Допуск к валютномУ рынкУ И рынку депозитов с центральным контрагентом ПАО Московская Биржа

Оглавление

[**Общие положения 2**](#_Toc488759364)

[**Нормативная база 2**](#_Toc488759365)

[**Валютный рынок 2**](#_Toc488759366)

[**Рынок депозитов с Центральным контрагентом 2**](#_Toc488759367)

[**Требования к кандидату 2**](#_Toc488759368)

[**Подключение к ЛКУ 5**](#_Toc488759370)

[**Досье Участника торгов и клиринга 2**](#_Toc488759369)

[**Доступ к Электронному документообороту (ЭДО) 9**](#_Toc488759371)

[**WEB-клиринг 11**](#_Toc488759372)

[**Допуск к торгам и клиринговому обслуживанию 11**](#_Toc488759373)

[**Технический доступ 13**](#_Toc488759374)

[**Оформление технического доступа 2**](#_Toc488759375)

[**Тестовый доступ 2**](#_Toc488759376)

[**Затраты по подключению и работе на рынках 2**](#_Toc488759377)

[**Операции с денежными средствами 15**](#_Toc488759378)

[**Внесение денежных средств 2**](#_Toc488759379)

[**Вывод денежных средств на Валютном рынке 2**](#_Toc488759380)

[**Вывод денежных средств на Рынке депозитов 2**](#_Toc488759381)

[**Перевод денежных средств 2**](#_Toc488759382)

[**Комиссионное вознаграждение за учет Обеспечения 2**](#_Toc488759383)

[**Штрафы за неисполнение обязательств и перенос позиций 2**](#_Toc488759384)

[**Валютный рынок 2**](#_Toc488759385)

[**Рынок депозитов 2**](#_Toc488759386)

**Штрафы за cut-off time………………………………………………………………………19**

[**Торговые и клиринговые отчеты 2**](#_Toc488759387)

Общие положения

* Кандидаты - Некредитные организации, не являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг или лицами, осуществляющими иную лицензируемую деятельность на финансовом рынке;
* Центральный контрагент - Небанковская кредитная организация-центральный контрагент «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).
* Валюта депозита – рубли, доллары США;
* 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 расчетов на Валютном рынке и Рынке депозитов с Центральным контрагентом регулируются Правилами допуска к участию в торгах, Правилами проведения организованных торгов и Правилами клиринга на соответствующем рынке. Все документы раскрываются на сайте Московской Биржи и НКЦ.

Валютный рынок

1. Правила допуска к участию в торгах - <http://fs.moex.com/files/713>
2. Правила организованных торгов - <http://fs.moex.com/files/714>
3. Правила клиринга - <http://www.nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=244>

Рынок депозитов с Центральным контрагентом

1. Правила допуска к участию в торгах - https://fs.moex.com/files/713
2. Правила организованных торгов - <https://fs.moex.com/files/17018>
3. Правила клиринга - <http://www.nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=244>

Требования к кандидату

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Показатель** | **Валютный рынок** | **Рынок депозитов с ЦК** |
| Квалификация | * В организации должно иметься отдельное структурное подразделение, к функциям работников которого относится осуществление операций на финансовом рынке, включая заключение сделок купли-продажи иностранной валюты (Казначейство); * В штате организации имеются как минимум 2 (два) работника, в должностные обязанности которых входит заключение сделок купли-продажи иностранной валюты, каждый из которых должен иметь опыт работы в организации, осуществляющей операции на финансовом рынке, и деятельность работника была непосредственно связана с совершением таких операций, **либо** имеет квалификационный аттестат; * За 2 (два) календарных года, предшествующих обращению Кандидата на Биржу для получения допуска на валютный рынок и рынок драгоценных металлов, годовой объем заключенных 1) организацией или 2) организацией и юридическими лицами, являющимися аффилированными лицами организации в соответствии с Законом РСФСР от 22.03.1991 N 948-1 «О конкуренции и ограничении монополистической деятельности на товарных рынках» и/или входящими в периметр консолидации при подготовке организацией консолидированной финансовой отчетности по МСФО, сделок купли-продажи иностранной валюты составляет не менее 100 млн. долларов США в год (по курсу, определяемому на 31 декабря каждого соответствующего календарного года). | * Наличие как минимум 2 (двух) работников, обладающих квалификационным аттестатом специалиста финансового рынка первого типа или соответствующим ему квалификационным аттестатом согласно требованиям законодательства и (или) прошедших профильное обучение в одном из учебных центров, перечень которых устанавливается решением Биржи и (или) имеющих опыт осуществления операций на финансовом рынке, и их деятельность непосредственно связана с совершением таких операций (что подтверждается письмом установленного образца, см. [Допуск к торгам и клиринговому обслуживанию](#_Допуск_к_торгам)). |
| **Полное депонирование (категория «В»)** | | |
| Размер собственных средств (капитала) | * не менее 1 (одного) миллиарда рублей. | |
| **Частичное депонирование (категория «Б»)** | | |
| Размер собственных средств (капитала) | * не менее 50 (пятидесяти) миллиардов рублей | * не менее 10 (десяти) миллиардов рублей; * иметь валюту баланса не менее, чем 50 (пятьдесят) миллиардов рублей. |
| Рейтинг | * рейтинг по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже BB- по классификации рейтинговых агентств "Standard & Poor's" или "Fitch Ratings" либо "Ba3" по классификации рейтингового агентства "Moody's Investors Service", либо * кредитный рейтинг по национальной шкале не менее A- по классификации Аналитического Кредитного Рейтингового Агентства (АКРА) или рейтингового агентства «Эксперт РА». |  |
| Взнос в Гарантийный фонд (возвратная сумма) | 10 000 000 ₽ | 1 000 000 ₽ |
| Финансовое состояние | 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). | |

Взнос в Гарантийный фонд осуществляется в рублях (или эквивалент в долларах США или евро) по реквизитам, указанным по данной ссылке: <http://www.nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=378>

Сведения о средствах, находящихся в Гарантийном фонде, отражаются в отчете EQM92 (ежедневно направляется участнику по системе ЭДО).

Подключение к ЛКУ

**"Личный кабинет Участника"** (далее – ЛКУ) – это информационное обеспечение, предоставляющее различные возможности в части трансляции данных и осуществления действий через кабинет. Все документы, полученные ПАО Московская Биржа в электронном виде от пользователя посредством ЛКУ, считаются представленными на Биржу в соответствии с Правилами.

**Для получения доступа к ЛКУ необходимо**:

1. Пройти процедуру регистрации по адресу: <https://passport.moex.com/registration> (для каждого сотрудника, который будет использовать ЛКУ от имени Вашей организации). Регистрация происходит анонимно, с указанием желаемого пользователем Псевдонима/E-mail/Пароля.
2. Заполнить [Заявление о предоставлении доступа к информационному обеспечению «Личный кабинет Участника»](http://fs.moex.com/files/14171/), включив данные пользователей, зарегистрированных согласно п.1.

Способ предоставления Заявления:

1. Первичное Заявление предоставляется на бумажном носителе на бланке организации с печатью за подписью уполномоченного лица.
2. Последующие заявления - по Системе ЭДО на адрес [lku@moex.com](mailto:lku@moex.com) - перед отправкой, заявление необходимо подписать любым действующим закрытым (секретным) ключом электронной подписи, зашифровать на имя уполномоченного сотрудника Департамента клиентской поддержки (далее – ДКП) ПАО Московская Биржа [КОПЫЛОВА М.Э.](http://fs.moex.com/files/1307) (<https://fs.moex.com/cdp/sert/MICEX_Reports(GOST).zip)>.

Файл в формате RTF рекомендуется назвать следующим образом: хххххххххх.rtf, где хххххххххх – ИНН Вашей организации).

Более подробную информацию о Порядке подключения к ЛКУ можно получить по ссылке: Приложении №1к Руководству пользователя "Личный кабинет участника"

Досье Участника торгов и клиринга

Для прохождения процедуры KYC необходимо предоставить следующие документы:

|  |  |
| --- | --- |
| **1** | Анкета (клиента)/Анкета Юридического Лица.  Анкета Юридического Лица заполняется в ЛКУ, после подключения. (После получения ключей ЭДО и доступа к Личному кабинету участника данную Анкету необходимо направить в зашифрованном и подписанном виде на адрес [regcard@moex.com](mailto:regcard@moex.com)). |
| **2** | Копии учредительных документов юридического лица с изменениями и дополнениями с отметкой о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц. Указанные копии должны быть заверены федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц, или нотариально. |
| **3** | Перечень лицензий на право осуществления деятельности, подлежащей лицензированию (при наличии) как приложение к Анкете ЮЛ (направляется в файле). |
| **4** | В отношении единоличного исполнительного органа (далее по тексту Руководитель):   * нотариально удостоверенная копия или копия, заверенная подписью Руководителяи печатью Кандидата (при наличии), письма Банка России с подтверждением согласования кандидатуры Руководителя * подлинник или нотариально удостоверенная копия или копия, заверенная подписью Руководителяи печатью Кандидата (при наличии), решения уполномоченного органа Кандидата (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения, или заверенный подписью Руководителя и печатью Кандидата (при наличии)) об избрании (назначении) Руководителя; * копия документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Кандидата (при наличии); * копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии), либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии). |
| **5** | Карточка с образцами подписей и оттиска печати Кандидата (при наличии), оформленная в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России (либо нотариально удостоверенная копия карточки). |
| **6** | Подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об одобрении сделок, заключаемых в соответствии с Правилами клиринга с Клиринговым центром, а также Договора об оказании клиринговых услуг в случае, если сделки/договор между юридическим лицом и Клиринговым центром в соответствии с требованиями действующего законодательства признаются сделками с заинтересованностью, в противном случае юридическое лицо предоставляет письмо об отсутствии признаков заинтересованности в указанных сделках (договорах). |
| **7** | Отзыв о деловой репутации юридического лица.  Организация предоставляет Отзыв о деловой репутации от Участников клиринга, имеющих с ним деловые отношения, и/или Отзыв о деловой репутации от кредитных организаций, в которых организация находится или ранее находилась на обслуживании, с информацией этих кредитных организаций об оценке деловой репутации данной организации. В случае невозможности получения вышеуказанных Отзывов о деловой репутации Клиринговый центр принимает Отзыв о деловой репутации от контрагентов, не являющихся Участниками клиринга.  Отзывы должны включать следующие основные характеристики: длительность взаимоотношений, вид(ы) операций, оценка деловой репутации, обоснование оценки деловой репутации (например, отсутствие/присутствие фактов недобросовестного поведения, нарушения партнерских отношений или принятых на себя обязательств). Отзыв должен быть адресован сразу в две организации группы – ПАО Московская Биржа и НКО НКЦ (АО). |
| **8** | Анкета для целей выявления иностранных налогоплательщиков (далее –Анкета) в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA.  Организации, информация о которых на основании части 2 ст. 2 Федерального закона от 28.06.2014 № 173-ФЗ не подлежит сбору и передаче, вправе не предоставлять в Анкете информацию в целях FATCA. В этом случае таким организациям необходимо на адрес [AnketaFATCA@moex.com](mailto:AnketaFATCA@moex.com) дополнительно направить электронное сообщение следующего примерного содержания: ««Краткое наименование организации из устава» (ИНН) на основании части 2 ст.2 Федерального закона от 28.06.2014 № 173-ФЗ вправе не предоставлять информацию в целях FATCA».  Организации вправе не предоставлять Анкету, в случае если они являются субъектами, на которых в соответствии с законодательством Российской Федерации не распространяются требования по представлению информации в федеральный орган исполнительной власти, уполномоченный по контролю и надзору в области налогов и сборов, в связи с автоматическим обменом финансовой информацией (CRS) (перечень организаций установлен в Положении, утвержденном Постановлением Правительства РФ от 16 июня 2018 года № 693).  Анкета доступна для заполнения по ссылке <http://moex.com/ru/fatca>.  Заполненную Анкету необходимо сохранить в zip файле (кнопка «Получить zip файл»). Рекомендуется не изменять наименование архива и файла. Электронный файл должен быть подписан закрытым (секретным) ключом электронной подписи Вашей организации и направлен по адресу: [AnketaFATCA@moex.com](mailto:AnketaFATCA@moex.com)  Кандидату, направляющему Анкету на бумажном носителе (до получения электронной подписи) необходимо на оборотной стороне последнего листа Анкеты проставить прошито, пронумеровано и скреплено, поставить печать и подпись уполномоченного лица. |
| **9** | Отчетность:   * Бухгалтерский баланс (форма 0710001); * Отчет о финансовых результатах (форма 0710002); * Отчет о движении денежных средств (форма 0710004); * Финансовая отчетность по МСФО (в т. ч. консолидированная) на русском или английском языке   Годовой бухгалтерский баланс и годовой отчет о финансовых результатах предоставляются на последнюю отчетную дату, квартальные формы отчетности – за три последние отчетные даты, а также финансовая отчетность по МСФО (в т. ч. консолидированная) на русском или английском языке – по мере составления или публикации.  Вся отчётность направляется в виде файла обмена (формата XML), сформированного для передачи в электронном виде данных по бухгалтерской отчетности организации в налоговые органы, подготовленного в следующем порядке:  - каждый электронный файл определенного типа должен быть подписан закрытым (секретным) ключом электронной подписи уполномоченного лица Вашей организации и зашифрован на имя уполномоченного сотрудника Департамента клиринга НКО НКЦ (АО) КОПЫЛОВА М.Э. (ссылка на ключ Копылова М.Э. - (<https://fs.moex.com/cdp/sert/MICEX_Reports(GOST).zip)>.  - сформированное электронное письмо в формате .xml с финансовой отчетностью направляется на адрес электронной почты finreport@moex.com и [oibd@moex.com](mailto:oibd@moex.com).  Сводная таблица требований к предоставляемой отчетности:  <http://fs.moex.com/files/1313> |
| **10** | Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия, или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя Кандидата, уполномоченного осуществлять действия (операции) от имени Кандидата во взаимоотношениях с Биржей, включая полномочия по подписанию необходимых документов.  В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:  - копия документа, удостоверяющего личность представителя Кандидата, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Кандидата (при наличии);  - копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) представителя Кандидата, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Кандидата (при наличии), либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии). |
| **11** | В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), пребывающим в Российской Федерации, то дополнительно необходимо предоставить:  - заверенную подписью уполномоченного лица и печатью Кандидата (при наличии) копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством РФ право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);  - заверенную подписью уполномоченного лица и печатью Кандидата (при наличии) копию миграционной карты;  - письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (в случае если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком). |
| **12** | Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства). |

Доступ к Электронному документообороту (ЭДО)

Функции:

* Обмен сообщениями и документами;
* Получение торговых и клиринговых отчетов.

Подробная информация о Системе ЭДО: <http://moex.com/s1273>

Для этого необходимо предоставить:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **1** | Договор об участии в Системе электронного документооборота (2 экз.) - без указания даты |  |
| **2** | Заявление на создание СКПЭП (для физического лица, действующего от имени юридического лица), выбрав области действия «Электронный документооборот валютного рынка» и/или «Электронный документооборот фондового рынка» и «Электронный документооборот НКЦ» |  |
| **3** | Доверенность на владельца СКПЭП, действующего от имени юридического лица  *(При создании СКПЭП на ЕИО не требуется)* |  |
| **4** | Доверенность на подписание электронных документов  *(При создании СКПЭП на ЕИО не требуется)* |  |
| **5** | Копия паспорта Владельца СКПЭП (кроме ЕИО), заверенная уполномоченным лицом и печатью организации либо нотариально |  |
| **6** | Копия свидетельства ИНН Владельца СКПЭП (кроме ЕИО), заверенная уполномоченным лицом и печатью организации либо нотариально |  |
| **7** | Согласие на обработку персональных данных (кроме ЕИО) |  |

Первичное создание СКПЭП производится в ЛКУ после предоставления Заявления на создание СКПЭП -> раздел "Техническое обслуживание" -> подраздел "Услуги УЦ".

По всем вопросам, связанным с оказанием услуг УЦ, Вы можете обращаться к Администратору СЭД по тел. +7 (495) 363-32-32 (доб.1110) или e-mail: [pki@moex.com](mailto:pki@moex.com)

Тарифы на Услуги Организатора СЭД:

|  |  |
| --- | --- |
| **Наименование Услуги** | **Тариф** (в рублях, без НДС) |
| Изготовление ключа | **3 500 ₽** ежегодно  (при изготовлении сертификата ключа) |
| Абонентская плата | **1 500 ₽**  Ежемесячно |
| Замена действующего СКПЭП в связи с внесением изменений | **1 000 ₽** |

WEB-клиринг

Функции:

* Направление поручений в клиринговую систему (вывод денежных средств, перевод денежных средств между счетами, поручения на постоянный возврат денежных средств и прочее).

Для регистрации в сервисе WEB-клиринг необходимо заполнить Заявление на подключение к WEB -клиринг <http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=483>.

Заполненное Заявление нужно направить по системе ЭДО на адрес [oibd@moex.com](mailto:oibd@moex.com), укажите тему сообщения «Web-клиринг». Заявление необходимо подписать закрытым (секретным) ключом электронной подписи уполномоченного лица Вашей организации и зашифровать на имя уполномоченного сотрудника Департамента клиринга НКО НКЦ (АО) КОПЫЛОВА М.Э. (<https://fs.moex.com/cdp/sert/MICEX_Reports(GOST).zip>).

На всех сотрудников, указанных в Заявлении, необходимо заполнить Доверенность на подписание электронной подписью электронных документов ([скачать файл (35 Kb)](http://nkcbank.ru/UserFiles/File/sed/Doverennost.doc)). (кроме ЕИО)

Код для доступа к WEB-клирингу будет направлен по контактам, которые указаны в заявлении. Наш технический специалист свяжется с вами и поможет настроить систему.

Допуск к торгам и клиринговому обслуживанию

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **№** | **Наименование документа** | **Валютный рынок** | | **Рынок депозитов** |
| **1** | Предоставить Договор об оказании клиринговых услуг (если не был заключен ранее) 2 экз. - без указания даты |  | | |
| **2** | Предоставить Заявление о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию |  | | |
| **3** | Предоставить Запрос на открытие Расчетного кода |  | | |
| **4** | Зарегистрировать счета для возврата | PAYPROPRQ в программе WEB-клиринг | | |
| **5** | Предоставить Договор об оказании услуг по проведению организованных торгов (если не был заключен ранее) 2 экз. - без указания даты  ***(!) Новая форма договора (ожидаемая дата вступления в силу 24 октября 2018 года)*** |  | | |
|  |  | ***NEW VERSION*** | | |
| **6** | Заключить Договор ИТС (если не был заключен ранее) 2 экз. - без указания даты |  | | |
|  | *Доверенность на подписанта п.п. 5,6* |  | | |
| **7** | Выбрать Расчетный код для списания комиссионного вознаграждения (при наличии нескольких) - опционально |  | | |
| **8** | Предоставить Заявление о предоставлении технического доступа |  | | |
| **9** | Предоставить Заявление о предоставлении допуска к участию в торгах |  | | |
| **10** | Предоставить Письмо о соответствии условиям допуска |  | | |
| **11** | Поскольку заключение Договора об оказании клиринговых услуг на фондовом рынке и рынке депозитов сопровождается открытием депозитного счета, необходимо оформить допуск к клиринговому обслуживанию в личном присутствии представителя клиента\* |  |  | |

Личное присутствие оформляется с представителем организации, являющимся ЕИО или включенным в карточку с образцами подписей и оттиска печати, уполномоченным распоряжаться денежными средствами, находящимися на счете, или представителем, которому организацией предоставлены доверенностью полномочия, связанные с открытием счета (заключением договора банковского счета)

Технический доступ

Оформление технического доступа

Для получения технического доступа к торгам необходимо предоставить:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **№** | **Наименование документа** | **Валютный рынок** | **Рынок депозитов** |
| **1** | Лицензионный договор (если не был заключен ранее) 2 экз. - без указания даты  Условия оказания услуг по договору представлены на сайте для ознакомления: <http://fs.moex.com/files/9762> |  | |
| **2** | Спецификация (в 2-х экз.) |  |  |
| **3** | Заявление о полномочиях торгового идентификатора |  |  |

Тарифы за техническое подключение: <http://moex.com/s324>

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

В IV квартале 2018 года планируется ввод в действие новых тарифов на услуги технического доступа к ПТК Московской Биржи. Подробнее о вступлении в силу новых правил будет сообщено дополнительно. С будущими тарифами можно ознакомиться на сайте Московской биржи. <https://fs.moex.com/files/9206>

Тестовый доступ

Для возможности ознакомления с работой терминала и торговой системы Биржа предоставляет доступ к тестовому контуру. Общую информацию по тестовому доступу можно получить по ссылке: <http://www.moex.com/s437>

Для того, чтобы получить доступ к тестовому контуру, необходимо:

1. Заполнить анкету по ссылке <http://moex.com/ru/forms/poll/questionnaire.aspx?id=03>

|  |  |
| --- | --- |
| **Версия торговой системы** | Текущая тестовая/разрабатываемая версия |
| **Рынок** | Валютный/Фондовый |
| **Способ подключения** | Интернет |
| **Протокол подключения** | Терминал MICEX Trade |
| **Участник торгов. Идентификатор фирмы** | Кандидат (на основании этого будет присвоен тестовый идентификатор и пароль) |

1. После направления анкеты с вами свяжутся технические специалисты Биржи с информацией и порядком по подключению. Для настройки тестового терминала:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **№** |  | **Валютный рынок** | **Рынок депозитов** |
| **1** | **Ссылка на скачивание тестового терминала** | [Ссылка на терминал 1](ftp://ftp.moex.com/pub/Terminals/ASTS/Currency/Test/) | [Ссылка на терминал 2](ftp://ftp.moex.com/pub/Terminals/ASTS/Equities/Test/) |
| **2** | **Настройки терминала** | После скачивания и установки терминала, запустите его. Далее необходимо выбрать профиль подключения INET\_GATEWAY. | |
| **3** | **Тестовый(ые) идентификатор(ы) для подключения** | *Будет сообщен дополнительно* | |
| **4** | **Пароль** | *Будет сообщен дополнительно* | |
| **5** | **Дополнительные параметры** | Для корректного подключения необходимо открыть порты 18011/tcp, 18012/udp для адреса 91.208.232.101, и добавить программу в исключения брэндмауэра/антивируса/файервола. | |

Затраты по подключению и работе на рынках

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **№** |  | **Валютный рынок** | **Рынок депозитов** |
| **1** | Вступительный взнос | отсутствует | |
| **2** | Взнос в Гарантийный Фонд (**для частичного депонирования**)  Сумма является возвратной | **10 000 000 ₽** | **1 000 000 ₽** |
| **3** | Взнос в Гарантийный Фонд (**для полного депонирования**) | отсутствует | |
| **4** | Минимальная ежемесячная комиссия | **20 000 ₽**  не взимается, если суммарный объем комиссии превысил 20 000 ₽ в месяц | отсутствует |
| **5** | Фиксированная ежемесячная комиссия за предоставление тех. доступа (ИТС) (взимается в случае, если трейдер хотя бы один раз осуществил авторизацию в ТС) | **3 000 ₽** | отсутствует |
| **6** | Оборотная комиссия | [Тарифы — Московская Биржа | Рынки](https://www.moex.com/s132) | [Тарифы по депозитам с Центральным контрагентом — Московская Биржа | Рынки](https://www.moex.com/s2313) |
| **7** | Терминал  (тарифы - <http://moex.com/s324>) | **4 500 ₽** – первый терминал  **4 050 ₽** – каждый последующий | **5 500 ₽** – первый терминал  **4 950 ₽** – каждый последующий |
| **8** | Электронный документооборот (ЭДО): |  | |
|  | - Ежемесячная абонентская плата | **1 500 ₽** | |
|  | - Изготовление ключа | **3 500 ₽** ежегодно  (изготовление сертификата ключа) | |

Операции с денежными средствами

Учет денежных средств участников клиринга осуществляется на Расчетных кодах, регистрируемых в рамках клиринговых счетов НКЦ: раздельно Расчетный код валютного рынка, и Расчетный код фондового рынка (рынка депозитов).

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 внесения индивидуального клирингового обеспечения на Валютном рынке](http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=174)
* [Реквизиты для внесения индивидуального клирингового обеспечения на Фондовом рынке и рынке депозитов](http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=327)

Вывод денежных средств на Валютном рынке

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

* Запроса о возврате (RURRETURN, CURRETURN);
* Постоянного поручения на возврат (RQ\_SETRET).

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Особенности исполнения запросов** | **Запрос о возврате** | | **Постоянное поручение на возврат** | | |
| в размере, указанном в запросе | в размере всей доступной суммы | в размере итогового нетто-требования по сделкам | в размере итогового нетто-требования | в размере всей доступной суммы |
| Количество попыток исполнения | неоднократно | 1 раз | неоднократно | неоднократно | 1 раз |
| Время исполнения | до наступления cut-off time по соответствующей иностранной валюте, а по российским рублям до 19:45 | сразу после получения запроса | до наступления cut-off time по соответствующей иностранной валюте, а по российским рублям до 19:45 | | |
| Результат исполнения | Исполняется в размере, указанном в запросе или не исполняется | Исполняется в размере всей доступной суммы или не исполняется | Исполняется в сумме, равной или меньше нетто-требования по сделкам, без учета комиссии | Исполняется в сумме, равной или меньше итогового нетто-требования по сделкам, с учетом комиссии | Исполняется в размере всей доступной суммы или не исполняется |

У Участника клиринга есть возможность посредством сервиса Web-клиринг подать заявление на ранние расчеты отдельно по каждому Расчетному коду.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Особенности исполнения запросов** | **Разовое поручение**  **ECLRRQ** | **Постоянное поручение**  **ECLRORD** |
| Количество попыток исполнения | 1 раз в течение 15 мин после поступления запроса | |
| Время исполнения | После подачи (11:00– cut-off по соответствующей иностранной валюте, а по рублям до 19:45) | Указывается в поручении (11:00,15:15 или 18:00) |
| Результат исполнения | Закрывается режим TOD, доступен режим Т+, исполнение обязательств, расчет доступной для вывода суммы (плановая позиция) | |

Возврат денежных средств на валютном рынке осуществляется в размере расчетной позиции. Более подробную информацию о возврате средств на валютном рынке можно найти по ссылке <http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=490>.

Вывод денежных средств на Рынке депозитов

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

* Запроса о возврате (RURRETURN, CURRETURN);

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Особенности исполнения запросов** | **Запрос о возврате** | **Постоянное поручение на возврат** |
| в размере, указанном в запросе | в размере всей доступной суммы |
| Количество попыток исполнения | неоднократно | 1 раз |
| Время исполнения | до наступления cut-off time по соответствующей валюте  (для российских рублей до 19:45 и долларов США до 20:00) | |
| Результат исполнения | Исполняется в размере, указанном в запросе или не исполняется | Исполняется в размере всей доступной суммы или не исполняется |

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 программы [WEB-клиринг](http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=483) 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. [Подробнее о регистрации Счета для возврата](http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=397)

Перевод денежных средств

Перевод денежных средств между Расчетными кодами валютного и рынка депозитов, а также между Расчетными кодами в рамках одного рынка осуществляется с помощью запроса **MTRNRQ**. Запрос направляется посредством [сервиса Web-клиринг](http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=483).

С порядком заполнения запроса MTRNRQ можно ознакомиться по ссылке <http://www.nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=341>.

[Презентация: Примеры заполнения запроса MTRNRQ в системе Web-клиринг.](http://www.nkcbank.ru/UserFiles/File/Perevody/MTRNRQ.ppt)

Комиссионное вознаграждение за учет Обеспечения

Комиссионное вознаграждение за учет Обеспечения в иностранной валюте (в евро и швейцарских франках) возникает у Участников клиринга в случае внесения указанного обеспечения на счета НКЦ, взимается в соответствии c п.3 раздела II [Тарифы НКО НКЦ (АО](http://www.nkcbank.ru/UserFiles/File/CK23/12.%20Tarify%20NKO%20NKTs%20(AO).pdf)) (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 ССХ10.Более подробную информацию о комиссии за учет Обеспечения и ставках можно найти по ссылке: <http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=168> п.10.

Штрафы за неисполнение обязательств и перенос позиций

Валютный рынок

В случае:

* если Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга не обеспечено средствами под исполнение;
* при наличии непогашенной до установленного времени Задолженности.

НКЦ без подачи заявок заключает с таким Недобросовестным участником сделку своп с иностранной валютой. Датой исполнения обязательств по первой части сделки своп является день ее заключения, по второй - Расчетный день, следующий за днем ее заключения.

Указанные сделки своп заключаются не более 2 (двух) Расчетных дней подряд. При превышении указанного срока с основного Расчетного кода Участника клиринга взимается штраф, а с участником заключается закрывающая сделка купли-продажи.

Ставки для урегулирования неисполнения обязательств приведены по ссылке: <http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=402>

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 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.

<http://www.nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=510>

Торговые и клиринговые отчеты

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

1. Валютный рынок – <http://fs.moex.com/files/1075/23029>
2. Рынок депозитов:
   1. Торговые отчеты - <http://fs.moex.com/files/943/22493>
   2. Клиринговые отчеты - <http://fs.moex.com/files/951/23031>