

ДОПУСК К ВАЛЮТНОМУ РЫНКУ И РЫНКУ ДЕПОЗИТОВ С ЦЕНТРАЛЬНЫМ КОНТРАГЕНТОМ **ПАО МОСКОВСКАЯ БИРЖА**

Оглавление

Общие положения	2
Нормативная база.....	2
Валютный рынок.....	2
Рынок депозитов с Центральным контрагентом	2
Требования к кандидату	3
Доступ к Электронному документообороту (ЭДО).....	4
WEB-клиринг	5
Допуск к торгам и клиринговому обслуживанию	6
Технический доступ.....	7
Оформление технического доступа	7
Тестовый доступ.....	8
Затраты по подключению и работе на рынках.....	9
Операции с денежными средствами	10
Штрафы за неисполнение обязательств и перенос позиций	12
Торговые и клиринговые отчеты	13

Общие положения

- Корпорация - Участник клиринга - Некредитная организация, не являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг.
- Клиринговый центр, НКЦ - Банк "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество). Выполняет функции Центрального контрагента (ЦК) на всех рынках Группы Московской Биржи.
- Рынок депозитов с центральным контрагентом организован в рамках фондового рынка Московской Биржи.
- Для работы на Валютном рынке и Рынке депозитов с Центральным контрагентом организуется допуск к торгам (Московская Биржа) и доступ к клиринговому обслуживанию (НКЦ).

Нормативная база

Допуск к торгам и порядок проведения на Валютном рынке и Рынке депозитов в Центральным контрагентом регулируются Правилами допуска к участию в торгах, Правилами проведения организованных торгов и Правилами клиринга на соответствующем рынке. Все документы раскрываются на сайте Московской Биржи и НКЦ.

Валютный рынок

1. Правила допуска к участию в торгах - <http://fs.moex.com/files/713>
2. Правила организованных торгов - <http://fs.moex.com/files/714>
3. Правила клиринга - <http://www.nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=244>

Рынок депозитов с Центральным контрагентом

Нормативные документы по допуску и работе на Рынке депозитов с Центральным контрагентом в настоящее время утверждаются. Утвержденные документы будут раскрыты на официальном сайте в ближайшее время.



Требования к кандидату

Показатель	Валютный рынок	Рынок депозитов с ЦК
Квалификация	<ul style="list-style-type: none"> ▪ В организации должно иметься отдельное структурное подразделение к функциям работников которого относится осуществление операций на финансовом рынке, включая заключение сделок купли-продажи иностранной валюты (Казначейство); ▪ В штате организации имеются как минимум 2 (два) работника, в должностные обязанности которых входит заключение сделок купли-продажи иностранной валюты, каждый из которых должен иметь опыт работы в организации, осуществляющей операции на финансовом рынке, и деятельность работника была непосредственно связана с совершением таких операций, либо имеет квалификационный аттестат; ▪ За предшествующие 2 (два) календарных года годовой объем заключенных организацией сделок купли-продажи иностранной валюты составляет не менее 100 млн. долларов США в год (по курсу, определяемому на 31 декабря каждого соответствующего календарного года). 	<ul style="list-style-type: none"> ▪ Наличие как минимум 2 (двух) работников, обладающих квалификационным аттестатом специалиста финансового рынка первого типа или соответствующим ему квалификационным аттестатом согласно требованиям законодательства и (или) прошедших профильное обучение в одном из учебных центров, перечень которых устанавливается решением Биржи (что подтверждается письмом установленного образца, см. Допуск к торгам и клиринговому обслуживанию).
Полное депонирование (категория «В»)		
Размер собственных средств (капитала)	<ul style="list-style-type: none"> ▪ не менее 1 (одного) миллиарда рублей. 	
Частичное депонирование (категория «Б»)		
Размер собственных средств (капитала) или рейтинг	<ul style="list-style-type: none"> ▪ не менее 50 (пятидесяти) миллиардов рублей и при наличии минимального рейтинга BB- по классификации S&P или Fitch Ratings или Ba3 по классификации Moody's. 	<ul style="list-style-type: none"> ▪ не менее 10 (десяти) миллиардов рублей; ▪ иметь валюту баланса не менее, чем 50 (пятьдесят) миллиардов рублей.
Взнос в Гарантийный фонд (возвратная сумма)	3 000 000 ₽	1 000 000 ₽
Финансовое состояние	<p>Должны отсутствовать факты ухудшения финансового состояния и/или должна отсутствовать информация, дающая основание считать возможным ухудшение финансового состояния организации. Должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве).</p>	

Взнос в Гарантийный фонд осуществляется в рублях (или эквивалент в долларах США или евро) по реквизитам, указанным по данной ссылке: <http://www.nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=378>

Сведения о средствах, находящихся в Гарантийном фонде, отражаются в отчете EQM92 (ежедневно направляется корпорации по системе ЭДО).





Доступ к Электронному документообороту (ЭДО)

Функции:

- Обмен сообщениями и документами;
- Получение торговых и клиринговых отчетов.

Подробная информация о Системе ЭДО: <http://moex.com/s1273>

Для этого необходимо предоставить:

1. Договор об участии в Системе электронного документооборота (2 экз.)	 Договор PKI.rtf
2. При изготовлении ключа на организацию: <ul style="list-style-type: none">▪ Заявление на создание СКПЭП (для юридического лица), выбрав области действия «Электронный документооборот валютного рынка» и «Электронный документооборот НКЦ»	 Заявление СКПЭП (юр.лицо).rtf
3. При изготовлении ключа на представителя (физическое лицо, действующее от имени юридического лица): <ul style="list-style-type: none">▪ Заявление на создание СКПЭП (для физического лица, действующего от имени юридического лица), выбрав области действия «Электронный документооборот валютного рынка» и «Электронный документооборот НКЦ»	 Заявление СКПЭП (физ.лицо).rtf
<ul style="list-style-type: none">▪ Доверенность на владельца СКПЭП, действующего от имени юридического лица	 Доверенность ЭДО.rtf

После получения ключевых носителей с ключом регистрации и сертификатом регистрации, программного и информационного обеспечения на носителе CD и сертификата регистрации в форме документа на бумажном носителе, подписать со своей стороны и вернуть Администратору СЭД один экземпляр сертификата регистрации.

Установить программное обеспечение на клиентском рабочем месте, сформировать свои закрытые (секретные) ключи и запрос на создание СКПЭП в виде файла. Отправить сформированный запрос в виде файла средствами электронной почты Администратору СЭД по адресу pki@moex.com.

Подробная инструкция по генерации ключа:



KeysRenovation.zip

Забрать выпущенный ключ может либо владелец ключа, либо иное лицо по доверенности (<http://fs.moex.com/files/7437/>). Также ключ может быть доставлен средствами спецсвязи.

Тарифы на Услуги Организатора СЭД:

Наименование Услуги	Тариф (в рублях, без НДС)
Изготовление ключа	6 500 Р единовременно (3 000 Р - изготовление самого ключа, 3 500 Р – изготовление сертификата ключа)
Абонентская плата	1 500 Р Ежемесячно
Замена действующего СКПЭП в связи с внесением изменений	1 000 Р

WEB-клиринг

Функции:

- Направление поручений в клиринговую систему (вывод денежных средств, перевод денежных средств между счетами, поручения на постоянный возврат денежных средств и прочее).

Для регистрации в сервисе WEB-клиринг необходимо заполнить Заявление на подключение к WEB -клиринг <http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=483>.

Заполненное Заявление нужно направить по системе ЭДО на адрес oibd@moex.com, укажите тему сообщения «Web-клиринг». Заявление необходимо подписать закрытым (секретным) ключом электронной подписи уполномоченного лица Вашей организации и зашифрован на имя уполномоченного сотрудника Департамента клиринга Банка НКЦ (АО) КОПЫЛОВА М.Э. (ссылка на ключ Копылова М.Э. - <http://fs.moex.com/files/1307>).













На всех сотрудников, указанных в Заявлении, необходимо заполнить Доверенность на подписание электронной подписью электронных документов (скачать файл (35 Kb)). Заполненные доверенности необходимо представить в бумажной форме по адресу: Б. Кисловский пер., 13.

Код для доступа к WEB-клиринг будет направлен вам по контактам, которые вы укажете в заявлении. Наш технический специалист свяжется с вами и поможет настроить систему.



Допуск к торгам и клиринговому обслуживанию

Для допуска к торгам и клиринговому обслуживанию необходимо:

№	Наименование документа	Валютный рынок	Рынок депозитов
1	Заклучить Договор об оказании клиринговых услуг (предоставить 2 экз.)	 Договор об оказании клирингс	
2	Предоставить необходимый комплект документов	для резидентов	
3	Предоставить Заявление о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию	 Заявление о допуске к клирингс	
4	Предоставить Заявление на регистрацию Расчетного Кода, соответствующего ТКС для ФР и рынка депозитов и для ВР + Счета для возврата (торгово-банковский счет в НКО АО НРД или любом другом банке)	 Заявление на регистрацию ТКС-Р	 Заявление на регистрацию ТКС Ф
5	Зарегистрировать дополнительные счета для возврата (торгово-банковский счет в НКО АО НРД или любом другом банке) - опционально	PAYPROPRQ в программе WEB-клиринг	PAYPROPRQ в программе WEB-клиринг
6	Выбрать Расчетный код для списания комиссионного вознаграждения (при наличии нескольких) - опционально	 Заявление о выборе РК для спис	 Заявление о выборе РК для спис
7	Заклучить Договор об оказании услуг по проведению организованных торгов (в 2-х экз.)	 Договор об оказании услуг по	
8	Заклучить Договор ИТС (в 2-х экз.)	 Договор ИТС.docx	
9	Предоставить Заявление о предоставлении технического доступа	 Заявление о предоставлении те.	
10	Предоставить Заявление о предоставлении допуска к участию в торгах	 Заявление о предоставлении дс	-
11	Предоставить Письмо о соответствии условиям допуска	 Письмо о соответствии услов	 Письмо о соответствии услов

Поскольку заключение Договора об оказании клиринговых услуг на фондовом рынке и рынке депозитов сопровождается открытием депозитного счета, необходимо оформить допуск к клиринговому обслуживанию в личном присутствии представителя клиента.






Информация о зарегистрированных на текущий момент Расчетных кодах и Торгово-клиринговых счетах содержится в отчете о Торгово-клиринговых счетах – **EQM20** (для фондового рынка) и **ССХ20** (для валютного рынка).

Информация о зарегистрированных реквизитах содержится в отчете о Расчетных кодах **ССХ98**, для его получения необходимо направить в системе Web-клиринг Запрос отчета о Расчетных кодах – **CODEINFORQ** (порядок получения доступа к системе WEB-клирингу описан в Разделе [WEB-клиринг](#)).

Технический доступ

Оформление технического доступа

Для получения технического доступа к торгам необходимо предоставить:

№	Наименование документа	Валютный рынок	Рынок депозитов
1	Лицензионный договор (в 2-х экз.) Условия оказания услуг по договору представлены на сайте для ознакомления: http://fs.moex.com/files/9762	 Лицензионный договор.docx	
2	Спецификация (в 2-х экз.)	 Спецификация ВР.docx	 Спецификация ФР.docx
3	Заявление на подключение IP-адресов (в 1-м экз.)	 Заявление на подключение IP-ад	 Заявление на подключение IP-ад
4	Заявление на криптоимя (если подключение будет осуществляться через Интернет)	 Заявление на криптоимя.docx	 Уведомление о криптоимени ФР.d
5	Заявление о полномочиях первого торгового идентификатора	 Заявление о полномочиях перв	 Заявление о полномочиях перв

Тарифы за техническое подключение: <http://moex.com/s324>

Тестовый доступ

Для возможности ознакомиться с работой терминала и торговой системы Биржа предоставляет доступ к тестовому контуру.

Общая информация по тестовому доступу доступна по ссылке: <http://www.moex.com/s437>

Для того, чтобы получить доступ к тестовому контуру, необходимо:

1. Заполнить анкету по ссылке <http://moex.com/ru/forms/poll/questionnaire.aspx?id=03>:

Версия торговой системы	Текущая тестовая/разрабатываемая версия
Рынок	Валютный/Фондовый
Способ подключения	Интернет
Протокол подключения	Терминал MICEX Trade
Участник торгов. Идентификатор фирмы	Кандидат (на основании этого будет присвоен тестовый идентификатор и пароль)

2. После направления анкеты с вами свяжутся технические специалисты Биржи с информацией и порядком по подключению. Для настройки тестового терминала:

№		Валютный рынок	Рынок депозитов
1	Ссылка на скачивание тестового терминала	Ссылка на терминал 1	Ссылка на терминал 2
2	Настройки терминала	После скачивания и установки терминала, запустите его. Там вам необходимо выбрать профиль подключения INET_GATEWAY.	
3	Тестовый(ые) идентификатор(ы) для подключения	<i>Будет сообщен дополнительно</i>	
4	Пароль	<i>Будет сообщен дополнительно</i>	
5	Дополнительные параметры	Для корректного подключения необходимо открыть порты 18011/tcp, 18012/udp для адреса 91.208.232.101, и добавить программу в исключения брандмауэра/антивируса/файрвола.	

Затраты по подключению и работе на рынках

№		Валютный рынок	Рынок депозитов
1	Вступительный взнос	отсутствует	
2	Взнос в Гарантийный Фонд (для частичного депонирования) Сумма является возвратной	3 000 000 Р	1 000 000 Р
3	Взнос в Гарантийный Фонд (для полного депонирования)	отсутствует	
4	Минимальная ежемесячная комиссия	20 000 Р не взимается, если суммарный объем комиссии превысил 20 000 Р в месяц	отсутствует
5	Фиксированная ежемесячная комиссия за предоставление тех. доступа (ИТС) (взимается в случае, если трейдер хотя бы один раз осуществил авторизацию в ТС)	3 000 Р	отсутствует
6	Оборотная комиссия	http://moex.com/s132	0,18% годовых
7	Терминал (тарифы - http://moex.com/s324)	4 500 Р – первый терминал 4 050 Р – каждый последующий	5 500 Р – первый терминал 4 950 Р – каждый последующий
8	Электронный документооборот (ЭДО): - Ежемесячная абонентская плата - Изготовление ключа	1 500 Р 6 500 Р одновременно (3 000 Р - изготовление ключа, 3 500 Р – изготовление сертификата ключа)	

Операции с денежными средствами

Учет денежных средств участников клиринга осуществляется на Расчетных кодах, регистрируемых в рамках клиринговых счетов НКЦ: отдельно Расчетный код валютного рынка, и Расчетный код фондового рынка (рынка депозитов).

Внесение денежных средств

Денежные средства на счета НКЦ можно перечислять на Расчетные коды с любого счета в любом банке. Денежные средства в валютах, принимаемых НКЦ в качестве Обеспечения, перечисляются Участниками клиринга на соответствующие счета НКЦ **с обязательным указанием в назначении платежа ключевого слова и Расчетного кода Участника клиринга**. По ссылкам ниже вы найдете:

- [Реквизиты для внесения индивидуального клирингового обеспечения на Валютном рынке](#)
- [Реквизиты для внесения индивидуального клирингового обеспечения на Фондовом рынке и рынке депозитов](#)

Вывод денежных средств на Валютном рынке

Возврат денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения по Расчетному коду Участника клиринга, осуществляется на основании:

- Запроса о возврате (RURRETURN, CURRETURN);
- Постоянного поручения на возврат (RQ_SETRET).

Особенности исполнения запросов	Запрос о возврате		Постоянное поручение на возврат	
	в размере, указанном в запросе	в размере всей доступной суммы	в размере итогового нетто-требования	в размере всей доступной суммы
Количество попыток исполнения	неоднократно	1 раз	неоднократно	1 раз
Время исполнения	до наступления cut-off time по соответствующей валюте	сразу после получения запроса	до наступления cut-off time по соответствующей валюте	
Результат исполнения	Исполняется в размере, указанном в запросе или не исполняется	Исполняется в размере всей доступной суммы или не исполняется	Исполняется в размере Итогового нетто-требования или в размере доступной суммы	Исполняется в размере всей доступной суммы или не исполняется

У Участника клиринга есть возможность посредством сервиса Web-клиринг подать заявление на ранние расчеты отдельно по каждому Расчетному коду.

Особенности исполнения запросов	Разовое поручение ECLRRQ	Постоянное поручение ECLRORD
Количество попыток исполнения	1 раз в течение 15 мин после поступления запроса	
Время исполнения	После подачи (11:00 – 14:00 и 15:15 – cut-off по соответствующей валюте)	Указывается в поручении (11:00 или 15:15)
Результат исполнения	Закрывается режим TOD, доступен режим T+, исполнение обязательств, расчет доступной для вывода суммы (плановая позиция)	

Возврат денежных средств на валютном рынке осуществляется в размере расчетной позиции.

Более подробную информацию о возврате средств на валютном рынке можно найти по ссылке <http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=490>.

Вывод денежных средств на Рынке депозитов

Возврат денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения по Расчетному коду Участника клиринга, осуществляется на основании:

- Запроса о возврате (RURRETURN, CURRETURN);
- Постоянного поручения на возврат (RQ_SETRET).

Особенности исполнения запросов	Запрос о возврате	Постоянное поручение на возврат
	в размере, указанном в запросе	в размере всей доступной суммы
Количество попыток исполнения	неоднократно	1 раз
Время исполнения	до наступления cut-off time по соответствующей валюте (для российских рублей до 20:30)	
Результат исполнения	Исполняется в размере, указанном в запросе или не исполняется	Исполняется в размере всей доступной суммы или не исполняется

Возврат денежных средств на фондовом рынке осуществляется в размере расчетной позиции.

Подача поручений через торговую систему возможна до 19:00, с помощью запросов, сформированных с помощью программы [WEB-клиринг](#) и/или с помощью запроса по системе [SWIFT](#) - до 20:00).

Вывод осуществляется на заранее зарегистрированный к Расчетному коду Счет для возврата. [Подробнее о регистрации Счета для возврата](#)

Перевод денежных средств

Перевод денежных средств между Расчетными кодами валютного и фондового рынка (и рынка депозитов), а также между Расчетными кодами в рамках одного рынка осуществляется с помощью запроса **MTRNRQ**. Запрос направляется посредством сервиса [Web-клиринг](#).

С порядком заполнения запроса MTRNRQ можно ознакомиться по ссылке <http://www.nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=341>.

[Презентация: Примеры заполнения запроса MTRNRQ в системе Web-клиринг.](#)

Комиссионное вознаграждение за учет Обеспечения

Комиссионное вознаграждение за учет Обеспечения в иностранной валюте (в евро и швейцарских франках) возникает у Участников клиринга в случае внесения указанного обеспечения на счета НКЦ, взимается в соответствии с п.3 раздела II [Правил клиринга Банка НКЦ, Часть II, Тарифы](#) (в соответствии со ставками иностранных банков, в которых у НКЦ открыты счета в евро и швейцарских франках).

Точная сумма комиссии, подлежащей списанию, отражается в Отчете о комиссионных вознаграждениях ССХ10.

Более подробную информацию о комиссии за учет Обеспечения и ставках можно найти по ссылке: <http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=168> п.10.

Штрафы за неисполнение обязательств и перенос позиций

Валютный рынок

В случае:

- если Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга не обеспечено средствами под исполнение;
- при наличии непогашенной до установленного времени Задолженности.

НКЦ без подачи заявок заключает с таким Недобросовестным участником сделку своп с иностранной валютой. Датой исполнения обязательств по первой части сделки своп является день ее заключения, по второй - Расчетный день, следующий за днем ее заключения.

Указанные сделки своп заключаются не более 2 (двух) Расчетных дней подряд. При превышении указанного срока с основного Расчетного кода Участника клиринга взимается штраф, а с участником заключается закрывающая сделка купли-продажи.

Ставки для урегулирования неисполнения обязательств приведены по ссылке: <http://nkcbank.ru/viewCatalog.do?menuKey=402>

Рынок депозитов

Участник клиринга должен обеспечить в день размещения средств в депозит до 20.00 на своем Расчетном коде наличие всей суммы размещаемых в этот день депозитов, а также обязательства по уплате комиссионного вознаграждения в этот день.

В случае отсутствия требуемых денежных средств в дату размещения депозита, сделка заключается на сумму, доступную на Расчетном коде (за вычетом комиссии, подлежащей уплате в данный день). Для сделок с кодами расчетов, отличных от Y0/Y1 и Y1/Y2, предоставляется возможность исполнения обязательств на следующий расчетный день на сумму неисполненных в прошлый день обязательств, при этом на донесенные денежные средства будет заключена еще одна депозитная сделка (с той же ставкой, датой возврата, но, соответственно, меньшим сроком). С Участника клиринга взимаются средства за перенос возможности заключения депозита на другой день в размере, зависящем от срока такого переноса, суммы невнесенных средств, разницы штрафной ставки НКЦ и ставки депозита. Такой перенос возможен не более чем один раз для данного депозита (предложения).

Для депозитных договоров с кодом расчетов Y0/Y1, Y1/Y2 в случае отсутствия требуемых денежных средств в дату размещения депозита НКЦ взимает отступное за ту часть обязательств, которые не были исполнены. Кроме того, отступное взимается и по сделкам с иными кодами расчетов в случае, если недостающие денежные средства не были донесены в следующий расчетный день (при вышеописанном переносе возможности довести средства). После взимания отступного у Участника клиринга прекращается возможность внести недостающие средства и заключить по ним депозитный договор в следующие дни.

Отступное рассчитывается в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и зависит от суммы невнесенных средств, оставшегося срока депозита (предложения), разницы штрафной ставки НКЦ и ставки депозита.

Торговые и клиринговые отчеты

На Валютном рынке и Рынке депозитов с Центральным контрагентом Участнику направляются торговые и клиринговые отчеты:

1. Валютный рынок – <http://fs.moex.com/files/1075/23029>
2. Рынок депозитов:
 - a. Торговые отчеты - <http://fs.moex.com/files/943/22493>
 - b. Клиринговые отчеты - <http://fs.moex.com/files/951/23031>

