



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

3 апреля 2017

ЭЛЕКТРОННЫЙ МЭТЧИНГ

СОДЕРЖАНИЕ

- Принципы поиска потенциальных встречных поручений.3
- Схема взаимодействия.....6
- Определение релевантного поручения.....9
- Опции для клиентов.....10
- Особенности и примеры отчетов.....12
- Преимущества и расчетная дисциплина.....16



ПРИНЦИПЫ ПОИСКА ПОТЕНЦИАЛЬНЫХ ВСТРЕЧНЫХ ПОРУЧЕНИЙ

Только для квитанки по «**дате сделки**». Если в поручении заполнен референс, то потенциально встречные поручения (ПВП) не подбираются.

Если поручение депонента не нашло себе встречное поручение, система НРД будет подбирать все возможные встреченные поручения, которые отличаются на одно поле или одну группу полей.

ПВП формируются при наличие расхождений в следующих полях:

Счет и раздел Отправителя	Счет и раздел Получателя	Дата расчетов	Дата сделки	Направление
Условия расчетов	Сумма сделки	Тип DVP (1,2,3)	Валюта сделки и расчетов	Место заключения сделки

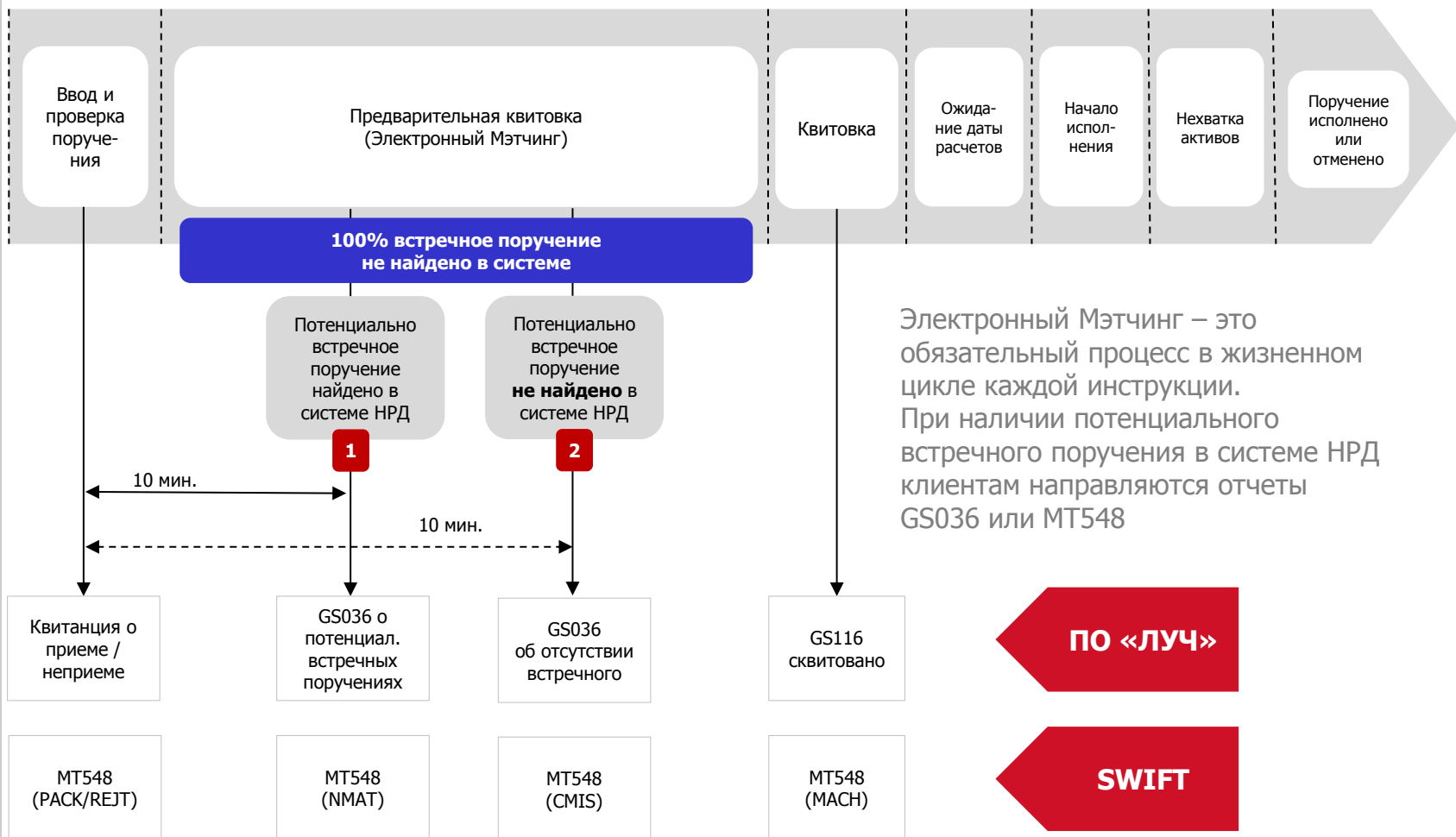
Поручение будет считаться потенциальным встречным, только если во встречных поручениях совпали остальные квитанционные поля, например инициатор и контрагент, код ценной бумаги, количество ценных бумаг, количество выпусков ценных бумаг в одном поручении и т.д.

РЕЗУЛЬТАТЫ ЭЛЕКТРОННОГО МЭТЧИНГА

В результате электронного мэтчинга появляется информация о потенциально встречных поручениях, которая предоставляется всем клиентам НРД в виде отчета:

- 1** GS036 / MT548 - уведомление о потенциальных встречных поручениях
Отчет предоставляется всем клиентам НРД по каналу взаимодействия, указанному в Анкете ЭДО. Отчет о потенциальных встречных поручениях напрямую связан со следующими отчетами:
- 2** GS036 / MT548 - уведомление об отсутствии / наличии встречного поручения
- 3** GS116 / MT548 - уведомление о сквитованных / несквитованных поручениях

ЖИЗНЕННЫЙ ЦИКЛ ПОРУЧЕНИЯ И ЭЛЕКТРОННЫЙ МЭТЧИНГ



ОБЩАЯ СХЕМА ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ



ПРИМЕР ОТЧЕТА GS036 О ПВП ДЛЯ КЛИЕНТА «А»

ЛУЧ

1. Рег. № поручения
2. Исходящий № поручения
3. Дата формирования

**Параметры
поручения №2**

4. Инициатор и Контрагент
5. Счет и раздел списания (идентификатор)
6. Счет и раздел зачисления (идентификатор)
7. Код операции
8. Дата расчетов (дата начала исполнения)
9. Место заключения сделки
10. Тип расчетов
11. Сумма сделки
12. Валюта сделки
13. Тип, №, дата документа - основания
14. Код ценной бумаги
15. Количество
16. Дата сделки

**Информация из
поручения №2**

17.11.2016

17. Причина расхождений
18. Релевантность поручения

NMAT//DTRD. Во встречном поручении рег.№ __ указано другое значение поля «Дата сделки»



ПРИМЕР ОТЧЕТА GS036 О ПВП ДЛЯ КЛИЕНТА «Б»

ЛУЧ

1. Рег. № поручения
2. Исходящий № поручения
3. Дата формирования

Параметры поручения №1

4. Инициатор и Контрагент
5. Счет и раздел списания (идентификатор)
6. Счет и раздел зачисления (идентификатор)
7. Код операции
8. Дата расчетов (дата начала исполнения)
9. Место заключения сделки
10. Тип расчетов
11. Сумма сделки
12. Валюта сделки
13. Тип, №, дата документа - основания
14. Код ценной бумаги
15. Количество
16. Дата сделки

Информация из поручения №1

16.11.2016

17. Причина расхождений
18. Релевантность поручения

NMAT//DTRD. Во встречном поручении рег.№ __ указано другое значение поля «Дата сделки»



КРИТЕРИИ ОПРЕДЕЛЕНИЯ РЕЛЕВАНТНОСТИ ПОРУЧЕНИЯ

Релевантное поручение – это потенциальное встречное поручение, которое наиболее подходит к поручению инициатора.

Для определения релевантности каждому типу расхождений присвоен определенный вес. **Релевантным** будет считаться то поручение, в котором расхождения имеет максимальный вес. Отчет обновляется при обнаружении в системе каждого потенциально встречного поручения в зависимости от описанных опций.

Весы для FOP поручений

Тип расхождений (квит. поле)		
1	Условия расчетов (FRAP)	950
2	Дата расчетов	900
3	Дата сделки	800
4	Счет/раздел отправителя	700
5	Счет/раздел получателя	700
6	Код операции	600

Весы для DVP поручений

Тип расхождений (квит. поле)		
1	Условия расчетов (FRAP)	950
2	Дата расчетов	900
3	Сумма сделки	850
4	Дата сделки	800
5	Счет/раздел отправителя	700
6	Счет/раздел получателя	700
7	Тип DVP (1,2,3)	650
8	Код операции	600
9	Валюта сделки/платежа	550
10	Место заключения сделки	500



ОПЦИИ ДЛЯ GS036 / MT548 (I)

Варианты предоставления отчетов

- **Отчет о релевантном встречном поручении (по умолчанию)**
- Отчет о всех потенциальных встречных поручениях

Для данной опции отчет по электронному мэтчингу (в зависимости от канала связи, указанного ниже) будет обновляться, только если новое потенциальное встречное поручение станет релевантным, т.е. вес расхождений с этим поручением будет больше чем у предыдущего

ЛУЧ

GS036 Уведомление «о потенциальных встречных поручениях»

- Отчет содержит информацию только об **одном** релевантном встречном поручении

SWIFT

Отчет MT548

- НРД отправляет **одно сообщение** MT548 с указанием кода расхождений с релевантным встречным поручением



ОПЦИИ ДЛЯ GS036 / MT548 (II)

Варианты предоставления отчетов

- Отчет о релевантном встречном поручении (по умолчанию)
- **Отчет о всех потенциальных встречных поручениях**

Для данной опции отчет по электронному мэтчингу (в зависимости от канала связи, указанного ниже) будет обновляться каждый раз при поступлении в систему нового потенциального встречного поручения

ЛУЧ

GS036 Уведомление «о потенциальных встречных поручениях»

- Отчет содержит информацию о **всех** подобранных потенциально встречных поручениях. Релевантное поручение отдельно выделяется в отчете.

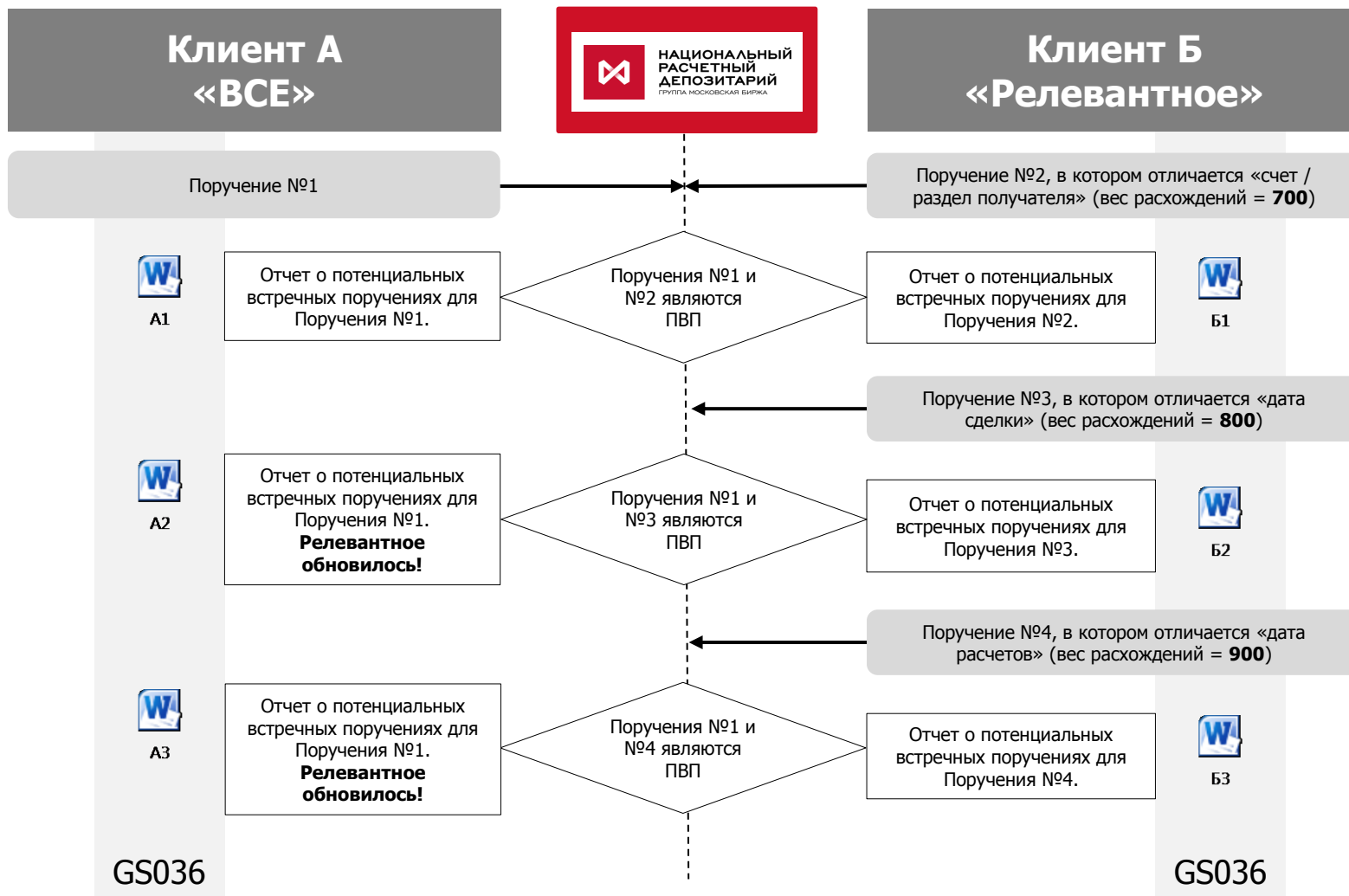
SWIFT

Отчет MT548

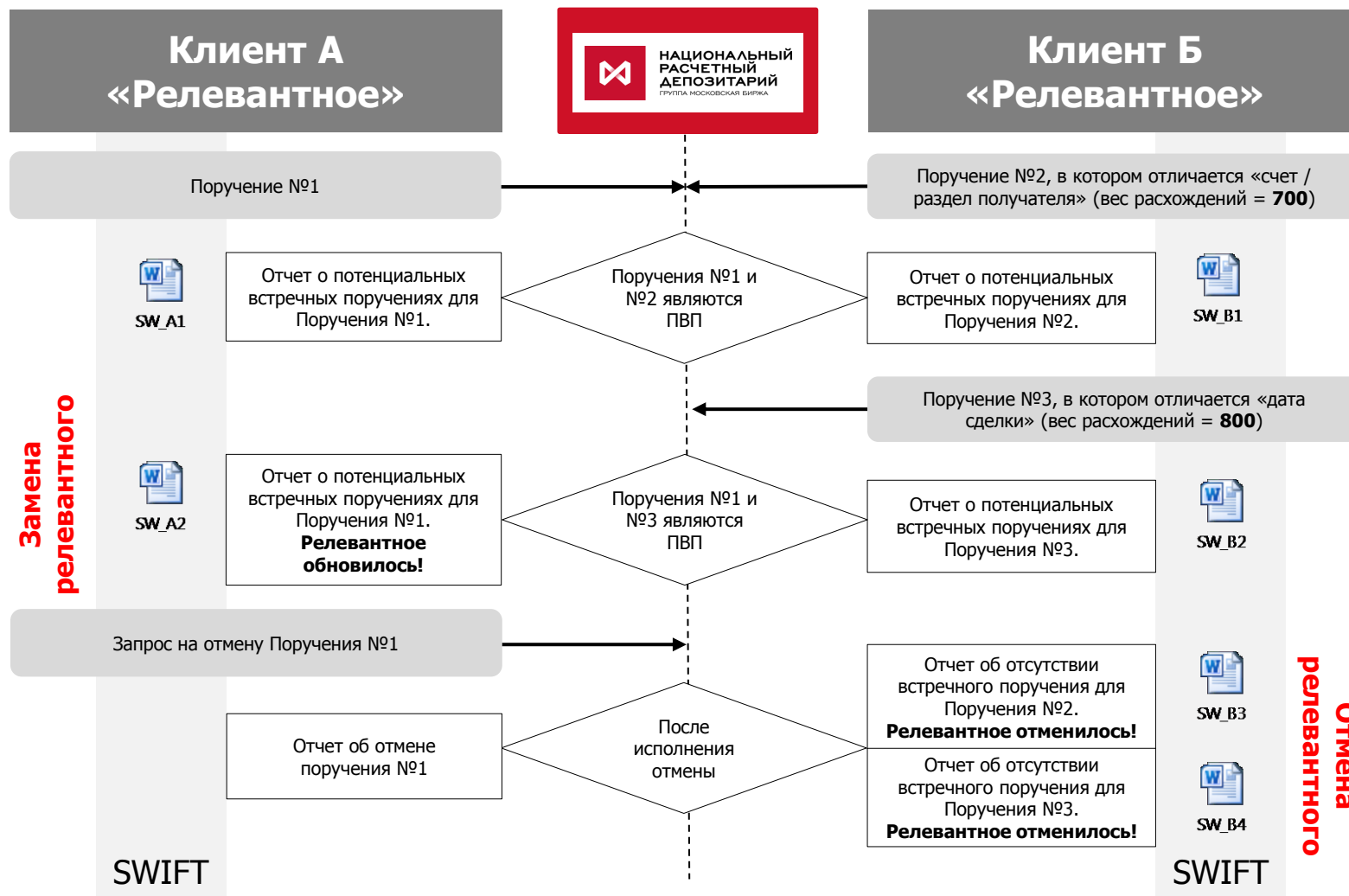
- НРД отправляет **отдельное сообщение** MT548 с указанием кода расхождений для каждого из потенциальных встречных поручений.



СХЕМА ДЛЯ РАЗНЫХ ОПЦИЙ



ЗАМЕНА И ОТМЕНА РЕЛЕВАНТНОГО



ОТЧЕТЫ В КОНЦЕ ОПЕРАЦИОННОГО ДНЯ

В отчете GS116 на конец операционного дня для несквитованных поручений отображается информация о релевантном встречном поручении при его наличии (опция по умолчанию)

Структура отчета:

Блок 1. Данный блок содержит информацию о:

- сквитованных поручениях Клиента
- несквитованных поручениях Клиента (квитовка «по референсу»)
- несквитованных поручениях Клиента (квитовка «по дате сделки»), к которым не найдены потенциальные встречные поручения

Электронный мэтчинг

Блок 2. Блок содержит информацию о:

- несквитованных поручениях Клиента (квитовка «по дате сделки»), к которым найдены потенциальные встречные поручения
- релевантные встречные поручения Контрагентов, которые подобраны к указанным выше поручениям Клиента.

Блок 3. Данный блок содержит информацию о всех

- выставленных в адрес Клиента встречных поручениях, которые не были сквитованы как «по дате сделке, так и «по референсу»

ОТЧЕТ О НАЛИЧИИ ВСТРЕЧНЫХ ПОРУЧЕНИЙ

Вариант предоставления отчета

- Отчет о наличии выставленных встречных поручениях депо предоставляется 3 раза в день

GS117 / MT586

- Сводный отчет* содержит информацию о всех выставленных в ваш адрес поручениях

Временной регламент

- Автоматическое формирование отчета несколько раз в день в 11:10, 14:10 и 17:10 (МСК)



ПРЕИМУЩЕСТВА ДЛЯ КЛИЕНТОВ

- 1 Возможность отказа от квитанки по телефону
- 2 Упрощение процесса предварительной квитанки поручений
- 3 Увеличение эффективности квитанки по «дате сделки»
- 4 Возможность электронной обработки инструкций и отчетов
- 5 Снижение риска незавершения расчетов



КВИТОВКА

- Виды квитанки
- Обязательные квитаночные поля



ВИДЫ КВИТОВКИ ПОРУЧЕНИЙ

FOP

СПОСОБ КВИТОВКИ	ЗАПОЛНЕНИЕ ПОЛЕЙ ПОРУЧЕНИЯ	ТИП ОПЕРАЦИИ	% ИСПОЛЬЗОВАНИЯ (ПО КОЛИЧЕСТВУ ПОРУЧЕНИЙ '2016)
ПО ДАТЕ СДЕЛКИ	Заполнено поле «Дата сделки» и не заполнено поле «Референс»	16 16/1	84%
ПО РЕФЕРЕНСУ	Заполнено поле «Референс». Обязательно заполняется поле «Дата сделки»	16 16/1	16%

DVP

СПОСОБ КВИТОВКИ	ЗАПОЛНЕНИЕ ПОЛЕЙ ПОРУЧЕНИЯ	ТИП ОПЕРАЦИИ	% ИСПОЛЬЗОВАНИЯ (ПО КОЛИЧЕСТВУ ПОРУЧЕНИЙ '2016)
ПО ДАТЕ СДЕЛКИ	Заполнено поле «Дата сделки» и не заполнено поле «Сделка №»	19/0 19/1	100%
ПО № СДЕЛКИ	Заполнено поле «Сделка №». Обязательно заполняется поле «Дата сделки»	19/0 19/1	0%



ОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ КВИТОВОЧНЫЕ ПОЛЯ ПРИ КВИТОВКЕ «ПО ДАТЕ СДЕЛКИ»

FOP

1	Контрагент
2	Счета депо
3	Разделы счетов
4	Дата расчетов/дата начала исполнения
5	Дата сделки
6	Код бумаги (ISIN)
7	Количество
8	Код операции

DVP

1	Контрагент
2	Счета депо
3	Разделы счетов
4	Дата расчетов
5	Дата сделки
6	Код бумаги (ISIN)
7	Количество
8	Код операции
9	Сумма сделки
10	Валюта сделки*
11	Тип DVP (1,2,3)
12	Место заключения сделки

* - сверяются валюта сделки, указанная в поручении, и валюты денежных счетов списания и зачисления.



ОБЯЗАТЕЛЬНЫЕ КВИТОВОЧНЫЕ ПОЛЯ ПРИ КВИТОВКЕ «ПО РЕФЕРЕНСУ»

FOP

1	Контрагент
2	Счета депо
3	Разделы счетов
4	Дата расчетов/дата начала исполнения
5	Дата сделки
6	Код бумаги (ISIN)
7	Количество
8	Код операции
9	Референс

DVP

1	Контрагент
2	Счета депо
3	Разделы счетов
4	Дата расчетов
5	Дата сделки
6	Код бумаги (ISIN)
7	Количество
8	Код операции
9	Сумма сделки
10	Валюта сделки*
11	Тип DVP (1,2,3)
12	Место заключения сделки
13	Сделка №

* - сверяются валюта сделки, указанная в поручении, и валюты денежных счетов списания и зачисления.



КВИТОВКА ПО ДАТЕ РАСЧЕТОВ

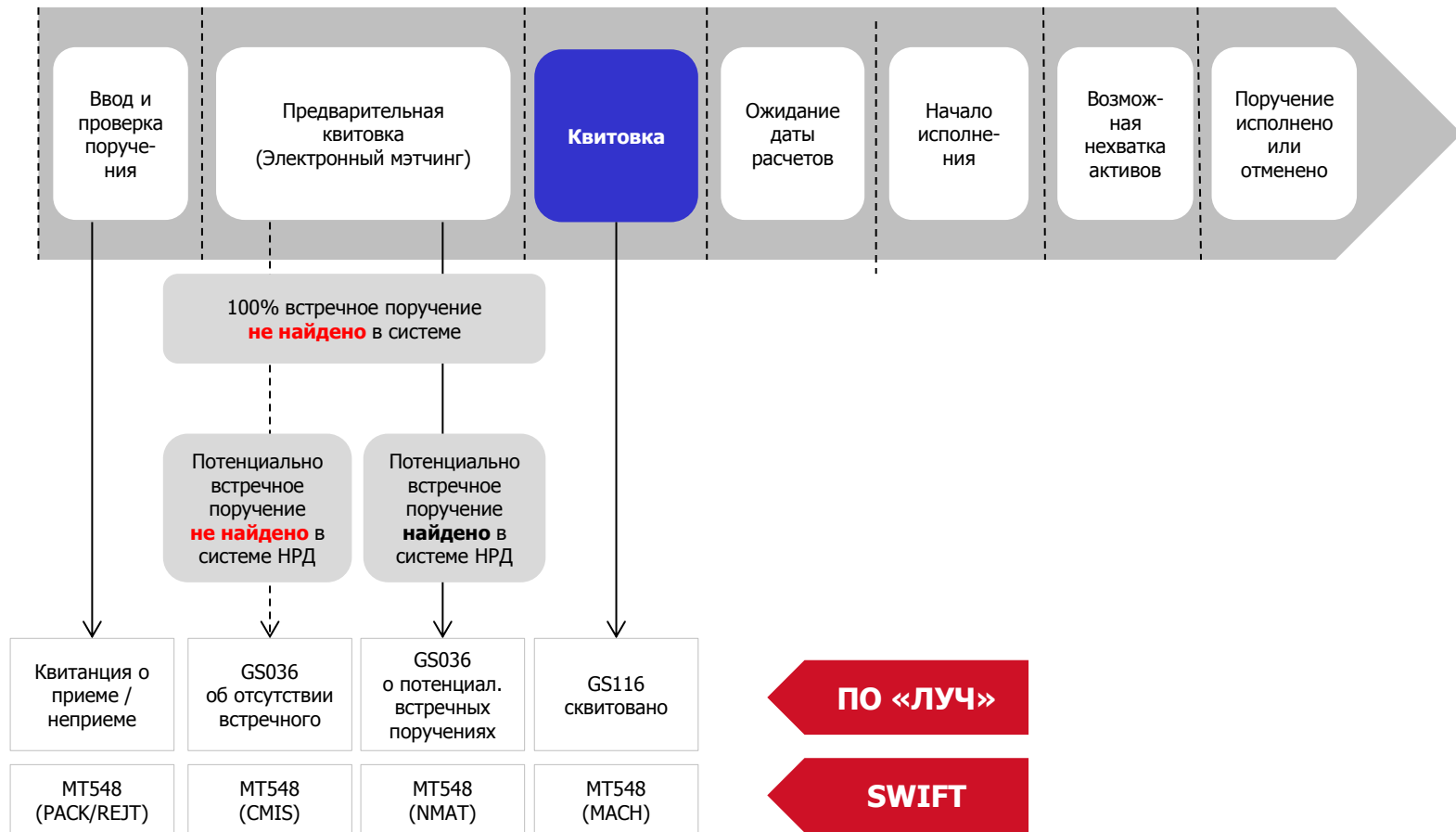
для всех операций с кодами 16 и 16/1
для всех операций с кодами 19/0 и 19/1



- **Дата расчетов (дата начала исполнения) должна совпадать во встречных поручениях**
- Дата окончания исполнения не сверяется, так как устанавливается стандартный срок в 30 дней от даты расчетов (даты начала исполнения) включительно



ОТЧЕТЫ ПОСЛЕ КВИТОВКИ



ОТМЕНА ПОРУЧЕНИЙ

- Принципы отмены поручений
- Отчеты
- Уведомление контрагента



ЗАПРОС НА ОТМЕНУ ПОРУЧЕНИЯ

Отмена неисполненного поручения оформляется отдельным поручением с кодом операции **70**

	ЛУЧ	SWIFT
Форма поручения	Форма GF070	MT540-MT543
Срок жизни поручения	от 1 до 90 дней	30 дней
Возможность установить срок жизни поручения	Да	Нет



ПРИНЦИПЫ ОТМЕНЫ ПОРУЧЕНИЙ

Клиент может подать запрос на отмену поручения на указанных этапах – после регистрации поручения в НРД и до его фактического исполнения



ОТЧЕТЫ ОБ ОТМЕНЕ

После отмены первоначального поручения НРД рассылает два типа отчетов:

- в привязке к поручению на отмену (70)
- в привязке к первоначальному поручению (16; 16/1; 19/0; 19/1)

Отчеты по поручению на отмену*

- 1 GS070 Отчет об отмене поручений депо
- 2 MT548 (CANI) со ссылкой на MT540-543 (CANC)

Отчеты по первоначальному поручению

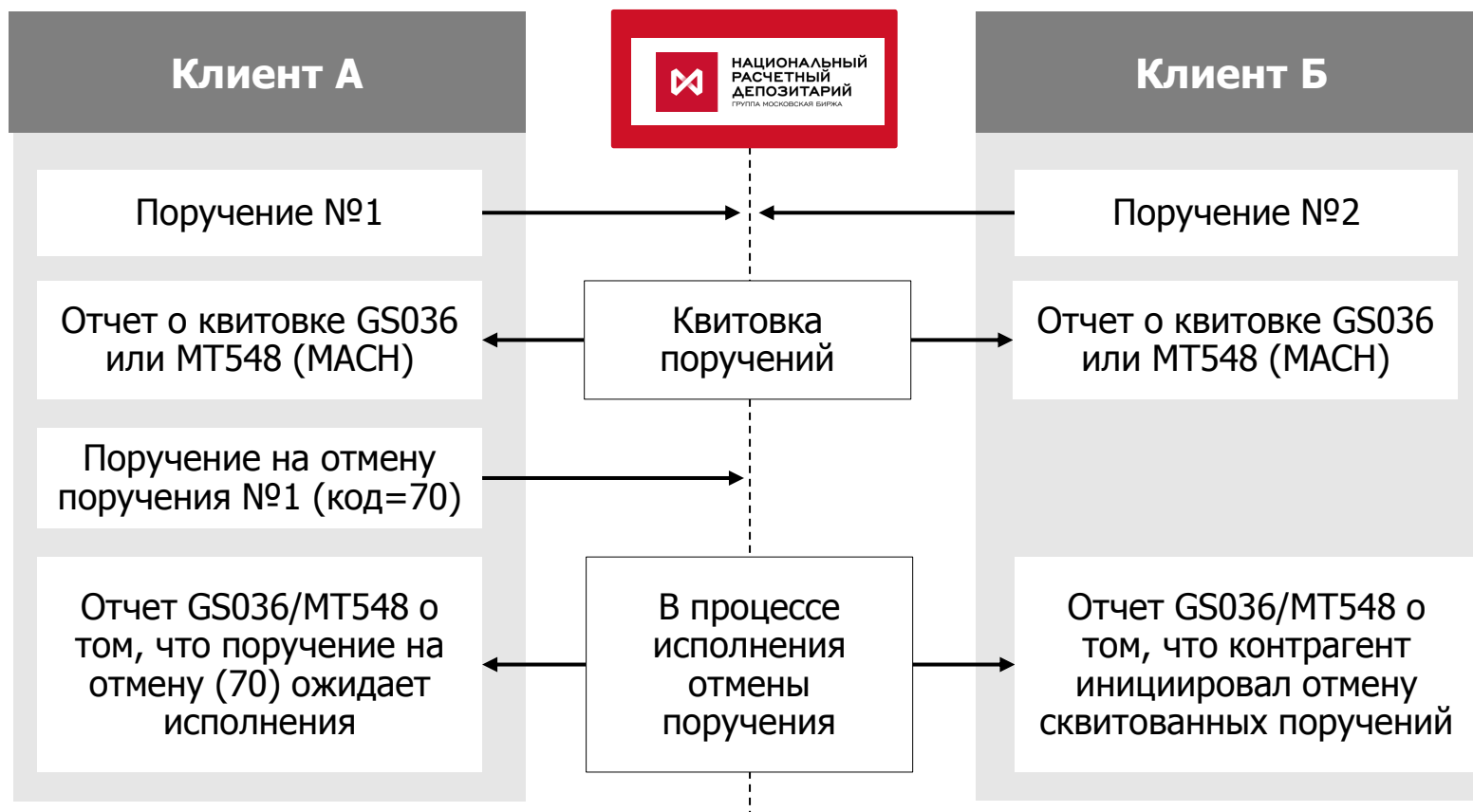
- 1 GS001 Отчет о неисполнении поручения
- 2 MT548 (CANI) со ссылкой на MT540-543 (NEWM, PREA)

* *при необходимости дополнительные отчеты по поручению на отмену можно отключить или изменить способ отправки через 97 операцию*



УВЕДОМЛЕНИЕ КОНТРАГЕНТА ОБ ОТМЕНЕ

НРД предоставляет клиенту отчет **GS036** или **MT548**, если Контрагент инициировал отмену сквитованной пары поручений.



КОНТАКТЫ

По вопросам текущего обслуживания клиентов просьба обращаться к персональным менеджерам:

T: +7 (495) 956-27-90

T: +7 (495) 956-27-91

E: sales@nsd.ru

По вопросам, связанным с сопровождением и развитием сервиса:

T: +7 (495) 234-48-27

Веб-сайт:

www.nsd.ru

www.nsd.ru/ru/services/matching/

Адрес:

105066, Россия, Москва,
ул. Спартаковская, д.12



**СПАСИБО
ЗА ВНИМАНИЕ!**



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ**
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

ПРАВОВАЯ ОГОВОРКА

- Настоящая презентация была подготовлена и выпущена НКО ЗАО НРД (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 преемственность 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.

