

Новая услуга НКЦ: «Неттинг по итогам клиринга на ЕТС»

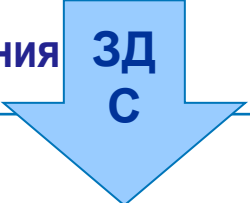
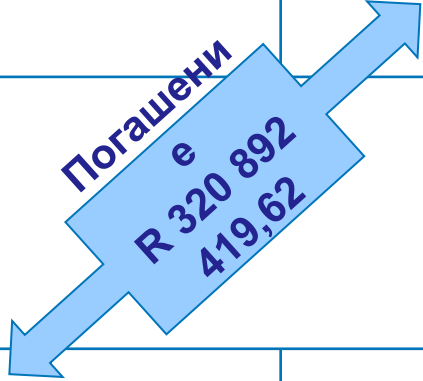
**ЗАО АКБ «Национальный
Клиринговый Центр»**

*Москва
Декабрь 2009 г.*

Инструменты управления ликвидностью для участников клиринга

Наименование документов	ЭДО	SWIFT	Бумажный носитель	Сроки представления МСК
Запрос на изменение торгового лимита	+		+	с 10:00 до 16:45
Запрос на депонирование денежных средств (ЗДС)	+	+	+	до 15:30 (13:15*) *сроки для УК через РРЦ
Запрос на возврат денежных средств (ВДС)	+	+	+	€ 17:00 (17:00*) \$ 20:00 (20:00*) R 20:00 (17:00*)
Постоянное поручение на возврат денежных средств	+		+	Единовременно
Постоянный запрос на изменение торгового лимита			+	Единовременно
Поручение на неттинг по итогам клиринга	+		+	до 15:30 (13:15*) до 16:30 (15:30*)
Постоянное поручение на неттинг по итогам клиринга	+		+	Единовременно

Использование ЗДС для управления ликвидностью при расчетах

Пара	Обязательства	Требования	ЗДС
EUR/RUB	€ 19 300 000	R 841 675 551,46	
			
USD/RUB	R 320 892 419,62	\$ 10 000 000	

Использование ЗДС для управления ликвидностью при расчетах

Пара	Обязательства	Требования
EUR/RUB	€ 5 658 000	R 251 018 486, е € 5 658 000
EUR/USD	\$ 7 468 345,30	€ 5 658 000
USD/RUB	R 329 702 129 (своб. деж. средства 93 486 526,78)	\$ 9 874 000

Diagram illustrating the use of ZDS (ЗДС) for liquidity management in payments across three currency pairs:

- EUR/RUB:** Obligation of € 5 658 000 is settled (Погашение) by a requirement of R 251 018 486 and € 5 658 000.
- EUR/USD:** Obligation of \$ 7 468 345,30 is settled (Погашение) by a requirement of € 5 658 000.
- USD/RUB:** Obligation of R 329 702 129 (free current assets: 93 486 526,78) is settled (Погашение) by a requirement of \$ 9 874 000.

Large blue arrows labeled **ЗДС** indicate the flow of ZDS from the requirements side.

Недостатки существующей схемы

- ❑ Существенная операционная нагрузка на участников в условиях жестких временных рамок, т.е. требуется:
 - выбрать обязательство(а);
 - рассчитать требуемую(е) сумму(ы) денежных средств, учитывая при этом денежные средства, зарезервированные для участия в торгах на ЕТС, и перечислить на счет НКЦ;
 - сформировать и направить в адрес НКЦ до трех запросов на депонирование денежных средств (возможно в течении 15-20 минут).
- ❑ Отвлечение денежных средств для исполнения перед НКЦ обязательств по итогам клиринга, даже при условии, что для исполнения своих обязательств по итогам клиринга по трем парам сумм причитающихся денежных средств достаточно для исполнения всех обязательств по итогам клиринга по всем трем (двум) парам.

Новая услуга НКЦ: «Неттинг по итогам клиринга на ЕТС»

Содержание услуги «Неттинг по итогам клиринга на ETC»

Предоставление Участнику клиринга возможности одновременно исполнить обязательства по итогам клиринга по сделкам, заключенным в рамках трех Торговых сессий по EUR/RUB, USD/RUB, EUR/USD или любой их комбинации без перечисления денежных средств в размере обязательств по каждой из Торговых сессий ETC за счет причитающихся денежных средств по итогам клиринга и депонированных им денежных средств, не учтенных для расчета торговых лимитов.

Технологическая схема услуги. Разовое поручение. (Начало)

1. До 15:30 мск, (до 13:15 для региональных участников) Участник клиринга направляет в адрес НКЦ поручение на неттинг по итогам клиринга.
2. До 15:40 мск, (до 14:40 для региональных участников) НКЦ производит расчет «нетто-нетто» обязательств данного Участника клиринга с учетом сумм, причитающихся ему по итогам клиринга по сделкам в сегментах EUR/RUB, USD/RUB, EUR/USD.
3. При достаточности денежных средств до 15:40 мск (до 14:40 для региональных участников) НКЦ направляет в адрес данного Участника клиринга уведомление об исполнении им обязательств по итогам клиринга на ETC.
4. При недостаточности денежных средств до 15:40 мск (до 14:40 для региональных участников) НКЦ направляет в адрес данного Участника клиринга уведомление, которым он оповещается о неисполнении обязательств по итогам клиринга на ETC с указанием сумм(ы) денежных средств, которых(ой) оказалось недостаточно для исполнения обязательств по итогам клиринга на ETC.

Технологическая схема услуги. Разовое поручение. (Продолжение)

5. До 16:30 мск (до 15:30 для региональных участников) Участник клиринга имеет право направлять в адрес НКЦ поручение(я) на неттинг и осуществлять перевод суммы (сумм), указанной(ых) в отчете на предыдущие поручение(я) на неттинг.
6. До 16:40 мск (до 15:40 для региональных участников) НКЦ проводит расчет «нетто-нетто» обязательств с учетом сумм, причитающихся Участнику по итогам клиринга по сделкам в сегментах EUR/RUB, USD/RUB, EUR/USD и поступивших на счета НКЦ к 16:30 мск (к 15:30 для региональных участников).
7. При достаточности денежных средств НКЦ до 16:40 мск (до 15:40 для региональных участников) направляет в адрес данного Участника клиринга уведомление об исполнении им обязательств по итогам клиринга на ETC.
8. При недостаточности денежных средств НКЦ до 16:40 мск (до 15:40 для региональных участников) направляет в адрес данного Участника клиринга уведомление, которым он оповещается о неисполнении обязательств по итогам клиринга на ETC с указанием сумм(ы) денежных средств, которых(ой) оказалось недостаточно для исполнения обязательств по итогам клиринга на ETC.

Технологическая схема услуги. Разовое поручение. (Продолжение)

9. Если **до 16:30 мск (до 15:30 для региональных участников)** Участник не прислал повторно поручение на неттинг И/ИЛИ не перечислил недостающие денежные средства, то для НКЦ этот факт означает, что Участник будет исполнять свои обязательства по итогам клиринга на ЕТС перед НКЦ в суммах указанных в биржевых свидетельствах и в сроки, установленные Правилами клиринга.
0. При несоблюдении сроков исполнения обязательств Участникам, НКЦ **ВПРАВЕ** провести с Участником Дополнительные сессии по EUR/RUB, USD/RUB, EUR/USD
1. Если участник, в поручении указал опцию «возврат», и НКЦ направил Участнику отчет об исполнении им обязательств по итогам клиринга на ЕТС, то участнику клиринга возвращаются остатки денежных средств, сформировавшиеся после проведения неттинга по итогам клиринга на ЕТС, за вычетом сумм депонированных денежных средств, учтенных для расчета торговых лимитов.

Форма разового поручения

ПОРУЧЕНИЕ

на неттинг по итогам клиринга на ETC
(Оформляется на бланке организации)

_____ /
(полное наименование Участника клиринга)

расчетный код участника клиринга: _____

- В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии межбанковских валютных бирж просим Вас провести неттинг по итогам клиринга по сделкам, заключенным в ходе Торговых сессий по евро, долларам США и евро за доллары США, которые завершатся «__» _____ 20__ г.
- (если есть необходимость воспользоваться опцией «возврат»)
- , а также осуществить возврат остатков предварительно депонированных денежных средств после исполнения нашей Организацией обязательств по итогам клиринга на ETC путем перечисления соответствующих денежных средств на корреспондентский(ие) счет(а), указанный(е) нашей Организацией в Перечне платежных реквизитов, представленных в ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр».

(Должность руководителя)

_____ / Ф.И.О. /

(Главный бухгалтер)

_____ / Ф.И.О. /

М.П.

«__» _____ 200__ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Уведомление

Настоящим, ЗАО АКБ «Национальный клиринговый центр» подтверждает исполнение _____, (расчетный код участника клиринга:___)

(полное наименование Участника клиринга)

обязательств по итогам клиринга по сделкам, заключенным в ходе Торговых сессий по евро, долларам США и евро за доллары США, которые завершились «__» _____ 20__г.

(Ответственное лицо

ЗАО АКБ «Национальный клиринговый центр»)

_____ / Ф.И.О. /

Уведомление

Настоящим, ЗАО АКБ «Национальный клиринговый центр» извещает
_____ (расчетный код участника клиринга: _____)

(полное наименование Участника клиринга)

о неисполнении Вашей Организацией обязательств по итогам клиринга по сделкам, заключенным в ходе Торговых сессий по евро, долларам США и евро за доллары США, которые завершились «_» _____ 20__г. по причине недостаточности денежных средств на счете(ах) НКЦ в сумме(ах):

в долларах США:

в евро:

в российских рублях:

(Ответственное лицо
ЗАО АКБ «Национальный клиринговый центр»)

_____ / Ф.И.О. /

Технологическая схема услуги. Постоянное поручение. (Начало)

1. Участник направляет в НКЦ Постоянное поручения на неттинг с указанием даты, с которой НКЦ должен ежедневно осуществлять неттинг по итогам клиринга на ETC.
2. НКЦ до 15:40 мск (до 14:40 для участников, осуществляющих расчеты через РРЦ) производит расчет «нетто-нетто» обязательств с учетом сумм, причитающихся Участнику по итогам клиринга по сделкам в сегментах EUR/RUB, USD/RUB, EUR/USD.
3. При достаточности денежных средств до 15:40 мск (до 14:40 для участников, осуществляющих расчеты через РРЦ) НКЦ направляет в адрес данного Участника клиринга уведомление об исполнении им обязательств по итогам клиринга на ETC.
4. При недостаточности денежных средств НКЦ до 15:40 мск (до 14:40 для участников, осуществляющих расчеты через РРЦ) направляет в адрес данного Участника клиринга уведомление, которым он оповещается о неисполнении обязательств по итогам клиринга на ETC с указанием сумм(ы) денежных средств, которых(ой) оказалось недостаточно для исполнения обязательств по итогам клиринга на ETC.

Технологическая схема услуги. Постоянное поручение. (Продолжение)

5. Участник обеспечивает зачисление требуемых сумм денежных средств на счета НКЦ до 16:30 мск (до 15:30 для участников, осуществляющих расчеты через РРЦ).
6. До 16:40 мск (до 14:40 для участников, осуществляющих расчеты через РРЦ) НКЦ, проводится расчет «нетто-нетто» обязательств с учетом сумм, причитающихся Участнику по итогам клиринга по сделкам в сегментах EUR/RUB, USD/RUB, EUR/USD и поступивших на счета НКЦ до 16:40 мск (до 15:40 для участников, осуществляющих расчеты через РРЦ).
7. При достаточности денежных средств НКЦ до 16:40 мск (до 15:40 для участников, осуществляющих расчеты через РРЦ) направляет Участнику уведомление об исполнении им обязательств по итогам клиринга на ETC.
8. При недостаточности денежных средств НКЦ до 16:40 мск (до 15:40 для участников, осуществляющих расчеты через РРЦ) направляет Участнику уведомление, которым он оповещается о неисполнении обязательств по итогам клиринга на ETC с указанием сумм(ы) денежных средств, которых(ой) оказалось недостаточно для исполнения обязательств по итогам клиринга на ETC.

Технологическая схема услуги. Постоянное поручение. (Продолжение)

9. Если до 16:30 мск (до 15:30 для участников, осуществляющих расчеты через РРЦ) не перечислил недостающие денежные средства, то для НКЦ этот факт означает, что Участник будет исполнять свои обязательства перед НКЦ в суммах указанных в биржевых свидетельствах и в сроки, установленные Правилами клиринга.
0. При несоблюдении сроков исполнения обязательств Участникам, НКЦ **ВПРАВЕ** провести с Участником Дополнительные сессии по EUR/RUB, USD/RUB, EUR/USD.
1. Если участник, в Постоянном поручении указал опцию «возврат», и НКЦ направил Участнику отчет об исполнении им обязательств по итогам клиринга на ETC, то участнику клиринга возвращаются остатки денежных средств, сформировавшиеся после проведения неттинга по итогам клиринга на ETC, за вычетом сумм депонированных денежных средств, учтенных для расчета торговых лимитов.

Форма постоянного поручения

ПОСТОЯННОЕ ПОРУЧЕНИЕ
на неттинг по итогам клиринга на ETC
(Оформляется на бланке организации)

(полное наименование Участника клиринга)
расчетный код участника клиринга: _____

- В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии межбанковских валютных бирж просим Вас с «_» _____ 200_г.* на постоянной основе проводить неттинг по итогам клиринга на ETC
-
- (если есть необходимость воспользоваться опцией «возврат»)
- и на постоянной основе осуществлять возврат остатка предварительно депонированных денежных средств после исполнения нашей Организацией обязательств по итогам клиринга путем перечисления соответствующих денежных средств на корреспондентские счета, указанные нашей Организацией в Перечне платежных реквизитов, представленных в ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр».
- Настоящее поручение действительно до его письменной отмены.

(Должность руководителя)

_____/ Ф.И.О. /

(Главный бухгалтер)

_____/ Ф.И.О. /

М.П.

«_» _____ 200_ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

* Постоянное поручение на возврат денежных средств принимается к исполнению Клиринговым центром с первого рабочего дня, следующего за датой поручения.

**Наш адрес: Россия, 125009, Москва,
Большой Кисловский переулок, 13**

Телефон: +7 (495) 782 97 94

E-mail: info@nkcbank.ru

http: [//www.nkcbank.ru](http://www.nkcbank.ru)