

## **Описание порядка предоставления НРД информационных услуг депонентам, для проведения операций расчетного РЕПО.**

### **1. Проведение услуг по расчетному кредитованию ценными бумагами в форме РЕПО.**

*Под сделками расчетного РЕПО понимаются сделки РЕПО, которые заключаются Депонентами с использованием информации, предоставляемой Депозитарием Депонентам по договору на оказание информационных услуг.*

### **2. Преимущества услуги**

В целом комплекс услуг расчетного кредитования ценными бумагами позволяет существенно упростить и ускорить для клиентов НРД процедуру заключения и исполнения внебиржевых сделок с ценными бумагами, необходимых для оперативного устранения недостатка ценных бумаг на их счетах депо в НРД, возникающего при исполнении клиентских поручений депо.

### **3. Как воспользоваться услугой в НРД**

Услуга НРД по расчетному кредитованию ценными бумагами требует соблюдения участниками, использующих данную услугу, определенных условий. Так, для использования данной услуги участники должны:

Иметь (открыть) счет депо в НКО ЗАО НРД.	<a href="http://www.nsd.ru/ru/documents/depo/">http://www.nsd.ru/ru/documents/depo/</a>
Быть (стать) участником СЭД НРД	( <a href="http://www.nsd.ru/ru/workflow/system/member">http://www.nsd.ru/ru/workflow/system/member</a> ).
Заключить Соглашение об использовании электронной подписи при обмене документами в электронном виде через СЭД НРД	<a href="http://www.nsd.ru/ru/documents/workflow/">http://www.nsd.ru/ru/documents/workflow/</a>
Заключить с НРД Договор на оказание информационных услуг	<a href="http://www.nsd.ru/ru/documents/cred_cb/">http://www.nsd.ru/ru/documents/cred_cb/</a>
Иметь (заключить) договор банковского счета в НРД в рублях и иметь (открыть) банковский счет (документы для открытия банковского счета в соответствии с перечнем документов, приведенных в разделе «Документы/ Расчетно-кассовое обслуживание»	<a href="http://www.nsd.ru/ru/documents/calc/forms/">http://www.nsd.ru/ru/documents/calc/forms/</a> ).
Иметь (заключить) Соглашение № 2 к Договору банковского счета об исполнении платежных поручений с контролем расчетов по денежным средствам	<a href="http://www.nsd.ru/ru/documents/calc/#anc_ppp1">http://www.nsd.ru/ru/documents/calc/#anc_ppp1</a> .
Иметь (выбрать) канал связи и заключить соответствующий договор (Договор об участии в Системе электронных расчетов, Договор об участии в Системе «Интернет Банк-Клиент», «Инtranет Банк-Клиент», Соглашение об обмене платежными документами по системе SWIFT и телексу) и получить необходимые ключи/обменяться паролями	<a href="http://www.nsd.ru/ru/documents/edo_rk/">http://www.nsd.ru/ru/documents/edo_rk/</a>
Подать поручение на регистрацию банковских реквизитов	<a href="http://www.nsd.ru/common/img/uploa">http://www.nsd.ru/common/img/uploa</a>

для проведения операций расчетного РЕПО (коды назначения банковских реквизитов -11)	ded/files/Documents/depodelo/poryadok_p1_nrd_211111.doc#И_GF088_в_валюте
Провести маркирование ценных бумаг	<a href="http://www.nsd.ru/common/img/uploaded/files/Documents/depodelo/poryadok_nrd_211111.doc">http://www.nsd.ru/common/img/uploaded/files/Documents/depodelo/poryadok_nrd_211111.doc</a>
Подать в НРД Информационный запрос №1(Анкету участника Расчетного РЕПО) согласно Договору на оказание информационных услуг	<a href="http://www.nsd.ru/ru/documents/cred_cb/">http://www.nsd.ru/ru/documents/cred_cb/</a>
Провести настройку ПО ЛУЧ	<a href="http://www.nsd.ru/ru/workflow/system/programs">http://www.nsd.ru/ru/workflow/system/programs</a>

#### 4. Перечень услуг

**Комплекс услуг по «кредитованию ценными бумагами» в форме сделок расчетного РЕПО объединяет в себе:**

1. возможности Системы электронного документооборота (далее – СЭД) НРД по оформлению сделок РЕПО путем обмена транзитными электронными документами между клиентами НРД на базе заключенных в СЭД НРД двусторонних Генеральных соглашений РЕПО,
2. новые возможности депозитарного учета НРД, обеспечивающие выделение (маркирование) ценных бумаг клиентов, доступных для сделок расчетного РЕПО в качестве расчетного и/или обеспечительного актива, с сохранением за клиентом свободы распоряжения маркированными ценными бумагами (отсутствие блокировки ценных бумаг),
3. новые информационные услуги НРД клиентам по подготовке на основании запросов клиентов макетов сделок расчетного РЕПО и связанных с ними макетов расчетных документов.

#### **5. Действия депонентов при использовании Комплекса услуг по «кредитованию ценными бумагами» в форме сделок расчетного РЕПО выглядит следующим образом:**

Для заключения сделок расчетного РЕПО клиентам необходимо:

1. настроить ПО ЛУЧ, который позволяет формировать поручения депо и другие электронные документы, просматривать отчеты об исполнении/неисполнении депозитарных операций в НРД. Руководство пользователя ЛРМ СЭД НРД (ПО «Луч»), а так же Инструкция по его обновлению опубликованном в разделе « ЭДО / СЭД / Программное обеспечение». **Соответствующие изменения ПО ЛУЧ станут доступны Клиентам с 01 декабря 2011.**
2. выделить (промаркировать) ценных бумаг, которые могут быть использованы при заключении сделок в качестве расчетного актива и/или актива обеспечения по сделкам расчетного РЕПО.

**Под Маркированием (выделением) ценных бумаг** понимается способ выделения ценных бумаг на счете депо (разделе счета депо) Клиента, определенный в договоре счета депо.

Для выделения (маркирования) ценных бумаг, которые могут быть использованы при заключении сделок в качестве расчетного актива и/или актива обеспечения по сделкам расчетного

РЕПО, Клиент направляет в Депозитарий с использованием ПО «Луч» анкету распределения ресурсов по форме, приведенной в приложении № 1 к Порядку, с указанием счета депо, раздела счета депо и/или конкретного выпуска ценных бумаг, которые Клиент предлагает использовать в качестве расчетного актива и/или актива обеспечения. Проводя операцию маркировки ценных бумаг Клиент таким образом также уполномочивает НКО ЗАО НРД передавать информацию о выделенных (маркированных) ценных бумагах, которые могут быть использованы в качестве расчетного актива и/или актива обеспечения другим Клиентам, заключившим с НКО ЗАО НРД договор на оказание информационных услуг.

Наименование поля	Пояснения
Номер счета депо	Указывается номер счета депо, на котором учитываются ценные бумаги, которые допускается использовать в качестве расчетного актива или актива обеспечения (12 символов). Поле, обязательное для заполнения.
Тип раздела	Указывается код типа раздела (2 символа) Поле, необязательное для заполнения. Заполняется в том случае, если в качестве расчетного актива или актива обеспечения допускается использование ценных бумаг, учитываемых на разделе заданного типа. Поле необязательное поле для заполнения. Не допускается одновременное заполнение полей «Тип раздела» и «Раздел счета депо».
Код раздела	Указывается код раздела счета депо, на котором учитываются ценные бумаги, которые допускается использовать в качестве расчетного актива или актива обеспечения (17 символов). Поле необязательное для заполнения. Поле должно быть заполнено в том случае, если в качестве расчетного актива или актива обеспечения можно использовать ценные бумаги, учитываемые на конкретном разделе. Не допускается одновременное заполнение полей «Тип раздела» и «Раздел счета депо».
Код ценной бумаги	Указывается код ценных бумаг, которые допускается использовать в качестве расчетного актива или актива обеспечения. Поле, необязательное для заполнения. Поле должно быть заполнено, в том случае, если в качестве расчетного актива или актива обеспечения могут использоваться только ценные бумаги конкретного выпуска, учитываемые на счете депо, разделах заданного типа, конкретном разделе счета депо.
Назначение	Поле, обязательное для заполнения. Могут быть указаны одно или два значения:  - актив обеспечения;  - расчетный актив.

3. Направить в Депозитарий с использованием ПО «Луч» до 19-00 мск. Информационный запрос №1 и информационный запрос №2/или поручение депо Клиента с отметкой в поле «Расчетное РЕПО»

В информационном запросе № 1 (анкета Участника расчетного РЕПО) Клиент указывает:

- в какой роли он собирается выступать в сделках расчетного РЕПО (возможно указание обеих ролей) в роли Первоначального продавца расчетного актива или в роли Первоначального покупателя расчетного актива;
- ставку платы за расчетный актив;
- требования к составу и структуре портфеля обеспечения (указывается только Первоначальным продавцом расчетного актива)

В Информационном запросе № 2 (заявка на кредит) должна содержаться информация о виде, категории и количестве ценных бумаг расчетного актива, которые необходимы Клиенту.

4. По результатам обработки информационного запроса №2 НРД направляет Информационные отчеты №1.1. и № 1.2. (макеты сделок РЕПО) или Информационный отчет №3 (Уведомление об отказе в формировании Информационного отчета).
5. Для формирования Информационного отчета №1.1. (макета сделки РЕПО) Клиенту НРД использует имеющуюся у него информацию, предоставленную другими клиентами, заключившими с НРД договоры об оказании информационных услуг (далее по тексту настоящего Порядка – Предложение), промаркировавшими ценные бумаги в качестве расчетного актива, при условии соответствия такой информации параметрам, указанным в Информационном запросе №2 (заявка на кредит) Клиента.

При определении значений полей Информационного отчета № 1.1. (макет сделки РЕПО) НРД действует по следующему алгоритму:

- 5.1. Вначале определяются клиенты НРД, указавшие в Информационном запросе №1 (анкета Участника расчетного РЕПО) минимальное значение платы за пользование ценными бумагами, промаркированными в качестве расчетного актива.
- 5.2. Равнозначные Предложения дополнительно ранжируются по объему ценных бумаг, промаркированных в качестве расчетного актива. Предложение с большим объемом имеет приоритет при формировании Информационных отчетов №1.1 и №1.2 (макеты сделок РЕПО), чем Предложение с меньшим объемом.
- 5.3. Формирование Информационного отчета № 1.1 (макет сделки РЕПО) начинается с определения клиента, сделавшего наиболее выгодное для Клиента Предложение на момент формирования Информационных отчетов № 1.1 и № 1.2. (макеты сделок РЕПО).
- 5.4. В анализируемом Предложении проверяется значение лимитов на Клиента, направившего Информационный запрос № 2.(заявка на кредит) Если лимит отсутствует или полностью исчерпан, осуществляется переход к анализу другого Предложения. Если нет Предложения, отвечающего Информационному запросу № 2 (заявка на кредит), то формируется Информационный отчет № 3 с обязательным заполнением поля 3.12 (причина отказа в формировании отчета).
- 5.5. При формировании Информационного отчета № 1.2. (макет сделки РЕПО) выбор ценных бумаг, промаркированных в качестве актива обеспечения, производится с учетом требований, указываемых клиентами в Информационном запросе №1 (анкета Участника расчетного РЕПО).

5.6. Вначале из доступных ценных бумаг, промаркированных в качестве активов обеспечения Клиента, направившего Информационный запрос № 2 (заявка на кредит), исключаются выпуски ценных бумаг, не соответствующие требованиям Предложения.

5.7. Приоритет при заполнении Информационного отчета №1.2 (макет сделки РЕПО) имеют оставшиеся ценные бумаги, промаркированные в качестве актива обеспечения, соответствующие Предложению.

Ценные бумаги, промаркированные в качестве актива обеспечения, ранжируются по уровню их ликвидности. Менее ликвидные имеют более высокий приоритет использования при формировании портфеля обеспечения. Ликвидность ценной бумаги определяется как отношение среднесуточного объема биржевых торгов данного выпуска ценных бумаг к объему данного выпуска ценных бумаг.

5.8. В Информационный отчет №1.2 (макет сделки РЕПО) в первую очередь включаются наименее ликвидные ценные бумаги, промаркированные в качестве актива обеспечения. При этом количество ценных бумаг определенного выпуска, определяется таким образом, чтобы доля ценных бумаг данного вида в портфеле обеспечения не превысила значение максимальной доли ценных бумаг определенной категории в общей стоимости портфеля обеспечения Информационного запроса №1 (анкета Участника расчетного РЕПО) клиента, промаркировавшего ценные бумаги в качестве расчетного актива.

5.9. Формирование Информационных отчетов №1.2 (макет сделки РЕПО) в отношении ценных бумаг, промаркированных в качестве актива обеспечения, проводится до тех пор, пока совокупная стоимость ценных бумаг портфеля обеспечения, рассчитанная с учетом дисконтов к стоимости ценных бумагах, маркированных в качестве актива обеспечения, не сравняется с суммой сделки Информационного отчета №1.1 (макет сделки РЕПО).

5.10. При возможности сформировать клиенту Информационные отчеты №1.1 и №1.2 на основании данных этих отчетов НРД также формирует Информационный отчет № 2.1(макет соглашения об урегулировании обязательств) и Информационный отчет № 2.2 (макет Соглашение об урегулировании обязательств).

6. Информационные отчеты №1.1 и №1.2 используются клиентами для заключения сделок расчетного РЕПО. Клиент в ПО ЛУЧ самостоятельно преобразует Информационные отчеты №1.1 и 1.2 в табличные Договоры РЕПО с расчетным активом и с активом обеспечения в качестве объекта договора, а Информационные отчеты №2.1 и №2.2 в Соглашение об урегулировании обязательств и заключает сделки расчетного РЕПО с помощью процедур транзита ЭДО НРД.

6.1. Подписав Информационные отчеты №1.1 и №1.2 и Информационные отчеты № 2.1 и № 2.2 клиент направляет их в адрес своего контрагента.

6.2. После подписания на стороне контрагента (Первоначального продавца расчетного актива) договоров и соглашений с использованием параметров заключенных Табличных договоров РЕПО формируются поручения депо по первой части расчетного РЕПО, которые направляются на исполнение в НРД.

6.3. При получении клиентом (Первоначальным покупателем расчетного актива) документов, подписанных его контрагентом (заключенных договоров и соглашений с подписями первоначального покупателя и первоначального продавца расчетного актива), на стороне клиента

на основании заключенных Табличных договоров РЕПО формируется и направляются на исполнение в НРД поручения депо и платежное поручение по первой части РЕПО.

6.4. НРД исполняет поручения депо и платежное поручение по первой части заключенных сделок расчетного РЕПО в соответствии с порядком, определенном условиями договоров счета депо и договоров денежного счета.

6.5. При поступлении стандартных отчетов об исполнении поручений депо по первой части РЕПО на стороне клиента и его контрагента (Первоначального продавца и Первоначального покупателя расчетного актива) с использованием параметров заключенных договоров и соглашений формируются, подписываются и отправляются в НРД на исполнение поручения депо по второй части расчетного РЕПО в день T+1.

6.6. После исполнения поручений депо по первой части РЕПО активы обеспечения зачисляются на специальный раздел счета депо Первоначального продавца расчетного актив до исполнения второй части РЕПО (дня T+1).

6.7. Исполнение вторых частей сделок расчетного РЕПО производится НРД в конце следующего рабочего дня (T+1) после исполнения первых частей данной сделки расчетного РЕПО (T+0).

6.8. В 19=30 дня T+1 НРД проверяет достаточность остатков расчетного актива на счете клиента (Первоначального покупателя расчетного актива) для исполнения второй части расчетного РЕПО. При наличии достаточного для исполнения поручения депо количества расчетного актива на счете депо покупателя НРД блокирует необходимое количество расчетного актива от других операций на период исполнения вторых частей сделки расчетного РЕПО. При недостатке расчетного актива на счете депо клиента для исполнения вторых частей сделки расчетного РЕПО дальнейшее исполнение вторых частей сделки расчетного РЕПО производится в порядке, определенном п.6.11-6.16 настоящего Порядка заключения и исполнения сделок расчетного РЕПО.

6.9. НРД исполняет поручения депо клиента и его контрагента (Первоначального продавца и первоначального покупателя расчетного актива) по второй части сделки расчетного РЕПО в режиме «поставка против поставки».

6.10. После исполнения поручений депо на возврат расчетного актива и актива обеспечения НРД и платежного поручения формирует и направляет клиенту и его контрагента стандартные отчеты об исполнении поручений.

6.11. Исполнение второй части сделки расчетного РЕПО при отсутствии у покупателя необходимого количества расчетного актива.

6.12. В случае выявления НРД недостатка расчетного актива на счете депо клиента НРД за 15 минут до начала исполнения поручений по вторым частям сделок расчетного РЕПО направляет клиенту и его контрагенту Информационный отчет №4 (Уведомление о недостаточности (отсутствии) расчетного актива).

6.13. После отправки Информационного отчета №4 НРД определяет стоимость доступных остатков активов обеспечения покупателя расчетного актива с учетом стоимости активов обеспечения, возвращаемых покупателю расчетного активов по условиям исполняемой сделки расчетного РЕПО.

6.14. В том случае, если рыночная стоимость активов обеспечения (с учетом дисконта) превышает рыночную стоимость недостающего для завершения сделки расчетного РЕПО количества расчетного актива, НРД предпринимает попытку оформить новую сделку расчетного РЕПО на недостающее количество расчетного актива в порядке, установленном п.п. 5.4 – 5.10 с учетом особенностей, изложенных пп.6.13, 6.14. настоящего раздела. Первоочередное право на заключение новых сделок расчетного РЕПО в случае недостатка расчетного актива на счете депо Первоначального покупателя расчетного актива принадлежит Первоначальному продавцу расчетного актива.

6.15. В случае заключения новой (дополнительной) сделки расчетного РЕПО исполнение ее первой части производится в режиме поставка против поставки одновременно с исполнением второй части первоначальной сделки расчетного РЕПО с неттированием встречных обязательств.

6.16. При невозможности заключения новой сделки расчетного РЕПО, в том числе в случае недостатка у клиента необходимых для заключения новой сделки расчетного РЕПО объемов активов обеспечения, НРД направляет клиенту и его контрагенту Уведомление о недостаточности (отсутствии) расчетного актива с пометкой о техническом дефолте и осуществляет завершение исполнения второй части сделок расчетного РЕПО в соответствии с п.6.17.

6.17. Если до 20 часов 00 минут по московскому времени клиентом и/или его контрагентом (Первоначальным продавцом и (или) Первоначальным покупателем) не исполнены обязательства по второй части сделки расчетного РЕПО определенные Договором РЕПО (в том числе путем заключения дополнительных сделок РЕПО), то Договор РЕПО считается расторгнутым с момента неисполнения Первоначальным продавцом и (или) Первоначальным покупателем своих обязательств по второй части сделки расчетного РЕПО. Соглашение о расторжении заключается Участниками расчетного РЕПО при подписании пакета документов в рамках автоматического заключения сделок расчетного РЕПО.

6.18. После получения Информационного отчета №3 (отказ в формировании новой сделки расчетного РЕПО) на стороне клиента (Первоначального продавца расчетного актива) автоматически формируются, подписываются клиентом и направляются в НРД поручения на отмену поручений депо на возврат активов обеспечения и прием расчетного актива по второй части расторгаемой сделки расчетного РЕПО.

6.19. На стороне контрагента клиента (Первоначального покупателя расчетного актива) также после получения Информационного отчета №3 автоматически формируются, подписываются клиентом и направляются в НРД поручения на отмену поручения депо на возврат расчетного актива и прием актива обеспечения по второй части расторгаемой сделки расчетного РЕПО.

6.20. После получения от Первоначального продавца расчетного актива и Первоначального покупателя расчетного актива соответствующих поручений на отмену поручений по второй части расчетного РЕПО НРД регистрирует в учетной системе такие поручения, исполняет их и направляет продавцу и покупателю расчетного актива стандартные отчеты об исполнении операции,

Дальнейшее урегулирование отношений, связанных с прекращением договора РЕПО клиент и его контрагент осуществляют самостоятельно.

6.21. Особенности формирования вышеперечисленных документов в виде электронных документов, их подписания электронной подписью, передачи, приема и обработки определены в Правилах ЭДО НРД.

## **7.Тарифы НКО ЗАО НРД за оказание информационных услуг**

7.1. Размер платы за информационные услуги НРД по Договору на оказание информационных услуг равен 0,00025% от суммы, рассчитываемой в соответствии с информационным запросом клиента при формировании НРД информационного отчета для последующего заключения клиентом сделки РЕПО с расчетным активом, на основании информации, содержащейся в поле 1.25 Информационного отчета №1.1 (сумма сделки РЕПО с расчетным активом), без учета НДС, но не менее 5 (Пяти) копеек, за каждый отправленный клиенту Информационный отчет №1.1.

7.2. НРД устанавливает маркетинговый период в целях продвижения комплекса информационных услуг для проведения операций расчетного РЕПО, сроком до 01.03.2012, в течение указанного периода плата за информационные услуги НРД по Договору на оказание информационных услуг не взимается.

7.3. Плата за переводы ценных бумаг и денежных средств, в связи с исполнением сделок расчетного РЕПО, взимается в соответствии с действующими тарифами НРД.