

Функционал в шлюзовом брокерском интерфейсе для проекта «Биржевое РЕПО Банка России с корзиной ценных бумаг с сервисами НРД» (Система управления обеспечением (СУО) НРД)

Для полноценной поддержки всех возможностей взаимодействия с биржей, клиентские внешние программно-технические средства (ВПТС) должны реализовывать работу по двум протоколам:

1. Стандартный шлюзовой брокерский интерфейс к торгово-клиринговой системе ASTS фондового рынка Московской Биржи. Версии интерфейса – 22 (**IFCBroker_22**) и более новые. В ТКС биржи осуществляется постановка заявок, мэтчинг и заключение сделок.
2. Вэб-сервис СУО НРД используется для всех остальных операций: маркировка ценных бумаг, поручение на замену обеспечения, информация о результатах клиринга включая частичное исполнение, перенос даты второй части, результат подбора ценных бумаг в обеспечение, исполнение компенсационных взносов.

Данный документ описывает функционал шлюзового интерфейса, используемый для СУО.

Типы инструментов в торгово-клиринговой системе (перечислимый тип **TSecType**):

- G – корзина бумаг;
- H – дополнительный идентификатор списка.

В заявке РЕПО с корзиной указывается инструмент с типом «корзина» (поле транзакции **SECCODE**). В заявке может указываться дополнительный идентификатор (приоритет или подмножество корзины, используемые для подбора обеспечения) в виде ценной бумаги, либо инструмента, указывающего на набор ценных бумаг (поле транзакции **LSECCODE**). Указание в заявке дополнительного идентификатора не обязательно, в случае отсутствия признака подбор обеспечения осуществляется согласно алгоритмам НРД. При наличии дополнительного идентификатора НРД учитывает данный признак как приоритет подбора обеспечения или ограничивающее подмножество (см. [Порядок взаимодействия клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением](#)) и подбирает ценные бумаги, входящие в список бумаг указанного инструмента.

При вводе заявки с корзиной в торговой системе регистрируется одна заявка.

Сделка РЕПО с корзиной заключается обычным образом. Тип сделки (перечислимый тип **TTradeType**) по первой части – «М», по второй части – «т».

Для подачи в торговую систему адресной заявки РЕПО с корзиной ценных бумаг используется транзакция **BKT_REPO_NEGDEAL**

Формат транзакции:

Входное поле	Описание	Тип	Размер	Примечание
ACCOUNT	Торговый счет	CHAR	12	Номер торгового счета
BUYSELL	К/П	TBuySell		Направленность заявки по первой части РЕПО - "купля/продажа" (в рамках данного проекта - S)
SECBOARD	Режим	CHAR	4	Идентификатор режима торгов для финансового инструмента
SECCODE	Инструмент	CHAR	12	Идентификатор финансового инструмента (в рамках данного проекта – инструмент типа корзина)
CPFIRMID	Партнер	CHAR	12	Идентификатор фирмы, которой адресована заявка (в рамках

				данного проекта – фирма ЦБ)
BROKERREF	Примечание	CHAR	20	Дополнительная справочная информация (заполняется трейдером), как правило - номер поручения
MATCHREF	Ссылка	CHAR	10	Текст-связка для однозначного соответствия двух встречных адресных заявок
SETTLECODE	Код расчетов	CHAR	12	Код расчетов по сделке
EXTREF	Код внешнего пользователя	CHAR	12	Поле-примечание, используется для обратной связи с внешними системами. Например, идентификатор пользователя внешней системы, поставившего заявку.
REPORATE	Ставка РЕПО, %	PRICE	9	Ставка РЕПО, в процентах
REPOORDERVALUE	Сумма РЕПО	NUMERIC	16.2	Сумма РЕПО, в руб.
REPOTERM	Срок РЕПО	INTEGER	4	Срок РЕПО - промежуток времени, выраженный в календарных днях, между датами исполнения первой и второй частей сделки РЕПО. Срок РЕПО исчисляется со дня, следующего за днем исполнения первой части сделки РЕПО, до дня исполнения второй части сделки РЕПО включительно.
ACCEPTEDORDERNO	На заявку №	INTEGER	12	Номер принимаемой адресной (NEGDEAL) заявки контрагента (если заявка посылается в ответ на адресную заявку), в противном случае заполняется пробелами
CLIENTCODE	Код клиента	CHAR	12	Код клиента, присвоенный брокером
LSECCODE	Приоритетное обеспечение или подмножество корзины	CHAR	12	Дополнительный идентификатор списка или идентификатор бумаги

Механизм работы с заявками и сделками СУО НРД реализован полностью аналогично заявкам и сделкам РЕПО с обычными ценными бумагами.

При подаче заявок и заключении сделок РЕПО с ЦБ с корзиной с клирингом в НРД используется специализированный технологический торгово-клиринговый счёт REPONSD0000. Расчеты по данным сделкам проходят по торговым счетам депо и торговым банковским счетам в НРД. Также в таблицах «Адресные заявки» и «Сделки» не несут смысловой нагрузки поля, не относящиеся к данному режиму торгов, такие как «Объём», «Лоты», «Начальный дисконт» и т.п.

В торгово-клиринговой системе рассчитывается только торговая составляющая комиссионного вознаграждения и комиссия за ИТС; клиринговая комиссия не рассчитывается. Комиссия отображается только в информационных целях, списывается во время расчётов и не уменьшает плановую позицию по деньгам.