

ВНЕСЕНИЕ ЦЕННЫХ БУМАГ В ОБЕСПЕЧЕНИЕ НА РЫНКЕ ДЕПОЗИТОВ С ЦК

С 28 сентября 2020 года для участников рынка депозитов с Центральным контрагентом (ЦК) появилась возможность внесения ценных бумаг в качестве обеспечения. Бумаги можно вносить:

- 1) В качестве Индивидуального клирингового обеспечения (ИКО) на Торгово-клиринговый счет (ТКС), связанный с Расчетным кодом (РК), на котором учитываются депозитные сделки. Ценные бумаги, принимаемые в обеспечение, будут учитываться в Едином лимите.
- 2) В качестве Коллективного клирингового обеспечения (ККО) на Торгово-клиринговый счет для учета взноса в Гарантийный фонд (принимаются ОФЗ).

Новые возможности позволят участникам, подключенным к рынку на условиях **частичного преддепонирования (Категория Б)**, использовать в качестве обеспечения не только денежные средства, но и ценные бумаги.

Примечание: для участников Категории Б, которые будут использовать в качестве обеспечения для заключения депозитных договоров ценные бумаги, ко времени проведения расчетов по депозитным сделкам (к 20:00) по-прежнему на РК необходимо обеспечить всю сумму денежных средств, требующуюся для размещения депозитов и уплаты комиссионного вознаграждения.

Подключение новой функциональности

Участникам для возможности внесения бумаг необходимо:

- 1) Стать депонентом НРД и открыть собственный торговый раздел торгового счета депо – 36 торговый раздел (если участник еще не является депонентом НРД). Собственный торговый раздел необходим для дальнейшего внесения ценных бумаг в Гарантийный фонд. В случае использования ТКС ДУ для целей внесения обеспечения в ценных бумагах в качестве ИКО на ТКС ДУ в НРД необходимо открыть торговый раздел ДУ.

Для ИКО:

- 2) Предоставить в НКЦ [Запрос на открытие Торгового-клирингового счета](#). В нем необходимо указать привязку торгового раздела счета депо к уже существующему или новому РК. Также данный [Запрос возможно предоставить в электронном виде](#). По вопросам заполнения и предоставления Запроса можно обратиться на Биржу к Вашему персональному менеджеру.

Для ККО:

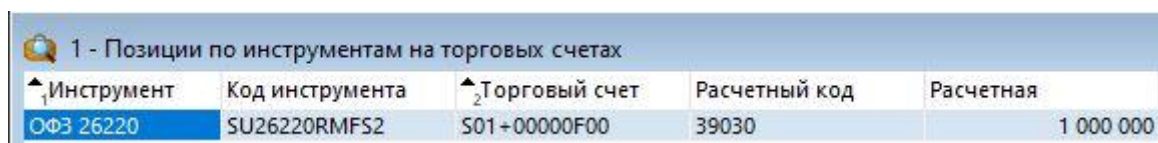
- 3) Заключить с НРД Дополнительное соглашение к Договору счета депо – согласие на передачу доходов по ценным бумагам, учитываемым на субсчете депо Участника клиринга, на клиринговый банковский счет НКЦ, открытый в Банке России и соответствующий РК для учета взноса в Гарантийный фонд. По

данному вопросу следует обращаться к менеджеру в НРД (если такое Дополнительное соглашение еще не подписано, но планируется использовать бумаги в качестве взноса в Гарантийный фонд).

- 4) После выполнения необходимых действий в НРД НКЦ откроет субсчет депо для учета ценных бумаг Участника клиринга на клиринговом счете депо. В состав ТКС для учета взноса в Гарантийный фонд будет входить РК и открытый субсчет депо.
- 5) Перевести через торговый терминал необходимое количество ценных бумаг с собственного ТКС на ТКС Гарантийного фонда (далее подробнее).

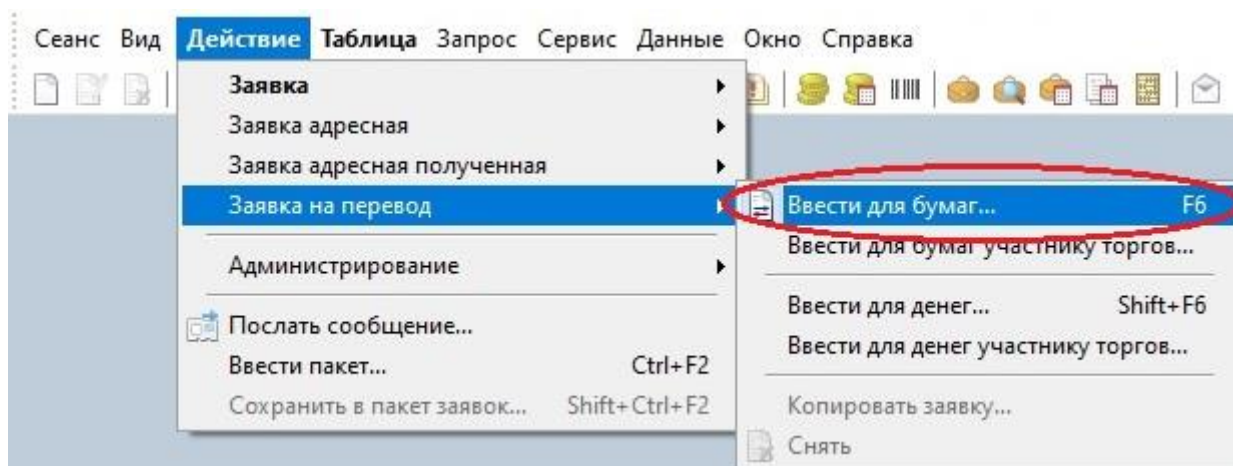
Отображение и использование ценных бумаг в торговом терминале

Информация о списке ценных бумаг и их количестве доступны в таблице торгового терминала MOEX Trade SE «Позиции по инструментам на торговых счетах». В данном примере на собственном ТКС S01+00000F00, связанном с основным депозитным РК 39030 (для каждого участника номера РК индивидуальные) находится 1 000 000 бумаг ОФЗ 26220:



| Инструмент | Код инструмента | Торговый счет | Расчетный код | Расчетная |
|------------|-----------------|---------------|---------------|-----------|
| ОФЗ 26220 | SU26220RMFS2 | S01+00000F00 | 39030 | 1 000 000 |

В торговом терминале предусмотрен перевод ценных бумаг между ТКС, не приводящий к смене владельца ([подробнее](#)). В рассматриваемом примере бумаги будут переведены через торговый терминал в Гарантийный фонд с собственного ТКС. В меню торгового терминала необходимо выбрать пункт «Действие», потом «Заявка на перевод», а далее «Ввести для бумаг».



После этого в торговом терминале появится окно ввода заявки на перевод ценных бумаг. В поле «Инструмент» необходимо выбрать бумагу, которую планируется перевести, в поле «Лотов» - количество бумаг для перевода. Также необходимо выбрать ТКС списания и ТКС зачисления бумаг.

Ввод заявки на перевод ценных бумаг

Перевод Заполнить последней

Режим: Перевод в обеспечение:

Инструмент:

Номинал: 1 000 руб., Код расч.: T0

Лотов: Код расчетов: ?

Размер лота: 1 Дата расчетов: 02.10.2020

Бумаг: 1 000

Перевести остаток не больше указанного

Списать с Торговый счет: Клиринговый расчетный код: 39030 Клиент: Поручение:

Зачислить на Торговый счет: Клиринговый расчетный код: Клиент: Поручение:

| Торговый счет | Описание | Клиринговый расчет |
|---------------------|--------------------|--------------------|
| 000000008628 | ДУ, депозиты | 08628 |
| F01+00000F00 | Счет ККО | 39056 |
| G01+00000F00 | Счет ОС | 39057 |
| REPONSD00000 | Технический счет | MC9043400NSD |
| S01+00000F00 | Основной, депозиты | 39030 |

В данном примере будет переведена 1 000 бумаг ОФЗ 26220 с собственного ТКС на ТКС Гарантийного фонда (ККО). После нажатия кнопки «Ввести заявку» появится окно подтверждения параметров перевода. Проверив параметры, нажмите на кнопку «Да»:

Ввод заявки на перевод ценных бумаг

Перевод Заполнить последней

Подтверждение X

Вы действительно хотите ввести заявку на перевод ценных бумаг со следующими параметрами?

| Параметр | Значение |
|-----------------|-----------------|
| З/С | Списать |
| Режим | Переводы |
| Инструмент | ОФЗ 26220 |
| Лоты | 1 000 |
| Код расчетов | T0 |
| Счет списания | S01+00000F00 |
| Счет зачисления | F01+00000F00 |
| Тип перевода | Обычный перевод |

После совершения перевода в таблице «Позиции по инструментам на торговых счетах» отобразилось 1 000 бумаг, переведённых в ККО на ТКС Гарантийного фонда, а также оставшиеся 999 000 бумаг в ИКО на собственном ТКС, с которого заключаются сделки.

| 2 - Позиции по инструментам на торговых счетах | | | | |
|--|-----------------|---------------|---------------|-----------|
| Инструмент | Код инструмента | Торговый счет | Расчетный код | Расчетная |
| ОФЗ 26220 | SU26220RMFS2 | F01+00000F00 | 39056 | 1 000 |
| ОФЗ 26220 | SU26220RMFS2 | S01+00000F00 | 39030 | 999 000 |

Информация о Едином лимите (величине свободного обеспечения) отображается в таблице «Позиции по деньгам». В рассматриваемом примере на обоих РК величина Единого лимита получена из оценки ценных бумаг, учитываемых на соответствующих им ТКС. При этом денежных средств на РК не было:

| * 13 - Позиции по деньгам | | | | |
|---------------------------|---------------|------|-----------------------------|------------------|
| Код фирмы | Расчетный код | Валк | Описание | Расчетная |
| МС9043400000 | 39030 | SUR | Оборотная ком. по счетам Т+ | 0,00 |
| МС9043400000 | 39030 | SUR | Маржинальное требование | 0,00 |
| МС9043400000 | 39030 | SUR | Единый лимит | 1 035 091 917,76 |
| МС9043400000 | 39030 | SUR | Средства - RUB | 0,00 |
| МС9043400000 | 39056 | SUR | Оборотная ком. по счетам Т+ | 0,00 |
| МС9043400000 | 39056 | SUR | Треб., гар. фонд ТР | 0,00 |
| МС9043400000 | 39056 | SUR | Треб., гар. фонд ВР | 0,00 |
| МС9043400000 | 39056 | SUR | Треб., гар. фонд СПФИ | 0,00 |
| МС9043400000 | 39056 | SUR | Треб., гар. фонд ФР | 0,00 |
| МС9043400000 | 39056 | SUR | Треб., гар. фонд СР | 0,00 |
| МС9043400000 | 39056 | SUR | Маржинальное требование | 0,00 |
| МС9043400000 | 39056 | SUR | Единый лимит | 1 036 128,00 |
| МС9043400000 | 39056 | SUR | Средства - RUB | 0,00 |

Единый лимит основного депозитного РК и РК Гарантийного фонда учитывает оценку бумаг в соответствии с [Методикой определения НКО НКЦ \(АО\) риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов ПАО Московская Биржа](#). Материалы про расчет Единого лимита доступны по ссылке: <https://www.moex.com/s1586>

Таким образом, для участников Категории Б (с частичным преддепонированием) Гарантийный фонд может быть полностью обеспечен ценными бумагами (эквивалентом более 1 000 000 рублей), а основной депозитный РК обеспечен Единым лимитом, полученным из учитываемых на ТКС бумаг, для возможности подачи депозитных заявок и заключения депозитных предложений. При этом к 20:00 необходимо будет обеспечить в полном объеме денежные средства для расчетов по заключаемым депозитам, а также уплате комиссионного вознаграждения.

Информация о ТКС и обеспечении в клиринговых отчетах

Информация о ТКС Гарантийного фонда, входящих в его состав Расчетном коде, субсчете депо, а также внесенном обеспечении в соответствующем активе отображается в клиринговом отчете EQM92 (Отчет о гарантийных фондах).

Информация о ТКС, входящих в их состав Расчетном коде и торговом разделе, отображается в клиринговом отчете EQM20 (Отчет о торгово-клиринговых счетах). Информация об обеспечении на таких ТКС в ценных бумагах отражается в Отчете об обеспечении (EQM99), в денежных средствах – в Отчете о движении денежных средств (ССХ99). Также участникам предоставляется Отчет об оценке обеспечения (EQM84),

включающий информацию об оценочной стоимости обеспечения в денежных средствах и ценных бумагах, учитываемых на соответствующих ТКС.

Подробное описание клиринговых отчетов по ссылке: <https://fs.moex.com/files/951>