



MOSCOW  
EXCHANGE

# Интерфейс в терминале MicexTradeSE

Март, 2016

# Оглавление

<u>Торгово-клиринговый счет имущественного пула</u> .....	3
<u>Заведение ценных бумаг в пул</u> .....	4
<u>Заведение денежных средств в пул</u> .....	6
<u>Позиции по деньгам и инструментам</u> .....	8
<u>Переводы, позиции по инструментам на торговых счетах</u> .....	9
<u>Подача заявки на заключение сделки РЕПО с КСУ</u> .....	10
<u>Доступ к СУО НРД через терминал MTSE</u> .....	12
<u>Сервисы СУО для управления обеспечением через терминал MicexTradeSE доступны через вкладку НРД</u> .....	13
<u>Анкета маркирования</u> .....	14
<u>Ввод строк анкеты маркирования</u> .....	15
<u>Подбор активов в пул с использованием сервисов СУО НРД</u> .....	16



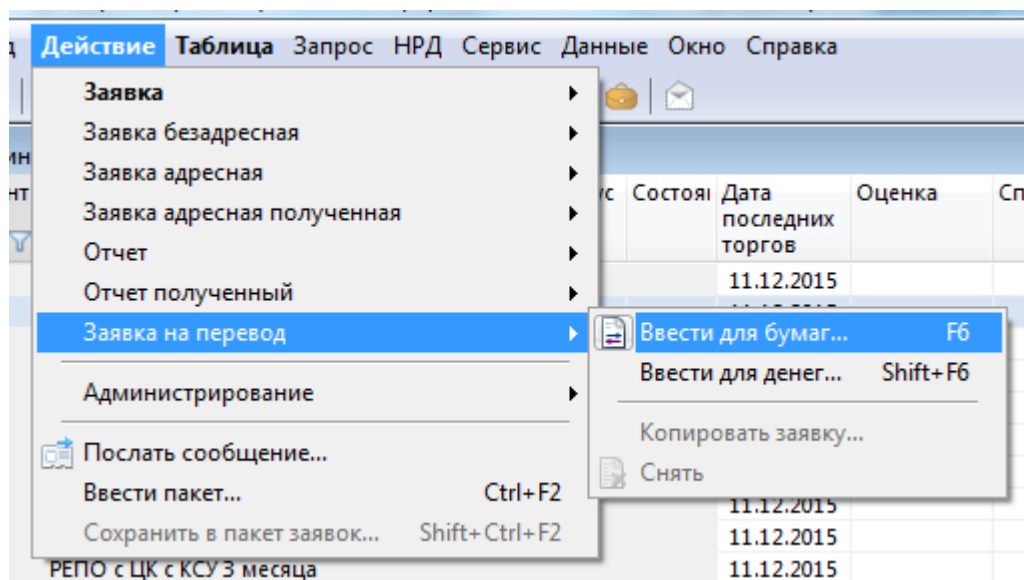
# Торгово-клиринговый счет имущественного пула

- Для заключения сделок РЕПО с КСУ необходимо зарегистрировать ТКС пула
- На основании Заявления на регистрацию ТКС имущественного пула НКЦ:
  - 1) Открывает Расчетный код имущественного пула; тип Расчетного кода совпадает с типом Расчетного кода в ТКС Т+, указанного в Заявлении
  - 2) Открывает счета Обеспечения 30420 в каждой валюте, принимаемой в имущественный пул
  - 3) Дает поручение НРД на открытие субсчета депо имущественного пула, тип субсчета совпадает с типом счета депо в ТКС Т+, указанного в Заявлении на регистрацию ТКС имущественного пула

Торговый	Описание	Код позиции	Счет депо	Статус	Типы за:	Признак	Запрет	Расчет:	Расчет:	Раздел счета	Депо	Связанный то
D01-00000F00	Счет доверительного уп...	900103AA4303	HD1512230081		КП_ (3)			НРД	НКЦ	31MC0146600000F03		
D01+00000F00	Счет доверительного уп...	900103AA4303	HD1512230081		КП_ (3)	Да		НКЦ	НКЦ	36MC0146600000F03		
D01b00000F00	пул GCBONDS	05585GCB	HB151207002B		КП_ (3)	Да	Да	НКЦ	НКЦ	8DMC0146600000F03		D01+00000F00
L01-00000F00	Клиентский счет 1	500103A01058	MHL000001960		КП_ (3)			НРД	НКЦ	31MC0146600000F01		
L01+00000F00	Клиентский счет 1	500103A01058	MHL000001960		КП_ (3)	Да		НКЦ	НКЦ	36MC0146600000F01		
L01b00000F00	пул GCBONDS	35761GCB	GCPNCC000002		КП_ (3)	Да	Да	НКЦ	НКЦ			L01+00000F00
S01-00000F00	Собственный счет фирмы	200103AA4303	HS151223005B		КП_ (3)			НРД	НКЦ	31MC0146600000F00		
S01+00000F00	Собственный счет фирмы	200103AA4303	HS151223005B		КП_ (3)	Да		НКЦ	НКЦ	36MC0146600000F00		
S01b00000F00	пул GCBONDS	01123GCB	HB151207002B		КП_ (3)	Да	Да	НКЦ	НКЦ	8SMC0146600000F00		S01+00000F00

# Заведение ценных бумаг в пул

Пункт меню Действие -> Заявка на перевод -> Ввести для бумаг или наберите F6



В открывшемся окне нужно указать:

- Инструмент - Ценная бумага, который нужно зачислить в пул
- Лотов - Количество ценных бумаг, которые нужно зачислить в пул
- Со счета – ТКС, с которого будет производиться списание бумаг
- На счет - Пульный ТКС, на который будут зачисляться ценные бумаги

# Заведение ценных бумаг в пул. Окно заявки

Ввод заявки на перевод ценных бумаг

Перевод [Заполнить последней](#)

Режим:       Перевод в обеспечение:

Инструмент:

Номинал: 1 000 руб., Код расч.: T0

Лотов: 

1	10	50
100	500	1000

Размер лота: 1  
Бумаг: 100 000

Перевести остаток не больше указанного

Списать      Зачислить

Со счета:       На счет:

Код позиции: 200103AA4303      Код позиции: 01123GCB

Клиент:

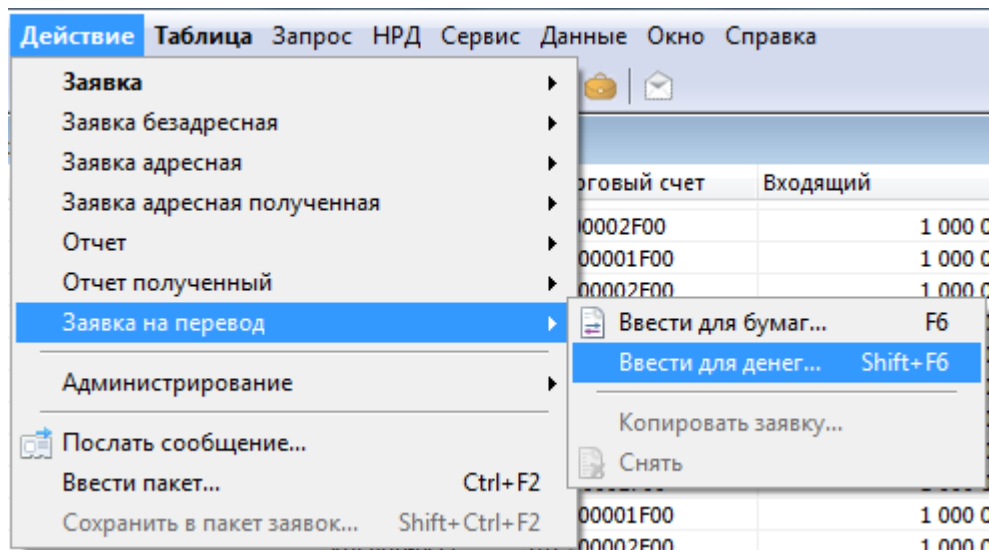
Поручение:



# Заведение денежных средств в пул

Пункт меню Действие -> Заявка на перевод -> Ввести для денег или наберите сочетание клавиш Shift+F6



В открывшемся окне укажите:

- Инструмент - Валюта, которую планируется зачислить в пул
- Объем - Сумма, которую планируется зачислить в пул
- Со счета - ТКС, с расчетного кода которого будет осуществлен перевод средств в пул
- На счет - Пульный ТКС, на расчетный код которого будут зачислены средства

# Заведение денежных средств в пул

## Окно заявки

Ввод заявки на перевод денежных средств

Перевод [Заполнить последней](#)

Режим:    
Инструмент:   Перевод в обеспечение:    
Сумма:    
 Перевести остаток не больше указанного

Списать  
Со счета:    
Код позиции: 200103AA4303  
Клиент:   ->  
Поручение:

Зачислить  
На счет:    
Код позиции: 01123GCB  
Клиент:    
Поручение:



# Позиции по деньгам и инструментам

\* 53 - Позиции по деньгам

Позиция	Код позиц	Валюта	Описание	Входящая	Текущая	Плановая	Нетто	Макс.	Внешн.	Зачисле	Списани	Контрольная	Расчетная
UTSD	01123GCB	USD	Средства - USD	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00			0,00	0,00
UTSE	01123GCB	EUR	Средства - EUR	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00			0,00	0,00
UTSR	01123GCB	SUR	Средства - RUB	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00			0,00	0,00
GCPR	01123GCB	SUR	Стоимость КСУ	306 272,00	306 454,00	306 454,00	306 454,00	0,00	0,00	182,00		306 272,00	306 454,00
MRCL	01123GCB	SUR	Маржинальное требование	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00				0,00	0,00
UTSL	01123GCB	SUR	Единый лимит	182,40	0,40	0,40	0,40	0,00	0,00			182,40	0,40
EQTV	200103AA4303	SUR	НГЦБ	50 000 000 000,00	50 000 000 000,00	50 000 000 000,00	50 000 000 000,00	0,00	0,00			50 000 000 000,00	50 000 000 000,00
RFND	200103AA4303	SUR	Передаваемые доходы	0,00	0,00	0,00	0,00					0,00	0,00
RFNE	200103AA4303	EUR	Передаваемые доходы (EUR)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00				0,00	0,00
RFNU	200103AA4303	USD	Передаваемые доходы (USD)	0,00	0,00	0,00	0,00					0,00	0,00
UTSD	200103AA4303	USD	Средства - USD	480 367,00	480 367,00	480 367,00	480 367,00	0,00	0,00			480 367,00	500 000,00
UTSE	200103AA4303	EUR	Средства - EUR	500 000,00	500 000,00	500 000,00	500 000,00	0,00	0,00			500 000,00	500 000,00
UTSR	200103AA4303	SUR	Средства - RUB	36,32	36,32	36,32	36,32	0,00	0,00			36,32	-1 861 633,05
MRCL	200103AA4303	SUR	Маржинальное требование	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00				0,00	0,00
UTSL	200103AA4303	SUR	Единый лимит	527 175 252,12	527 175 252,12	527 175 252,12	527 175 252,12	0,00	0,00			527 175 252,12	527 175 252,12
ECYK	500103A01058	CNY	НГЦБ, Счет клиента CNY	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	0,00	0,00			100 000 000,00	100 000 000,00
EEUK	500103A01058	EUR	НГЦБ, Счет клиента EUR	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	0,00	0,00			100 000 000,00	100 000 000,00
EGBK	500103A01058	GBP	НГЦБ, Счет клиента GBP	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	0,00	0,00			100 000 000,00	100 000 000,00
EQTV	500103A01058	SUR	НГЦБ	500 000 000,00	500 000 000,00	500 000 000,00	500 000 000,00	0,00	0,00			500 000 000,00	500 000 000,00
EUSK	500103A01058	USD	НГЦБ, Счет клиента USD	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	0,00	0,00			100 000 000,00	100 000 000,00
RFND	500103A01058	SUR	Передаваемые доходы	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00			0,00	0,00
RFNE	500103A01058	EUR	Передаваемые доходы (EUR)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00			0,00	0,00

\* [8 - Позиции по инструментам]

Инструм	Входящий	Текущий	Покупка	Продажа	Куплен	Продан	Код инструм	Код фирмы
ВТБ ао	500 200	500 200					VTBR	MC0146600000
ГАЗПРОМ ао	502 123	502 123					GAZP	MC0146600000
ГМКНорНик	500 000	500 000					GMKN	MC0146600000
КСУ обл.	0	183			183		GCP_BONDS	MC0146600000
ЛУКОЙЛ	500 000	500 000					LKOH	MC0146600000
ОФЗ 25080	998 395	998 395					SU25080RMFS1	MC0146600000
Роснефть	500 000	500 000					ROSN	MC0146600000
Сбербанк	500 000	500 000					SBER	MC0146600000



# Переводы, позиции по инструментам на торговых счетах

1 - Переводы

Перевод №	Время	Заявка №	Инструмент	Режим	З/С	Лоты	Объем	Торговый счет	Код позиции	Расчетн. Код	Примеч.	Код уча	Партнер
541 898 125	10:00:00	302 705 312	КСУ обл.	Автоматические переводы	КСУ	3	183	S01+00000F00	200103AA4303	НКЦ			Банк НКЦ АО

1 - КСУ обл. - Позиции по инструменту на торговых счетах

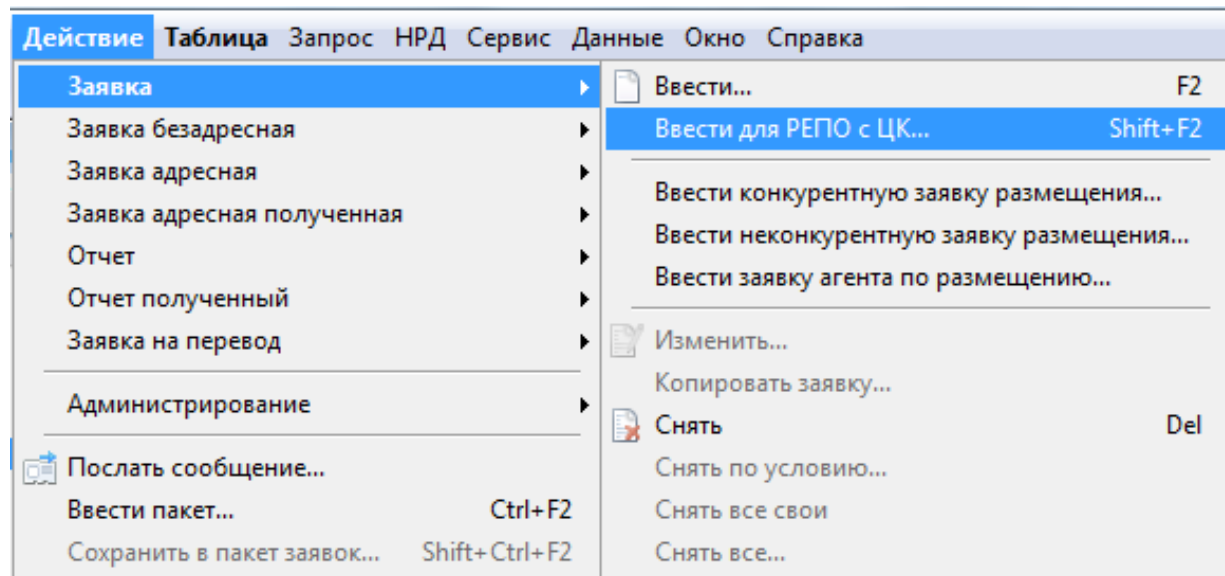
Торговый сч	Входящий	Текущий	Покупка:	Продажа:	Плановый	Контроль	Куплен	Продан	Код позиции	Расчетная	Призна	Внешн.	Лимит	Лимит	Лимит
S01+00000F00	0	0			0	0			200103AA4303	306 278	Да	0			

\* 16 - Позиции по инструментам на торговых счетах

Инстр	Торговый сч	Входящ	Текущи	Покупка:	Продажа:	Планов	Контро	Куплен	Продан	Код позиции	Расчетн	Призна
КСУ обл.	S01+00000F00	0	0			0	0			200103AA4303	306 278	Да
ГАЗПР...	S01-00000F00	500 000	500 000			500 000	500 000			200103AA4303	500 000	
ГМКНо...	S01-00000F00	500 000	500 000			500 000	500 000			200103AA4303	500 000	
ЛУКОЙЛ	S01-00000F00	500 000	500 000			500 000	500 000			200103AA4303	500 000	
Роснеф...	S01-00000F00	500 000	500 000			500 000	500 000			200103AA4303	500 000	
Сберба...	S01-00000F00	500 000	500 000			500 000	500 000			200103AA4303	500 000	
ВТБ ао	S01-00000F00	500 000	500 000			500 000	500 000			200103AA4303	500 000	
ОФЗ 25...	S01-00000F00	500 000	500 000			500 000	500 000			200103AA4303	500 000	
ГАЗПР...	S01с00000F00	1 000	1 000			1 000	1 000			01123GC	1 000	Да
ГАЗПР...	S01х00000F00	10	10			10	10			01123GCS	10	Да
ГАЗПР...	S01+00000F00	1 113	1 113			1 113	1 113			200103AA4303	1 113	Да
ОФЗ 25...	S01b00000F00	320	320			320	320			01123GCB	320	Да
ВТБ ао	S01х00000F00	200	200			200	200			01123GCS	200	Да
ОФЗ 25...	S01+00000F00	498 075	498 075			498 075	498 075			200103AA4303	498 075	Да

# Подача заявки на заключение сделки РЕПО с КСУ

Для ввода заявки на совершение сделки Биржевого РЕПО с КСУ выберите пункт меню Действие -> Заявка -> Заявка для РЕПО с ЦК или воспользуйтесь комбинацией клавиш Shift+F2



# Подача заявки на заключение сделки РЕПО с КСУ

Ввод заявки РЕПО с ЦК

Купить/Продать   Продать/Купить   [Заполнить последней](#)

Режим: РЕПО с ЦК с КСУ 1 день

Инструмент: КСУ обл.

Валюта расч.: руб.

Первая часть сделки РЕПО

Сумма РЕПО: 1000000,00

Лотов: 1 000

1	10	50
100	500	1000

Размер лота: 1 000  
Бумаг: 1 000 000  
НКД: 0,00  
Код расчетов: Y0   Дата расчетов: 14.03.2016

Вторая часть сделки РЕПО

Макс: 55,49

Ставка, %: 12,00

Мин: -35,41    $\frac{1}{T}$    Посл.

НКД: 0,00  
Срок РЕПО, дней: 1   Дата расчетов: 15.03.2016

Тип

Лимитная  
 Рыночная

Тип исполнения по остатку

Поставить в очередь  
 Снять остаток  
 Полностью или отклонить

Тип исполнения по цене

По разным ценам  
 По одной цене

Заявка маркет-мейкера

Риск-параметры

Расчетная цена: 1,00

Дисконт, %: 0,00

Расч.цена с учетом дисконта: 1,00

Торговый счет: S01+00000F00   Код позиции: 200103AA4303

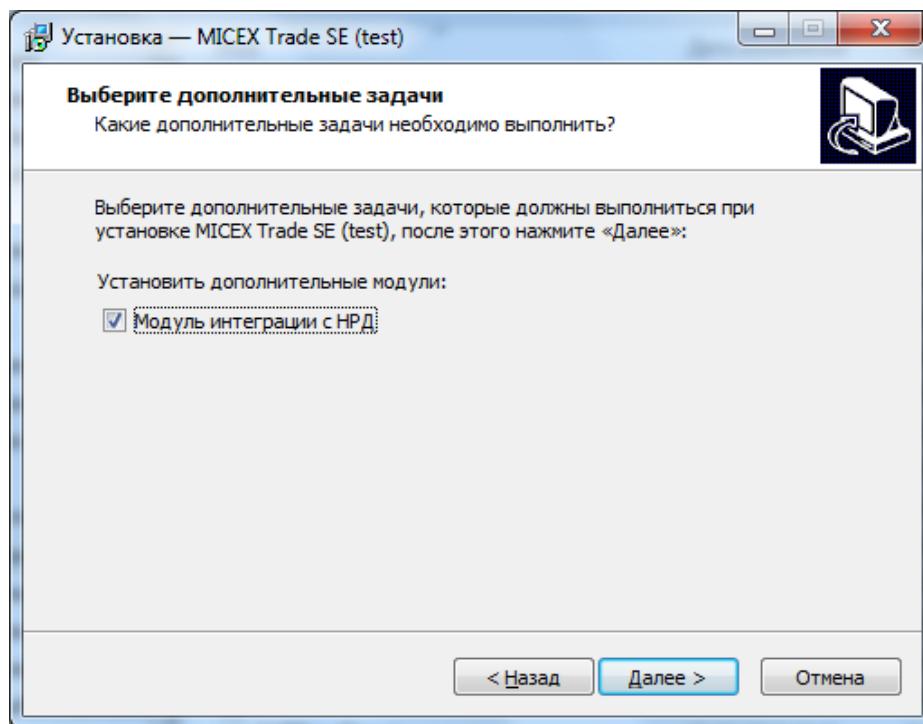
Клиент:   Поручение:



# Доступ к СУО НРД через терминал MTSE

- Необходимо обновить торговый терминал с указанием из программы установки **«Модуль интеграции с НРД»**
- При автоматическом обновлении терминала при подключении к торговой системе данный модуль доступен не будет
- В терминале **MICEX Trade SE** это выглядит так:



# Сервисы СУО для управления обеспечением через терминал MiсexTradeSE доступны через вкладку НРД

Тестовый идентификатор 2 - Управляющий фирмы - MICEX Trade SE (тестовая версия)

Сеанс Вид Действие Таблица Запрос НРД Сервис Данные Окно Справка

0 - Сделки

Сделка №	Время	Тип	Заявка №	Партнер	Лоты	Объем	Объем НКД	Торговый счет
1002	25.07.2014		11 485 001 266	MOEX				
1004	25.07.2014		11 485 001 267	MOEX				
54531920	03.07.2014		67 418 367	MOEX				
54531922	03.07.2014		67 418 369	MOEX				
55558908	08.07.2014		69 847 226	MOEX				
55558910	08.07.2014		69 848 292	MOEX				
55558914	08.07.2014		69 849 560	MOEX				
56747152	10.07.2014		71 662 243	MOEX				
64271980	15.07.2014		74 401 153	MOEX				
69528502	28.07.2014		81 407 741	MOEX				3 000 000,00
69950001	29.07.2014		81 774 949	MOEX				

\* 11 - НРД: Сделки в клиринге - 17:10:48

Номер	Дата сделки	Номер заявки	Плоск	Объем	Объем, исполненный НРД
				11,00	
				22,00	
				1 000 000,00	
				2 000 000,00	
				8 000 000,00	
				9 000 000,00	
				10 000 000,00	
	08.07.2014	09.07.2014		3 000 000,00	
	10.07.2014	17.07.2014		3 000 000,00	
	15.07.2014	16.07.2014		3 000 000,00	
	28.07.2014	04.08.2014		3 000 000,00	3 000 000,00
	29.07.2014	30.07.2014		1 300 000,00	

Меню НРД:

- Анкета маркирования...
- Поручение на замену обеспечения...
- Состояние обеспечения
- Бумаги в обеспечении
- Сделки в клиринге
- Бумаги в обеспечении под сделкой
- Состояние поручений
- Корзины ценных бумаг
- Состав корзин ценных бумаг
- Дисконты и параметры обеспечения
- Остатки бумаг на разделах
- Депозитарные счета
- Торговые банковские счета



# Анкета маркирования

- в терминале выберите пункт НРД-> Анкета маркирования
- можно изменить строки анкеты, поменяв их местами или исправив любой атрибут, а также добавить строку с выбранными атрибутами. Нажмите кнопку «Ввести поручение»

№ п/п	Код инструмента	Инструмент	Группа сделок	Количество	Счет депо	Раздел счета депо	Торговля	Правила	Цена подбора	Дисконт
1	MSNG	+МосЭнерго	GNCC	20 000	HS1212115419	36MC0128800000F00	Да		0,8180	45,00%
2	RU000A0JUP14	100 КЖИ, АО ао01	CBR1	Любое	MS100616006A	000000000000000000				0,00%
3			CBR1,GNCC	Любое	HS1212115419	36MC0128800000F00	Да			
4			GNCC	Любое	TS121207032B	000000000000000000	Да			

Счет вывода:  Раздел счета:  Торговый счет:

Считать указанную в сделке корзину переменной

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

# Ввод строк анкеты маркирования

- анкета маркирования определяет правила, с каких разделов счетов депо (группа полей, относящаяся к счетам подбора) на какие разделы счетов депо (группа полей, относящаяся к счетам поставки) может производиться подбор
- порядок строк в анкете определяет, в какой последовательности эти правила подбора будут выполняться

Заявка на маркировку

Инструмент: < все инструменты >

Количество: [input field]

Стоимость по макс.дисконту: -

Включить в список обеспечения для подбора  
 Исключить из списка обеспечения для подбора

Группа сделок: GNCC

Счет депо подбора: HS1512230070

Раздел счета депо подбора: 36MC0128800000F00

Торговый счет подбора: S01+00000F00

Счет депо поставки: HX151102002C

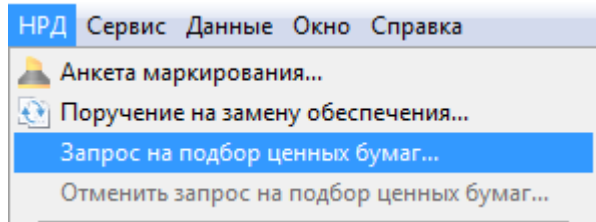
Раздел счета депо поставки: 8SMC0128800000F00

Торговый счет поставки: S01b00000F00

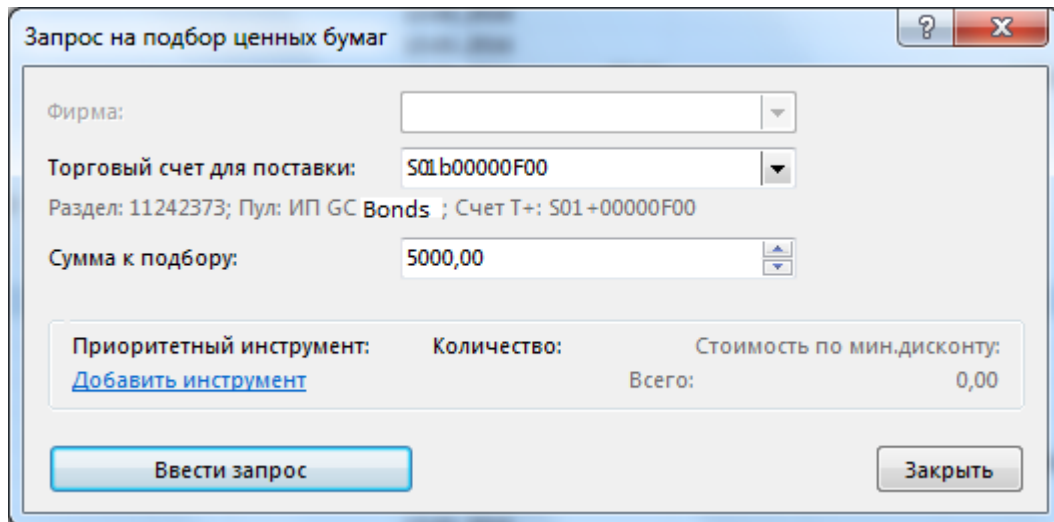
Да      Закрыть

# Подбор активов в пул с использованием сервисов СУО НРД

Для подбора активов в терминале необходимо выбрать НРД-> Запрос на подбор ценных бумаг



- «Торговый счет для поставки» - необходимое для заполнения поле, нужно указать соответствующий пульный ТКС, связанный с ТКС Т+, на который будут зачислены КСУ
- Также необходимо указать либо сумму, необходимую к подбору (поле «Сумма к подбору»), либо ценные бумаги и их количество (поля «Приоритетный инструмент» и «Количество»)
- Можно указать и сумму, и количество ценных бумаг к подбору. В этом случае будет подобрано активов не более, чем на указанную сумму, в количестве не превышающем указанное в поручении

A screenshot of a dialog box titled 'Запрос на подбор ценных бумаг'. It contains the following fields and controls:

- 'Фирма:' dropdown menu.
- 'Торговый счет для поставки:' dropdown menu with value 'S01b00000F00'.
- 'Раздел: 11242373; Пул: ИП GC Bonds ; Счет Т+: S01+00000F00'.
- 'Сумма к подбору:' spinner box with value '5000,00'.
- A table with columns: 'Приоритетный инструмент:', 'Количество:', 'Стоимость по мин.дисконту:'. Below the table is a blue link 'Добавить инструмент' and the text 'Всего: 0,00'.
- 'Ввести запрос' button.
- 'Закрыть' button.

# Раскрытие информации

Настоящая презентация была подготовлена и выпущена Публичным акционерным обществом «Московская Биржа ММВБ-ПТС» (далее – «Компания»). Если нет какой-либо оговорки об ином, то Компания считается источником всей информации, изложенной в настоящем документе. Данная информация предоставляется по состоянию на дату настоящего документа и может быть изменена без какого-либо уведомления.

Данный документ не является, не формирует и не должен рассматриваться в качестве предложения или же приглашения для продажи или участия в подписке, или же, как побуждение к приобретению или же к подписке на какие-либо ценные бумаги, а также этот документ или его часть или же факт его распространения не являются основанием и на них нельзя полагаться в связи с каким-либо предложением, договором, обязательством или же инвестиционным решением, связанными с ним, равно как и он не является рекомендацией относительно ценных бумаг компании.

Изложенная в данном документе информация не являлась предметом независимой проверки. В нем также не содержится каких-либо заверений или гарантий, сформулированных или подразумеваемых и никто не должен полагаться на достоверность, точность и полноту информации или мнения, изложенного здесь. Никто из Компании или каких-либо ее дочерних обществ или аффилированных лиц или их директоров, сотрудников или работников, консультантов или их представителей не принимает какой-либо ответственности (независимо от того, возникла ли она в результате халатности или чего-то другого), прямо или косвенно связанной с использованием этого документа или иным образом возникшей из него.

Данная презентация содержит прогнозные заявления. Все включенные в настоящую презентацию заявления, за исключением заявлений об исторических фактах, включая, но, не ограничиваясь, заявлениями, относящимися к нашему финансовому положению, бизнес-стратегии, планам менеджмента и целям по будущим операциям являются прогнозными заявлениями. Эти прогнозные заявления включают в себя известные и неизвестные риски, факторы неопределенности и иные факторы, которые могут стать причиной того, что наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, будут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются под этими прогнозными заявлениями. Данные прогнозные заявления основаны на многочисленных презумпциях относительно нашей нынешней и будущей бизнес-стратегии и среды, в которой мы ожидаем осуществлять свою деятельность в будущем. Важнейшими факторами, которые могут повлиять на наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, которые могут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются этими прогнозными заявлениями являются, помимо иных факторов, следующие:

- восприятие рыночных услуг, предоставляемых Компанией и ее дочерними обществами;
- волатильность (а) Российской экономики и рынка ценных бумаг и (b) секторов с высоким уровнем конкуренции, в которых Компания и ее дочерние общества осуществляют свою деятельность;
- изменения в (а) отечественном и международном законодательстве и налоговом регулировании и (b) государственных программах, относящихся к финансовым рынкам и рынкам ценных бумаг;
- ростом уровня конкуренции со стороны новых игроков на рынке России;
- способность успевать за быстрыми изменениями в научно-технической среде, включая способность использовать расширенные функциональные возможности, которые популярны среди клиентов Компании и ее дочерних обществ;
- способность сохранять преэминентность процесса внедрения новых конкурентных продуктов и услуг, равно как и поддержка конкурентоспособности;
- способность привлекать новых клиентов на отечественный рынок и в зарубежных юрисдикциях;
- способность увеличивать предложение продукции в зарубежных юрисдикциях.

Прогнозные заявления делаются только на дату настоящей презентации, и мы точно отрицаем наличие любых обязательств по обновлению или пересмотру прогнозных заявлений в настоящей презентации в связи с изменениями наших ожиданий, или перемен в условиях или обстоятельствах, на которых основаны эти прогнозные заявления.



# КОНТАКТНАЯ ИНФОРМАЦИЯ

## **Сергей Титов**

Начальник Управления продаж  
+7 (495) 363-3232, доб. 26129  
[Sergey.Titov@moex.com](mailto:Sergey.Titov@moex.com)

## **Евгений Головин**

Начальник Управления развития  
+7 (495) 363-3232, доб. 26130  
[Eugeney.Golovin@moex.com](mailto:Eugeney.Golovin@moex.com)

## **Яна Морякова**

Руководитель направления  
Управление продаж  
+7 (495) 363-3232, доб. 26125  
[Yana.Moryakova@moex.com](mailto:Yana.Moryakova@moex.com)

## **Наиля Юнусова**

Ведущий специалист  
Отдела анализа и развития бизнеса  
+7 (495) 363-3232, доб. 26128  
[Nailia.Yunysova@moex.com](mailto:Nailia.Yunysova@moex.com)

