



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ**
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



РОЛЬ НРД В ПРОДУКТЕ КСУ

СИСТЕМА УПРАВЛЕНИЯ ОБЕСПЕЧЕНИЕМ РОЛЬ НРД В ПРОЕКТЕ КСУ



СИСТЕМА УПРАВЛЕНИЯ ОБЕСПЕЧЕНИЕМ

РОЛЬ НРД В ПРОЕКТЕ КСУ

Клиринговый сертификат участия (КСУ) совместный проект группы Московская Биржа и Банка России по созданию однородного универсального обеспечения – новой ценной бумаги КСУ.

Участники сохраняют право собственности на активы, вносимые в пул (право на получение доходов и право голоса), а владельцы КСУ получают дополнительную защиту благодаря невозможности наложения ареста на активы в имущественном пуле.

РОЛЬ НРД В РЕАЛИЗАЦИИ И ФУНКЦИОНИРОВАНИИ НОВОГО ПРОДУКТА:

УЧЕТ И ХРАНЕНИЕ

- хранение базовых активов на субсчетах депо для учета ценных бумаг, переданных в имущественный пул
- хранение КСУ и глобальных сертификатов КСУ

СИСТЕМА УПРАВЛЕНИЯ ОБЕСПЕЧЕНИЕМ

- первоначальный подбор активов в имущественный пул для выпуска КСУ
- подбор активов для целей исполнения маржинальных требований по пулу
- при согласовании с Банком России подбор КСУ в корзину РЕПО Банка России



ТАРИФНАЯ МОДЕЛЬ

УСЛУГА НРД	ПРЕДЛАГАЕМАЯ ТАРИФИКАЦИЯ	КОММЕНТАРИЙ
Хранение базовых активов на субсчетах клиринговой организации, осуществляющей выдачу КСУ	Действующая регрессионная шкала платы за хранение ценных бумаг НКО АО НРД	Плата взимается с Клиента. При расчете комиссии также учитываются остатки клиента на счетах депо *
Хранение КСУ	1000 рублей в месяц	Плата взимается с Клиента. Плата взимается за каждый раздел счета депо депонента, на котором хотя бы один день в расчетном месяце хранился КСУ *
Обеспечение возможности использования СУО НРД в целях осуществления операций с клиринговыми сертификатами участия	На период действия маркетингового периода комиссия за сделки РЕПО с КСУ тарифицируются так же, как и сделки РЕПО с Центральным контрагентом**	
Инвентарные операции	Действующие тарифы за инвентарные операции НКО АО НРД	Плата взимается с Клиента

* С подробной информацией о тарифах НКО АО НРД можно ознакомиться на сайте в разделе [Тарифы](#)

** С подробной информацией о тарифах Фондовой биржи ММВБ и НКЦ за обслуживание сделок РЕПО с Центральным контрагентом можно ознакомиться на сайте Московской биржи в разделе [Тарифы РЕПО](#)



ДЕПОЗИТАРНЫЙ УЧЕТ ЦЕННЫХ БУМАГ, ПЕРЕДАННЫХ В ИМУЩЕСТВЕННЫЕ ПУЛЫ, И КСУ



СУБСЧЕТА ДЕПО ДЛЯ УЧЕТА ЦЕННЫХ БУМАГ, ВНЕСЕННЫХ В ИМУЩЕСТВЕННЫЕ ПУЛЫ

- 8S** Субсчет депо. Ценные бумаги владельца, переданные НКЦ в имущественный пул
- 8D** Субсчет депо. Ценные бумаги доверительного управляющего, переданные НКЦ в имущественный пул
- 8L** Субсчет депо. Ценные бумаги номинального держателя, переданные НКЦ в имущественный пул
- 8W** Субсчет депо. Ценные бумаги иностранного номинального держателя, переданные НКЦ в имущественный пул

Субсчет депо открывается при условии заключения с депонентом дополнительного соглашения к ранее заключенным с депонентом договорам счета депо.



ОТКРЫТИЕ СУБСЧЕТА ДЕПО

- Субсчет депо открывается по поручению Банка НКЦ (АО) на имя депонента, ценные бумаги которого учитываются на субсчете депо.
- Код субсчета депо формируется по правилам формирования кода торгового раздела.
- По результатам исполнения операции депоненту предоставляется отчет по форме AS090.

ЗАЧИСЛЕНИЕ ЦЕННЫХ БУМАГ НА СУБСЧЕТА ДЕПО МОЖЕТ ОСУЩЕСТВЛЯТЬСЯ:

- В соответствии с распоряжением участника клиринга Банка НКЦ (АО), указанного в коде субсчета депо, переданным через терминал в Торговую систему. Ценные бумаги будут переведены на основании поручения Банка НКЦ (АО) (код операции – 14), Депоненту будет предоставлен отчет по форме **MS140**;
- в результате подбора ценных бумаг в соответствии с договором об оказании услуг по управлению обеспечением:
 - по поручению Банка НКЦ (АО);
 - По поручению депонента.

Ценные бумаги будут переведены по поручению НКО АО НРД (код операции 10/GET). По результатам исполнения операции депоненту будет предоставлен отчет по форме **MS101**.

ПО ОКОНЧАНИИ ОПЕРАЦИОННОГО ДНЯ ВЛАДЕЛЬЦАМ СУБСЧЕТОВ ДЕПО, ВЫДАЮТСЯ СЛЕДУЮЩИЕ ОТЧЕТЫ:

- Отчет об остатках ценных бумаг на субсчетах депо по форме **IS40K** (код операции – 40, вид запроса – К);
- Отчет об операциях с ценными бумагами, учитываемыми на субсчетах депо по форме **IS41K** (код операции – 41, вид запроса – К).
- Отчеты предоставляются по запросу Банка НКЦ (АО), запрос депонента не требуется.
- Отчеты предоставляются в электронном виде по адресам, указанным в анкете ЭДО.

ДОХОДЫ ПО ЦЕННЫМ БУМАГАМ

- учитываемым на субсчетах депо владельца и иностранного номинального держателя, зачисляются на клиринговый банковский счет Банка НКЦ (АО), предназначенный для учета денежных средств, переданных в соответствующий имущественный пул;
- учитываемым на субсчетах депо номинального держателя или доверительного управляющего на банковские счета депонентов, реквизиты которых зарегистрированы по поручению депонентов по форме **AF005** с приложением уведомления о банковских реквизитах по форме **GF088** (код операции – 07, код назначения банковских реквизитов – 06).
- Ценные бумаги, полученные по результатам корпоративных действий, будут зачислены на тот же субсчет депо, на котором учитывались базовые ценные бумаги.

ВЫДАННЫЕ КСУ ЗАЧИСЛЯЮТСЯ НА 36 РАЗДЕЛ ТОРГОВОГО СЧЕТА ДЕПО:

- По поручению Банка НКЦ (АО) (код операции – 14).
- По результатам исполнения операции депонентам предоставляется отчет по форме **MS140**.
- КСУ могут быть переданы:
 - по договору РЕПО с центральным контрагентом или с Банком России;
 - в порядке универсального правопреемства.
- Допускаются переводы КСУ без перехода прав собственности между торговыми счетами депо одного и того же депонента, открытыми для клиринга Банка НКЦ (АО) и НКО АО НРД.

МАРКИРОВАНИЕ И ИНЫЕ ПОРУЧЕНИЯ ЗАЕМЩИКОВ



КАКИЕ УСЛУГИ НКЦ ОКАЗЫВАЕТ СУО НРД?

1. Поиск, подбор и перевод нужных НКЦ ценных бумаг на заданную или меньшую сумму
2. Поиск, подбор и перевод нужных НКЦ ценных бумаг в заданном или меньшем количестве

ПОЧЕМУ СУО НРД УДОБНА ДЛЯ УЧАСТНИКА КЛИРИНГА НКЦ?

1. В качестве источника активов используются все счета депо НРД
2. Не нужно подавать депозитарные поручения, тем более, что для перевода на субсчет поручения депонента не принимаются
3. Расчет необходимого количества ценных бумаг осуществляется автоматически, перевод осуществляется в онлайн

КАК УЧАСТНИКУ КЛИРИНГА НКЦ ПОЛУЧИТЬ УСЛУГУ СУО НРД?

1. Заключение с НРД договора об оказании клиринговых услуг, т.е., стать Участником клиринга НРД
2. Заключение с НРД договора об оказании услуг по управлению обеспечением
3. Маркировать ресурсы для подбора активов НКЦ поручением 18/MARK
4. Подать поручение подбора 18/GET

ОСОБЕННОСТИ МАРКИРОВАНИЯ 18/MARK ДЛЯ НКЦ

1. Группа сделок «GNCC»
2. Обязательное заполнение субсчета (раздела счета депо) поставки, на который будут переводиться подобранные бумаги. Варианты:
 1. Субсчет клирингового счета НКЦ, предназначенного для хранения обеспечения КСУ
 2. *Субсчет клирингового счета НКЦ, предназначенного для хранения коллективного обеспечения (гарантийных фондов)*
 3. *Субсчет клирингового счета НКЦ, предназначенного хранения обеспечения под стресс*
 4. *36 или 31 раздел торгового счета НКЦ, индивидуальное клиринговое обеспечение*
3. Типы счетов и разделов, с которых возможен подбор активов
 1. Торговые счета депо НКЦ, раздела 31 и 36
 2. Торговые счета депо НРД, разделы 00, 70, 73
 3. Основные счета депо, разделы 00, 70, 73, IN
4. Типы счетов, с которых возможен подбор активов, должны соответствовать типам счета депо (субсчета клирингового счета) поставки. Например, для субсчета владельца допустим подбор только со счетов депо владельца, для субсчета номини – только со счетов депо номини.
5. Подача поручения возможна через Торговый терминал.

ОСОБЕННОСТИ ПОДБОРА 18/GET ДЛЯ НКЦ

1. Указывается субсчет/раздел, на который нужно подобрать
2. Подбор по сумме в рублях:
 1. Указывается сумма, на которую нужно подобрать
 2. Опционально:
 1. Указываются ценные бумаги, приоритетные для подбора, с возможностью указания максимально допустимого количества
 2. Указываются ценные бумаги, которые подбирать не следует
3. Подбор по количеству:
 1. Указываются ценные бумаги и их количества
4. Подача поручения возможна через Торговый терминал.
5. Исполняется немедленно, допустимо частичное исполнение
6. Расчет при подборе по сумме осуществляется на основании ежедневной информации НКЦ о ценах и дисконтах
7. Результат подбора в клиринговом отчете по форме MS18G
8. Результат переводов в депозитарном отчете по поручению 10/GET, сформированному СУО НРД, по форме MS101
9. Подбор используется как для КСУ, так и для других типов обеспечения (гарантийные фонды, обеспечение под стресс, индивидуальное обеспечение)



ОСОБЕННОСТИ ПОДКЛЮЧЕНИЯ К УСЛУГЕ



ДОКУМЕНТЫ, НЕОБХОДИМЫЕ ДЛЯ ПОДКЛЮЧЕНИЯ К УСЛУГЕ РЕПО С КСУ

ДОПОЛНИТЕЛЬНОЕ СОГЛАШЕНИЕ К ДОГОВОРАМ СЧЕТОВ ДЕПО

- в дополнительном соглашении указываются номера и даты всех договоров счетов депо, заключенных с НКО АО НРД
- дополнительное соглашение оформляется в количестве указанных в нем договоров счетов депо в двух экземплярах

ДОГОВОР ОБ ОКАЗАНИИ УСЛУГ ПО УПРАВЛЕНИЮ ОБЕСПЕЧЕНИЕМ

ДОГОВОР ОБ ОКАЗАНИИ КЛИРИНГОВЫХ УСЛУГ

- заключаются в случае использования услуги по подбору ценных бумаг, учитываемых на счетах депо клиента в НРД



КОНТАКТЫ

Информацию по вопросам СУО НРД Вы можете получить у Вашего персонального менеджера в Отделе по работе с клиентами:

Телефон: +7 (495) 956-27-90, +7 (495) 956-27-91

Дополнительную **информацию по вопросам подписания документов НРД** Вы можете получить в Отделе заключения и сопровождения договоров с клиентами:

Телефон: +7 (495) 956-27-89.

Техническая поддержка НРД:

Телефон: +7 (495) 956-09-34, e-mail: soed@nsd.ru

**СПАСИБО
ЗА ВНИМАНИЕ!**



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ**
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

ПРАВОВАЯ ОГОВОРКА

- Настоящая презентация была подготовлена и выпущена НКО АО 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.

