля актива с рынка, указанного в запросе, на фондовый рынок;
- Возврат обеспечения с фондового рынка на заранее зарегистрированные реквизиты Счета для возврата.

9.2. Для возврата обеспечения с Расчетного кода Единого пула используется **Запрос на возврат обеспечения**:

- RURRETURN – для возврата рублей,
- CURRETURN – для возврата иностранной валюты.

9.3. В запросе необходимо указать:

- Рынок, с которого будет предварительно переведен профиль возвращаемого актива;
- Расчетный код Единого пула, с которого будет осуществлен возврат;
- Сумма платежа (если возврат в размере указанной суммы);
- Список (детализация списаний):
 - Клиринговый регистр:
 - на срочном рынке – код раздела регистра, обязательное поле,
 - на валютном рынке – Расчетный код 2-го уровня, необязательное поле;
 - на фондовом рынке и рынке СПФИ поле не заполняется;
 - Сумма возврата;
- Признак, указывающий на свойство возврата, может принимать значения:
 - 1 - «Возврат в размере указанной в запросе суммы»,
 - 5 - «Возврат в максимально возможном размере»;
- Код актива;
- Реквизиты Счета для возврата.

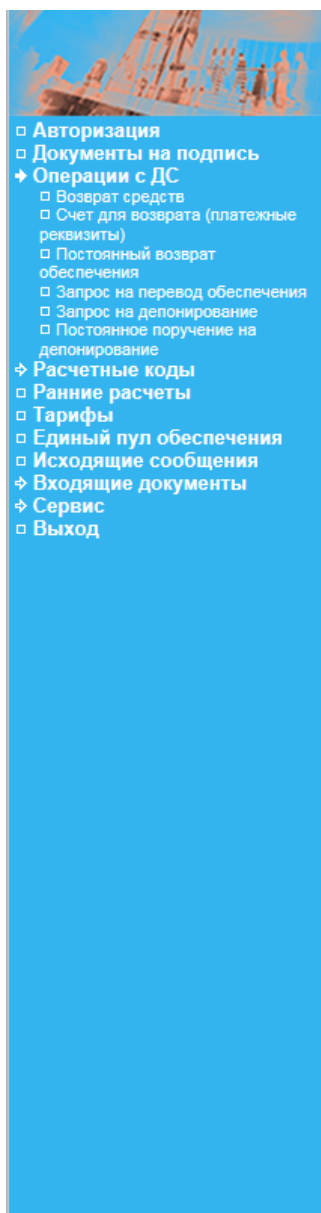
9.4. В случае использования опции «Возврат в максимально возможном размере» в Запросе в качестве рынка должен быть указан **фондовый рынок**. Максимально возможная сумма вычисляется с учетом требования, чтобы Единый лимит по Расчетному коду **на фондовом рынке** не стал отрицательным.

9.5. Способы направления Запроса на возврат обеспечения:

Способ 1: направить запрос с использованием сервиса Web-клиринг.

Порядок действий:

- Меню «Операции с ДС»
- «Возврат средств»
- Новый документ
- Заполнить в открывшейся форме поля:
 - Идентификатор участника клиринга (определяет рынок, с которого будет предварительно передан профиль актива);
 - Расчетный код участника: выбрать Расчетный код Единого пула;
 - Сумма платежа (если возврат в размере указанной суммы);
 - Детализация: по кнопке «Добавить» заполнить поля:
 - Клиринговый регистр (на срочном рынке – код раздела регистра, обязательное поле, на валютном рынке - Расчетный код 2-го уровня, необязательное поле, на фондовом рынке и рынке СПФИ поле не заполняется);
 - сумма – сумма возврата, соответствующая регистру;
 - Свойство суммы запроса (в размере указанной суммы / в максимально возможном размере).
- Реквизиты заранее зарегистрированного Счета для возврата.



Запрос на возврат обеспечения в иностранной валюте (CURRETURN) ▼	
No 126554	от 09/11/2018
Идентификатор участника клиринга	MB0224000000 ▼
Расчетный код участника	02240
Сектор рынка	VALRUR ▼
Сумма платежа	500.55
Детализация	Клиринговый регистр Сумма
Добавить	
Свойство суммы запроса	вывод средств в размере указанном в запросе ▼
Код валюты платежа	EUR Евро ▼
Банк-посредник F56A ▼	Номер счета: BIC код S.W.I.F.T. : Наименование:
Банк-бенефициара F57A ▼	Номер счета: BIC код S.W.I.F.T. : CHASDEFX Наименование:
Бенефициар F58D ▼	Номер счета: /6661112233 BIC код S.W.I.F.T. : Наименование: THE COLUMBIA PICTURES x
Исполнить	Сохранить с кодом

В приведенном примере осуществляется возврат Евро с Расчетного кода Единого пула. В результате выполнения запроса профиль актива в размере 500.55 EUR будет передан по расчетному коду 02240 с валютного рынка на фондовый рынок, а затем осуществлен возврат данной суммы с фондового рынка по указанным в запросе реквизитам (заранее зарегистрированным).

Максимально возможная сумма обеспечения вычисляется с учетом требования, чтобы Единый лимит по Расчетному коду **на фондовом рынке** не стал отрицательным. В Запросе на возврат обеспечения необходимо указать **Идентификатор на фондовом рынке**.

Способ 2: сформировать запрос в соответствии с форматом RURRETURN или CURRETURN и направить в НКЦ по ЭДО. Спецификация форматов RURRETURN и CURRETURN, а также порядок направления запросов по ЭДО приведен в документе [Формы и форматы электронных документов и отчетов. Часть I. Общая часть.](#)

10. Постоянный возврат обеспечения, запросы на депонирование

10.1. По Расчетному коду Единого пула может быть направлено Постоянное поручение на возврат денежных средств (ПВДС). ПВДС формируется и направляется стандартным образом, аналогично обычным Расчетным кодам. Особенность ПВДС для Расчетных кодов Единого пула:

- Максимально возможная сумма обеспечения вычисляется с учетом требования, чтобы Единый лимит по Расчетному коду **на фондовом рынке** не стал отрицательным. В Постоянном поручении на возврат обеспечения, формируемом через Web-клиринг, необходимо указать **Идентификатор на фондовом рынке**. При самостоятельном формировании ПВДС в формате txt, необходимо указать в качестве рынка **Фондовый рынок**.

10.2. По Расчетному коду Единого пула может быть направлен Запрос на депонирование и/или Постоянное поручение на депонирование. Указанные запрос и поручение формируются аналогично обычным Расчетным кодам.

11. Перевод обеспечения между Расчетными кодами

11.1. Перевод обеспечения между Расчетными кодами осуществляется в несколько этапов.

- Если оба расчетных кода являются Расчетными кодами Единого пула:
 - **Этап 1:** передача профиля актива с рынка списания на фондовый рынок (если требуется одновременно с переводом произвести передачу профиля с фондового или валютного рынка);
 - **Этап 2:** перевод обеспечения с Расчетного кода списания на Расчетный код зачисления;
 - **Этап 3:** передача профиля актива на рынок зачисления (если требуется одновременно с переводом произвести передачу профиля на фондовый или валютный рынок);
- Если Расчетный код списания является Расчетным кодом Единого пула, а зачисления – обычным Расчетным кодом, то выполняются 1 и 2 этапы;
- Если Расчетный код списания является обычным Расчетным кодом, а зачисления – Расчетным кодом Единого пула, то выполняются 2 и 3 этапы;
- Если оба Расчетных кода не являются Расчетными кодами Единого пула, то выполняется только этап 2.

11.2. Для перевода обеспечения между Расчетными кодами можно использовать два варианта:

- направить в НКЦ Запрос на перевод обеспечения;
- использовать функционал Торговой системы.

11.3. Запрос на перевод обеспечения (по ЭДО или через Web-клиринг)

11.3.1. В запросе необходимо указать:

- Расчетный код списания;
- Список (детализация списаний):
 - Клиринговый регистр

- на срочном рынке – код раздела регистра, обязательное поле,
 - на валютном рынке – Расчетный код 2-го уровня, необязательное поле;
 - на фондовом рынке и рынке СПФИ поле не заполняется;
- Сумма списания;
- Расчетный код зачисления;
- Список (детализация зачислений):
 - Клиринговый регистр
 - на срочном рынке – код раздела регистра, обязательное поле,
 - на валютном рынке – Расчетный код 2-го уровня, необязательное поле;
 - на фондовом рынке и рынке СПФИ поле не заполняется;
 - Сумма зачисления;
- Код валюты;
- Общая сумма списания/зачисления (должна быть равна сумме по регистрам);
- Рынок списания (валютный, срочный или рынок СПФИ) – с этого рынка будет передан профиль актива на фондовый рынок, необязательное поле;
- Рынок зачисления (валютный, срочный или рынок СПФИ) – на этот рынок будет передан профиль актива с фондового рынка, необязательное поле.

11.3.2. Способы направления Запроса на перевод обеспечения:

Способ 1: направить запрос с использованием Web-клиринг.

Порядок действий:

- Меню «Операции с ДС»
- «Запрос на перевод обеспечения»
- Новый документ
- Заполнить в открывшейся форме поля в соответствии с описанием в пункте 11.3.1. Рынок списания и рынок зачисления задаются указанием Идентификаторов Участника клиринга для списания и для зачисления. Поле Клиринговый регистр и суммы заполняются вручную, остальные поля выбираются из выпадающего списка.

 □ Авторизация □ Документы на подпись ♦ Операции с ДС □ Возврат средств □ Счет для возврата (платежные реквизиты) □ Постоянный возврат обеспечения □ Запрос на перевод обеспечения □ Запрос на депонирование □ Постоянное поручение на депонирование ♦ Расчетные коды □ Запрос на открытие Расчетного кода □ Действия с расчетными кодами □ Запрос на открытие ТКС (имущественного пула) □ Ранние расчеты □ Тарифы □ Единый пул обеспечения □ Исходящие сообщения ♦ Входящие документы ♦ Сервис □ Выход - Свернуть Развернуть © компания ИНИСТ 1998-2017	MTRNRQ Запрос на перевод обеспечения	
	No 19828 от 02/06/2017	
	Идентификатор УК для списания	MB0224000000 ▾
	Расчетный код для списания	02240
	Детализация списаний	Клиринговый регистр Сумма
	Добавить	
	Идентификатор УК для зачисления	L7 ▾
	Расчетный код для зачисления	06439
	Детализация зачислений	Клиринговый регистр Сумма
	Добавить	
		☒ X500001 100
		☒ X500002 200
	Код валюты	RUB Российский рубль ▾
	Сумма	300.00
	Исполнить Сохранить с кодом	

В приведенном примере с обычного расчетного кода валютного рынка 02240 осуществляется перевод рублей на Расчетный код Единого пула 06439. В результате выполнения запроса 300 рублей будут перечислены с валютного рынка с расчетного кода 02240 на фондовый рынок на расчетный код 06439, а затем профиль актива 300 руб. будет передан в торгово-клиринговую систему срочного рынка, причем на регистр X500001 будет передан профиль в размере 100 руб., и на регистр X500002 будет передан профиль в размере 200 руб.

Способ 2: сформировать запрос в соответствии с форматом MTRPA и направить в НКЦ по ЭДО. Спецификация формата MTRPA и порядок направления запросов в НКЦ по ЭДО приведены в документе [Формы и Форматы документов и отчетов. Часть I. Общая часть.](#)

11.4. Перевод обеспечения между Расчетными кодами с использованием функционала торговых систем валютного или фондового рынков

11.4.1. Выбрать пункт меню «НКЦ», затем «Перевод обеспечения»

11.4.2. В открывшейся форме заполнить поля:

- Первый рынок – с этого рынка будет списано обеспечение;
- Первый Расчетный код (списание);
- При необходимости нажать «Добавить изменение», в открывшемся окне заполнить:
 - клиринговый регистр:
 - на срочном рынке – код раздела регистра, обязательное поле,
 - на валютном рынке – Расчетный код 2-го уровня, необязательное поле;
 - на фондовом рынке и рынке СПФИ поле не заполняется;
 - изменение позиции (со знаком плюс);
- Второй рынок – на этот рынок будет зачислено обеспечение;

- Второй Расчетный код (зачисление);
- При необходимости нажать «Добавить изменение», в открывшемся окне заполнить:
 - клиринговый регистр:
 - на срочном рынке – код раздела регистра, обязательное поле,
 - на валютном рынке – Расчетный код 2-го уровня, необязательное поле;
 - на фондовом рынке и рынке СПФИ поле не заполняется;
 - изменение позиции (со знаком плюс);

11.5. Перевод обеспечения между Расчетными кодами с использованием функционала торговой системы срочного рынка

11.5.1. Выбрать пункт меню «Администрирование», затем «Поручения на перевод обеспечения»

11.5.2. В открывшейся форме заполнить поля:

- Дата, Время, Номер поручения на фондовом рынке заполняются автоматически.
- В разделе «Списание» указывается Расчетный код и рынок, с которого будет списано обеспечение;
- В разделе «Зачисление» указывается Расчетный код и рынок, на который будет зачислено обеспечение;
- Из выпадающего списка выбрать обеспечение;
- Далее построчно указывается регистр и размер обеспечения:
 - на срочном рынке – код раздела регистра, обязательное поле,
 - на валютном рынке – Расчетный код 2-го уровня, необязательное поле;
 - на фондовом рынке и рынке СПФИ поле не заполняется;
- нажать «+» и добавить выбранные параметры в таблицу для перевода обеспечения

- После того как таблица переводов по регистрам сформирована, нажать «Перевести».

Перевод обеспечения

Идентификационные параметры поручения

Дата: 22.03.2017 Время: 15:15:47 Номер: 151547282

Списание **Зачисление**

Расчетный Код: 00178 Расчетный Код: 26888

Рынок: EQ Фондовый Рынок: FU Срочный

Обеспечение: RUB Российские рубли

40,00 4100000 30

Кл. регистр	Кол-во
4100001	10,00
4100010	30,00

Сумма: 40 Сумма: 40,00

Перевести **Отмена**

РАЗДЕЛ III. Исполнение обязательств, margin call по Расчетному коду Единого пула

12. Исполнение обязательств по Расчетному коду Единого пула осуществляется следующим образом:

- Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования, учитываемые по Расчетному коду Единого пула, после их определения в Клиринговой системе валютного рынка / срочного рынка/ рынка СПФИ передаются в Клиринговую систему фондового рынка и прекращают учитываться в Клиринговой системе валютного рынка / срочного рынка/ рынка СПФИ.
- Профили активов, учитываемые по Расчетному коду Единого пула в Клиринговой системе валютного рынка / срочного рынка/ рынка СПФИ, уменьшаются на объем Итоговых нетто-обязательств и увеличиваются на объем Итоговых нетто-требований.
- Профили активов, учитываемые по Расчетному коду Единого пула в Клиринговой системе фондового рынка, изменяются противоположно изменению Профилей активов в Клиринговой системе валютного рынка / срочного рынка/ рынка СПФИ.
- Указанные выше Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования включаются в Единый клиринговый пул, участвуют в расчете Итоговых нетто-

обязательств / Итоговых нетто-требований по ценным бумагам / драгоценным металлам / денежным средствам в соответствующей валюте.

Таким образом, по Расчетному коду Единого пула осуществляется неттинг обязательств по сделкам, заключенным на фондовом, валютном, срочном рынках и рынке СПФИ.

Участник клиринга обязан исполнить свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам, драгоценным металлам или ценным бумагам, определенные в соответствующем Едином клиринговом пуле, до времени, установленного Временным регламентом.

13. Маржинальное требование по Расчетному коду Единого пула

Маржинальное требование по Расчетному коду Единого пула может возникнуть у Участника клиринга в Клиринговой системе любого из биржевых рынков, включенных в единый пул обеспечения, и может быть прекращено путем передачи Профилей активов со знаком «плюс» в Клиринговую систему соответствующего биржевого рынка Участником клиринга.

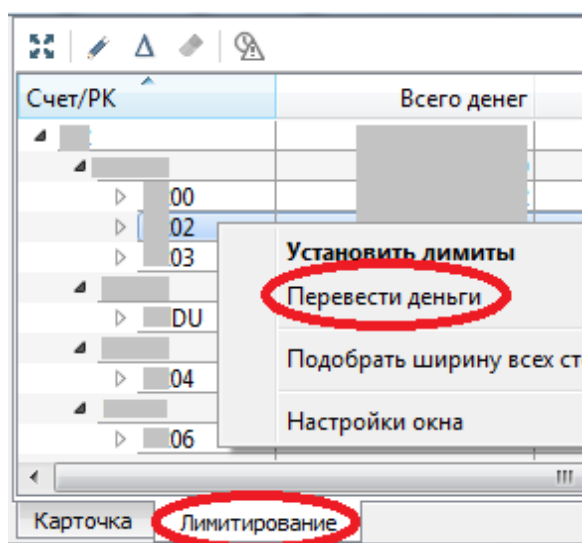
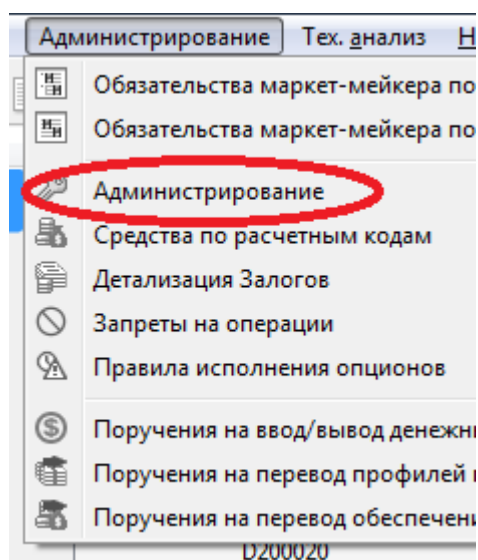
В случае неисполнения Маржинального требования Участником клиринга до 17:00, НКЦ вправе:

- передать Профили активов в Клиринговую систему биржевого рынка, в которой учитывается неисполненное Маржинальное требование по Расчетному коду Единого пула;
- уведомить Биржу о необходимости приостановления возможности подачи или снятия заявок;
- заключить без подачи заявок закрывающие Сделки с частичным обеспечением;
- заключить закрывающие Сделки Т+, направленные на продажу имущества (ценных бумаг или иностранной валюты) из имущественного пула (для Участника пула, не исполнившего Маржинальное требование).

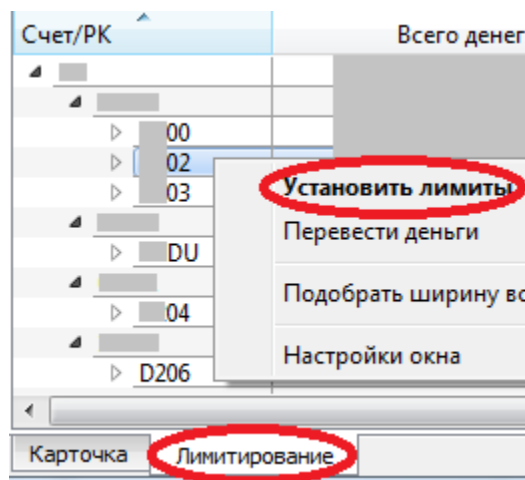
РАЗДЕЛ IV. Изменения на срочном рынке

14. Терминал Spectra

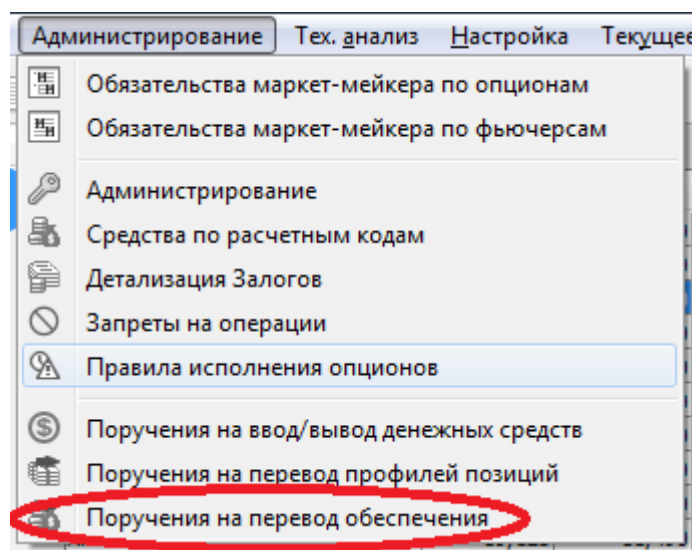
Функционал перевода денег в окне «Лимитирование» между брокерскими фирмами, когда перевод происходит между разными РК, и хотя бы один из РК является РК ЕП, более не поддерживается.



Возможность переводов внутри РК, а также между разными РК, не переведенными на ЕП, сохраняется. Поддержка «установки лимитов», доступная для РК с БФ ХХ00, сохраняется.



Для переводов в обеспечения между любыми РК можно использовать окно переводов обеспечения:



15. Шлюз Plaza2

В таблицу fut_margin_type потока FORTS_FUTINFO_REPL добавлен флаг UCP_type (признак включения РК в единый пул).

Транзакция ExchangeBFMoney не может быть использована в случае, если указанные БФ принадлежат разным РК, и хотя бы один из РК является РК Единого пула.

Продолжают поддерживаться:

- Транзакция ExchangeBFMoney при применении к БФ одного РК или к БФ разных РК, в случае если оба РК не являются РК Единого пула.
- Транзакция ChangeBFMoney. Как в версии ТКС Spectra 5.3 она может применена только к БФ, которые находятся в одном РК с БФ XX00.

Для автоматизированных переводов денежных средств между Расчетными кодами Единого пула можно использовать запрос MTRNRQ (см. пункт РАЗДЕЛ II.11.3).

16. Специальные Брокерские фирмы

Для каждого Расчетного кода зарегистрирована Специальная Брокерская фирма (исключение – Расчетный код для Обособленной Брокерской Фирмы).

На Специальной Брокерской фирме зарегистрирован ровно один раздел ХХУУ000. Регистрация дополнительных разделов запрещена.

Торговые операции с использованием Специальных БФ невозможны.

Специальная БФ может использоваться для:

- Списания штрафов за рублевую задолженность
- Учета дисконтирования вариационной маржи
- Учета рублевого и валютного обеспечения (по желанию участника)

На РК для ОБФ учет штрафов за рублевую задолженность и учет дисконтирования вариационной маржи производится по разделу ХХУУ000.

