

Изменения в торгово-клиринговой системе ASTS валютного и фондового рынков по проекту Единый пул обеспечения

Презентация проекта размещена на сайте НКЦ:

<http://www.nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=223>

Изменения в ПО и биржевых протоколах

В системе ASTS нововведения реализованы в:

- новых шлюзовых интерфейсах IFC_Broker28 (валютный рынок) и IFCBroker_28 (фондовый рынок);
- новой версии терминалов - MICEX Trade Currency 3.12 и MICEX Trade SE 3.12;
- клиринговых XML-отчётах.

Протоколы FIX и FAST UDP multicast marketdata не меняются.

Новое в брокерских шлюзовых интерфейсах:

- Поле BANKACC.UNIFIEDPOOL (BP и ФР) - признак единого пула для расчётного кода.
- Поле TRADES.STATUS (BP и ФР) - статус сделки.
- Поля SECTRANSFERS.TRANTYPE и TRADES.TRANTYPE (ФР) - тип перевода.
- Таблица TRANTYPES (ФР) - типы переводов.
- Размерность всех полей, содержащих объём (QUANTITY, HIDDEN, BALANCE и т.п.) меняется с 10 на 16 байт.

Новое в терминалах MICEX Trade:

- Функционал для подключения к НКЦ для управления обеспечением и активами.
- Форма для передачи профилей активов (через НКЦ).
- Форма для перевода обеспечения (через НКЦ).
- Таблицы с операциями передачи профилей активов и перевода обеспечения.
- Поля и таблицы, аналогичные добавленным в брокерский шлюзовой интерфейс.

Вносятся изменения в структуру клиринговых отчётов всех рынков. Подробная информация будет доступна позднее.

Переход на технологию переводов

В системах ФР и BP добавляется новый режим торгов TRAD – Переводы НКЦ (на ФР ранее этот режим уже был доступен участникам рынка депозитов с ЦК).

Изменяется технология учёта активов и обязательств в системах фондового и валютного рынков. Следующие операции, которые влияют на текущую позицию по деньгам на

расчётном коде, будут отображаться в торгово-клиринговой системе в виде технологических сделок перевода.

В системе фондового рынка:

- Ввод, вывод денежных средств и ценных бумаг по «динамике».
- Зачисление/вывод денежных средств на расчётный код единого пула.
- Списание комиссии.
- Списание вариационной маржи, рассчитанной на CP или BP, с расчётных кодов ФР в рамках реализации проекта «единый пул обеспечения на всех рынках».
- Передача профиля актива в другую торгово-клиринговую систему в рамках реализации проекта «единый пул обеспечения на всех рынках».
- Удержание комиссионного вознаграждения за учёт клирингового обеспечения в иностранной валюте или драгоценных металлах.

В системе валютного рынка:

- Списание и зачисление вариационной маржи.
- Списание комиссии.
- Комиссионное вознаграждение за учёт обеспечения.
- Зачисление денежных средств на расчётный код.
- Списание денежных средств с расчётного кода.

В зависимости от типа операции, в сгенерированной технической сделке будут указаны идентификаторы фирмы-участника клиринга и НКЦ или двух участников клиринга. В поле "Информация о переводе" (TRANINFO) в таблицах TRADES и SECTRANSFERS отображается код операции и дополнительная информация. Идентификатор типа перевода указан в новом поле TRANTYPE - возможные значения перечислены в новой таблице TRANTYPES.

Для подобных транзакций, связанных с изменением позиции по денежным средствам, в ASTS ФР автоматически заводятся специальные технологические торгово-клиринговые счета.

Помимо этого, технические сделки по передаче дохода по сделкам РЕПО с ЦК, которые ранее были на режимах RFND, RFNU, RFNE, также переводятся на борд TRAD.

Расчётные коды для единого пула

Информация об использовании расчётного кода для технологии единого пула доступна в шлюзовом интерфейсе в новом поле BANKACC.UNIFIEDPOOL.

Если участник клиринга принимает решение использовать технологию единого пула, то в рамках присвоения расчётному коду признака единого пула возможно присоединение к нему расчётного кода другого рынка. В этом случае для не исполненных сделок, заключённых с указанием присоединяемого расчётного кода, будет произведена его замена на расчётный код единого пула. В системе валютного рынка замена производится путём генерирования двух технических сделок, закрывающей сделки и открывающей сделки, на борде SHFT.

Передача профилей активов на другие рынки

Участники клиринга направляют запросы на передачу профилей активов на срочный и валютный рынки одним из следующих способов:

- из терминала MICEX Trade SE, MICEX Trade Currency, Spectra
- через систему ЭДО НКЦ (<http://www.nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=223>)
- на портале Web-клиринга НКЦ (<http://www.nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=466>)

Передача профилей реализована через механизм распределённых транзакций и проходит в следующей последовательности:

1. В системе ФР генерируется техническая сделка на борде TRAD.
2. Если из системы СР или ВР получено подтверждение на возможность исполнения запрошенного перевода, техническая сделка получает статус исполненной.
3. Если из системы СР или ВР пришёл отказ на перевод, то техническая сделка получает статус "отменена системой".

Для отображения статусов технических сделок в шлюзовой интерфейс добавлено новое поле TRADES . STATUS. Данное поле может использоваться также и для получения информации о статусе обычных сделок участника торгов.

Добавляются новые коды позиций на фондовом рынке (возможные значения в POSITIONS . TAG):

BYCU	Переданный профиль на ВР – BYN
BYFO	Переданный профиль на СР – BYN
CYCU	Переданный профиль на ВР – CNY
CYFO	Переданный профиль на СР – CNY
EUCU	Переданный профиль на ВР – EUR
EUFO	Переданный профиль на СР – EUR
GBCU	Переданный профиль на ВР – GBP
GBFO	Переданный профиль на СР – GBP
GLCU	Переданный профиль на ВР – GLD
GLFO	Переданный профиль на СР – GLD
HKCU	Переданный профиль на ВР – HKD
HKFO	Переданный профиль на СР – HKD
KZCU	Переданный профиль на ВР – KZT
KZFO	Переданный профиль на СР – KZT
RUCU	Переданный профиль на ВР – RUB
RUFO	Переданный профиль на СР – RUB
SLCU	Переданный профиль на ВР – SLV
SLFO	Переданный профиль на СР – SLV
UACU	Переданный профиль на ВР – UAH
UAFO	Переданный профиль на СР – UAH
USCU	Переданный профиль на ВР – USD
USFO	Переданный профиль на СР – USD
UTSA	Средства – UAH
UTSB	Средства – BYN
UTSH	Средства – HKD
UTSK	Средства – KZT

В технических сделках перевода используются новые коды расчётов.

На фондовом рынке:

TRAN_B	Зачисление/списание средств
AO_B	Перевод/возврат профиля актива, зачисление/списание средств в две фазы
NO	Создание обязательств/требований T+

Переводы изменяют значение входящей позиции.

На валютном рынке:

TRAN	Зачисление/списание средств
AO	Перевод/возврат профиля актива, зачисление/списание средств в две фазы
NO	Создание обязательств/требований T+

Переводы изменяют значение текущей позиции.