

Клуб казначейских расчетов: новый механизм расчетов по итогам клиринга

7 заседание




Спикер:

СВЕТЛАНА ТИМАШЕВА, руководитель направления по развитию СУО и трехсторонних сервисов НРД



ДОРОЖНАЯ КАРТА ЗАПУСКА НОВЫХ РАСЧЕТОВ

	декабрь.2025- март.2026	апрель	май	июнь
Мжвд тестирование (сценарии 1 – 8)	до 20.фев			
Пилот в режиме ограниченного распространения (3 сделки на ПРОД)	09-11.дек			
Пилот в режиме расширенного распространения (на расширенном составе КО)				
Подготовка				
Подача ненулевых лимитов на НРД		19.мар – 06.апр		
Маркирование группы сделок EKS4		23.мар – 15.апр		
Подача банковских реквизитов для депозитных сделок		23.мар – 06.апр		
Проведение пилота				
Сценарий 3 (КО с ГС депозиты)		07-09.апр	14-16.апр	
Сценарий 4 (КО с ГС депозиты + ГС РЕПО)		!!! Подача 07 поручений прямо перед пилотными сделками	15-17.апр	22-24.апр
Сценарий 5 (КО с ГС РЕПО)		!!! Подача 07 поручений прямо перед пилотными сделками	23-27.апр	14-18.май
Полномасштабный промышленный запуск				01.июн

-  Завершенный этап
-  Основные даты предстоящего этапа
-  Резервные даты предстоящего этапа

ПИЛОТНЫЕ СДЕЛКИ. СЦЕНАРИЙ 3

Участники: КО с генеральным соглашением с ФК (МУФК СУЛ) только по депозитам

День 1:

Депозитный аукцион с заключением 8 договоров банковского депозита (по одному одинаковому договору банковского депозита с каждой КО) со средствами ЕКС (группа сделок ЕКС).
МОУ ФК пополняет счет 47422 до клирингового сеанса на общую сумму заключенных сделок.
Расчеты в клиринге НРД сделок размещения депозитов, КО получают сообщение ED101 в платежной системе Банка России.

День 2:

Депозитный аукцион с заключением 8 договоров банковского депозита (по одному одинаковому договору банковского депозита с каждой КО) со средствами ЕКС (группа сделок ЕКС).
МОУ ФК пополняет счет 47422 на нетто-сумму до клирингового сеанса.
Расчеты в клиринге НРД обязательств по возврату депозита и размещению депозита, КО получают сообщение ED101 в платежной системе Банка России.

День 3:

Расчеты по второй части депозитов.
КО имеют до клирингового сеанса на корсчетах необходимую сумму денежных средств для расчета.
Расчеты в клиринге НРД обязательств по возврату депозита, кредитные организации получают сообщения ED295, ED104 в платежной системе Банка России.

Кредитор	Тип сделки	Период от начала отбора до отправки реестра сделок в НРД	Группа сделок	Сумма каждой сделки	Лимит отбора заявок	Дата размещения ДС	Дата возврата ДС	Биржа
МУФК	Депозит	09.30 – 10.05	EKS	1 млн руб.	8 млн руб.	День 1	День 2	Московская биржа
МУФК	Депозит	09.30 – 10.05	EKS	1,1 млн руб.	8,8 млн руб.	День 2	День 3	Московская биржа

Основные даты сценария 3

День 1: 07.04.26
День 2: 08.04.26
День 3: 09.04.26

Резервные даты сценария 3 *

День 1: 14.04.26
День 2: 15.04.26
День 3: 16.04.26

* При использовании резервных дат для сценария 3 для сценариев 4 и 5 также задействуются резервные даты, обозначенные для этих сценариев

ПИЛОТНЫЕ СДЕЛКИ. СЦЕНАРИЙ 4

Участники: КО с генеральным соглашением с ФК (МУФК СУЛ) по депозитам и репо

День 1:

Депозитный аукцион с заключением 17 договоров банковского депозита (по одному одинаковому договору банковского депозита с каждой КО) со средствами ЕКС (группа сделок ЕКС).
МОУ ФК пополняет счет 47422 до клирингового сеанса на общую сумму заключенных сделок.
Расчеты в клиринге НРД сделок размещения депозитов, КО получают сообщение ED101 в платежной системе Банка России.

День 2:

Аукцион репо с заключением 17 договоров репо (по одному одинаковому договору репо с каждой КО) со средствами ЕКС (группа сделок ЕКС4).
МОУ ФК пополняет счет 47422 на нетто-сумму до клирингового сеанса.
Расчеты в клиринге НРД обязательств по возврату депозита и размещению репо, КО получают сообщение ED101 в платежной системе Банка России.

День 3:

Расчеты по второй части репо.
КО имеют до клирингового сеанса на корсчетах необходимую сумму денежных средств для расчета.
Расчеты в клиринге НРД обязательств по возврату репо, КО получают сообщения ED295, ED104 в платежной системе Банка России.

Кредитор	Тип сделки	Период от начала отбора до отправки реестра сделок в НРД	Группа сделок	Сумма каждой сделки	Лимит отбора заявок	Дата размещения ДС	Дата возврата ДС	Биржа
МУФК	Депозит	09.30 – 10.05	EKS	1 млн руб.	17 млн руб.	День 1	День 2	СПВБ
МУФК	Репо	09.30 – 10.05	EKS4	1,1 млн руб.	18,7 млн руб.	День 2	День 3	Московская биржа

Основные даты сценария 4

День 1: 15.04.26
День 2: 16.04.26
День 3: 17.04.26

Резервные даты сценария 4 *

День 1: 22.04.26
День 2: 23.04.26
День 3: 24.04.26

* При использовании резервных дат для сценария 3 для сценариев 4 и 5 также задействуются резервные даты, обозначенные для этих сценариев

ПИЛОТНЫЕ СДЕЛКИ. СЦЕНАРИЙ 5

Участники: КО с генеральным соглашением с ФК (МУФК СУЛ) только по репо

День 1:

Аукцион репо с заключением 20 договоров репо (по одному одинаковому договору репо с каждой КО) со средствами ЕКС (группа сделок ЕКС4).
МОУ ФК пополняет счет 47422 до клирингового сеанса на общую сумму заключенных сделок.
Расчеты в клиринге НРД первой части репо, КО получают сообщение ED101 в платежной системе Банка России.

День 2:

Аукцион репо с заключением 20 договоров репо (по одному одинаковому договору репо с каждой КО) со средствами ЕКС (группа сделок ЕКС4).
МОУ ФК пополняет счет 47422 на нетто-сумму до клирингового сеанса.
Расчеты в клиринге НРД обязательств по второй части репо и первой части репо, КО получают сообщение ED101 в платежной системе Банка России.

День 3:

Расчеты по второй части репо.
КО имеют до клирингового сеанса на корсчетах необходимую сумму денежных средств для расчета.
Расчеты в клиринге НРД обязательств по второй части репо, КО получают сообщения ED295, ED104 в платежной системе Банка России.

Кредитор	Тип сделки	Период от начала отбора до отправки реестра сделок в НРД	Группа сделок	Сумма каждой сделки	Лимит отбора заявок	Дата размещения ДС	Дата возврата ДС	Биржа
МУФК	Репо	09.30 – 10.05	ЕКС4	1 млн руб.	20 млн руб.	День 1	День 2	Московская биржа
МУФК	Репо	09.30 – 10.05	ЕКС4	1,1 млн руб.	22 млн руб.	День 2	День 3	Московская биржа

Основные даты сценария 5

День 1: 23.04.26

День 2: 24.04.26

День 3: 27.04.26

Резервные даты сценария 5 *

День 1: 14.05.26

День 2: 15.05.26

День 3: 18.05.26

* При использовании резервных дат для сценария 3 для сценариев 4 и 5 также задействуются резервные даты, обозначенные для этих сценариев