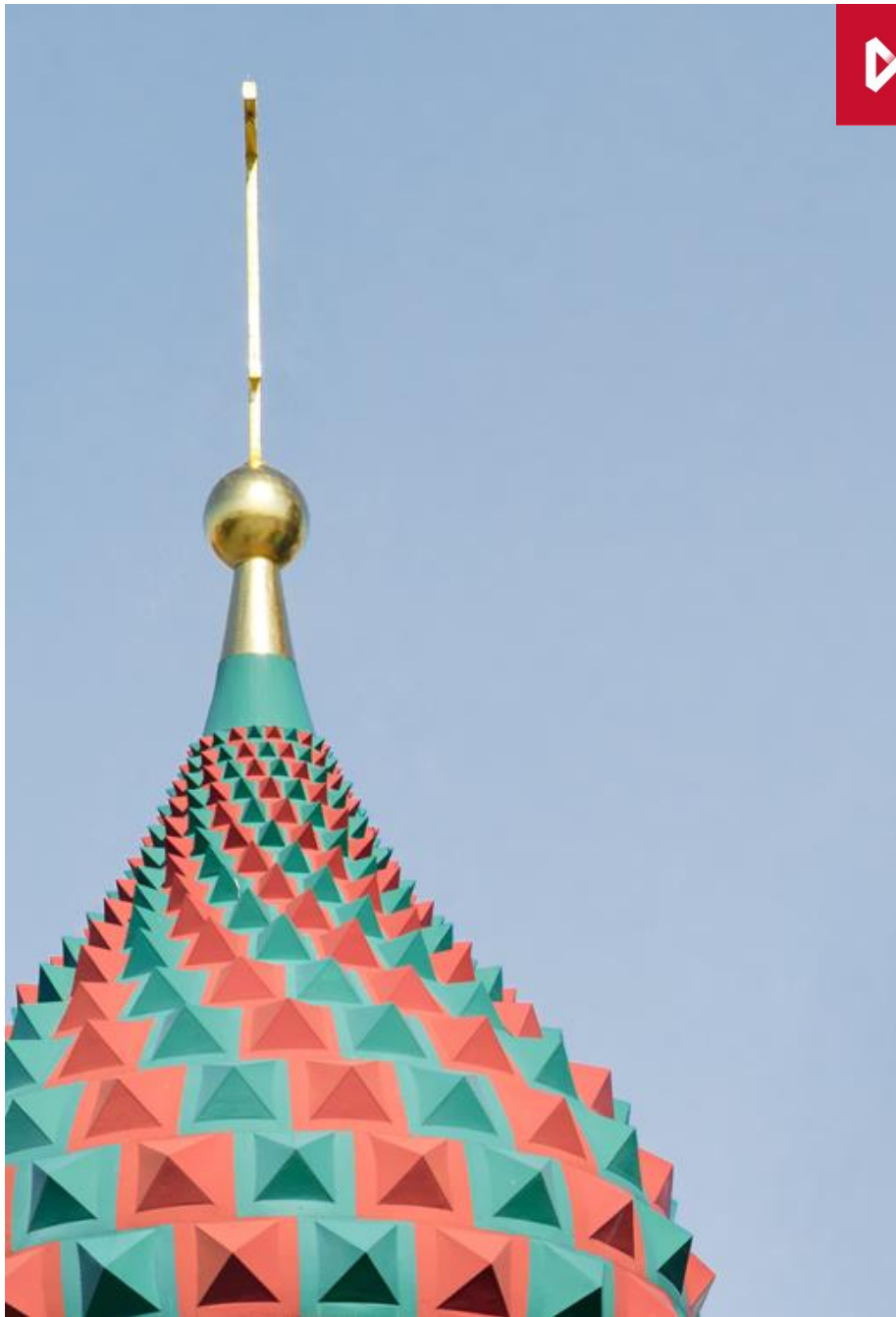




МОСКОВСКАЯ
БИРЖА



июнь 2017

USE cases Единый пул обеспечения

Кейс 1: Создание РК Единого пула (1/2)

1. Создать новый или выбрать действующий Расчетный код на фондовом рынке(ФР).
2. Присвоить Расчетному коду из п.1 признак «Единый пул» (подачей запроса CODETM на присвоение РК ФР признака Единого пула)*.
 - В запросе необходимо указать Расчетный код, открытый на фондовом рынке в п.1.
3. Выбрать действующий Расчетный код на валютном рынке(ВР).
4. Выбрать действующий Расчетный код на срочном рынке(СР).
5. РК срочного и валютного рынков из п.3 и 4 присоединить к РК Единого пула из п.2 (подачей двух «Запросов CODEEA на изменение области действия РК ЕП»)*. В запросе необходимо указать:
 - РК фондового рынка
 - Код присоединяемого рынка (CU – валютный, FU - срочный)
 - РК, открытый на присоединяемом рынке
6. Получить результат запроса.
7. Ожидаемый результат: успешное создание РК Единого пула на трех рынках.



Кейс 1: Создание РК Единого пула (2/2)

1. На время тестирования запросы CODETM и CODEEA подаются в свободной форме на почту help@moex.com.
2. В web-клиринге запросы будут иметь следующий интерфейс:

The screenshot shows the CODETM request form. On the left is a blue sidebar with a menu: 'Авторизация', 'Документы на подпись', 'Операции с ДС' (expanded), 'Возврат средств', 'Счет для возврата (платежные реквизиты)', 'Постоянный возврат обеспечения', 'Запрос на перевод обеспечения', 'Запрос на депонирование', 'Постоянное поручение на депонирование', 'Свернуть | Развернуть', and '© компания ИНИСТ 1998-2017'. The main form area has a title 'CODETM Запрос на присвоение Расчетному коду признака «Единый пул»' with a dropdown arrow. Below the title are input fields for 'No' (7) and 'от' (01/06/2017). A 'Расчетный код' field contains '03631'. At the bottom are buttons 'Исполнить' and 'Сохранить с кодом' followed by an empty input field.

The screenshot shows the CODEEA request form. It has the same sidebar as the CODETM form. The main form area has a title 'CODEEA Запрос на изменение области действия Расчетного кода Единого пула' with a dropdown arrow. Below the title are input fields for 'No' (9) and 'от' (02/06/2017). A 'Расчетный код единого пула' field contains '03631'. A 'Рынок' dropdown menu is set to 'CU - Валютный'. A 'Присоединяемый Расчетный код' field contains '04856'. At the bottom are buttons 'Исполнить' and 'Сохранить с кодом' followed by an empty input field.

Кейс 2: Перевод профилей рублей с фондового на срочный рынок с помощью торгового терминала Спектра/АСТС (1/2)

1. Выбрать ТКС Единого пула на фондовом рынке и два 7кр на срочном рынке из РК Единого пула.
2. На ТКС Единого пула на фондовом рынке обеспечить наличие единого лимита в размере **100 рублей** или более.
3. Осуществить запрос на перевод **100 профилей рублей** с ФР на СР. В запросе необходимо указать:
 - ТКС Единого пула.
 - Код актива (в первой фазе только RUB).
 - Рынки.
 - Для срочного рынка указать клиринговый регистр (обязательно). В данном примере указываем два клиринговых регистра.
 - Напротив рынка и регистров указываем изменение профиля актива. В данном примере напротив первого регистра СР **40** и напротив второго регистра СР **60**.
4. Получить результат запроса.
5. **Ожидаемый результат: успешный перевод 100 профилей рублей с ФР на два регистра СР в пропорции 40/60.**

Кейс 2: Перевод профилей рублей с фондового на срочный рынок с помощью торгового терминала Спектра/АСТС (2/2)

Запрос на перевод профиля рублей в терминале Spectra:

Идентификационные параметры поручения

Дата: 22.03.2017 Время: 16:47:42 Номер: 164742479

Ид. участника клиринга: MC0174700000

ТКС Единого Пула: N35+00000N34

Расчетный Код: 00886

Сектор отправителя: EQ Фондовый Сектор получателя: FU Срочный

RUB Российские руб 60 K700000

Код актива	Кол-во	Кл. регистр
RUB	40,00	K700001
RUB	60,00	K700002

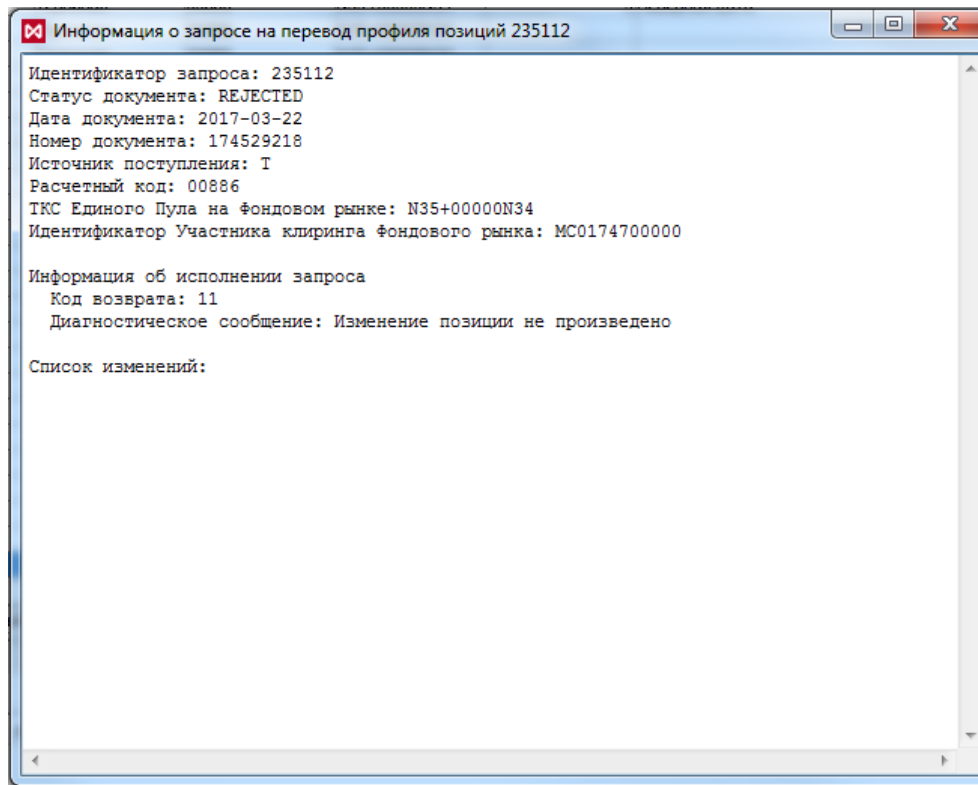
Перевести Отмена

Кейс 3: Перевод профилей рублей с фондового на валютный рынок с помощью торгового терминала Спектра/АСТС (1/2)

1. Выбрать ТКС Единого пула на фондовом рынке и соответствующий ему РК на валютном рынке.
2. На ТКС Единого пула на фондовом рынке обеспечить наличие единого лимита в размере **99 рублей** или менее.
3. Осуществить запрос на перевод **100 профилей рублей** с ФР на ВР. В запросе необходимо указать:
 - ТКС Единого пула.
 - Код актива.
 - Рынки.
 - Для валютного рынка указать РК 2 или РК 3 уровня (не обязательно).
 - Напротив рынка указываем изменение профиля актива. В данном примере для ФР записываем - **100**, для ВР **+100**.
4. Получить результат запроса.
5. **Ожидаемый результат: отказ в переводе по причине недостаточности средств на фондовом рынке ТКС Единого пула.**

Кейс 3: Перевод профилей рублей с фондового на валютный рынок с помощью торгового терминала Спектра/АСТС (2/2)

Информация об отказанном запросе



Кейс 4: Перевод средств с обычного РК на РК Единого пула помощью торгового терминала Спектра/АСТС (1/2)

1. В качестве Расчетного кода списания выбрать обычный Расчетный код, а для зачисления Расчетный код Единого пула.
2. Осуществить запрос на перевод **40 евро** с Расчетного кода валютного рынка на Расчетный код Единого пула на регистры срочного рынка. В запросе необходимо указать:
 - Расчетный код списания и Расчетный код зачисления
 - Рынок списания и зачисления, в примере валютный и срочный рынки
 - РК 2-го уровня на валютном рынке (опционально)
 - Клиринговые регистры на срочном рынке (обязательно)
 - Сумма списания и зачисления
 - Код актива - EUR
3. Получить результат запроса.
4. **Ожидаемый результат: успешный перевод 40 Евро с обычного РК на срочный рынок РК Единого пула.**

Кейс 5: Расчеты на нетто-основе

1. На РК Единого пула иметь только долларовое обеспечение.
2. Перевести профиль долларов на валютный рынок.
3. Продать в короткую доллары на валютном рынке в ТОМ.
4. Подождать 1 день, когда произойдут расчеты по сделкам и получить рубли.
5. Профиль полученных рублей перевести на фондовый рынок.
6. Купить акции Т+ и исполнить обязательства по рублям за счет рублей полученных от продажи на ТОМ.
7. **Ожидаемый результат: обязательства по рублям за покупку акций исполняются за счет требований по рублям от продажи долларов.**

Кейс 6: Расчеты на нетто-основе

1. Обеспечить наличие достаточного единого (свободного) лимита на ФР, СР и ВР. При необходимости перевести профили рублей между рынками (см. Кейс 3). Обеспечить наличие любой ликвидной акции в обеспечении на ФР.
2. Запомнить кол-во рублей в обеспечении на РК Единого пула (данные отображаются на ФР)
3. Продать акцию на ФР, купить на USD на ВР и открыть позицию на СР.
4. Подождать 2 дня, когда произойдут расчеты по сделкам, а на СР будет несколько раз перечислена вариационная маржа.
5. **Ожидаемый результат:**
 - Кол-во рублей на ФР увеличилось на (стоимость проданных акций – стоимость купленных USD + сумма полученной ВМ на СР)
 - Кол-во долларов на ФР увеличилось на количество купленных долларов
 - Кол-во профилей рублей, переданных на СР увеличилось на сумму полученной ВМ
 - Кол-во профилей рублей, переданных на ВР уменьшилось на рублевую стоимость купленных долларов
 - Кол-во профилей долларов, переданных на ВР изменилось на количество купленных долларов

Кейс 7: Балансировка риска* в РК Единого пула

1. Выбрать РК Единого пула с областью действия на валютном и срочном рынках.
2. Подать заявление о соответствии БФ на срочном рынке и РК Единого пула.
3. Открыть длинную позицию на валютном рынке в размере \$1000 и короткую позицию по одному фьючерсу Si (в одном фьючерсе \$1000) на ближайший срок.
4. После привязки подать поручение через ТКС Spectra на проброс риска с помощью рисковых инструментов USDRUB_RSK 1 лот (1 лот = \$1000).
5. В поле «Контрагент» указать код БФ. Направление – покупка.
6. **Ожидаемый результат: Автоматически генерируются две противоположно направленные позиции по инструменту риска на срочном и валютном рынках.**
 - На ВР в результате полного нетто свободный лимит увеличится на ставку риска по доллару.
 - На СР в результате принципа «большой ноги» свободный лимит не изменится.

