

Описание функциональных характеристик программного обеспечения «Аламеда»

1.1 НАИМЕНОВАНИЕ ПРОГРАММЫ

Полное наименование программы: Программное обеспечение «Аламеда».

Условное обозначение программы: ПО «Аламеда», Программа.

1.2 КРАТКАЯ ХАРАКТЕРИСТИКА ОБЛАСТИ ПРИМЕНЕНИЯ ПРОГРАММЫ

Программное обеспечение «Аламеда» – это депозитарно-клиринговая учетная система, разработанная НКО АО «Национальный расчетный депозитарий».

Программа применяется для реализации и выполнения основных направлений деятельности НКО АО «Национальный расчетный депозитарий», а именно поддерживает следующие функциональные возможности:

- осуществление депозитарной деятельности;
- проведение корпоративных действий;
- осуществление клиринговой деятельности;
- управление обеспечением в сделках РЕПО с Корзиной ценных бумаг.

1.3 ФУНКЦИОНАЛЬНОЕ НАЗНАЧЕНИЕ ПРОГРАММЫ

Функциональным назначением Программы является автоматизация процессов, обеспечивающих ведение депозитарной деятельности НКО АО «Национальный расчетный депозитарий», в том числе прием поручений депо, их исполнение и генерация необходимой отчетности; на основании поручений депо, выполнение операций, связанных с учетом прав и операций с ценными бумагами российских и иностранных эмитентов; выполнение клиринговых расчетов; генерация, прием, передача SWIFT-сообщений.

Программа поддерживает следующие функциональные возможности:

- ведение информации о клиентах и контрагентах;
- ведение полномочий пользователей, ролей;
- осуществление депозитарной деятельности;
- проведение корпоративных действий;
- осуществление клиринговой деятельности;
- управление обеспечением в сделках РЕПО с Корзиной ценных бумаг.

1.4 ФУНКЦИОНАЛЬНЫЕ ХАРАКТЕРИСТИКИ

1.4.1 Выполняемые функции в части управления обеспечением в сделках РЕПО с Корзиной ценных бумаг

Программа обеспечивает выполнение следующих функциональных возможностей в части управление обеспечением в сделках РЕПО с Корзиной ценных бумаг:

- регистрацию и удаление реквизитов банковских счетов для клиринга на рынке депозитов;
- регистрацию, изменение и удаление участником СУО корзины ценных бумаг, а также указание дисконтов по бумагам корзины;
- подачу участником СУО анкеты кредитора, которая будет использоваться в РЕПО между банками;

- подбор маркированных Участником клиринга активов на его разделах и перевод на указанный в поручении раздел/субсчет;
- подачу маркирования участником СУО допустимых к подбору в обеспечение бумаг на счетах и разделах;
- подачу участником СУО дополнительных параметров обслуживания сделок СУО;
- регистрацию, изменение и удаление лимитов концентрации для ценных бумаг на торговых разделах счетов депо для целей обработки в СУО;
- применение настроек по связи счетов/разделов депо списания и зачисления ценных бумаг, а также указания расписания и условий выполнения автоматических перевод ценных бумаг между такими счета/разделами депо;
- передача депонентом цен для ценных бумаг, подготовленных согласно собственной методики расчета справедливой стоимости;
- исполнение прямого или обратного денежного компенсационного взноса (КВ) для выбранной сделки Группы сделок СУО междилерского РЕПО;
- регистрация изменения и прекращения обязательства со стороны заемщика;
- регистрация изменения и прекращения обязательства со стороны кредитора;
- регистрация изменения даты расчета обязательства;
- замена обеспечения обязательства;
- замена обеспечения без подбора;
- передача информации о перечне ценных бумаг в пулах и оценочной стоимости ценных бумаг;
- передача информации об аффилированности;
- определение порядка расчета сумм и формирования платежных поручений перевода в АСЭР с торговых банковских счетов НКЦ на торговые банковские счета НРД;
- определение порядка расчета сумм и формирования платежных поручений перевода в АСЭР с торговых банковских счетов НРД на торговые банковские счета НКЦ либо на клиринговый банковский счет НКЦ, открытый в НРД, либо на корреспондентский счет, открытый в Банке России (поручение 18/ROUT);
- формирование отчетов об обеспеченности, выполнение ежедневных процедур обслуживания СУО.

1.4.2 Выполняемые функции в части клиринговой деятельности

Программа обеспечивает выполнение следующих функциональных возможностей в части клиринговой деятельности:

- ведение клирингового сеанса;
- исполнение обязательства по денежным средствам, в том числе депозитных сделок (сделок без обеспечения в ц/б);
- перевод ценных бумаг по результатам клиринга НРД;
- расчет сделок DVP, аналогичных реализованным в ДКК:
 - исполнение сделки с ценными бумагами (поставка ц/б.) (поручение на списание ценных бумаг и получение денежных средств);
 - исполнение сделки с ценными бумагами (получение ц/б) (поручение на получение ценных бумаг и списание денежных средств);
- расчет двуногих сделок и использование СУО (в частности, внебиржевых сделок РЕПО с корзиной):
 - исполнение сделки с ц/б Регистрация обязательств по 2-ой части сделки. Поставка;
 - исполнение сделки с ц/б Регистрация обязательств по 2-ой части сделки. Получение;

- вывод денежных средств;
- должны быть реализованы следующие реестры для ведения клиринга:
 - реестр участников клиринга;
 - реестр клиентов участников клиринга;
 - реестр остатков ценных бумаг;
 - реестр остатков денежных средств;
 - реестр сделок, по которым осуществлен клиринг;
 - реестр принятых поручений;
 - реестр поручений, направленных расчетной организации и расчетному депозитарию;
 - реестр отчетов, направленных участникам клиринга и их клиентам.

1.4.3 Выполняемые функции в части депозитарной деятельности

Программа обеспечивает выполнение следующих функциональных возможностей в части депозитарной деятельности:

- перевод по результатам торговой сессии;
- перевод по результатам сделки, включенной в простой клиринг;
- перевод при расчетах в ходе торгов при многостороннем клиринге;
- передача информации о состоянии торговых разделов в соответствии с регламентом взаимодействия до начала торговой сессии;
- формирование отчета об остатках на торговых разделах в торговой сессии;
- списание ценных бумаг со счетов НРД – снятие ценных бумаг с хранения и/или учета при списании ценных бумаг со счета Депонента НРД и переводе их на счет, открытый во внешней организации;
- прием ценных бумаг на хранение и/или учет при зачислении на счета Депонентов НРД с одновременным зачислением ценных бумаг на активный счет НРД, открытый во внешней организации;
- прием ценных бумаг на хранение и/или учет при переводе ценных бумаг на междепозитарный счет депо НРД в другом депозитарию;
- обслуживание эмиссионных счетов депо при приеме ценных бумаг на хранение и/или учет;
- обслуживание эмиссионных счетов депо при снятии ценных бумаг с хранения и/или учета;
- начисление ценных бумаг (инвестиционные паи или ипотечные сертификаты участия) на счет Депонента НРД со счета, открытого во внешней организации;
- списание ценных бумаг (инвестиционные паи или ипотечные сертификаты участия) со счета Депонента НРД и перевод их на счет, открытый во внешней организации;
- обмен инвестиционных паев/ипотечных сертификатов участия одного ПИФ на инвестиционные паи/ипотечные сертификаты участия другого ПИФ;
- изменение деталей поручения;
- перевод ценных бумаг между активными счетами в учете НРД и перевод ценных бумаг между корреспондентскими счетами, открытыми НРД в других депозитариях/регистраторах;
- зачисление, списание, перевод или комбинацию вышеуказанных действий с ценными бумагами в привязке к счетам депо и разделам счетов депо;
- перевод ценных бумаг с контролем расчетов по денежным средствам;
- перевод ценных бумаг с контролем расчетов по денежным средствам (встречный);
- перевод между счетами депо;
- перевод в рамках одного счета депо;

- перевод ценных бумаг на счет депо с подтверждением;
- перевод ценных бумаг на счет депо с подтверждением. Встречное поручение;
- перевод ценных бумаг на основании встречных поручений депо депонента отправителя и депонента получателя ценных бумаг;
- перевод ценных бумаг на основании встречных поручений депо депонента отправителя и депонента получателя ценных;
- формирование информационного запроса об остатках на счете депо;
- формирование информационного запроса об операциях по счету депо;
- формирование информационного запроса по состоянию анкеты;
- формирование информационного запроса оператора об остатках по разделам;
- формирование информационного запроса оператора раздела об операциях;
- формирование информационного запроса рос на повторное получение отчета;
- формирование служебного информационного запроса об остатках ценных бумаг, учитываемых на пассивном счете/ счетах депо депонентов НРД;
- формирование служебного информационного запроса об операциях с ценными бумагами, учитываемыми на счете/ счетах депо депонентов НРД;
- информирование депонентов по корпоративным действиям;
- контроль корректного отражения в синтетическом учете операций по аналитическим счетам;
- формирование следующих отчетных документов:
 - ежеквартальной отчетности НРД по клиринговой деятельности;
 - отчет «Сведения об инвестициях уполномоченного банка и его клиентов-резидентов (кроме кредитных организаций) в ценные бумаги, выпущенные нерезидентами, и в уставный капитал (доли) нерезидентов»;
 - отчет по ценным бумагам и цифровым правам для Банка России;
 - отчет по ценным бумагам по форме 0409711;
 - отчет в Банк России по форме 0409716;
 - сведения кредитной организации, осуществляющей клиринговую деятельность, об исполненных обязательствах, допущенных к клирингу;
 - отчет по форме 0409729;
 - сведения о количестве договоров, обязательства из которых допущены к клирингу, а также о количестве УК и сегрегированных КУК;
 - отчет для Банка России по погашенным ценным бумагам;
 - отчеты для отдела валютного контроля;
 - отчет по ценным бумагам «Сведения об осуществлении депозитарной деятельности и деятельности по инвестиционному консультированию» по форме 0409707;
 - отчет по ценным бумагам «сведения об индивидуальном клиринговом обеспечении и ином обеспечении участника клиринга» по форме 0409710;
 - отчет по ценным бумагам «сведения об участниках клиринга и операциях, проведенных по торговым счетам и (или) клиринговым счетам» по форме 0409712;
- закрытие лицевого счета;
- открытие счета депо;
- закрытие счета депо;
- административная блокировка/разблокировка;
- закрытие раздела счета депо;
- открытие раздела счета депо;

- изменение параметров счета/раздела счета депо;
- изменение параметров активного счета;
- открытие/закрытие раздела специального типа;
- определение перечня разделов счетов депо для раскрытия информации.

1.4.4 Выполняемые функции в части корпоративных действий

Программа обеспечивает выполнение следующих функциональных возможностей в части корпоративных действий:

- регистрацию поручений, распоряжений, инструкций, получаемых от Депонентов НРД по каналу SWIFT File Act;
- ручная загрузка сообщений из SWIFT File Act;
- доставка до Депонентов, использующих сеть SWIFT FileAct в качестве основного канала взаимодействия, сообщений, не предусмотренных стандартами электронного взаимодействия SWIFT Fin;
- прием файлов по SWIFT File Act;
- формирование запроса сведений по налогообложению иностранного номинальных держателей»;
- формирование поручения «Налоговое раскрытие»;
- информирование депонентов по корпоративному действию;
- отмена неисполненного поручения;
- взаимодействие с ДПО при сверке с регистратором;
- обеспечение проведения взаиморасчетов с вышестоящими депозитариями и депонентами при исполнении корпоративных действий по иностранным ценным бумагам;
- списание/зачисление ценных бумаг при проведении КД по ИФИ;
- формирование поручения на участие в собрании;
- отмена участия в КД;
- отмена участия по иностранным КД (Отмена инструкции на участие в КД. Иностранные ценные бумаги);
- отмена участия в КД по российским КД;
- отмена исключения ц/б из участия в КД;
- отмена инструкции с волеизъявлением лица, осуществляющего права по ц/б;
- передача информации регистратору/эмитенту;
- созывы общих собраний;
- передача инструкции с волеизъявлением лица, осуществляющего права по ц/б;
- исключение ц/б из проведения корпоративных действий;
- списание ц/б при проведении корпоративных действий (BPUT);
- списание/зачисление ценных бумаг при конвертации (CONV);
- формирование поручения на участие в собрании по ц/б, попадающим под действие директивы SRD II;
- формирование поручения на отмену участия в собрании по ц/б, попадающим под действие директивы SRD II;
- формирование поручения на участие в КД. Иностранные ценные бумаги;
- формирование поручения на участие в российских КД (BIDS/TEND);
- обработка дефолта/отмены КД в рамках поручения на участие в российских КД. BIDS/TEND;
- формирование поручения на участие в российских КД (PRIO);

- фиксация параметров КД. Иностранные ценные бумаги.
- сбор информации для идентификации владельцев по ц/б согласно директиве SRD II;
- сбор поручений на участие в собрании согласно стандарту ISO 20022;
- проведение обязательных КД по ценным бумагам российских эмитентов;
- сбор поручений на участие в собрании;
- формирование поручения на проведение КД (BIDS);
- формирование поручения на проведение КД (PRIO);
- формирование поручения на проведение КД TEND по статье 84.8;
- формирование дочернего поручения на проведение КД TEND по статье 84.8;
- формирование поручения на проведение КД. Фиксация информации о КД (BPUT);
- формирование поручения на проведение КД (CONV);
- формирование поручения на сохранение блокировки;
- формирование поручения на отмену сохранения блокировки;
- формирование отчетов по US- бумагам;
- формирование поручения на изменение ранее предоставленного налогового вычета по US- бумагам (Tax Adjustment Instruction);
- формирование списка лиц (владельцев / доверительных управляющих / номинальных держателей), на счетах или субсчетах депо которых учитываются определенные ценные бумаги по состоянию на конец операционного дня указанной даты;
- прием и трансляция результатов обработки списка владельцев ценных бумаг;
- регистрация списка / изменений списка владельцев ценных бумаг;
- аннулирование зарегистрированного в НРД списка владельцев ценных бумаг.