**Краткий алгоритм поставки**

**Предпоследний торговый день(T-2):**

1. 19:00 – Биржа публикует на сайте, какие выпуски для продавцов будут выбраны **по умолчанию**, если в последний торговый день продавцы не сообщили Бирже о своем выборе. Такими облигациями будут наиболее дешевые к поставке облигации (**cheapest-to-deliver**)

**Последний торговый день(T-1):**

1. До 17:00 подать «[Заявления о соответствии Торгово-клирингового …](http://nkcbank.ru/UserFiles/File/CK24/Zayavlenie%20o%20sootvetstvii%20TKS%20dlya%20postavki%20BF.doc)» с соответствием 7-значного кода клиента со Срочного рынка и связки ТКС и краткого кода клиента Фондового рынка (если его нет).

Образец заявления, пример и инструкция по заполнению: <http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=312>

Каждому коду клиента на Срочном рынке соответствует только один ТКС. Т.е. если до этого Вы осуществляли поставку по акциям и торгуете фьючерсами на акции с того же раздела, что и фьючерсами на облигации, то поставка будет осуществлена ту да же, куда поставлялись акции.

Если связка не указана, то поставка пройдет на «Любимый» клиентский ТКС, указанный брокером. В случае отсутствия и такого ТКС, поставка не будет осуществлена.

1. В 19:00 определяются цены поставки облигаций, как расчетная цена фьючерса, умноженная на конверсионный коэффициент.
2. До 19:50 В случае наличия короткой позиции по фьючерсу прислать отчет о поставляемых выпусках. Иначе выпуски выбираются **по умолчанию**. Для выбора выпусков в ЛКУ, нужно:
   1. Зайти в ЛКУ https://passport.moex.com, используя свой логин/пароль
   2. Перейти в Раздел «Документооборот», далее в «Выбор выпусков ОФЗ».
   3. Выбрать выпуски для поставки
   4. Отправить сформированный файл по системе ЭДО Срочного рынка до 19:50.

**День поставки(T):**

1. С 9:30 до 19:00 – Автоматическое заключение сделки купли/продажи соответствующих бумаг в T+1 в случае достаточности обеспечения на фондовом рынке. Код борда: **SPOB.** После заключения сделки ГО на срочном рынке сразу же освобождается.

* Если единый лимит включен, то проверяется достаточность средств на едином лимите для обеспечения сделки – сделка сразу же заключается, как только единый лимит превышает необходимое под сделку обеспечение
* Если единый лимит выключен, то необходимо наличие 100% обеспечения (т.е. все бумаги или деньги в полном объеме).

1. Возможен неттинг с другими операциями с ЦК: РЕПО с ЦК, РПС с ЦК в T+1, стакан ОФЗ T+1.

**День исполнения сделки(T+1):**

1. В случае покупки бумаг обеспечить наличие денег в необходимом размере на указанном в п.1 счете к 17:00.

В случае продажи – обеспечить наличие бумаг на указанном в п.1 счете к 17:00.

В случае отсутствия бумаги для поставки к 17:00 заключается сделка переноса позиции.

**Алгоритм выбора CTD бумаг.**

Для всех облигаций, входящих в корзину фьючерса считаются конвертированные цены облигаций. Облигация с минимальной конвертированной ценой называется CTD, или наилучшей к поставке для этого фьючерса.

Конвертированная цена облигации – ее официальная цена закрытия (Legal close price) деленная на ее конверсионный коэффициент.

**Заполнение Заявлений**

Если связка 7-значного кода клиента со Срочного рынка и связки ТКС и краткого кода клиента Фондового рынка, которую Вы хотите использовать для поставки не задана, то в последний торговый день необходимо заполнить и отправить на Срочный рынок «[Заявления о соответствии Торгово-клирингового …](http://nkcbank.ru/UserFiles/File/CK24/Zayavlenie%20o%20sootvetstvii%20TKS%20dlya%20postavki%20BF.doc)».

При этом можно выбрать либо «Заявления о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки Брокерской фирме» (Заявление №2)либо «Заявления о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки разделу регистра учета позиций» (Заявление №3).

Заявление №2 подается в том случае, если вся Брокерская фирма или большинство регистров раздела учета позиций внутри одной Брокерской фирмы привязываются к одному ТКС (нет смысла перечислять все регистры).

По отдельным регистрам, которые привязываются к разным ТКС, предоставляется Заявление №3.

В Заявлении №2 при желании можно указать соответствие «Код раздела регистра учета позиций» - «Краткий код клиента» на фондовом рынке, тогда после заключения Сделок Т+ для поставки (BoardId = SPOB) в отчете EQM06 будет заполнено поле Systemref (код раздела регистра учета) и поле ClientCode (краткий код клиента). В противном случае будет заполнено только поле Systemref.

В Заявлении №3 поле «Краткий код клиента» обязательно для заполнения (кроме собственных разделов).

Заявления можно предоставлять в форматах: Word, RTF, Excel, plain text.

Заявления должны быть предоставлены по ЭДО на срочный рынок до 15:00 последнего дня заключения фьючерсного контракта.

По результатам обработки заявления участник получит клиринговый Отчет о соответствии Торгово-клирингового счета Брокерской фирме/ разделу регистра учета позиций (toeqXXYY.csv) в общем пакете отчетов. В случае если заявление не обработано, то необходимо связаться с отделом клиринга срочного рынка для уточнения причин, и прислать новое Заявление.