

Программа тестирования Биржевого РЕПО с ЦБ с сервисами НРД

Оглавление

1.	Начальные условия.....	3
1.1	Система НРД Аламеда	3
1.2	Торгово-клиринговая система ASTS	3
2.	Тестирование операций.....	4
2.1.	Тестирование связи и взаимодействия с сервисами НРД.....	4
2.1.1.	Нормальное Отображение дисконтов и прочих параметров СУО	4
2.1.2.	Попытка с неверным сертификатом	5
2.1.3.	Отсутствие связи с НРД.....	5
2.2	Тестирование анкеты маркирования.....	5
2.2.1	Подача анкеты маркирования.....	5
2.2.2	Ввод строк анкеты.....	6
2.2.3	Состав анкеты.....	7
2.2.4	Просмотр поручений	8
2.2.5	Отображение текущей анкеты	8
3.	Тестирование сделок.....	9
3.1	Регламент тестирования*	9
3.2	Перечень тестируемых функций (используемые методы)	11
3.3	Тестирование просмотра остатков бумаг и денежных средств на счетах и разделах	11
3.4	Тестирование просмотра бумаг в разбивке по корзинам	12

3.5	Ввод заявки	13
3.6	Тестирование подачи от участников поручений на замену	16
3.7	Тестирование просмотра состояния сделок	17

1. Начальные условия

Через биржевой терминал осуществляется заключение сделок и управление обеспечением по сделкам.

НРД осуществляет прием реестра сделок, его загрузку в СУО и дальнейшую обработку сделок, согласно Правилам клиринга и Порядку взаимодействия клиентов и НКО ЗАО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением.

1.1 Система НРД Аламеда

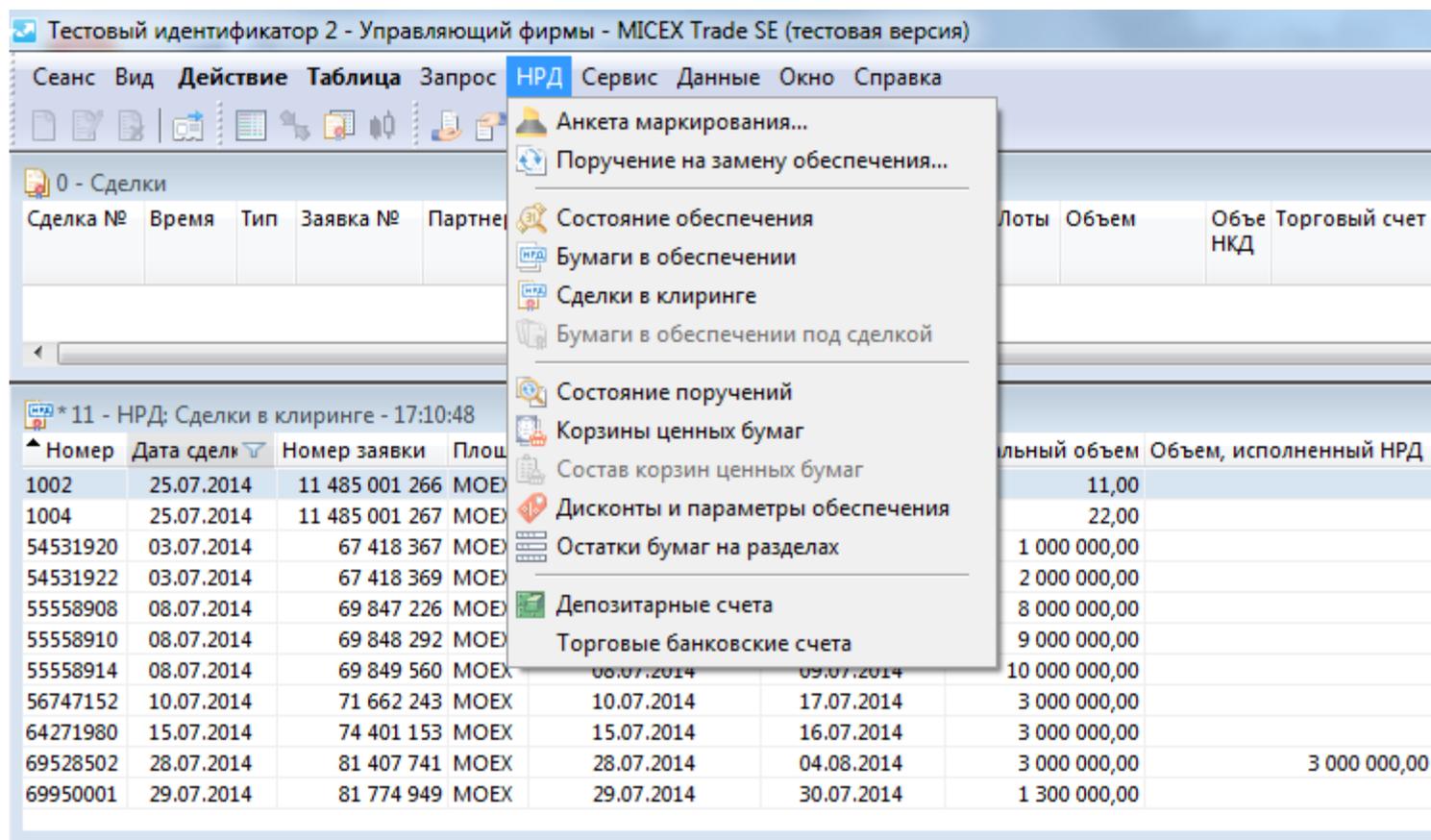
- загружены корзина (GCOLLATERAL) и доп. идентификаторы (GCBONDS, GCSHARES, GCFOREIGN, GCNOSHARES)
- зарегистрированы два Генеральных соглашений (ГС): RCBR (внебиржевое РЕПО с БР) и MERR (биржевое РЕПО с БР)
- к данным ГС привязаны корзина и доп. идентификаторы
- загружены цены по бумагам
- загружены дисконты, список аффилированных.

1.2 Торгово-клиринговая система ASTS

- Код бумаги – GCOLLATERAL
Название - КорзинаЦБ
- Доступные типы расчетов – DVP1, DVP3
- Настроены режимы – FBCB и FBFX
- Дата торгов в тестовой системе соответствует текущей календарной дате.

Разрешено заводить заявки в режиме FBCB и FBFX с технического счета REPONSD00000.

Если тестирование осуществляется через терминал MicexTradeSE, то функционал НРД по управлению обеспечением доступен через вкладку НРД в строке меню:



2. Тестирование операций

2.1. Тестирование связи и взаимодействия с сервисами НРД

Проводится на основе справочника «Дисконты и параметры обеспечения».

2.1.1. Нормальное Отображение дисконтов и прочих параметров СУО

В терминале с установленным сертификатом вызвать во вкладке НРД таблицу «Дисконты и параметры обеспечения».

Ожидаемый результат: отображение списка ценных бумаг с заполненными кодами МБ, НРД, ISIN, наименованием бумаги по справочнику МБ и НРД, непустыми полями дисконтов, ценами переоценки и подбора. Также отображение перечня корпоративных действий с плановой датой, большей либо равной текущему дню. Выводятся два ближайших КД по бумаге. Аффилированная бумага отображается с признаком аффилированности.

Код НРД	Инструмент в НРД	Торговый код	Инструмент на МБ	ISIN	Тип инструмента	Цена переоценки	Цена подбора НРД	Дисконт, %	Цена с учетом дисконта, руб	НКД	Аффилирован	Ближайшие КД	Корзины ценных бумаг	Исключена из подбора	Признак запрета смены собственности	Страна эмитента
1/100_SVAV	СОЛЛЕРС ао_1/100			RU0006914488	Акция	5,3260	5,3260	45,00%		2,93		INTR: 16.10.2014, 27.10....	GCOLLATERAL, GCSHARES			RUS
FSAO/02	ФосАгро ао02	PHOR	ФосАгро ао	RU000A0JRKTB	Акция	1 325,9000	1 325,9000	45,00%		729,24		DRAW: 03.09.2014, 04.0...	GCOLLATERAL, GCSHARES			RUS
FSKE/DR	ФСК ЕЭС ао 1/115...			RU000A0JPNIN9	Акция	0,0000	0,0000	45,00%		0,00		INTR: 17.10.2014, 23.10....	GCOLLATERAL, GCSHARES	Да		RUS
MAGN/03	ММК ао03	MAGN	ММК	RU0009084396	Акция	6,7350	6,7350	45,00%		3,70		REDM/BN: 04.07.2014, ...	GCOLLATERAL, GCSHARES			RUS
MGFN/03	Мегафон ао03	MFON	МегаФон ао	RU000A0J5942	Акция	985,7000	985,7000	45,00%		542,14		REDM/BN: 27.05.2014, ...	GCOLLATERAL, GCSHARES			RUS

2.1.2. Попытка с неверным сертификатом

- (1) В терминале без установленного сертификата вызвать таблицу «Дисконты и параметры обеспечения».
- (2) То же с неверным сертификатом, т.е. сертификатом, на который не предоставлена доверенность ЭДО. НРД по отдельному запросу может создать такой сертификат для тестовых целей.

Ожидаемый результат: Сообщение об ошибке сертификата

2.1.3. Отсутствие связи с НРД

В терминале с установленным сертификатом вызвать таблицу «Дисконты и параметры обеспечения», при этом связь (путь до) НРД должен отсутствовать (например, указать неверный URL в настройках НРД в пункте Сервис).

Ожидаемый результат: после таймаута сообщение об ошибке связи.

2.2 Тестирование анкеты маркирования

2.2.1 Подача анкеты маркирования

В терминале вызвать пункт НРД/ Анкета маркирования.

Анкета маркирования

№ п/п	Код инструмента	Инструмент	Количество бумаг	Счет депо	Раздел счета депо	Торговый счет	Код генсоглашения	Цена подбора	Дисконт, %	Максимальное количество	Цена с учетом дисконта, руб	Оценка позиции
1	RU000A0E6TK0	МГор44-о6	900 000	TS1405150035	000000000000000000		MERR,RCBR	1 000,8500	2,50%	900 000	975,83	878 245 875,00
2	RU000A0DASA0	МГор39-о6	Не подбирать	TS140117001B	000000000000000000		MERR,RCBR	0,0000	2,50%	0	0,00	0,00
3	X50088543193	MINFIN RF 12...	Любое	TS1405150035	000000000000000000		MERR,RCBR	61 154,7495	2,00%		59 931,65	59 900 010 559,69

Счет вывода: Раздел счета: Торговый счет:

Ввести поручение Очистить анкету... Загрузить... Сохранить... Закрыть

Добавить...
Изменить...
Удалить
Выше
Ниже
Вернуть
Повторить
Обновить

Изменить строки анкеты, поменяв их местами или исправив любой атрибут.

Добавить строку с выбранными атрибутами. Нажать кнопку «Ввести поручение».

Для корректного тестирования п. 2.2.1. убедиться, что в анкете присутствуют минимум 3 строки, минимум одна из которых - с указанным инструментом.

2.2.2 Ввод строк анкеты

В терминале вызвать пункт НРД/ Анкета маркирования.

Ввести новую/отредактировать старую строку анкеты, обращая внимание на:

1. Генсоглашение по умолчанию – двойное MERR; RCBR;
2. Невозможность ввода заявки на маркировку при некорректном заполнении строк (указание бумаги и количества без указания счета и раздела, указание счета без указания раздела, без указания генсоглашений)
3. Возможность указания раздела и счета без указания бумаги (при этом маркируется весь соответствующий раздел)
4. Возможность указания бумаги без указания количества (при этом маркируются данные бумаги со всех разделов)

5. Возможность указания бумаги с указанием количества «0» (при этом соответствующая бумага запрещается для подбора)
6. Автоматическую подстановку счета/раздела в случае выбора торгового счета.

Сохраните анкету, нажав кнопку «Ввести поручение». Откройте ее снова.

Ожидаемый результат: Открывается существующая анкета. Анкета сохраняется. В таблице «НРД: Состояние поручений» появляется новая строка типа 18/MARK. Повторный вызов анкеты показывает измененную анкету.

2.2.3 Состав анкеты

В терминале вызвать пункт НРД/ Анкета маркирования.

Ожидаемый результат:

колонка «Оценка позиции» заполняется:

- Для строк с указанным кодом инструмента – Цена с учетом дисконта*Макс количество на текущий момент;
- Для строк с указанным разделом без указанного инструмента – суммарной оценкой остатка на счете и разделе.

Колонка «Оценка нарастающим итогом» показывает корректный нарастающий итог.

В боевом режиме к маркированию для сделок РЕПО с корзиной ценных бумаг с Банком России доступны следующие счета/разделы:

Тип счета депо	Наименование типа	Тип раздела счета депо	Наименование типа
HS	Торговый. НКЦ. Ценные бумаги в собств. депонента	31	Блокировано для клиринга в НКЦ
HS	Торговый. НКЦ. Ценные бумаги в собств. Депонента	36	Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение
HS	Торговый. НКЦ. Ценные бумаги в собств. депонента	3Y	Блокировано для клиринга в НКЦ. Предложение крупных пакетов акций
S	Владелец	00	Основной
S	Владелец	73	Основной (дополнительный)
TS	Торговый. НРД. Ценные бумаги в собств. депонента	00	Основной
TS	Торговый. НРД. Ценные бумаги в собств. депонента	73	Основной (дополнительный)

Доступные к маркированию в тестовом режиме разделы указаны в таблице «НРД: остатки бумаг на разделах» (см. п. 3.3).

При тестировании можно маркировать счета S и TS.

Ожидаемый результат: Изменения сохраняются. По остаткам участника, промаркированным под каждое из генеральных соглашений, и допустимых (не из списка аффилированных выпусков) к подбору, производится расчет их стоимости с дисконтом. Используется цена подбора, а **не** цена переоценки.

Если раздел лицевого счета маркирован одновременно без указания остатка, то считается, что ограничения по остатку нет и маркирован весь раздел целиком. Остатки берутся без запросов по динамике, то есть фактически на утро текущего дня. Считается, что между аукционом и началом торгов проходит небольшое время, и стоимость остатков при этом понадобится до заключения сделок на аукционе.

2.2.4 Просмотр поручений

После выполнения пункта 2.2.1 вызвать НРД/ Состояние поручений НРД.

Ожидаемый результат: Отражаются поручения, поданные участником, согласно параметрам запроса.

Дата поручения	Номер поручения	Тип поручения	Номер поручения в НРД	Время регистрации в НРД	Время исполнения в НРД	Состояние поручения	Причина отказа
28.07.2014	MOME_00002120723	18/PAR	X741	28.07.2014 12:07:26		Исполняется	Нет полномочий на регистрацию поручения от лица участника MС00MEX00000.
28.07.2014	MOMEX00002120922	18/Z	276420	28.07.2014 12:09:23		Не исполнено	Операция не может быть осуществлена по причине отсутствия ценных бумаг на замену.
28.07.2014	MOMEX00002120723	18/MARK	276419	28.07.2014 12:07:26	28.07.2014 12:07:29	Исполнено	

2.2.5 Отображение текущей анкеты

В терминале вызвать пункт НРД/ Анкета маркирования.

Ожидаемый результат: отображение текущих параметров анкеты маркирования, установленных в п. 2.2.1.

3. Тестирование сделок

3.1 Регламент тестирования*

*все производимые действия реализуются методами, описанными в разделах 3.2—3.7

9:00 – 10:00 – Просмотр остатков, допустимых к маркированию, текущей стоимости свободного обеспечения, бумаг в разбивке по корзинам.

10:00 – 10:30 – отправка Банком России в НРД информации о корзине, дисконтах, границах переоценки, аффилированных с заёмщиками ценных бумагах.

10:00 – 10:10 – запрос списка участников в торгах.

10:30 – 10:40 – переоценка

10:40 – отчет MS0181, MS218, MS118, при изменении остатков на счетах ДЕПО участника – отчет MS101

10:30 – 10:40 - запрос перечня ценных бумаг по корзинам (нужно при наличии возможности указания в сделке или в поручениях приоритетной бумаги);

10:45 – 16:00 – торги по фиксированной ставке

10.45 – 11.15, 14.00 – 15.00 - аукционные торги

12:00 – 12:30 – клиринговый сеанс

12:15 – MS018, MS218, MS118, MS007, MS009. если произошло изменение остатков на счетах ДЕПО, денежных счетах участника –MS101 и MS102.

12:30 – 13:00 – запрос результатов расчета сделок по клиринговому сеансу.

13:00 – 14:00 – технологическое окно, тестирование не производится.

14:00 – 15:45 – тестирование функционала системы управления обеспечением как по сделкам с типом расчетов DVP1, так и сделкам DVP3:

– отправка поручения на замену одной из бумаг, подобранной в сделки. Проверка состояния поручения.

– подача маркирования Участником, отличающегося от ранее поданного. Проверка состояния поручения. Просмотр текущего состояния маркирования.

– просмотр текущей стоимости свободного обеспечения Участником.

– просмотр состояния сделок Участника.

– подача маркирования Участником, отличающегося от ранее поданного. Проверка состояния поручения. Просмотр текущего состояния маркирования.

16:00 – 16:30 – клиринговый сеанс в НРД и расчеты по окончанию торгов на тестовом стенде торговой системы

16:15 – MS018, MS218, MS118, MS007, MS009; если произошло изменение остатков на счетах ДЕПО, денежных счетах участника – MS101 и MS102.

16:30 – 17:00 – запрос результатов расчета сделок по клиринговому сеансу.

16:00 – 9:00 – технологическое окно, тестирование не производится.

до 12.00 следующего торгового дня – получение торговых отчетов (SEM02, SEM03) от ФБ ММВБ по результатам торгов

после исполнения сделок DVP1 – отчеты MS018, MS007, MS009; если было изменение остатков по денежным счетам и счетам ДЕПО – MS102

после получения и обработки поручений на замену – MS018

после получения поручения на маркирование или запроса на маркирование через терминал – MS18M и MS18

Передача реестра сделок с Участниками и Банком России (депозитарный код MZ0000200000) каждые 15 минут после начала торгов. После загрузки реестра сделок РЕПО – отчет MS018

¹ Расшифровка кодов отчетов приведена в таблице ниже

Подача маркирования Участником, проверка состояния поручения, просмотр текущего состояния маркирования возможны в течение всего торгового дня.

Также рекомендуем протестировать перенос обязательств при отсутствии ценных бумаг и денежных средств у заемщика для исполнения обязательств.

Название отчетов	Код отчета
Выписка из реестра заявок на фондовом рынке	SEM02
Информация по совершенным сделкам на фондовом рынке	SEM03
Отчет о регистрации, изменении и прекращении обязательств по сделке	MS018
Отчет о составе обязательств и их обеспеченности	MS118
Сводный отчет о регистрации/изменении и прекращении обязательств по сделкам за период	MS218
Отчет о маркировании ресурсов для подбора ценных бумаг	MS18M
Отчет о регистрации дополнительных параметров обслуживания	MS18P
Отчет о неисполненных обязанностях	MS007
Отчет по итогам клиринга	MS009
Отчет об исполнении перевода ценных бумаг	MS101
Отчет о переводе ценных бумаг по результатам клиринга НРД	MS102
Исполнение сделки с ц.б. Регистрация обязательств по 2-ой части сделки.	MS194

3.2 Перечень тестируемых функций (используемые методы)

- просмотр остатков, допустимых к маркированию (balances), просмотр допустимых счетов и разделов к маркированию (agreements),
- просмотр бумаг в разбивке по корзинам (suodata),
- подача маркирования (markups),
- просмотр текущей стоимости свободного обеспечения (marked_cost),
- подача реестра (tradesregistry),
- обработка реестра СУО НРД,
- просмотр состояния сделок (deals),
- подача от участников поручений на замену (order_18z),
- изменение даты сделки (order_deal),
- просмотр состояния поручений (orders),
- исполнение вторых частей сделок (Аламеда),
- просмотр состояния сделок (deals).

3.3 Тестирование просмотра остатков бумаг и денежных средств на счетах и разделах

Пункты меню НРД/ Остатки бумаг на разделах

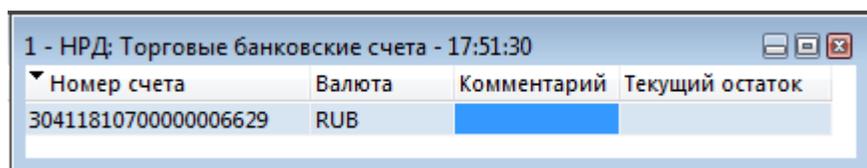
Счет	Раздел	Код НРД (все)	Код НРД (ломб.сп.)	Инструмент	Доступно к маркированию	Количество	Аффилирован	Исключена из подбора	Цена подбора НРД	Стоимость остатка
HS1405150024	000000000000000000	RU000A0DASA0	RU000A0DASA0	МГор39-о6	-	1 000 000		Да		
HS1405150024	000000000000000000	RU000A0E6TK0	RU000A0E6TK0	МГор44-о6	-	1 000 000			1 000,3600	975 351 000,00
HS1405150024	000000000000000000	XS0088543193	XS0088543193	MINFIN RF 12.75 24/06/28	-	1 000 000			60 759,3205	59 544 134 113,76
HS1405150024	000000000000000000	XS0089375249	XS0089375249	МФ-126(XS)	-	1 000 000			46 102,3543	45 180 307 246,26
HS1405150024	36MC00MEX00000F00	RU000A0DASA0	RU000A0DASA0	МГор39-о6	-	1 000 000		Да		
HS1405150024	36MC00MEX00000F00	RU000A0E6TK0	RU000A0E6TK0	МГор44-о6	-	1 000 000			1 000,3600	975 351 000,00
HS1405150024	36MC00MEX00000F00	XS0088543193	XS0088543193	MINFIN RF 12.75 24/06/28	-	1 000 000			60 759,3205	59 544 134 113,76
HS1405150024	36MC00MEX00000F00	XS0089375249	XS0089375249	МФ-126(XS)	-	1 000 000			46 102,3543	45 180 307 246,26
TS140117001B	000000000000000000	RU000A0DASA0	RU000A0DASA0	МГор39-о6	+	12 934		Да		
TS140117001B	000000000000000000	XS0088543193	XS0088543193	MINFIN RF 12.75 24/06/28	+	69			60 759,3205	4 108 545,25
TS1405150035	000000000000000000	RU000A0DASA0	RU000A0DASA0	МГор39-о6	+	987 066		Да		
TS1405150035	000000000000000000	RU000A0E6TK0	RU000A0E6TK0	МГор44-о6	+	981 918			1 000,3600	957 714 703,22
TS1405150035	000000000000000000	XS0088543193	XS0088543193	MINFIN RF 12.75 24/06/28	+	999 472			60 759,3205	59 512 694 810,94
TS1405150035	000000000000000000	XS0089375249	XS0089375249	МФ-126(XS)	+	999 980			46 102,3543	45 179 403 640,12

В таблице отражены остатки по всем бумагам, включая и не входящих в Ломбардный список Банка России, как на разделах, доступных к маркированию, так и на всех открытых счетах и разделах Участника. По торгуемым на Бирже бумагам наименование и код инструмента указаны те, что присвоены на Московской Бирже, по остальным бумагам – то, что присвоены в НРД. Указан признак аффилированности эмитента ценной бумаги с Участником. Также указана доступность к маркированию ценные бумаги, если они входят в Ломбардный список Банка России и находятся на доступных к маркированию счетах и разделах. Также в таблице «НРД: состояние обеспечения» приведена оценочная стоимость доступных к маркированию ценных бумаг.

Ожидаемый результат: по всем ГС и допустимым к маркированию счетам и разделам у данного участника отражаются остатки на каждом лицевом счете, встречающемся хоть раз. Блокированные на лицевом счете остатки и нулевые остатки не учитываются.

Пункты меню НРД/ Торговые банковские счета участника

В таблице отражен текущий остаток на торговом банковском денежном счете торговой пары НРД, на который поступают денежные средства по первой части и списываются по второй.



Номер счета	Валюта	Комментарий	Текущий остаток
30411810700000006629	RUB		

3.4 Тестирование просмотра бумаг в разбивке по корзинам

Просмотр бумаг в разбивке по корзинам доступен для вызова из вкладки «НРД/Состав корзины ценных бумаг» при открытой таблице «Корзины ценных бумаг».

Ожидаемый результат:

Возвращает по каждой бумаге (с указанием торгового кода МБ, кода НРД, а также ISIN), входящей в какую-либо корзину, актуальные: цену переоценки, цену подбора, дисконт, НКД, характеристики бумаги, а также перечень корпоративных действий с плановой датой, большей либо равной текущему дню. Выводятся два ближайших КД по бумаге (параметры данных по бумаге аналогичны параметрам в таблице «Дисконты и параметры обеспечения»).

6 - НРД: Корзины ценных бумаг - 17:16:02

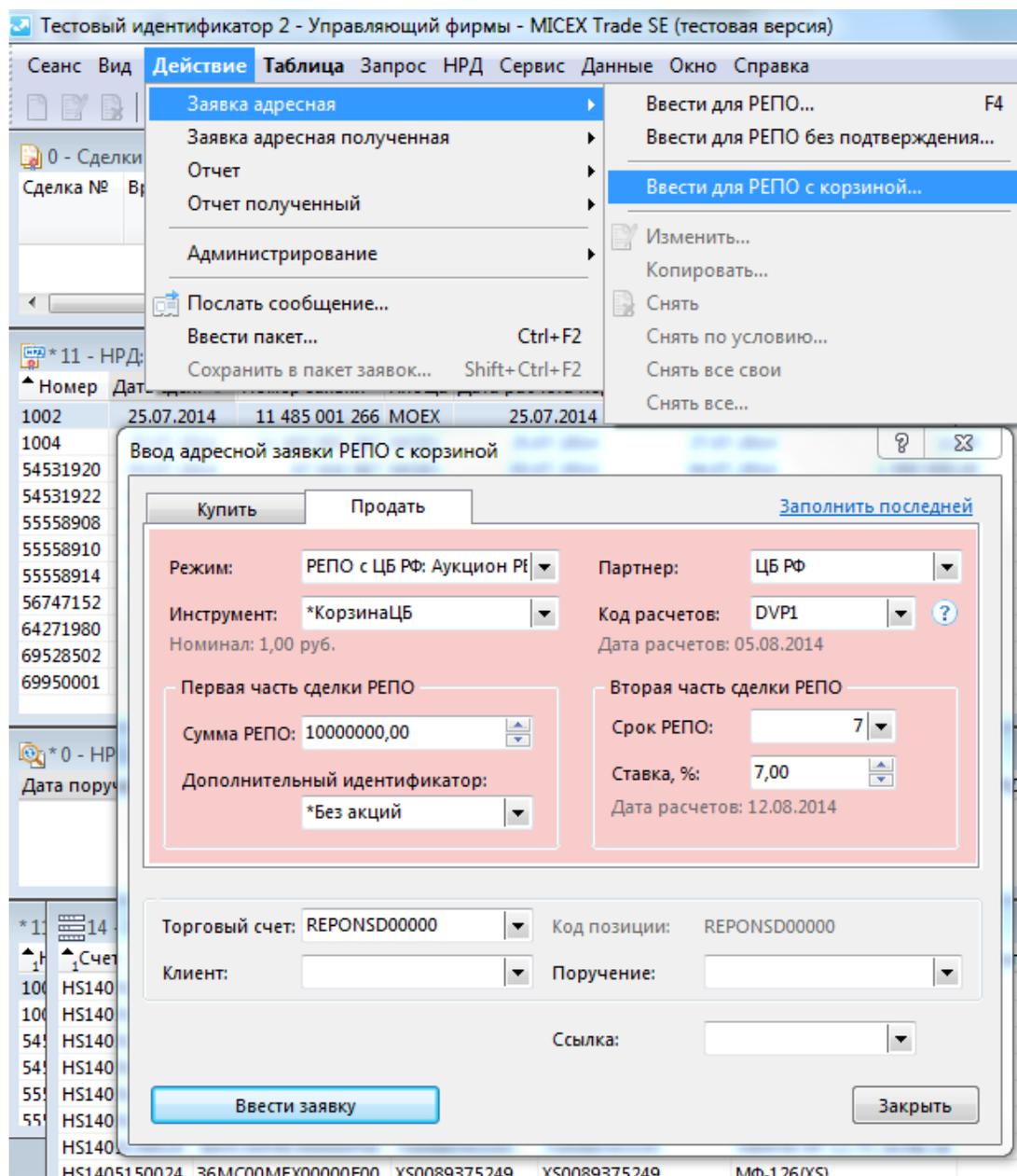
Код корзины	Краткое наименование
GCBONDS	Облигации корзины РЕПО БР
GCFEDBONDS	Облигации корзины РЕПО БР
GCForeign	Ин-ые ц.б. из корзины РЕПО БР
GCNOSHARES	Ц.б. без акций корзины РЕПО БР
GCOLLATERAL	Корзина цен. бум. РЕПО БР
GCSHARES	Акции из корзины РЕПО БР

708 - GCBONDS - НРД: Состав корзин ценных бумаг - 17:21:18

Код НРД	Инструмент в НРД	Торговый код	Инструмент на МБ	ISIN	Тип инструмента	Цена переоценки	Цена подбора НРД	Дисконт, %	Цена с учетом дисконта	НКД	Аффилирован	Ближайшие КД	Корзины ценных бумаг	Исключена из подбора	Признак запрета смены собственно
RU000A0DAS40	Москва 0639	RU000A0DAS40	МГор39-06	RU000A0D...	Облигация	999,3000	0,0000	2,50%	974,32			REDM/BN: 14.07.2014, 21.07.2014	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES	Да	Да
RU000A0DH708	Прав. Ленинград...	RU000A0DH708	ЛенОбл-3-06	RU000A0D...	Облигация	1 026,6200	1 026,6200	10,00%	923,96	19,3200		INTR: 27.11.2014, 05.12.2014; REDM/BN: 27....	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES		
RU000A0EBTK0	Москва 0644	RU000A0EBTK0	МГор44-06	RU000A0E6...	Облигация	1 000,6600	1 000,6600	2,50%	975,64	8,0600		INTR: 17.12.2014, 24.12.2014; INTR: 17.06.20...	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES		Да
RU000A0GKK87	Коми респ. 06а08	RU000A0GKK87	КОМИ 8в 06	RU000A0GK...	Облигация	990,3100	990,3100	10,00%	891,28	23,2100		DRAW: 27.08.2014, 03.09.2014; INTR: 27.08....	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES		
RU000A0GKNF2	АИЖК 0606	RU000A0GKNF2	АИЖК 6-06	RU000A0GK...	Облигация	399,9200	0,0000	10,00%	359,93			REDM/BN: 04.07.2014, 15.07.2014	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES	Да	
RU000A0GN9B5	Мосэнерго 0603	RU000A0GN9B5	Мосэнерго2	RU000A0G...	Облигация	1 036,4200	1 036,4200	15,00%	880,96	37,5200		INTR: 15.08.2014, 21.08.2014; INTR: 13.02.20...	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES		
RU000A0JNGU3	ВТБ 0606	RU000A0JNGU3	ВТБ - 6 06	RU000A0JN...	Облигация	1 001,9800	1 001,9800	12,50%	876,73	6,8800		INTR: 30.09.2014, 08.10.2014; INTR: 24.12.20...	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES		
RU000A0JNP17	АИЖК 0607	RU000A0JNP17	АИЖК 7-06	RU000A0JN...	Облигация	490,0600	490,0600	10,00%	441,05	2,2100		DRAW: 06.07.2015, 15.07.2017; INTR: 06.10....	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES		
RU000A0JNPK5	АИЖК 0608	RU000A0JNPK5	АИЖК 8-06	RU000A0JN...	Облигация	287,5700	287,5700	10,00%	258,81	3,2000		DRAW: 05.06.2017, 15.06.2017; INTR: 04.09....	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES		
RU000A0JNPN1	Москва 0648	RU000A0JNPN1	МГор48-06	RU000A0JN...	Облигация	862,1500	862,1500	2,50%	840,60	10,5500		INTR: 04.12.2014, 11.12.2014; INTR: 04.06.20...	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES		Да
RU000A0JNPP6	Москва 0649	RU000A0JNPP6	МГор49-06	RU000A0JN...	Облигация	981,3700	981,3700	2,50%	956,84	9,9700		INTR: 05.12.2014, 15.12.2014; INTR: 05.06.20...	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES		Да
RU000A0JP1V5	АИЖК 0609	RU000A0JP1V5	АИЖК 9-06	RU000A0JP...	Облигация	594,7400	594,7400	10,00%	535,27	10,1000		DRAW: 05.02.2015, 16.02.2015; DRAW: 04.0...	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES		
RU000A0JP2G4	Россельхозбанк ...	RU000A0JP2G4	Россельб Э	RU000A0JP...	Облигация	1 028,3300	1 028,3300	12,50%	899,79	38,6300		INTR: 08.08.2014, 14.08.2014; INTR: 06.02.20...	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES		
RU000A0JP518	СЦС 0601	RU000A0JP518	СЦС 01	RU000A0JP...	Облигация	1 021,6500	1 021,6500	15,00%	868,40	30,7500		INTR: 09.09.2014, 18.09.2014; INTR: 10.03.20...	GCOLLATERAL, GCBONDS, GCNOSHARES		

3.5 Ввод заявки

Пункт меню Действие/ Заявка адресная/ Ввести для РЕПО с корзиной
Направленность – продать.



Обязательные поля:

- Режим (РЕПО с ЦБ РФ: Аукцион РЕПО или РЕПО с ЦБ РФ: фикс. ставка)
- Инструмент (*КорзинаЦБ)
- Партнер (ЦБ РФ)
- Код расчетов (DVP1 или DVP3)
- Сумма РЕПО (стоимость обратного выкупа РЕПО не может превышать 9 999 999 999 999,00 руб)
- Срок РЕПО (1, 7)
- Ставка, %
- Торговый счет (технический счет – REPONSD00000)

Указание дополнительного идентификатора необязательно. В качестве дополнительного идентификатора можно указать *Акции, *Без акций, *Ин.бумаги, *Облигации или ISIN ценной бумаги.

Поданные заявки отражаются в Отправленных адресных заявках.

Заклученные сделки отражаются в Сделках. После попадания сделок в клиринг НРД сделки отражаются в табл. «НРД: сделки в клиринге», в котором указан их статус обработки в НРД:

- Принята
- Подбор произведен
- Подбор произведен частично
- Подбор не произведен
- Рассчитана 1 часть
- Рассчитана 1 часть частично

№	Номер	Дата сделк	Номер заявки	Площа	Дата расчета первой	Дата выхода из о	Начальный объем	Объем, исполненный НРД	Сумма возврата	Ставка	Сумма обязатель	Сумма обеспечен	Статус сделки
1002		25.07.2014	11 485 001 266	МОЕХ	25.07.2014	26.07.2014	11,00			8,50000			Подбор не произв...
1004		25.07.2014	11 485 001 267	МОЕХ	25.07.2014	27.07.2014	22,00			8,50000			Подбор не произв...
54531920		03.07.2014	67 418 367	МОЕХ	03.07.2014	04.07.2014	1 000 000,00			8,50000			Подбор не произв...
54531922		03.07.2014	67 418 369	МОЕХ	03.07.2014	10.07.2014	2 000 000,00			6,50000			Принята
55558908		08.07.2014	69 847 226	МОЕХ	08.07.2014	09.07.2014	8 000 000,00			7,60000			Принята
55558910		08.07.2014	69 848 292	МОЕХ	08.07.2014	15.07.2014	9 000 000,00			6,50000			Принята
55558914		08.07.2014	69 849 560	МОЕХ	08.07.2014	09.07.2014	10 000 000,00			8,50000			Принята
56747152		10.07.2014	71 662 243	МОЕХ	10.07.2014	17.07.2014	3 000 000,00			6,50000			Подбор не произв...
64271980		15.07.2014	74 401 153	МОЕХ	15.07.2014	16.07.2014	3 000 000,00			8,50000			Подбор не произв...
69528502		28.07.2014	81 407 741	МОЕХ	28.07.2014	04.08.2014	3 000 000,00	3 000 000,00		6,50000			Подбор произведен
69950001		29.07.2014	81 774 949	МОЕХ	29.07.2014	30.07.2014	1 300 000,00			8,50000			Подбор не произв...

3.6 Тестирование подачи от участников поручений на замену

Вызвать пункт «Ввести поручение на замену обеспечения» в меню НРД либо в таблицах «бумаги в обеспечении» или «бумаги в обеспечении под сделкой» через контекстное меню.

Поручение на замену обеспечения

Заменяемый инструмент:	Количество:	Оценочная стоимость:
Башнефт ао	10000000	10 418 100 000,00
Номер сделки:	Ген. соглашение:	
7494184	MERR	

Замещающий инструмент: [Добавить инструмент](#) Количество: Оценочная стоимость:
Всего: -

Счет для вывода

Счет ДЕПО:	TS140117001B
Раздел счета:	000000000000000000
Торговый счет:	

Ввести поручение Закреть

При вводе поручения на замену необходимо обратить внимание на:

1. Возможность указания заменяемой бумаги без указания ее количества и номера сделки, а также без указания замещающих бумаг и их количества одновременно при переобеспеченности пула
2. Возможность указания количества замещающих бумаг
3. То, что Генсоглашение по умолчанию MERR
4. Невозможность ввода поручения на замену при некорректном заполнении строк (без указания генсоглашений)
5. Возможность не указывать счет ДЕПО для вывода, раздел счета и торговый счет
6. То, что при указании количества заменяемых бумаг «0» и не указанном номере сделки, замене подлежат все данные ценные бумаги конкретного выпуска.

Ожидаемый результат:

По данному запросу формируется и отправляется на исполнение поручение 18/z от инициатора - участника, подавшего запрос.

3.7 Тестирование просмотра состояния сделок

1. НРД/Состояние обеспечения (по всему пулу²), также здесь отражается оценочная стоимость с учетом дисконтов ценных бумаг, доступных к маркированию

Сумма обязательств	Стоимость обеспечения	Признак обеспеченност	Порог переоценки	Доступно к маркированию
3 000 000,00	3 000 673,41	Нормально	6 000,00	106 291 894 661,38

2. НРД/Бумаги в обеспечении (по всему пулу)

Код инструмента	Инструмент	Количество	Цена переоцен	НКД	Дисконт, %	Цена с учетом дисконт	Оценка
RU000A0E6TK0	МГор44-о6	3 075	1 000,8500	8,2500	2,50%	975,83	3 000 673,56

3. НРД/Бумаги в обеспечении под сделкой
4. НРД/Сделки в клиринге (обеспеченность по каждой сделке с указанием статуса) (Возможен просмотр бумаг в обеспечении по каждой сделке через контекстное меню)

² EXCS – пул переобеспечен, DEFI – пул недообеспечен, FLAT – оценка пула находится внутри допустимых границ обеспеченности