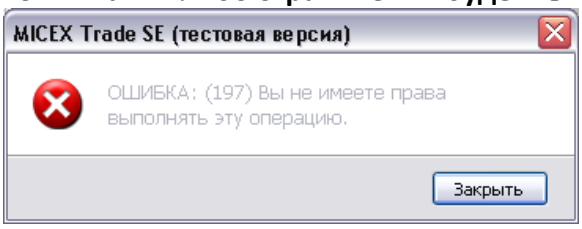
Инструкция по установлению ограничений на торгово-клиринговые счета на примере рабочего места MICEX Trade SE

ВНИМАНИЕ!

Установка на счета признаков «Без необеспеченных продаж», «Без необеспеченных покупок», внутреннего ограничения по деньгам и «Лимита необеспеченных продаж» по бумагам возможно только с идентификаторов имеющих клиринговые полномочия «Клиринговый менеджер».

В случае отсутствия у идентификатора необходимых полномочий при попытке установки каких-либо ограничений будет выводиться ошибка.

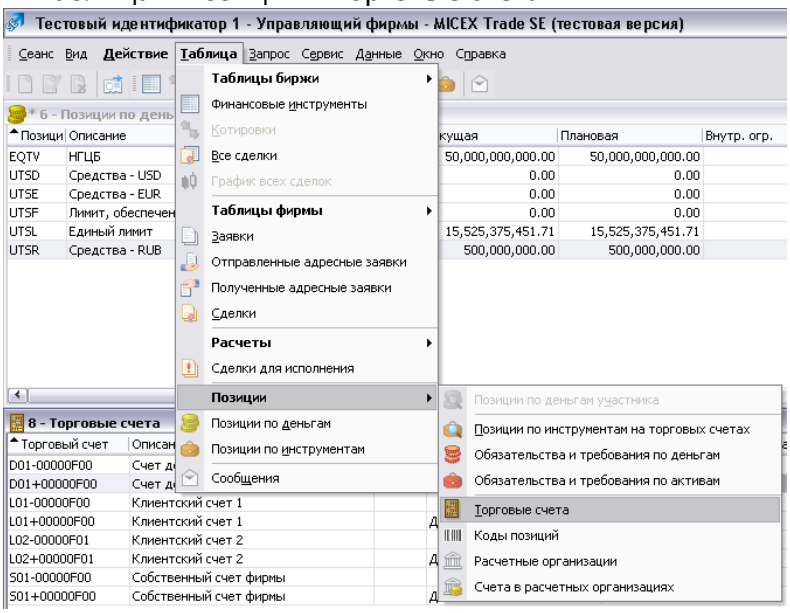


ВНИМАНИЕ!

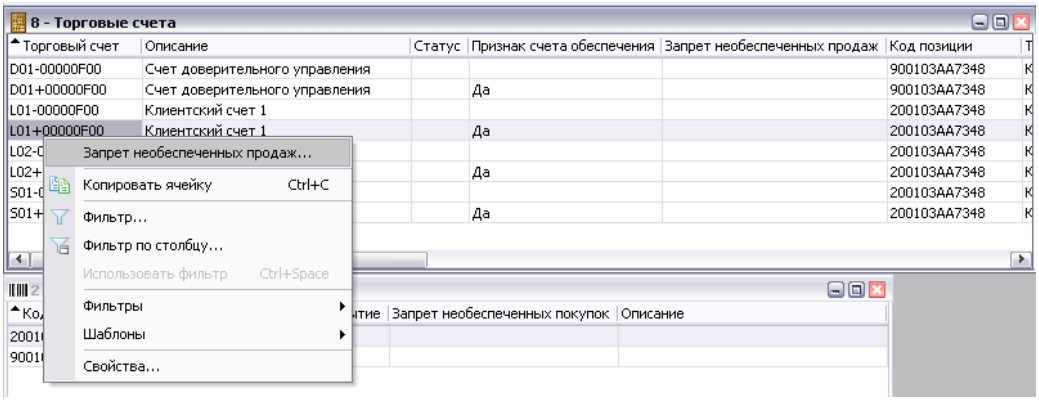
Признаки «Без необеспеченных продаж», «Без необеспеченных покупок», внутреннего ограничения по деньгам и «Лимита необеспеченных продаж» по бумагам не сбрасываются перед следующим торговым днем. Эти признаки остаются активными до тех пор, пока Участник самостоятельно их не снимет.

Установка признака «Без необеспеченных продаж» для торгово-клирингового счета (далее - ТКС)

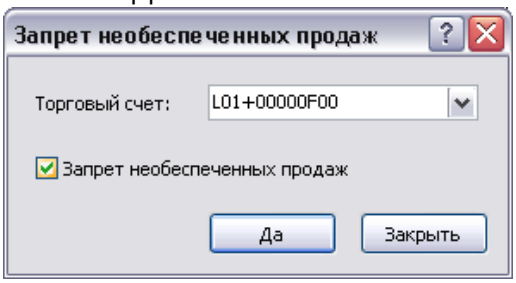
1. Таблица – Позиции – Торговые счета



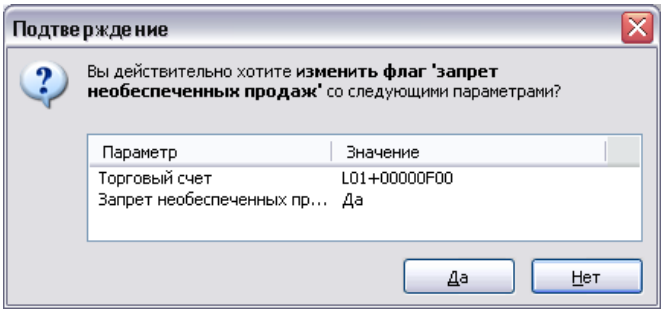
2. В появившемся окне «Торговые счета» выбирается ТКС, имеющий признак обеспечения (привязанный к 36 разделу счета депо, в названии имеет символ «+»). Например, L01+00000F00. Далее либо производится нажатие правой кнопки мыши и в появившемся меню выбирается «Запрет необеспеченных продаж…», либо Действие – Администрирование – Запрет необеспеченных продаж…



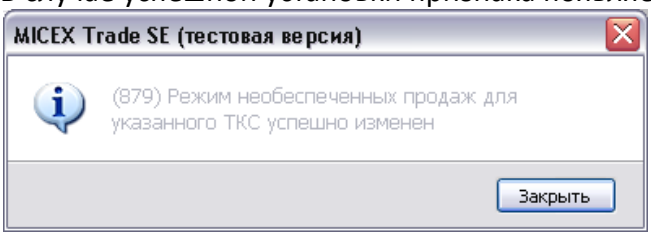
3. В появившемся окне устанавливается флаг «Запрет необеспеченных продаж» и нажимается «Да»



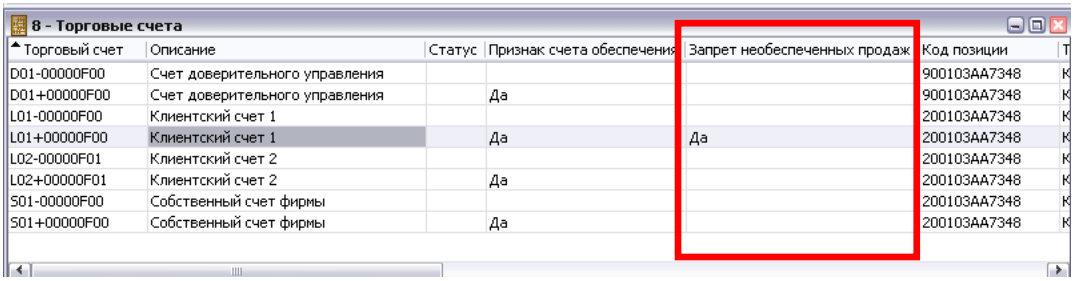
4. В окне с подтверждением еще раз нажимается «Да»



В случае успешной установки признака появляется окно



5. В окне «Торговые счета» для ТКСов, имеющих признак «Без необеспеченных продаж», будет стоять соответствующий флаг

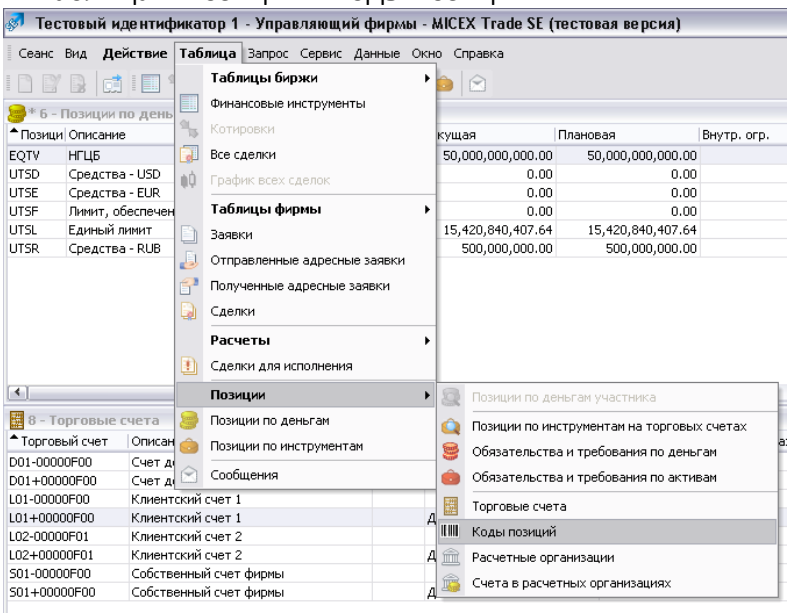


Торговый счет	Описание	Статус	Признак счета обеспечения	Запрет необеспеченных продаж	Код позиции	Т
D01-00000F00	Счет доверительного управления				900103AA7348	К
D01+00000F00	Счет доверительного управления		Да		900103AA7348	К
L01-00000F00	Клиентский счет 1				200103AA7348	К
L01+00000F00	Клиентский счет 1		Да	Да	200103AA7348	К
L02-00000F01	Клиентский счет 2				200103AA7348	К
L02+00000F01	Клиентский счет 2		Да		200103AA7348	К
S01-00000F00	Собственный счет фирмы				200103AA7348	К
S01+00000F00	Собственный счет фирмы		Да		200103AA7348	К

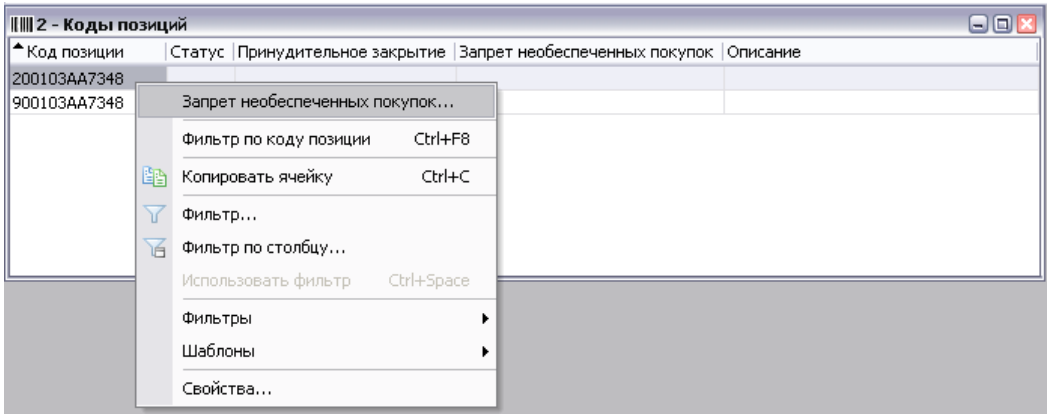
NB Для снятия этого признака необходимо повторить пп. 1-2. Далее в появившемся окне снимается флаг «Запрет необеспеченных продаж» и нажимается «Да»

Установка признака «Без необеспеченных покупок» для денежной позиции Т+ (далее – расчетного кода)

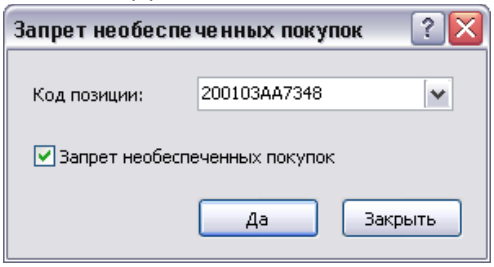
1. Таблица – Позиции – Коды позиций



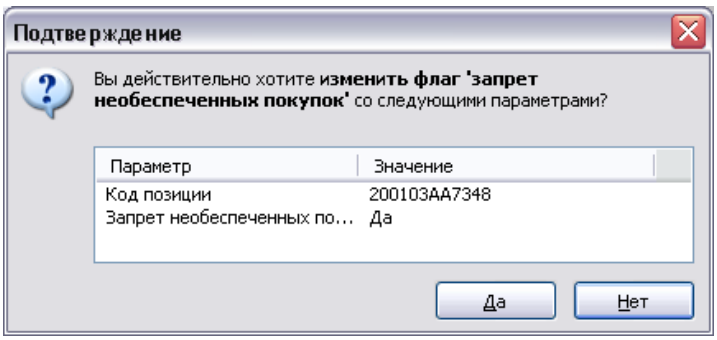
2. В появившемся окне «Коды позиций» выбирается нужная денежная позиция. Например, 200103AA7348. Далее либо производится нажатие правой кнопки мыши и в появившемся меню выбирается «Запрет необеспеченных покупок…», либо Действие – Администрирование – Запрет необеспеченных покупок…



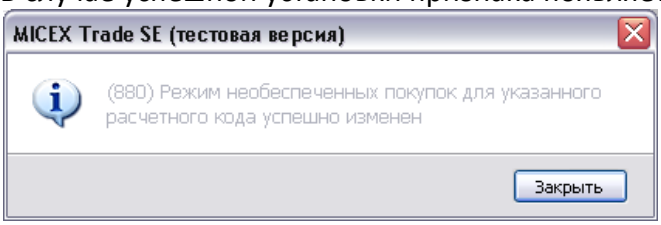
3. В появившемся окне устанавливается флаг «Запрет необеспеченных покупок» и нажимается «Да»



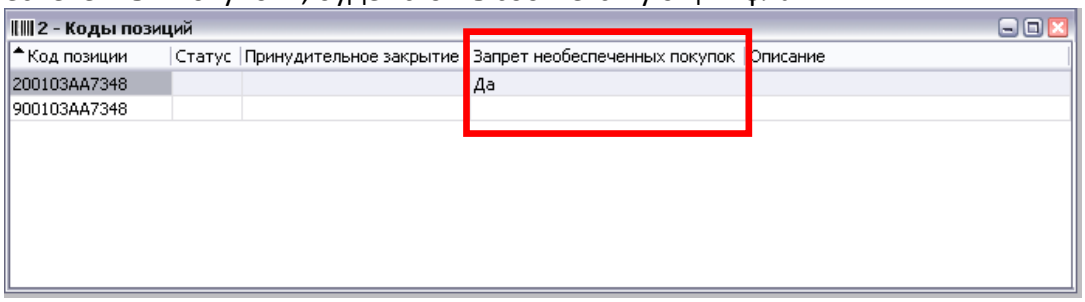
4. В окне с подтверждением еще раз нажимается «Да»



В случае успешной установки признака появляется окно

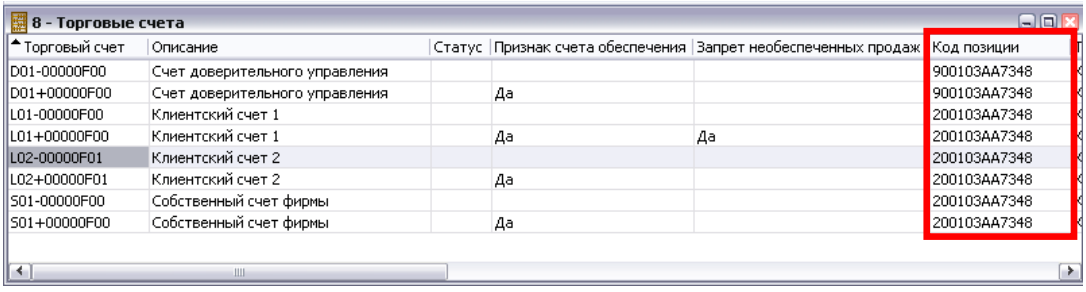


5. В окне «Торговые счета» для расчетных кодов, имеющих признак «Без необеспеченных покупок», будет стоять соответствующий флаг



NB Для снятия этого признака необходимо повторить пп. 1-2. Далее в появившемся окне снимается флаг «Запрет необеспеченных покупок» и нажимается «Да»

NB В случае установки признака «Запрет необеспеченных покупок», он действует на все ТКСы, привязанные к нему.



В данном примере «Запрет необеспеченных покупок» распространяется на ТКСы:

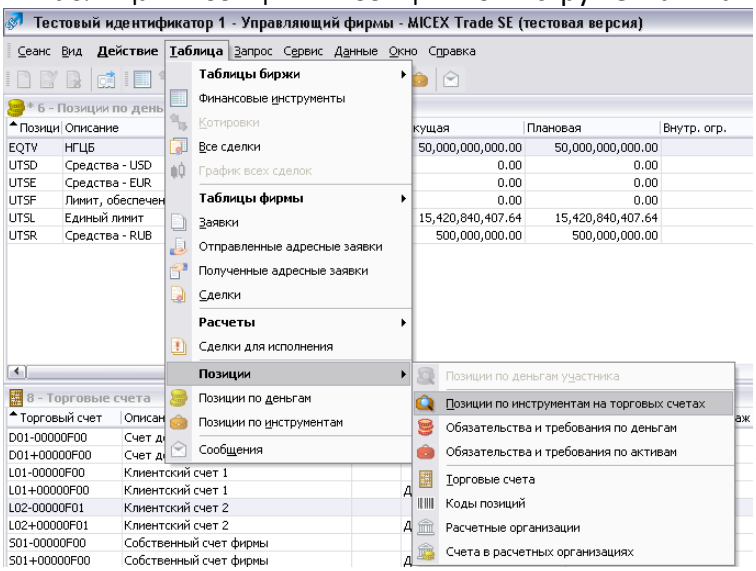
- L01+00000F00
- L02+00000F01
- S01+00000F00

Установка «Лимита необеспеченных продаж» ценной бумаги на торгово-клиринговом счете

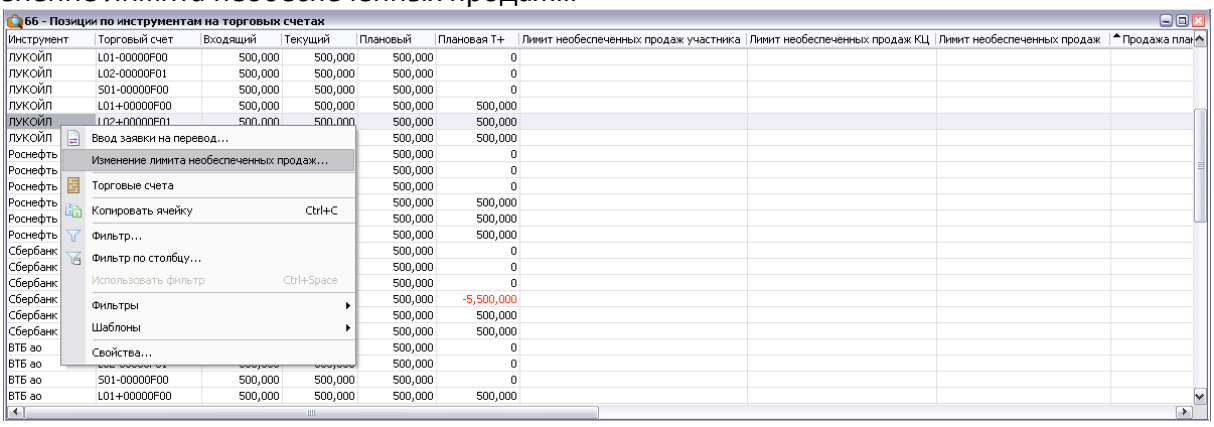
Внимание!

При подаче заявок и отчетов на исполнение будет осуществляться проверка на то, что Плановая позиция Т+ по ценной бумаге на данном ТКСе не станет меньше установленного лимита

1. Таблица – Позиции – Позиции по инструментам на торговых счетах



2. В появившемся окне «Позиции по инструментам на торговых счетах» выбирается ценная бумага на ТКСе, имеющем признак обеспечения (привязанный к 36 разделу счета депо, в названии имеет символ «+»). Например, ЛУКОЙЛ на ТКСе L02+00000F01. Далее либо производится нажатие правой кнопки мыши и в появившемся меню выбирается «Изменение лимита необеспеченных продаж…», либо Действие – Администрирование – Изменение лимита необеспеченных продаж…

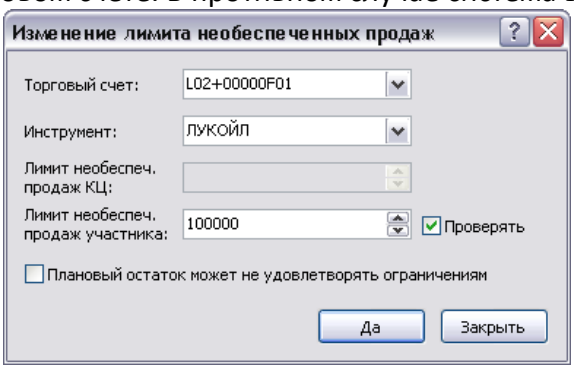


3. В появившемся окне устанавливается лимит необеспеченных продаж

- Лимит необеспеченных продаж – устанавливается лимит, ниже которого не может опуститься Плановая позиция Т+ по данной ценной бумаге на данном ТКСе. Лимит устанавливается в штуках (не в лотах). Возможно установление положительного, нулевого и отрицательного значения
- «Проверять» – Если флаг установлен, соответствие ограничениям, установленным для необеспеченных продаж, будет проверяться на этапе ввода заявки и отчета на

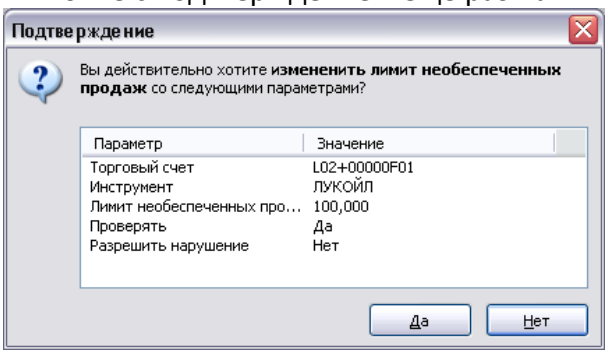
исполнение. Если флаг не установлен - проверка осуществляться не будет

- «Плановый остаток может не удовлетворять ограничениям» - Если флаг установлен, изменение значения лимита необеспеченных продаж будет осуществлено даже если целевое значение противоречит плановому остатку Т+ по выбранной бумаге на торговом счете. В противном случае система вернет ошибку.

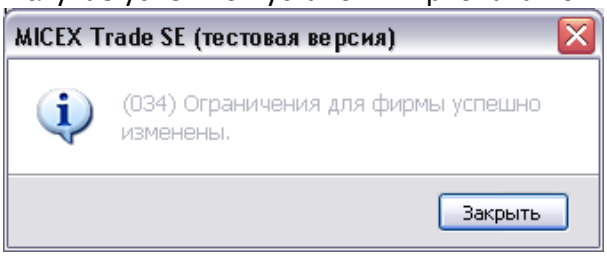


Например, устанавливается лимит акций ЛУКОЙЛа на ТКСе L02+00000F01 в размере 100 000 шт.

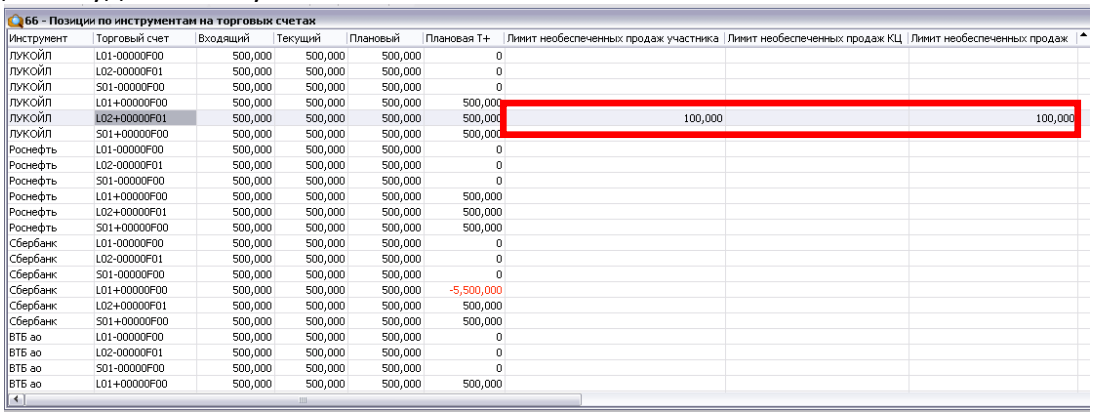
4. В окне с подтверждением еще раз нажимается «Да»



В случае успешной установки признака появляется окно



5. В окне «Позиции по инструментам на торговых счетах» для ценной бумаги на ТКСе, в столбцах «Лимит необеспеченных продаж участника» и «Лимит необеспеченных продаж» будет стоять указанное значение.



NB Для снятия этого признака необходимо повторить пп. 1-2. Далее в появившемся окне снимается флаг «Проверять» и нажимается «Да»

NB НКЦ как клиринговая организация имеет право на установку лимита необеспеченных продаж для ТКСов Участника. В случае такой установки лимиты НКЦ будут отображаться в столбце «Лимит необеспеченных продаж КЦ». В таком случае проверка осуществляется по наибольшему из лимитов установленных Участником и НКЦ (наибольшее значение отображается в столбце «Лимит необеспеченных продаж»).

NB В случае если текущая плановая позиция Т+ меньше чем желаемое ограничение и при установлении ограничения был установлен флаг «Плановый остаток может не удовлетворять ограничениям», то в дальнейшем допускается подача только таких заявок и отчетов на исполнение, при которых Плановая позиция Т+ станет больше установленного лимита.

Варианты использования данного ограничения:

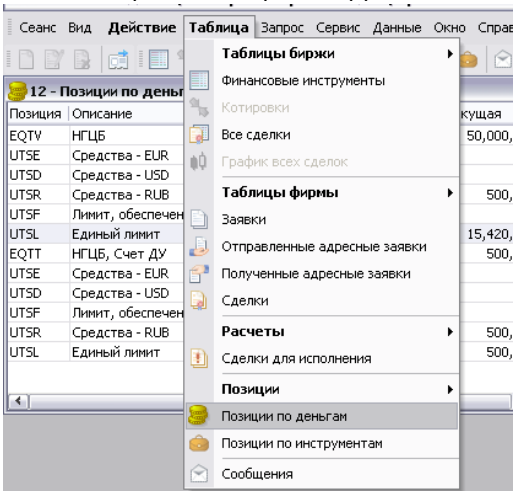
- Если лимит указан положительный – то неснижаемым лимитом по можно заблокировать ценные бумаги, используемые в качестве обеспечения (например, ОФЗ), чтобы их случайно не продали.
- Если стоит ноль – один из вариантов осуществления 100% преддепонирования по бумагам (при этом торговый счет может «уйти в минус» по бумаге в один день, а на следующий вернутся «в ноль»)
- Если лимит указан отрицательный – данный ТКС может «уйти в минус» по бумаге не больше, чем указанный лимит. Например, на ТКСе 0 бумаг. Лимит стоит -100. Значит можно продать в стакане Т+2 не больше чем 100 бумаг.

Установка неснижаемого лимита на денежную позицию

Внимание!

При подаче заявок и отчетов на исполнение будет осуществляться проверка на то, что Плановая позиция по денежному счету не станет меньше установленного лимита

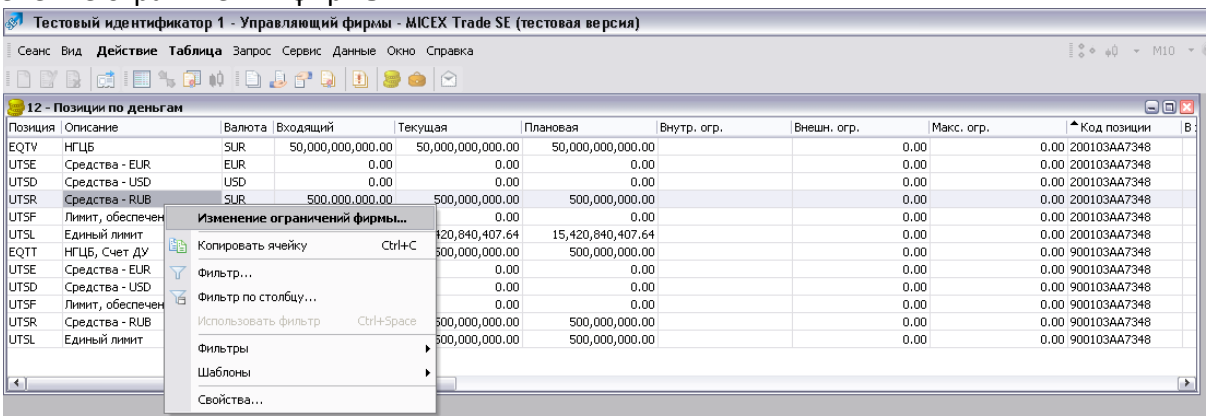
1. Таблица – Позиции по деньгам



2. В появившемся окне «Позиции по деньгам» выбирается денежная позиция, на которую требуется наложить ограничение. Ограничение возможно устанавливать для всех денежных позиций:

- EQTV, EQTS, EQTT – денежная позиция по рублям Т0
- UTSE – денежная позиция по евро Т+ (евро на расчетном коде)
- UTSD – денежная позиция по долларам Т+ (доллары на расчетном коде)
- UTSR– денежная позиция по рублям Т+ (рубли на расчетном коде)
- UTSL – единый лимит

Далее либо производится нажатие правой кнопки мыши и в появившемся меню выбирается «Изменение ограничений фирмы…», либо Действие – Администрирование – Изменение ограничений фирмы…

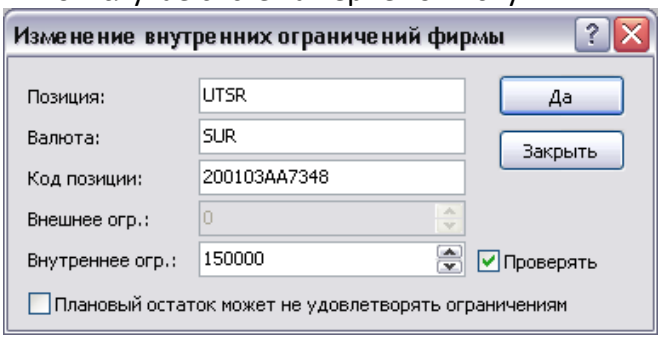


Например, ограничение накладывается на позицию UTSR на денежном счете 200103AA7348.

3. В появившемся окне устанавливается лимит на денежную позицию

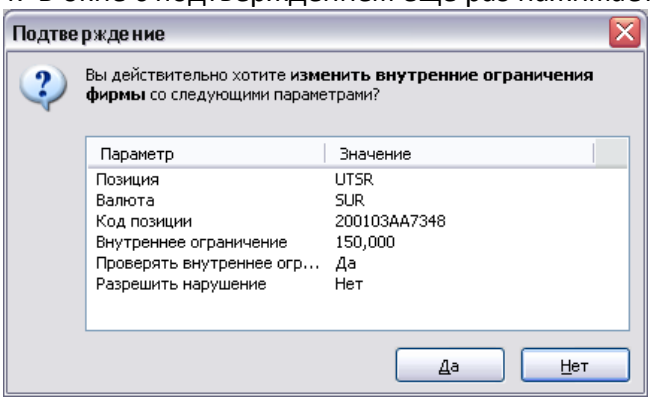
- Внутреннее ограничение – устанавливается лимит, ниже которого не может опуститься Плановая позиция по данной денежной позиции.

- «Проверять» – Если флаг установлен, соответствие ограничениям, будет проверяться на этапе ввода заявки. Если флаг не установлен - проверка осуществляться не будет
- «Плановый остаток может не удовлетворять ограничениям» - Если флаг установлен, изменение значения лимита будет осуществлено даже если целевое значение противоречит плановому остатку по выбранной денежной позиции. В противном случае система вернет ошибку.

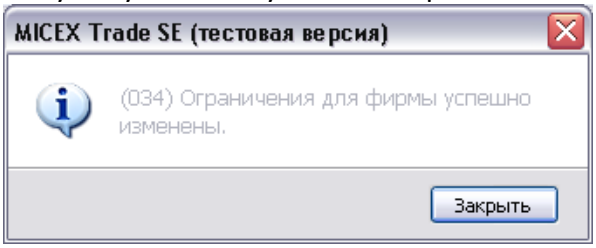


Например, устанавливается лимит 150 000 рублей на денежную позицию UTSR, код позиции 200103AA7348.

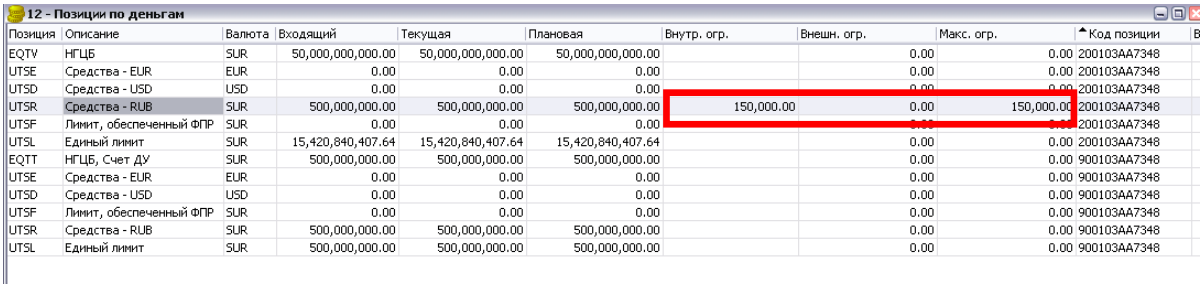
4. В окне с подтверждением еще раз нажимается «Да»



В случае успешной установки признака появляется окно



5. В окне «Позиции по деньгам» денежной позиции, в столбцах «Внутр. огр.» и «Макс. огр.» будет стоять указанное значение.


12 - Позиции по деньгам

Позиция	Описание	Валюта	Входящий	Текущая	Плановая	Внутр. огр.	Внешн. огр.	Макс. огр.	Код позиции
EQTV	НГЦБ	SUR	50,000,000,000.00	50,000,000,000.00	50,000,000,000.00		0.00	0.00	200103AA7348
UTSE	Средства - EUR	EUR	0.00	0.00	0.00		0.00	0.00	200103AA7348
UTSD	Средства - USD	USD	0.00	0.00	0.00		0.00	0.00	200103AA7348
UTSR	Средства - RUB	SUR	500,000,000.00	500,000,000.00	500,000,000.00	150,000.00	0.00	150,000.00	200103AA7348
UTSF	Лимит, обеспеченный ФПР	SUR	0.00	0.00	0.00				200103AA7348
UTSL	Единый лимит	SUR	15,420,840,407.64	15,420,840,407.64	15,420,840,407.64		0.00	0.00	200103AA7348
EQTT	НГЦБ, Счет ДУ	SUR	500,000,000.00	500,000,000.00	500,000,000.00		0.00	0.00	900103AA7348
UTSE	Средства - EUR	EUR	0.00	0.00	0.00		0.00	0.00	900103AA7348
UTSD	Средства - USD	USD	0.00	0.00	0.00		0.00	0.00	900103AA7348
UTSF	Лимит, обеспеченный ФПР	SUR	0.00	0.00	0.00		0.00	0.00	900103AA7348
UTSR	Средства - RUB	SUR	500,000,000.00	500,000,000.00	500,000,000.00		0.00	0.00	900103AA7348
UTSL	Единый лимит	SUR	500,000,000.00	500,000,000.00	500,000,000.00		0.00	0.00	900103AA7348

NB Для снятия этого признака необходимо повторить пп. 1-2. Далее в

появившемся окне снимается флаг «Проверять» и нажимается «Да»

NB НКЦ как клиринговая организация имеет право на установку лимита денежной позиции Участника. В случае такой установки лимиты НКЦ будут отображаться в столбце «Внеш. огр.». В таком случае проверка осуществляется по наибольшему из лимитов установленных Участником и НКЦ (наибольшее значение отображается в столбце «Макс. огр.»).

NB В случае если текущая плановая позиция меньше чем желаемое ограничение и при установлении ограничения был установлен флаг «Плановый остаток может не удовлетворять ограничениям», то в дальнейшем допускается подача только таких заявок и отчетов на исполнение, при которых Плановая позиция станет больше установленного лимита.