



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ**
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Электронный мэтчинг: руководство пользователя



Содержание

ПРАВОВАЯ ОГОВОРКА	2
КОНТАКТЫ И ПОЛЕЗНЫЕ ССЫЛКИ	3
1. ОБЩАЯ ИНФОРМАЦИЯ	4
1.1 Описание сервиса	4
1.2 Преимущества	4
1.3 Тарифы	4
1.4 Жизненный цикл поручения	5
2. КВИТОВКА.....	6
2.1 Квитовка «по дате сделки» для 16х операций.....	6
2.2 Квитовка «по референсу» для 16х операций.....	7
2.3 Квитовка «по дате сделки» для 19х операций.....	8
2.4 Квитовка «по номеру сделки» для 19х операций	9
2.5 Результат квитовки	10
3. ПРЕДВАРИТЕЛЬНАЯ КВИТОВКА	11
3.1 Для 16х операций.....	11
3.2 Для 19х операций.....	12
4. ЭЛЕКТРОННЫЙ МЭТЧИНГ ДЛЯ КВИТОВКИ ПО «ДАТЕ СДЕЛКИ»	13
4.1 Для 16х операций.....	13
4.2 Для 19х операций.....	14
4.3 Исключения из правил	14
4.4 Отчет по электронному мэтчингу	15
4.4.1 Вариант 1. Потенциально встречное поручение есть	15
4.4.2 Вариант 2. Потенциального встречного поручения нет	16
5. КАК РАБОТАЮТ ВЕСА.....	17
5.1 Этапы поиска релевантных поручений	17
Этап 1. Предоставление поручения	17
Этап 2. Направление встречного поручения	17
Этап 3. Отправка дополнительного поручения	18
5.2 Групповая сверка полей	18
6. КАК ПОДКЛЮЧИТЬСЯ.....	21
Опция 1. Уведомление об одном (релевантном) встречном поручении.....	22
Опция 2. Уведомление о всех потенциальных встречных поручениях	23
7. УПРАВЛЕНИЕ ОТЧЕТАМИ	24
8. ОТМЕНА ПОРУЧЕНИЙ	25
Как работает двусторонняя отмена при одностороннем Hold&Release	25
Приложения	26
Приложение 1. Примеры отчетов при наличии потенциального встречного поручения	26
Приложение 2. Примеры отчетов при отсутствии потенциального встречного поручения	27



ПРАВОВАЯ ОГОВОРКА

Настоящее Руководство пользователя создано исключительно в целях информирования клиентов об услуге НКО ЗАО НРД, и ни при каких обстоятельствах не может рассматриваться как регулирующий отношения сторон документ. Клиент, при подключении и использовании любой услуги НКО ЗАО НРД обязан руководствоваться положениями заключенного договора, в том числе, но не ограничиваясь, Договора об оказании клиринговых услуг, Договора банковского счета, Договора соответствующего счета депо, Договора об электронном взаимодействии, с учетом приложений и дополнений к ним, а также Правилами клиринга НКО ЗАО НРД, Условиями осуществления депозитарной деятельности НКО ЗАО НРД, Условиями оказания расчетных услуг НКО ЗАО НРД, Порядком взаимодействия клиентов и НКО ЗАО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением, регламентами, а также иными документами НКО ЗАО НРД, опубликованными на сайте НКО ЗАО НРД в сети Интернет по адресу: www.nsd.ru. Некоторая информация, содержащаяся в настоящем Руководстве, может утратить актуальность в связи с изменением порядка оказания услуг, произошедшим после его создания. НКО ЗАО НРД оставляет за собой право изменять настоящее Руководство пользователя в любое время без предварительного уведомления. НКО ЗАО НРД не возмещает любые прямые, косвенные убытки, вызванные использованием настоящего Руководства клиентом и/или третьими лицами. Клиенту может быть отказано в предоставлении Услуги в предусмотренных законодательством Российской Федерации случаях. Настоящее Руководство может содержать примеры экранных форм, при этом их поля и визуализация на соответствующих рабочих местах клиента может отличаться.



КОНТАКТЫ И ПОЛЕЗНЫЕ ССЫЛКИ¹

Раздел «Электронный мэтчинг» на официальном сайте НРД:

- Главная страница: <https://www.nsd.ru/ru/services/matching/>

Контактная информация:

- Принятие клиентов на обслуживание, персональные менеджеры:
<https://www.nsd.ru/ru/about/contacts/#client>

¹ Информация по приведенным в данном разделе ссылкам может периодически обновляться. Актуальная информация всегда доступна на [официальном сайте НРД](#).



1. ОБЩАЯ ИНФОРМАЦИЯ

1.1 Описание сервиса

Сервис «Электронный мэтчинг» позволяет упростить процедуры расчетов по ценным бумагам внутри НРД. НРД предоставляет клиентам информацию о наличии потенциальных встречных поручений для каждой несквитованной инструкции Клиента. Поиск потенциальных встречных поручений (электронный мэтчинг) осуществляется по следующим видам операций:

Код операции	Тип инструкции	Описание операции
16	MT542	Перевод с подтверждением. Deliver free (DF)
16/1	MT540	Перевод с подтверждением. Встречное поручение. Receipt free (RF)
19/0	MT543	Исполнение сделки с ценными бумагами. Поставка ценных бумаг. Delivery vs. Payment (DVP)
19/1	MT541	Исполнение сделки с ценными бумагами. Получение ценных бумаг. Receipt vs. Payment (RVP)

Электронный мэтчинг – это предварительный этап жизненного цикла поручения, который позволяет выявить подходящие друг к другу поручения, несмотря на наличие в них определенных расхождений. Результаты предварительного этапа не являются окончательными и после прохождения электронного мэтчинга поручение не может быть исполнено. В любом случае поручению потребуется пройти следующий этап «квитовки» или «сверки» встречных поручений, на котором требуется полное совпадение всех квиточных полей.

1.2 Преимущества

Преимущества, которые дает электронный мэтчинг поручений в НРД:

- клиенты НРД могут отказаться от предварительной сверки поручений по телефону, тем самым упростить внутренние процессы обработки поручений;
- электронный мэтчинг можно использовать для большинства поручений, где используется квитовка по «дате сделки»;
- упрощение процесса предварительной квитовки поручений на расчеты с ценными бумагами;
- возможность автоматической обработки отчетов;
- снижение рисков незавершения расчетов.

1.3 Тарифы

За оказание услуги по электронному мэтчингу отдельная плата не взимается. При этом за уведомления и отчеты, отправленные клиентам по каналу связи – SWIFT FIN, взимается плата согласно тарифам ЭДО НРД.



1.4 Жизненный цикл поручения

Жизненный цикл поручения схематично может быть представлен следующим образом:



Сразу после поступления поручения и прохождения первоначальных проверок система НРД начинает искать встречное поручение, которое бы совпадало по всем квитаночным полям. Если полное совпадение найти не удалось, то поручение поступает на этап «предварительной квитанвки» или «электронного мэтчинга». Таким образом, «предварительная квитанвка» является дополнительным этапом, который осуществляется только для несквитованных поручений.

Далее в руководстве будет рассмотрен этап «квитовки» или «сверки» встречных поручений, от успешного или неуспешного прохождения которого зависит наличие или отсутствие в жизненном цикле поручения дополнительного этапа в виде «предварительной квитанвки» или «электронного мэтчинга».



2. КВИТОВКА

НРД предоставляет клиентам два способа квитовки поручений:

- **ПО ДАТЕ СДЕЛКИ;**
- **ПО РЕФЕРЕНСУ.**

2.1 Квитовка «по дате сделки» для 16х операций

В поручение должно быть заполнено поле «дата сделки» и не заполнено поле «референс». Поле «основание» может быть заполнено клиентом, но оно не сверяется во встречных поручениях.

Обязательные квитовочные поля	Комментарии
Счета депо	Во встречных поручениях должны совпадать поля «счет депо отправителя». Во встречных поручениях должны совпадать поля «счет депо получателя».
Разделы счетов депо	Во встречных поручениях должны совпадать поля «раздел счета депо отправителя». Во встречных поручениях должны совпадать поля «раздел счета депо получателя». Если в поручении указан «идентификатор раздела», то такой идентификатор должен совпадать с идентификатором раздела или должен соответствовать коду раздела счета депо, указанному во встречном поручении.
Дата расчетов/дата начала исполнения	Во встречных поручениях сверяется только дата расчетов / дата начала исполнения. Срок окончания исполнения 30 календарных дней устанавливается НРД от даты расчетов и является стандартным, поэтому не сверяется во встречных поручениях.
Код ценной бумаги	В поручении может быть указано несколько выпусков ценных бумаг. В данном случае коды и соответствующее им количество ценных бумаг должны совпадать во встречных поручениях.
Количество ценных бумаг	Если в поручении указано несколько выпусков ценных бумаг, то количество, соответствующее каждому коду ценной бумаги, должно совпадать во встречных поручениях.
Код операции	
Дата сделки	Во встречных поручениях поля «дата сделки» должны совпадать.
Дополнительные квитовочные поля	Комментарии
Код клиента депонента-получателя	Сверяется только, если поля заполнено в обоих поручениях. Если поле заполнено только в одном поручении, то сверка не осуществляется. При этом код клиента депонента-получателя можно использовать только в поручениях, направляемых через ПО «ЛУЧ». В SWIFT поручениях такое поле не предусмотрено.
Наличие и вид обременения ценных бумаг	Данные дополнительные поля для квитовки сверяются в обязательном порядке, если указанное поле заполнено хотя бы в одном из поручений.



2.2 Квитовка «по референсу» для 16х операций

В поручении должны быть заполнены поля «дата сделки» и «референс». Поле «основание» может быть заполнено клиентом, но оно не сверяется во встречных поручениях.

Обязательные квитовочные поля	Комментарии
Счета депо	Во встречных поручениях должны совпадать поля «счет депо отправителя». Во встречных поручениях должны совпадать поля «счет депо получателя».
Разделы счетов депо	Во встречных поручениях должны совпадать поля «раздел счета депо отправителя». Во встречных поручениях должны совпадать поля «раздел счета депо получателя». Если в поручении указан «идентификатор раздела», то такой идентификатор должен совпадать с идентификатором раздела или должен соответствовать коду раздела счета депо, указанному во встречном поручении.
Дата расчетов/дата начала исполнения	Во встречных поручениях сверяется только дата расчетов / дата начала исполнения. Срок окончания исполнения 30 календарных дней устанавливается НРД от даты расчетов и является стандартным, поэтому не сверяется во встречных поручениях.
Код ценной бумаги	В поручение может быть указано несколько выпусков ценных бумаг. В данном случае коды и соответствующее им количество ценных бумаг должны совпадать во встречных поручениях.
Количество ценных бумаг	Если в поручении указано несколько выпусков ценных бумаг, то количество, соответствующее каждому коду ценной бумаги, должно совпадать во встречных поручениях.
Код операции	
Дата сделки	Во встречных поручениях поля «дата сделки» должны совпадать.
Референс	В поручении можно заполнить поле «референс» только при наличии «даты сделки». Поля «референс» должны совпадать во встречных поручениях.
Дополнительные квитовочные поля	Комментарии
Код клиента депонента-получателя	Сверяется только, если поля заполнено в обоих поручениях. Если поле заполнено только в одном поручении, то сверка не осуществляется. При этом код клиента депонента-получателя можно использовать только в поручениях, направляемых через ПО «ЛУЧ». В SWIFT поручениях такое поле не предусмотрено.
Наличие и вид обременения ценных бумаг	Данные дополнительные поля для квитовки сверяются в обязательном порядке, если указанное поле заполнено хотя бы в одном из поручений.



2.3 Квитовка «по дате сделки» для 19х операций

В поручение должно быть заполнено поле «дата сделки» и не заполнено поле «номер сделки». Поле «основание» может быть заполнено клиентом, но оно не сверяется во встречных поручениях.

Обязательные квитовочные поля	Комментарии
Инициатор и контрагент	
Счета депо	Во встречных поручениях должны совпадать поля «счет депо отправителя». Во встречных поручениях должны совпадать поля «счет депо получателя».
Разделы счетов депо	Во встречных поручениях должны совпадать поля «раздел счета депо отправителя». Во встречных поручениях должны совпадать поля «раздел счета депо получателя». Если в поручении указан «идентификатор раздела», то такой идентификатор должен совпадать с идентификатором раздела или должен соответствовать коду раздела счета депо, указанному во встречном поручении.
Дата расчетов/дата начала исполнения	Во встречных поручениях сверяется только дата расчетов / дата начала исполнения. Срок окончания исполнения 30 календарных дней устанавливается НРД от даты расчетов и является стандартным, поэтому не сверяется во встречных поручениях.
Код ценной бумаги	В поручение может быть указано несколько выпусков ценных бумаг. В данном случае коды и соответствующее им количество ценных бумаг должны совпадать во встречных поручениях.
Количество ценных бумаг	Если в поручении указано несколько выпусков ценных бумаг, то количество, соответствующее каждому коду ценной бумаги, должно совпадать во встречных поручениях.
Код операции	
Сумма сделки	Сумма сделки во встречных поручениях сверяется с учетом допустимого отклонения, установленного для каждой из сторон.
Валюта сделки	В общем случае валюта сделки должна совпадать с валютой денежного счета. Исключение составляет случай, когда сделка заключена в долларах, а денежные счета в поручениях отправителя и получателя — рублевые. В данном случае будет произведен пересчет суммы сделки из долларов в рубли по курсу Банка России на день, предшествующий фактической дате расчетов.
Валюта платежа	Валюта денежного счета списания должна совпадать с валютой денежного счета зачисления.
Тип DVP	Если в одном из поручений выбран тип расчетов DVP-1, то такой тип расчетов должен совпадать в обоих поручениях. Если в одном из поручений выбран тип расчетов DVP-2, то во встречном поручении может быть указан как тип расчетов DVP-2, так и тип расчетов DVP-3, при этом такие поручения будут сквитованы.
Дата сделки	Во встречных поручениях поля «дата сделки» должны совпадать.
Дополнительные квитовочные поля	Комментарии
Место заключения сделки	Данное поле сверяется в обязательном порядке, если оно заполнено хотя бы в одном из поручений.



2.4 Квитовка «по номеру сделки» для 19х операций

В поручении должны быть заполнены поле «дата сделки» и «номер сделки». Поле «основание» может быть заполнено клиентом, но оно не сверяется во встречных поручениях.

Обязательные квитовочные поля	Комментарии
Инициатор и контрагент	
Счета депо	Во встречных поручениях должны совпадать поля «счет депо отправителя». Во встречных поручениях должны совпадать поля «счет депо получателя».
Разделы счетов депо	Во встречных поручениях должны совпадать поля «раздел счета депо отправителя». Во встречных поручениях должны совпадать поля «раздел счета депо получателя». Если в поручении указан «идентификатор раздела», то такой идентификатор должен совпадать с идентификатором раздела или должен соответствовать коду раздела счета депо, указанному во встречном поручении.
Дата расчетов/дата начала исполнения	Во встречных поручениях сверяется только дата расчетов / дата начала исполнения. Срок окончания исполнения 30 календарных дней устанавливается НРД от даты расчетов и является стандартным, поэтому не сверяется во встречных поручениях.
Код ценной бумаги	В поручение может быть указано несколько выпусков ценных бумаг. В данном случае коды и соответствующее им количество ценных бумаг должны совпадать во встречных поручениях.
Количество ценных бумаг	Если в поручении указано несколько выпусков ценных бумаг, то количество, соответствующее каждому коду ценной бумаги, должно совпадать во встречных поручениях.
Код операции	
Сумма сделки	Сумма сделки во встречных поручениях сверяется с учетом толеранса, установленного для каждой из сторон.
Валюта сделки	В общем случае валюта сделки должна совпадать с валютой денежного счета. Исключение составляет случай, когда сделка заключена в долларах, а денежные счета в поручениях отправителя и получателя — рублевые. В данном случае будет произведен пересчет суммы сделки из долларов в рубли по курсу Банка России на день, предшествующий фактической дате расчетов.
Валюта платежа	Валюта денежного счета списания должна совпадать с валютой денежного счета зачисления.
Тип DVP	Если в одном из поручений выбран тип расчетов DVP-1, то такой тип расчетов должен совпадать в обоих поручениях. Если в одном из поручений выбран тип расчетов DVP-2, то во встречном поручении может быть указан как тип расчетов DVP-2, так и тип расчетов DVP-3, при этом такие поручения будут сквитованы.
Дата сделки	Во встречных поручениях поля «дата сделки» должны совпадать.
Номер сделки	В поручении можно заполнить поле «сделка №» только при наличии «даты сделки». Поля «сделка №» должны совпадать во встречных поручениях.
Дополнительные квитовочные поля	Комментарии
Место заключения сделки	Данное поле сверяется в обязательном порядке, если оно заполнено хотя бы в одном из поручений.



2.5 Результат квитовки

По результатам успешной квитовки поручений клиентам предоставляются следующие отчеты:

- **GS116** со статусом «сквитовано» (ПО «ЛУЧ»);
- **MT548** со статусом MACH (SWIFT).

Если поручение осталось несквитованным, то оно переходит на дополнительный этап «Предварительной квитовки» или «Электронного мэтчинга».



3. ПРЕДВАРИТЕЛЬНАЯ КВИТОВКА

НРД предоставляет сервис Электронного мэтчинга, когда клиенту передается информация о наличии в системе потенциально встречных инструкций – несквитованных инструкций, отличающихся друг от друга на одно поле или на одну группу полей. При этом для всех найденных потенциально встречных поручений определяется степень релевантности.

Электронный мэтчинг осуществляется только при использовании в поручениях способа квитовки по «дате сделки». Соответственно, если в поручении указан референс или номер сделки, то предварительная сверка поручений осуществляется по правилам описанным в приложенным ниже таблицам для квитовки по референсу.

3.1 Для 16х операций

Способ квитовки	Этап «Предварительной квитовки»	Информация/поля, которые должны совпадать во встречных поручениях	Информация/поля, которые могут отличаться во встречных поручениях
По дате сделки	Применяется «Электронный мэтчинг» - механизм поиска потенциальных встречных поручений и определения релевантного поручения.	<ol style="list-style-type: none"> 1. Получатель 2. Отправитель 3. Код ценной бумаги 4. Количество 5. Количество выпусков в одном поручении 6. Дополнительные квитовочные поля 	<ol style="list-style-type: none"> 1. Счет депо и раздел отправителя 2. Счет депо и раздел получателя 3. Дата расчетов/дата начала исполнения 4. Дата сделки 5. Код операции 6. Условия расчетов (FOP/DVP)
По референсу	НРД формирует отчеты с информацией по всем полям, по которым не прошла сверка между двумя поручениями с одинаковым референсом. Отдельный отчет отправляется для каждого расхождения.	<ol style="list-style-type: none"> 1. Код операции 2. Референс 3. Дата сделки 4. Получатель 5. Отправитель 	<ol style="list-style-type: none"> 1. Счет депо отправителя 2. Раздел счета депо отправителя 3. Счет депо получателя 4. Раздел счета депо получателя 5. Код ценной бумаги 6. Количество выпусков в одном поручении 6. Дата расчетов/дата начала исполнения 7. Дополнительные квитовочные поля



3.2 Для 19х операций

Способ квитовки	Этап «Предварительной квитовки»	Информация/поля, которые должны совпадать во встречных поручениях	Информация/поля, которые могут отличаться во встречных поручениях
По дате сделки	Применяется «Электронный мэтчинг» - механизм поиска потенциальных встречных поручений и определения релевантного поручения.	<ol style="list-style-type: none">1. Контрагент и инициатор2. Код ценной бумаги3. Количество4. Количество выпусков в одном поручении	<ol style="list-style-type: none">1. Счет депо и раздел отправителя2. Счет депо и раздел получателя3. Дата расчетов4. Дата сделки5. Сумма сделки6. Валюта сделки и валюта платежа7. Тип DVP (1,2,3)8. Код операции9. Условия расчетов (FOP/DVP)10. Место заключения сделки
По номеру сделки	НРД формирует отчеты с информацией по всем полям, по которым не прошла сверка между двумя поручениями с одинаковым номером сделки. Отдельный отчет отправляется для каждого расхождения.	<ol style="list-style-type: none">1. Код операции2. Номер сделки3. Дата сделки4. Контрагент и инициатор	<ol style="list-style-type: none">1. Счета депо2. Разделы счетов депо3. Дата расчетов4. Сумма сделки5. Валюта сделки6. Валюта платежа7. Тип DVP (1,2,3)8. Код ценной бумаги9. Количество10. Количество выпусков в одном поручении11. Место заключения сделки



4. ЭЛЕКТРОННЫЙ МЭТЧИНГ ДЛЯ КВИТОВКИ ПО «ДАТЕ СДЕЛКИ»

При поиске потенциальных встречных поручений **определенные поля** в поручениях клиентов **должны совпадать**, а **оставшиеся поля могут отличаться**.

Поручения будут считаться потенциально встречными (ПВП), если в них совпадают все квитовочные поля, кроме одного поля или одной группы полей, из приведенного ниже списка. Каждое поле или группа полей, которые отличаются во встречных поручениях, образует расхождение, информация о котором предоставляется клиенту и его контрагенту.

Необходимо иметь в виду, что между потенциально встречными поручениями может быть только одно расхождение, но для каждого поручения может быть найдено несколько потенциально встречных поручений с одинаковыми или разными типами расхождений. Если расхождения имеют разный тип, то система НРД ранжирует такие поручения по степени релевантности по присвоенному весу согласно нижеприведённому списку.

Если поручения имеют одинаковый тип расхождений (поручения с равными весами расходящихся полей), то в качестве наиболее релевантного поручения считается первое по времени поступления в НРД.

Потенциальной встречной будет считаться инструкция, в которой отличаются не более одного поля или одной группы полей из перечня ниже.

4.1 Для 16х операций

Наименование поля / Группы полей, которые могут отличаться	Тип расхождений	Вес
Условия расчетов (FOP или DVP)	FRAP	950
Дата расчетов	DDAT	900
Дата сделки	DTRD	800
Группа полей: счет депо и раздел счета депо отправителя	SAFE	700
Группа полей: счет депо и раздел счета депо получателя	SAFE	700
Код операции (Списание или Зачисление ценных бумаг)	DELN	600



4.2 Для 19х операций

Наименование поля / Группы полей, которые могут отличаться	Тип расхождений	Вес
Условия расчетов (FOP или DVP)	FRAP	950
Дата расчетов	DDAT	900
Сумма сделки	DMON	850
Дата сделки	DTRD	800
Группа полей: счет депо и раздел счета депо отправителя	SAFE	700
Группа полей: счет депо и раздел счета депо получателя	SAFE	700
Тип DVP (1,2,3)	NARR	650
Код операции (Списание или Зачисление ценных бумаг)	DELN	600
Группы полей: валюта сделки и валюта платежа	NCRR	550
Место заключения сделки	PLCE	500

4.3 Исключения из правил

Исключением из правил является сверка условий расчетов, когда поручения на перевод ценных бумаг без оплаты (FOP) сверяются с поручениями на перевод ценных бумаг против платежа (DVP). Во встречных поручениях могут отличаться условия расчетов по денежным средствам, когда одна сторона сделки рассчитывает исполнить сделку на условиях DVP, а другая – на условиях свободной поставки (FOP).

Для данной ситуации формируется отчет о потенциально встречных поручениях с кодом расхождений «FRAP». Сверка условий расчетов осуществляется по нестандартному алгоритму:

- между поручениями **16 (DF)** и **19/1 (RVP)**, или
- между поручениями **16/1 (RF)** и **19/0 (DVP)**, когда во встречных поручениях могут отличаться все поля, **за исключением:**
 - счета депо и раздела счета депо отправителя
 - счета депо и раздела счета депо получателя
 - кода ценных бумаг
 - количества ценных бумаг
 - даты сделки
 - даты расчетов/даты начала исполнения.



4.4 Отчет по электронному мэтчингу

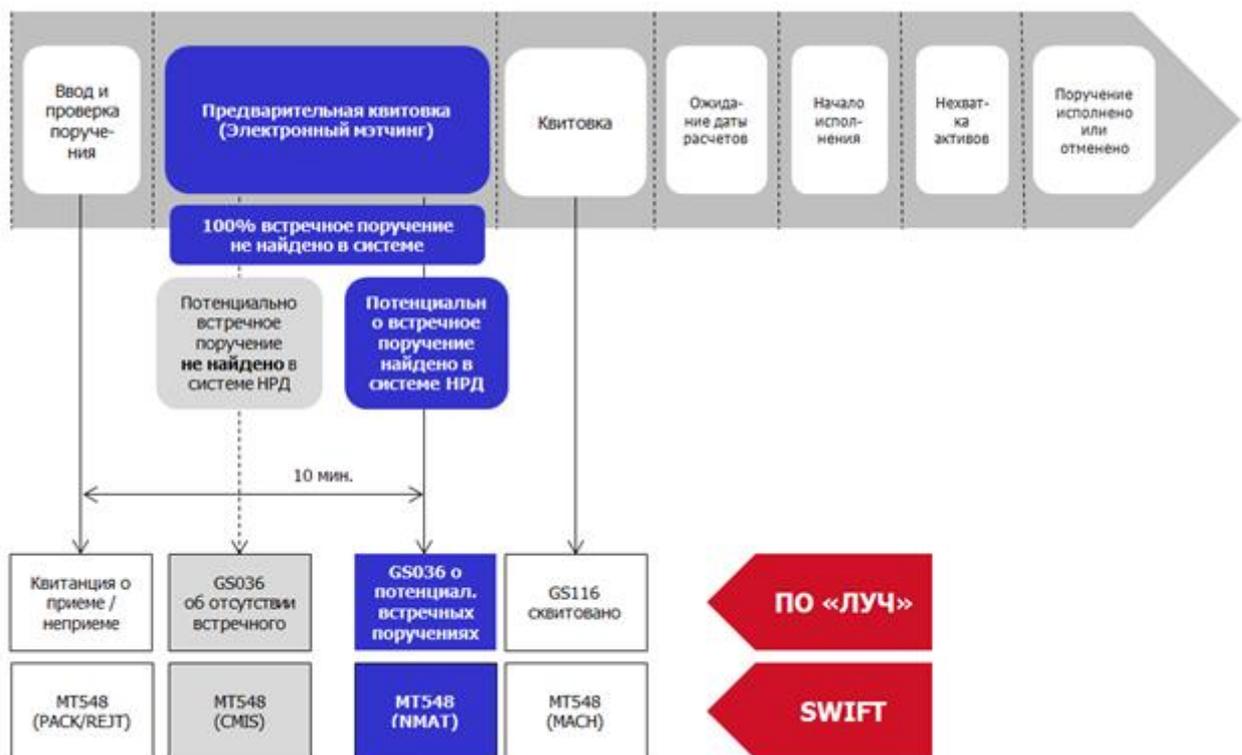
При наличии потенциального встречного поручения в системе НРД клиентам отправляется Уведомление о потенциальных встречных поручениях в формате GS036 и MT548. Уведомления о потенциальных встречных поручениях с информацией о расхождениях отправляются:

- **инициатору поручения;**
- **контрагенту,** указанному в таком поручении;

при этом анализируется опция, которую выбрал каждый из указанных клиентов.

Общая схема отправки отчетов по электронному мэтчингу может быть представлена в двух базовых вариантах:

4.4.1 Вариант 1. Потенциально встречное поручение есть

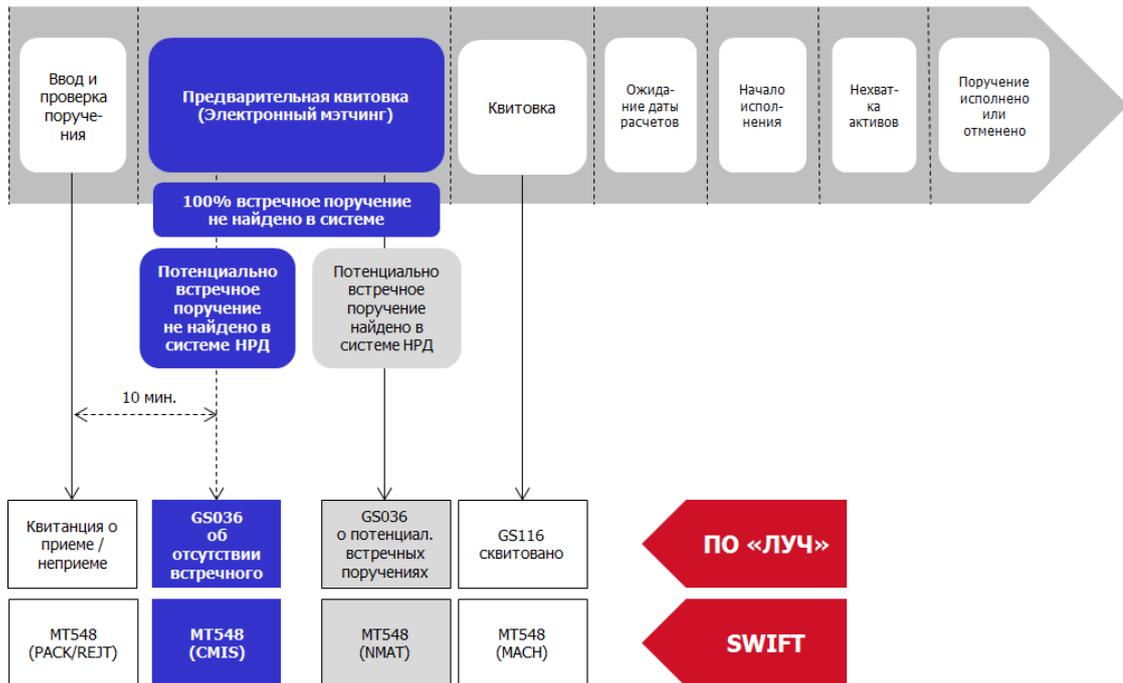


Поручение поступает в НРД, но остается несквитованным, так как встречного поручения со всеми совпадающими полями нет. Через 10 минут после поступления для такого поручения начинается дополнительный этап «электронного мэтчинга». Если в системе найдено потенциальное встречное поручение, то клиенту и его контрагенту отправляются следующие отчеты в зависимости от канала связи:

- **GS036** – Уведомление о потенциальных встречных поручениях (ПО «ЛУЧ»);
- **MT548** (NMAT//Disagreement code) – Settlement status (SWIFT).

Примеры отчетов приведены в [Приложении 1 к настоящему Руководству](#).

4.4.2 Вариант 2. Потенциального встречного поручения нет



Поручение поступает в НРД, но остается несквитованным, так как встречного поручения со всеми совпадающими полями нет. Через 10 минут после поступления для такого поручения начинается дополнительный этап «электронного мэтчинга». Если потенциальное встречное поручение не обнаружено, то клиенту отправляются следующие отчеты в зависимости от канала связи:

- **GS036** – Уведомление об отсутствии встречного поручения (ПО «ЛУЧ»)
- **MT548** (NMAT//CMIS) – Settlement status (SWIFT)

Одновременно Контрагенту, указанному в поручении клиента, будут отправлены следующие отчеты:

- **GS036** – Уведомление о наличии встречного поручения (ПО «ЛУЧ»)
- **MT578** – Settlement Allegement (SWIFT)

Уведомления о наличии встречного поручения, направляемые как через ПО ЛУЧ, так через SWIFT, содержат полную информацию о квитовочных полях во встречном поручении. Это позволяет клиенту самостоятельно определить встречную инструкцию в своей системе и выставить поручение в НРД. Перед отправкой таких отчетов НРД контролирует, что контрагент и счет депо совпадают и не допущена ошибка. Исключением является случай предоставления поручения через SWIFT, когда в SWIFT инструкции MT540-543 контрагент (DEAG, REAG) прописан через опцию «Q»². В данном случае соответствующая проверка контрагента и счета депо не осуществляется и отчет о наличии встречного поручения направляется в адрес владельца счета депо, указанного в такой SWIFT инструкции.

Примеры отчетов приведены в [Приложении 2 к настоящему Руководству](#).

² Опция «Q» - текстовое описание контрагента без использования какого-либо кода, например, SWIFT BIC или код НРД.



Все клиенты НРД могут настроить получение информационного отчета, который содержит «Информацию о наличии встречных поручений депонента – контрагента», который является аналогом 3 блока отчета **GS116**. Такой отчет отправляется депонентам и участникам клиринга в зависимости от канала связи: **GS117** (ПО «ЛУЧ») или **MT586** (SWIFT). Периодичность предоставления отчета - 3 раза в день в 11:10, 14:10 и 17:10. Если депонент является оператором, то отчет такому депоненту будет формироваться отдельно по его собственным счетам и отдельно по счетам представляемого лица, т.е. в этом случае депонент будет получать 2 отчета.

По умолчанию отчет не предоставляется. Для получения отчета депонент должен подать 97 поручение, в котором необходимо явно указать тип отчета **GS117** с опцией «Направлять».

5. КАК РАБОТАЮТ ВЕСА

В зависимости от веса расходящихся полей/группы полей НРД рассчитывает наиболее близкие друг к другу поручения (релевантные поручения). Релевантными считаются поручения, в которых вес расходящихся полей максимальный. При наличии двух или более инструкций с равными весами расходящихся полей, в качестве наиболее релевантной инструкции считается первая по времени поступления инструкция.

Далее представлен пример для Клиента А, состоящий из 3х этапов.

5.1 Этапы поиска релевантных поручений

Этап 1. Предоставление поручения

Клиент А предоставил в НРД поручение №1:

Наименование поля	Поручение №1
Инициатор	Клиент А
Контрагент	Клиент Б
Код операции	16/1 (зачисление)
Дата расчетов / дата начала исп.	05.11.2014
Счет депо списания	TL1111111111
Раздел счета депо списания	0000000000000000
Счет депо зачисления	TL3333333333
Раздел счета депо зачисления	7000000000000000
Код ценной бумаги	RU0009029540
Количество	1000
Дата сделки	30.10.2014

Этап 2. Направление встречного поручения

После этого Клиент Б направляет в НРД встречное поручение №2, в котором отличается раздел счета депо получателя. В результате для поручения №1 поручение №2 становится потенциально встречным и имеет расхождение с весом 700. Так как других поручений нет в системе, поручение №2 являются еще и самым релевантным.

Наименование поля	Поручение №1	Поручение №2
Инициатор	Клиент А	Клиент Б
Контрагент	Клиент Б	Клиент А
Код операции	16/1 (зачисление)	16 (списание)
Дата расчетов / дата начала исп.	05.11.2014	05.11.2014
Счет депо списания	TL1111111111	TL1111111111
Раздел счета депо списания	0000000000000000	0000000000000000
Счет депо зачисления	TL3333333333	TL3333333333
Раздел счета депо зачисления	7000000000000000	0000000000000000
Код ценной бумаги	RU0009029540	RU0009029540
Количество	1000	1000
Дата сделки	30.10.2014	30.10.2014
Вес расхождений с Поручением №1		700 – Релевантное



Этап 3. Отправка дополнительного поручения

Клиент Б направляет еще одно поручение №3, в котором уже отличается дата сделки. В результате для поручения №1 существует два подходящих потенциально встречных поручения.

Наименование поля	Поручение №1	Поручение №2	Поручение №3
Инициатор	Клиент А	Клиент Б	Клиент Б
Контрагент	Клиент Б	Клиент А	Клиент А
Код операции	16/1 (зачисление)	16 (списание)	16 (списание)
Дата расчетов / дата начала исп.	05.11.2014	05.11.2014	05.11.2014
Счет депо списания	TL1111111111	TL1111111111	TL1111111111
Раздел счета депо списания	0000000000000000	0000000000000000	0000000000000000
Счет депо зачисления	TL3333333333	TL3333333333	TL3333333333
Раздел счета депо зачисления	7000000000000000	0000000000000000	7000000000000000
Код ценной бумаги	RU0009029540	RU0009029540	RU0009029540
Количество	1000	1000	1000
Дата сделки	30.10.2014	30.10.2014	29.10.2014
Вес расхождений с Поручением №1		700	800 – Релевантное

При этом расхождения с поручением №3 имеют больший вес (**800**), чем вес расхождений с поручением №2, что делает поручение №3 более релевантным для поручения Клиента А.

5.2 Групповая сверка полей

При осуществлении групповой сверки определенный блок информации из одного поручения сравнивается с блоком аналогичной информации во встречном поручении. При наличии расхождения в любом из полей или во всех полях из указанного блока направляется отчет с одним расхождением и соответствующим кодом ошибки.

В поручениях с кодами операций **16, 16/1, 19/0, 19/1 (MT540-543)** групповая сверка осуществляется для поиска расхождений с кодом «SAFE» в счетах депо и разделах счетов депо. Существуют две группы со следующими полями:

- Счет депо и раздел счета депо отправителя (или дополнительный идентификатор);
- Счет депо и раздел счета депо получателя (или дополнительный идентификатор).



ПРИМЕР:

Во встречных поручениях Клиента А и Клиента Б отличаются и счет депо, и раздел счета депо получателя.

Наименование поля	Поручение №1 от Клиента А (MT542)	Поручение №2 от Клиента Б (MT540)	
Инициатор	Клиент А	Клиент Б	
Контрагент	Клиент Б	Клиент А	
Код операции	16 (Списание)	16/1 (зачисление)	
Дата расчетов / дата начала исп.	05.11.2014	05.11.2014	
Счет депо списания	TL1111111111	TL1111111111	Группа полей: счет депо и раздел счета депо отправителя
Раздел счета депо списания	000000000000000000	000000000000000000	
Счет депо зачисления	TL3333333333	TL2222222222	Группа полей: счет депо и раздела счета депо получателя
Раздел счета депо зачисления	700000000000000000	000000000000000000	
Код ценной бумаги	RU0009029540	RU0009029540	
Количество	1000	1000	
Дата сделки	30.10.2014	30.10.2014	
Описание расхождений (русский)	Во встречном поручении №2 указано другое значение полей «Номер счета депо получателя» и «Раздел счета депо получателя» (SAFE)	Во встречном поручении №1 указано другое значение полей «Номер счета депо получателя» и «Раздел счета депо получателя» (SAFE)	
Описание расхождений (английский)	Receiving Agent safekeeping account mismatch (SAFE)	Receiving Agent safekeeping account mismatch (SAFE)	
Пример отчета SWIFT	 Пример А1	 Пример Б2	



Для поручений с кодами операций 19/0 и 19/1 (MT541 и MT543) групповая сверка осуществляется для поиска расхождений в полях «Валюта сделки» и расхождений в денежных счетах зачисления и списания (валюта платежа). В данном случае используется код расхождений «NCRR».

ПРИМЕР:

Во встречных поручениях Клиента А и Клиента Б отличаются денежные счета (валюта платежа) при этом валюта сделки совпадает.

Наименование поля	Клиринговое поручение №3 от Клиента А (MT543)	Клиринговое поручение №4 от Клиента Б (MT541)	
Инициатор	Клиент А (AAAARUMM)	Клиент Б (BBBBRUMM)	
Контрагент	Клиент Б (BBBBRUMM)	Клиент А (AAAARUMM)	
Код операции	19/0 (списание)	19/1 (зачисление)	
Дата расчетов / дата начала исп.	09.11.2015	09.11.2015	
Счет депо списания	TL1111111111	TL1111111111	
Раздел счета депо списания	000000000000000000	000000000000000000	
Счет депо зачисления	TL3333333333	TL3333333333	
Раздел счета депо зачисления	700000000000000000	700000000000000000	
Код ценной бумаги	RU0009029540	RU0009029540	
Количество	1000	1000	
Дата сделки	09.11.2015	09.11.2015	
Валюта сделки	USD	USD	
Сумма сделки	1000	1000	
Денежный счет зачисления	RUB	-	Группа полей: валюта сделки и валюта платежа
Денежный счет списания	-	USD	
Описание расхождений (русский)	NMAT//NCRR Во встречном поручении №4 указано другое значение валюты сделки / платежа	NMAT//NCRR Во встречном поручении №3 указано другое значение валюты сделки / платежа	
Описание расхождений (английский)	Transaction currency and payment currency mismatch (NCRR)	Transaction currency and payment currency mismatch (NCRR)	
Пример отчета SWIFT	 Пример А3	 Пример Б4	



6. КАК ПОДКЛЮЧИТЬСЯ

Подключение не требуется.

Всем клиентам НРД при наличии в системе потенциально встречного поручения рассылается соответствующие уведомления по каналам взаимодействия, указанным в Анкете ЭДО или в распоряжении по форме GF097 «Изменение порядка направления отчетных и других документов».

Уведомления о потенциальных встречных поручениях являются одной из обязательных частей в группе отчетов о статусе поручения. Все клиенты получают такие уведомления в виде отчета:

- **GS036** - Уведомление о потенциальных встречных поручений (ПО «ЛУЧ»)
- **MT548** со статусом NMAT (SWIFT)

Уведомления о потенциальных встречных могут формироваться по одной из опций, которую можно выбрать через 93 операцию:

- **Опция 1** – по умолчанию – «включать одно поручение»
- **Опция 2** – «включать все поручения»

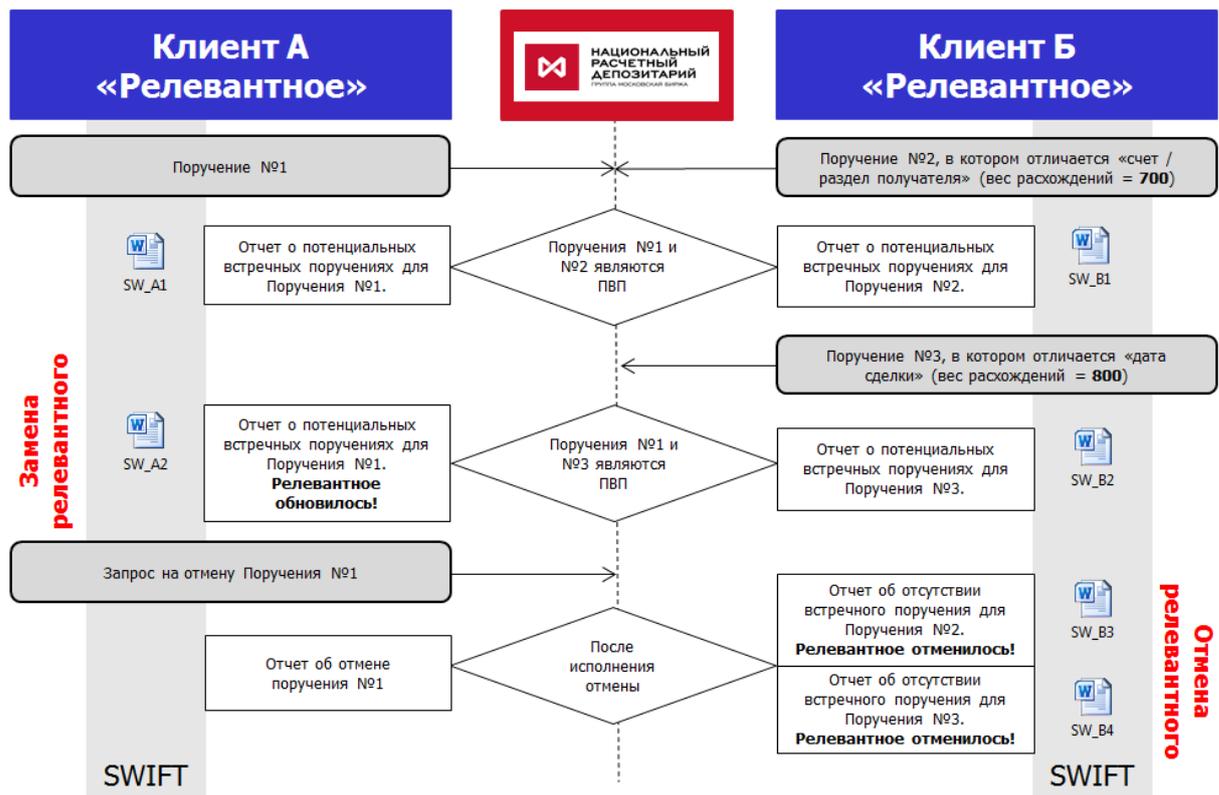


Опция 1. Уведомление об одном (релевантном) встречном поручении

Для каждого поручения клиента, если для него были подобраны возможные встречные поручения, НРД направляет информацию в виде отчета GS036 - Уведомление о потенциальных встречных поручениях или MT548 (NMAT).

В уведомлении содержится информация только о «релевантном» поручении, т.е. указывается только одно встречное поручение с типом расхождений, которое имеет максимальный вес. Уведомление о релевантном встречном поручении может быть обновлено в 2 случаях:

- 1) При поступлении в систему НРД поручения с большим весом расхождений Клиенту будет предоставлен **НОВЫЙ** отчет о «релевантном» встречном поручении.
- 2) Если «релевантное» поручение было сквитовано с другим поручением или отменено, то отчет о релевантном поручении будет также обновлен при наличии в системе другого поручения с меньшим весом. Важно! Если в системе нет другого потенциально встречного поручения, то инициатору будет предоставлен отчет GS036 – Уведомление об отсутствии встречного поручения или MT548 (NMAT//CMIS).



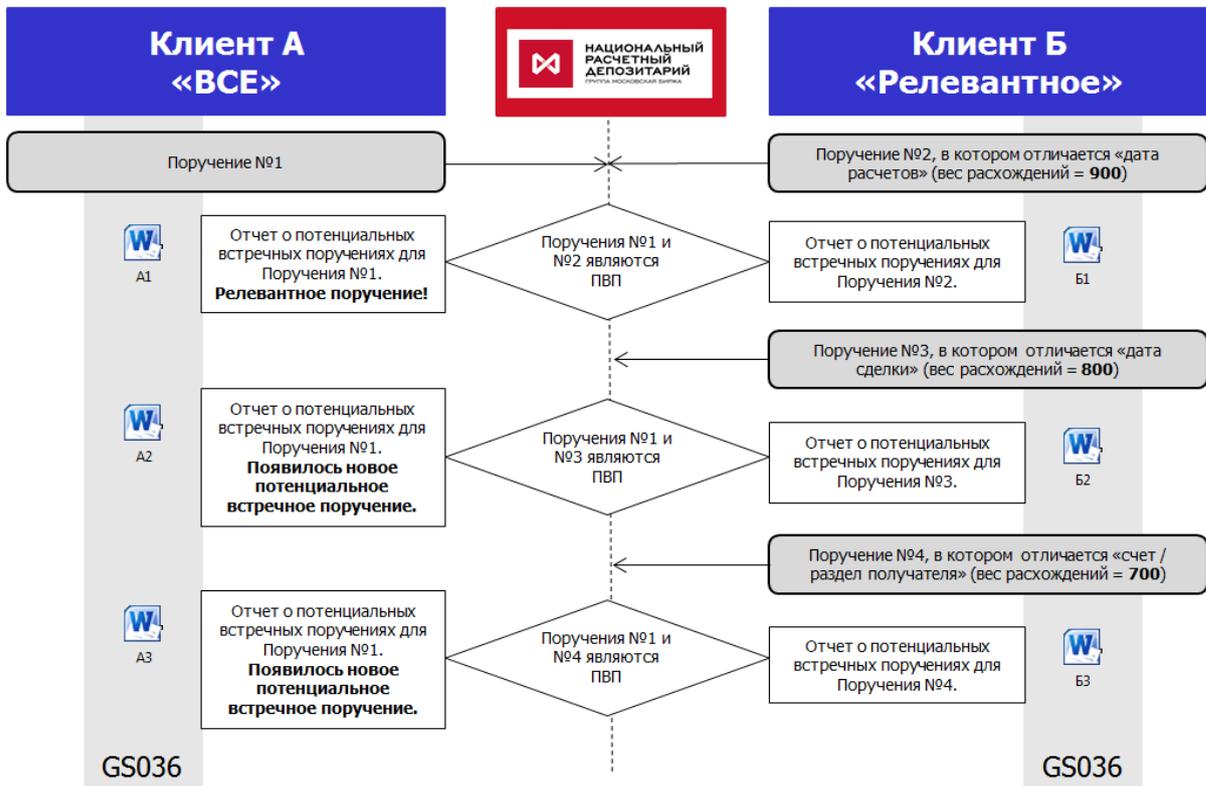


Опция 2. Уведомление о всех потенциальных встречных поручениях

Для каждого поручения клиента, если для него были подобраны возможные встречные поручения, НРД направляет информацию в виде отчета GS036 - Уведомление о потенциальных встречных поручений или MT548 (NMAT).

В уведомлении GS036 содержится информация обо всех подобранных потенциальных встречных поручениях, при этом отдельно в отчете в специальном поле отмечается «релевантное» поручение (встречное поручение с расхождениями, имеющими максимальный вес). Для клиентов использующих SWIFT отправляется отдельное сообщение MT548 для каждого потенциального встречного.

В данной опции отчет обновляется при поступлении в систему каждого нового встречного поручения, а также при отмене или квитовке любого из потенциальных встречных поручений, которое ранее было отражено в уведомлении.



Более подробно сценарии отправки отчетов для каждой опции представлены в [презентации](#).



7. УПРАВЛЕНИЕ ОТЧЕТАМИ

Для того, чтобы изменить опцию по умолчанию можно предоставить в НРД поручение к счету депо по форме AF093 (код операции - 93) с указанием нового значения для параметра «Уведомление о потенциальных встречных поручениях»:

- **Опция 2** – «включать все поручения», если клиент хочет получать уведомление обо всех потенциальных встречных поручениях.

Чтобы вернуть опцию по умолчанию необходимо подать новое поручение к данному счету депо с указанием нового значения для параметра «Уведомление о потенциальных встречных поручениях»:

- **Опция 1** – «включать одно поручение», если клиент хочет получать уведомление об одном, наиболее подходящем встречном поручении. «Релевантное» поручение.

93 операцию можно оформить и предоставить в НРД через ПО «ЛУЧ».

Отдельными отчетами в рамках предварительной квитанки, квитанки и других этапов жизненного цикла поручений можно управлять через [97 операцию](#).



8. ОТМЕНА ПОРУЧЕНИЙ

После квитовки инструкций их отмена возможна только по инициативе обоих контрагентов. В НРД применяется подход, основанный на двусторонней отмене сквитованных поручений при наличии одностороннего механизма «Hold&Release». Если квитовка поручений осуществляется заранее, то вероятность возникновения необходимости отмены встречных инструкций существенно возрастает. Для уведомления контрагента о намерении клиента отменить сквитованные поручения используется отдельный тип отчета:

- **GS036** - Уведомление о наличии поручения на отмену (ПО «ЛУЧ»);
- **MT548** со статусом IPRC//CPRC (SWIFT).

Как работает двусторонняя отмена при одностороннем Hold&Release

Если одному из контрагентов по сделке потребовалось отменить еще не исполненное поручение после его квитовки со встречным поручением, то последовательность действий может быть следующей:

- 1) Клиент изменяет статус своего поручения и устанавливает статус «для сверки» посредством операции с кодом 530 (способы оформления данной операции описаны в соответствующем [разделе на сайте НРД](#));
- 2) После исполнения 530 операции Клиенту и Контрагенту отправляется отчет о статусе сквитованной пары с информацией о том, что поручения не могут быть рассчитаны из-за статуса одного из поручений - «для сверки»;
- 3) Клиент отправляет запрос на отмену своего поручения посредством операции с кодом 70;
- 4) Клиенту отправляется отчет о том, что его запрос на отмену ожидает подтверждение со стороны контрагента;
- 5) Контрагенту отправляется отчет о том, что инициирован процесс отмены сквитованных поручений и от него ожидается поступление встречного поручения на отмену собственного поручения.

При этом последовательность отправки поручений с кодами 70 и 530 может быть и обратной.



Приложения

Приложение 1. Примеры отчетов при наличии потенциального встречного поручения

Наименование поля / группы полей, которые могут отличаться	Тип расхождений	Отчет ПО «ЛУЧ»	Отчет SWIFT
Условия расчетов (FOP / DVP)	FRAP	 ЛУЧ.FRAP	 SWIFT.FRAP
Дата расчетов	DDAT	 ЛУЧ.DDAT	 SWIFT.DDAT
Дата сделки	DTRD	 ЛУЧ.DTRD	 SWIFT.DTRD
Группа полей: счет депо и раздел счета депо получателя	SAFE	 ЛУЧ.SAFE (REC)	 SWIFT.SAFE (REC)
Группа полей: счет депо и раздел счета депо отправителя	SAFE	 ЛУЧ.SAFE (DEL)	 SWIFT.SAFE (DEL)
Код операции (Списание / Зачисление)	DELN	 ЛУЧ.DELN	 SWIFT.DELN
Сумма сделки <i>только для 19х операций</i>	DMON	 ЛУЧ.DMON	 SWIFT.DMON
Тип DVP (1,2,3) <i>только для 19х операций</i>	NARR	 ЛУЧ.NARR	 SWIFT.NARR
Группа полей: валюта сделки и валюта платежа <i>только для 19х операций</i>	NCRR	 ЛУЧ.NCRR	 SWIFT.NCRR
Место заключения сделки <i>только для 19х операций</i>	PLCE	 ЛУЧ.PLCE	 SWIFT.PLCE



Приложение 2. Примеры отчетов при отсутствии потенциального встречного поручения

Наименование отчета	ПО «ЛУЧ»	SWIFT
Уведомление об отсутствии встречного поручения (Отчет для инициатора поручения)	 ЛУЧ.Отсутствие	 SWIFT.CMIS
Уведомление о наличии встречного поручения (Отчет для контрагента)	 ЛУЧ.Наличие	 SWIFT.578