

Фондовый рынок

Таблица "Позиция по инструментам на счетах депо" по торгово-клиринговым счетам "S+/I-/C+" (тип раздела KASE)			
Входящая = входящий остаток на утро + рассчитанные сделки (Z0, B0) + внешняя динамика по ценным бумагам	Текущая = входящий остаток + динамика + исполненные сделки (T0, Yn) + рассчитанные сделки (Z0, B0)	Плановая = Текущая - заявки T0 на <u>продажу</u> - выставленный отчет на исполнение (Z0, B0) - заявки Z0 на продажу	Расчетная = Плановая + Нетто по сделкам T+ с наступившей датой исполнения - Внешн.огр.плановой (блокировка для расчетов клиринга)

Таблицы "Обязательства и требования по бумагам/активам" (с ЦК)
Плановая T(n) = Плановая T(n-1) + Нетто T(n) - заявки T(n)на <u>продажу</u>

Таблица "Позиция по деньгам" по торгово-клиринговым счетам "S+/I-/C+" по сделкам с ЦК			
Входящая = входящий остаток на утро	Текущая = входящий остаток + динамика + исполненные сделки (T0) + расчеты клиринговой сессии	Плановая = Текущая - заявки T0 на <u>покупку</u> - выставленный отчет на исполнение по прямым сделкам	Расчетная = Плановая + Нетто по сделкам T+ с наступившей датой исполнения - Макс.огр. (блокировка для расчетов клиринга)

Таблица "Обязательства и требования по деньгам" (с ЦК)
Плановая T(n) = Плановая T(n-1) + Нетто T(n)по сделкам с ЦК - заявки T(n) на <u>покупку</u>

Таблица "Позиция по деньгам" по торгово-клиринговым счетам "S0/I0/C0" по сделкам без ЦК			
Входящая = входящий остаток на утро	Текущая = входящий остаток + динамика + рассчитанные сделки (Z0, B0)	Плановая = Текущая - заявки Z0 на <u>покупку</u> - выставленный отчет на исполнение сделки на покупку (Z0, B0)	Расчетная = Плановая

коды расчетов с ЦК (нетто)

T0 - сделки с полным покрытием
Y- сделки с частичным обесп.

коды расчетов без ЦК (гросс)

Z0 -сделки гросс
B0 -сделки аукционы

Клиринговый пул сделок 1-й сессии	Клиринговый пул сделок 2-й сессии
1. сделки Y с текущей датой расчетов, заключенные до 15:30 2. сделки T0, заключенные до 16:35 3. сделки в режимах Самоурегулирования с 15:30 до 16:00 4. сделки по передаче дохода	1. сделки Y с текущей датой расчетов, заключенные с 15:30 до 17:30 2. сделки T0, заключенные с 16:35 до 17:30 3. сделки в режимах Самоурегулирования с 17:30 до 17:45
Начало сессии 15:30 Конец сессии 17:00 Cut-off time 16:00	Начало сессии 17:30 Конец сессии 18:45 Cut-off time 17:45
Достаточность активов для расчетов показывает расчетная позиция на время 15:30	Достаточность активов для расчетов показывает расчетная позиция на время 17:30
В случае минусов по расчетным позициям необходимо до 16:00 !!!: - довести деньги на коррсчет KASE в ЦД + для клиентских счетов сегрегировать их на счета I+/C+ в TC ASTS+ - довести ценные бумаги на раздел KASE заключить репо только в режимах Самоурегулирования с 15:30 до 16:00!!! заключить куплю-продажу в режимах T0 до 16:00!!!	В случае минусов по расчетным позициям необходимо до 17:45 !!!: - довести деньги на коррсчет KASE в ЦД + для клиентских счетов сегрегировать их на счета I+/C+ в TC ASTS+ - довести ценные бумаги на раздел KASE заключить репо только в режимах Самоурегулирования с 17:30 до 17:45!!!

В случае отсутствия на время Cut-off time необходимого количества активов автоматически проводится процедура переноса неисполненных обязательств посредством операций репо по штрафным ставкам урегулирования

Вывод денег со счета KASE в ЦД осуществляется в течение дня по распоряжениям участников, отправленных с 10:30 до 18:00
Вывод денег возможен в размере [Плановой позиции - Макс. Огр.(блокировка под расчеты клиринга)] по деньгам (! только при положительной проверке Единого лимита)
Вывод ценных бумаг с раздела KASE возможен в размере минимального значения из Входящей и [Плановой-Внешн.огр.по плановой] позиции по ценной бумаге (! только при положительной проверке Единого лимита)