

Технические изменения в порядке проведения депозитных операций Федерального казначейства в связи с появлением депозитов с плавающими ставками

В связи с изменениями проведения отборов заявок по депозитным операциям Федерального казначейства, **с 4 декабря 2017 года** вносятся корректировки в технологический процесс отборов заявок и структуры биржевых отчетов:

- 1) Для депозитов по плавающим ставкам в Торговой системе Биржи, терминале и отчетах появляется 6 новых инструментов. Существующие операции по фиксированным ставкам будут по-прежнему проводиться на уже существующих инструментах. Обновленная кодировка инструментов:

	Срочный депозит	Особый депозит
RUB	TR_DEP_RUB_T TR_FRD_RUB_T	TR_DEP_RUB_S TR_FRD_RUB_S
USD	TR_DEP_USD_T TR_FRD_USD_T	TR_DEP_USD_S TR_FRD_USD_S
EUR	TR_DEP_EUR_T TR_FRD_EUR_T	TR_DEP_EUR_S TR_FRD_EUR_S
*где DEP – признак фиксированной ставки, FRD – плавающей ставки		

- 2) Операции как по плавающим, так и фиксированным ставкам будут проходить в существующих Режимах торгов (бордах): «Депозиты ФК, открытая форма» (DPFO) и «Депозиты ФК, закрытая форма» (DPFK).
- 3) Информация о бэнчмарке (базовой ставке) будет определяться Федеральным казначейством и содержаться в уведомлении об отборе заявок, а также в торговом терминале при выборе инструмента в окне ввода заявки и в таблице «Финансовые инструменты».
- 4) При подаче заявки по депозиту с плавающей ставкой банки-участники будут указывать **спред (разницу)** между ставкой депозита и бэнчмарком, а для депозитов по фиксированной ставке – само значение ставки депозита.
- 5) Расчет и начисление процентов по депозитам с плавающей ставкой будет осуществляться в двустороннем порядке между Федеральным казначейством и кредитными организациями вне Биржи.
- 6) Изменения в биржевых отчетах для кредитных организаций:

Выписка из реестра заявок

Вид: электронный документ

Формат: XML

Наименование: <IDIDIDI>_FTP01_F00_<ДДММГГ>.xml, где <IDIDIDI> - сокращенное значение Идентификатора участника, <ДДММГГ> - дата формирования файла

Структура:

Название тегов	Название атрибутов	Описание	Обязательно е	Тип	Размер	Десятичные знаки
----------------	--------------------	----------	------------------	-----	--------	---------------------

MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.	Да			
DOC_REQUISITIONS		Блок информации о файле	Да			
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Да	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Да	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
/DOC_REQUISITIONS		Завершение блока информации о документе				
FTP01		Блок данных о заявках	Да			
	VER	Ограничения на версию документа FTP01	Да	Character	3-12	
FTP01_AUCTIONS		Данные об отборах заявок	Да			
	TRADEDATE	Дата проведения отбора заявок	Да	Date		
	EXCHANGE	Наименование Биржи (ПАО Московская Биржа)	Да	Character	1-30	
	FIRMID	Идентификатор Участника	Да	Character	12	
	FIRMNAME	Наименование Участника	Да	Character	1-120	
	ORGANIZERID	Идентификатор Федерального казначейства	Да	Character	12	
	ORGANIZERNAME	Наименование Федерального казначейства	Да	Character	1-120	
FTP01_AUCTION		Данные об отборе заявок	Да			
	BOARDID	Режим проведения операций	Да	Character	4	
	BOARDNAME	Наименование режима проведения операций	Да	Character	1-30	
	SECURITYID	Код инструмента	Да	Character	9-12	
	CURRENCYID	Валюта депозита	Да	Character	3	
	<u>RATE_TYPE</u>	<u>Тип ставки депозита: фиксированная «FIXED» или плавающая</u>	<u>Да</u>	<u>String</u>	<u>10-17</u>	

		«FLOATING *****», где ***** - обозначение кода бэнчмарка.				
	AUCTION_ID	Уникальный идентификатор отбора заявок	Да	Character	1-12	
	SETTLEDATE1	Дата размещения средств	Да	Date		
	SETTLEDATE2	Дата возврата средств	Да	Date		
	TERM	Срок размещения (календарных дней)	Да	Number	11	
FTP01_REC		Данные о заявке	Нет			
	REC_NUMBER	Номер по порядку	Да	Number	11	
	ORDER_NUMBER	Номер Заявки в Системе торгов Биржи	Да	Number	11	
	STATUS	Состояние заявки: С – Заявка снята Биржей по завершении периода сбора Заявок, М – Заявка подлежит удовлетворению по итогам отбора заявок, W – Заявка снята Участником	Да	Character	1	
	RATE	Процентная ставка <u>или</u> <u>разница между ставкой</u> <u>депозита и базовой</u> <u>ставкой</u> , % годовых	Да	Number	20	2
	TRADERID	Торговый идентификатор	Да	Character	12	
	BUYSELL	Вид Заявки: "В"- привлечение денежных средств	Да	Character	1	
	AMOUNT	Сумма размещения (в валюте депозита)	Да	Number	20	2
	ENTRYTIME	Время введения заявки в Систему торгов Биржи	Да	Time		
	AMENDTIME	Время снятия заявки из Системы торгов Биржи	Нет	Time		
/		Завершение записи о заявке				
/FTP01_AUC TION		Завершение записи об отборе заявок				
/FTP01_AUCTI ONS		Завершение записи об отборах заявок				
/FTP01		Завершение записи о заявках				
MICEX_DOC		Завершение документа				

Выписка из реестра заявок, подлежащих удовлетворению по итогам отбора заявок

Вид: электронный документ

Формат: XML

Наименование: <IDIDIDI>_FTP06_F<NN>_<ДДММГГ>.xml, где <IDIDIDI> - сокращенное значение Идентификатора участника, <NN> - номер файла в течении дня (01, 02 и т.д.), <ДДММГГ> - дата формирования файла

Структура:

Название тегов	Название атрибутов	Описание	Обязательное	Тип	Размер	Десятичные знаки
MICEX_DOC		Корневой элемент (root element) XML документа.	Да			
DOC_REQUISITIONS		Блок информации о файле	Да			
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Да	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Да	Time		
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_TYPE_ID	Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор отправителя	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование отправителя	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор получателя	Нет	Character	1-12	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
DOC_REQUISITIONS		Завершение блока информации о документе				
FTP06		Блок данных о заявках, подлежащих удовлетворению	Да			
	VER	Ограничения на версию документа FTP06	Да	Character	3-12	
FTP06_AUCTION		Данные об отборе заявок	Да			
	TRADEDATE	Дата проведения отбора заявок	Да	Date		
	EXCHANGE	Наименование Биржи (ПАО Московская Биржа)	Да	Character	1-30	
	FIRMID	Идентификатор Участника	Да	Character	12	
	FIRMNAME	Наименование Участника	Да	Character	1-120	
	ORGANIZERID	Идентификатор Федерального казначейства	Да	Character	12	
	ORGANIZERNAME	Наименование Федерального казначейства	Да	Character	1-120	
	BOARDID	Режим проведения операций	Да	Character	4	
	BOARDNAME	Наименование режима проведения операций	Да	Character	1-30	
	SECURITYID	Код инструмента	Да	Character	9-12	
	CURRENCYID	Валюта депозита	Да	Character	3	

	<u>RATE_TYPE</u>	Тип ставки депозита: <u>фиксированная «FIXED»</u> <u>или плавающая</u> <u>«FLOATING *****»</u> , где ***** - <u>обозначение кода</u> <u>Бэнчмарка.</u>	<u>Да</u>	<u>String</u>	<u>10-17</u>	
	AUCTION_ID	Уникальный идентификатор отбора заявок	Да	Character	1-12	
	SETTLEDATE1	Дата размещения средств	Да	Date		
	SETTLEDATE2	Дата возврата средств	Да	Date		
	TERM	Срок размещения (календарных дней)	Да	Number	11	
FTP06_REC		Данные о Заявке, подлежащей удовлетворению	Нет			
	REC_NUMBER	Номер по порядку	Да	Number	11	
	TRADE_NUMBER	Номер записи о заявке в Системе торгов Биржи, подлежащей удовлетворению	Да	Number	11	
	ORDER_NUMBER	Номер заявки в Системе торгов Биржи	Да	Number	11	
	RATE	Процентная ставка <u>или</u> <u>разница между ставкой</u> <u>депозита и базовой</u> <u>ставкой</u> , % годовых	Да	Number	20	2
	TRADERID	Торговый идентификатор	Да	Character	12	
	BUYSELL	Вид Заявки: "В"- привлечение денежных средств	Да	Character	1	
	PART1AMOUNT	Сумма размещения (в валюте депозита)	Да	Number	20	2
	COMMISSION	Сумма комиссионного вознаграждения Биржи (в рублях)	Да	Number	20	2
	PERCAMOUNT	Сумма процентов (в валюте депозита). <u>Для</u> <u>депозитов по плавающей</u> <u>ставке не заполняется</u>	<u>ДаНет</u>	Number	20	2
	PART2AMOUNT	Сумма возврата (в валюте депозита). <u>Для депозитов</u> <u>по плавающей ставке не</u> <u>заполняется</u>	<u>ДаНет</u>	Number	20	2
/		Завершение записи о заявке, подлежащей удовлетворению				
/FTP06_AUC TION		Завершение записи об отборе заявок				
/FTP06		Завершение записи о заявках, подлежащих удовлетворению				
/MICEX_DOC		Завершение документа				