



Адаптация НРД к CSDR. Ежедневное и ежемесячное информирование о денежных штрафах в соответствии с CSDR Settlement discipline regime.

Настоящий документ содержит информацию о подходе НКО АО НРД к заполнению ежедневных и ежемесячных отчетов о штрафах / премиях, выставленных европейскими (I)CSDs¹ по депозитарному поручению депонента в соответствии с CSDR Settlement discipline regime. Подробная информация о порядке применения обязательных денежных штрафов европейскими (I)CSDs за срыв исполнения сделки в плановую дату расчётов представлена в документе [«Адаптация деятельности НКО АО НРД к нормам CSDR Settlement discipline regime. Руководство для клиентов НРД, совершающих сделки в европейских \(I\)CSD»](#).

1 Ежедневный отчет о штрафе / премии

Для ежедневного отчета в НКО АО НРД используется доработанная форма GS036. В форму добавлены поля с информацией о штрафе / премии. Примеры заполнения уведомления будут предоставлены в течение 3 квартала 2021 г.

Отчет формируется в привязке к регистрационному номеру поручения депо, по которому получена информация о штрафе / премии, и направляется инициатору поручения депо. Каждый ежедневный отчет содержит информацию о штрафах, выставленных по одному поручению депо. Если по поручению выставлено 2 типа штрафа (LMFP и SEFP), информация об обоих штрафах включается в один отчет. Вся последовательность полей повторяется дважды. Если того требует тип выставленного штрафа, последовательность «Детали расчета» вместе с заголовком может быть представлена в отчете более одного раза.

Сценарий:

Поручение было передано в ICSD после плановой даты расчетов. Причина – отсутствие достаточного количества ценных бумаг у участника для исполнения сделки в срок. В отношении поставщика ценных бумаг сформирован штраф за позднюю квитанцию. Следовательно, участник должен заплатить LMFP в пользу своего контрагента.

¹ ICSD – International central securities depository – международные расчётно-клиринговые центры ЕС: Euroclear Bank и Clearstream Banking. CSD – Central securities depository – Центральный депозитарий локального рынка Европейского Союза.

- Номер счета в ICSD 12345
- Дата сделки 08.03.2021
- Плановая дата расчетов (ISD) 10.03.2021
- Количество ценных бумаг 1000
- Цена за единицу 900 EUR
- Сумма сделки 900000 EUR
- Код ценной бумаги XX0247770224
- Дата принятия поручения к исполнению 11.03.2021
- Дата квитанции 11.03.2021

Порядок заполнения отчета:

Форма GS036

Уведомление о: штрафе/премии, выставленном ICSD по поручению

Наименование поля	Пример значения	Пояснение
Рег. № поручения	11738572	Регистрационный номер поручения
Исходящий № поручения	3601	Исходящий номер поручения
Дата формирования	11.03.2021	Дата формирования поручения
Дата штрафа/премии	11.03.2021	Дата, в которую рассчитан штраф за неисполнение сделки. Эта дата не меняется в течение срока действия штрафа. Обновления по штрафу по-прежнему сообщаются с этой датой, даже если обновление произошло в другой день.
Номер счета в ICSD	12345	
Референс штрафа/премии	C21031000000184	Уникальный референс, присвоенный вычисляющим CSD штрафу. Референс является общим как для виновного, так и для пострадавшего участника сделки.
Индивидуальный референс штрафа/премии	NC21031000000184	Уникальный референс, присвоенный вычисляющим CSD штрафу, с указанием индивидуального идентификатора: F – для виновного участника сделки; N – для пострадавшего участника сделки.
Предыдущий референс штрафа/премии	C21031000000183 (Если применимо)	Применимо в случае перевыставления (re-allocation) штрафа по итогам апелляции. Виновный участник сделки получает статус пострадавшего, и наоборот. Если штраф не был перевыставлен, поле останется незаполненным.
Предыдущий индивидуальный референс штрафа/премии	FC21031000000183 (Если применимо)	Применимо в случае перевыставления (re-allocation) штрафа по итогам апелляции. Виновный участник сделки получает статус пострадавшего, и наоборот. Если штраф не был перевыставлен, поле останется незаполненным. Индивидуальные идентификаторы: F – для виновного участника сделки; N – для пострадавшего участника сделки.

Тип штрафа/премии	LMFP	Тип начисленного штрафа / премии. LMFP – late matching fail penalty – штраф за позднюю квитанку встречных инструкций по сделке; SEFP – settlement fail penalty – штраф за срыв исполнения сделки в плановую дату расчетов.
Способ расчета штрафа/премии	CALM//SECU	Возможные индикаторы: MIXE Сумма штрафа основана на дисконтной ставке; SECU Сумма штрафа рассчитывается только по ценным бумагам.
Статус штрафа/премии	PNST//ACTV	Возможные индикаторы: PNST//ACTV активный штраф; PNST//REMO штраф исключен.
Причина применения статуса	ACTV//NEWP новый штраф	Возможные индикаторы: ACTV//NEWP новый штраф; ACTV//UPDT штраф пересчитан или заново включен; ACTV//RALO после предшествующего исключения штраф перевыставлен; REMO//CORP ценная бумага изъята из обращения впоследствии КД; REMO//INSO штраф исключен из-за объявленной процедуры банкротства контрагента; REMO//OTHR другое; REMO//RALO перераспределение штрафа; REMO//SEMP расчет по сделке на нескольких платформах, где одна из платформ закрыта для расчетов; REMO//SESU расчет по сделке на нескольких платформах, где одна из платформ закрыта для расчетов; REMO//TEIM технические неполадки привели к срыву расчетов.
Сумма штрафа/ премии	EUR 8.19	Указывается значение суммы штрафа / премии и валюты, рассчитанное европейскими (I)CSDs. Для штрафа типа LMFP, охватывающего несколько рабочих дней, значение представляет собой общую сумму штрафов/премий, рассчитанных за каждый день срыва расчетов по сделке.
Признак штраф/премия	штраф	Текстовая расшифровка для указания штрафа или премии по отношению к депоненту.
Количество дней штрафа/премии	001	Для штрафа типа SEFP значение всегда равно 001. Для штрафа типа LMFP поле содержит количество рабочих дней от плановой даты расчетов до даты квитанки. Если квитанка наступила после окончания последнего расчетного цикла для сделки (то есть в

		день квитовки сделка не могла быть исполнена), такой день включается в количество дней штрафа. Если квитовка наступила до окончания последнего расчетного цикла для сделки, такой день не включается в количество дней штрафа.
Детали расчета		Заголовок, открывающий последовательность полей с деталями расчета конкретного штрафа.
Дата расчета штрафа/премии	11.03.2021	Дата, за которую рассчитан штраф / премия.
Финансовый инструмент	XX9527816843	Код ISIN ценной бумаги – предмета сделки. Может не соответствовать деп. коду ценной бумаги в НРД.
Ставка штрафа/премии по типу актива	GOMB//0.001 государственные и муниципальные облигации (Если применимо)	Ставка, примененная для расчета штрафа. Заполняется для метода расчета SECU. Возможные индикаторы: LISH ликвидные акции; ILSH неликвидные акции; CBON корпоративные облигации, не торгуемые на SME Growth market; NBON корпоративные облигации, торгуемые на SME Growth market; GOMB государственные и муниципальные облигации; GBON другие финансовые инструменты, торгуемые на SME Growth market; OTHR другие финансовые инструменты.
Ставка штрафа/премии за дату	PDRA//0.02 Дисконтная штрафная ставка по соответствующей валюте (Если применимо)	Ставка, примененная для расчета штрафа. Заполняется для метода расчета MIXE. Возможные индикаторы: PDRA Дисконтная штрафная ставка по соответствующей валюте; EXCH Курс конвертации, если штраф рассчитан в иной валюте, чем валюта сделки.
Сумма штрафа/премии за дату	SECU 8.19 EUR	Указывается метод расчета, сумма штрафа/премии за дату и валюта штрафа/премии за дату расчета.
Признак штраф/премия за дату	штраф	Текстовая расшифровка для указания штрафа или премии по отношению к депоненту за дату расчета штрафа.
Референс инструкции	11738572	Рег. Номер поручения депонента, по которому рассчитан штраф / премия.
Дата принятия поручения к исполнению	11.03.2021	Дата принятия поручения к исполнению в ICSD.
Дата квитовки инструкций в ICSD	11.03.2021	
Плановая дата расчетов	10.03.2021	Плановая дата расчетов (ISD), установленная в поручении депонента.
Количество ценных бумаг для расчета штрафа/премии	1000	Количество ценных бумаг, учитываемых для расчета штрафа ICSD. Если по сделке были произведены частичные расчеты, указывается количество недопоставленных бумаг.

Определитель количества ценных бумаг для расчета штрафа	UNIT	Возможные индикаторы: UNIT количество штук; FAMT сумма номинала; AMOR стоимость с учетом амортизации.
Сумма сделки для расчета штрафа/премии	900000 EUR	Сумма сделки, учитываемая для расчета штрафа. Если по сделке были произведены частичные расчеты, указывается количество неуплаченных денежных средств.
Статус расчета по сделке	MTCH//NMAT	Указывается статус расчета по сделке.
Причина применения статуса		Описание причины статуса расчета по сделке.

2 Ежемесячный отчет о штрафах / премиях.

Для ежемесячного отчета в НКО АО НРД используется новая форма GS110 (приложение 1 настоящего Документа). Примеры заполнения отчета будут предоставлены в течение 3 квартала 2021 г.

В отчете указывается краткая информация по каждому штрафу / премии за отчетный период в разрезе депозитарного кода депонента. Отчет содержит совокупную информацию по всем поручениям, по которым от ICSD получена информация о выставленном штрафе / начисленной премии (по всем местам расчетов, видам расчетов – FOP/DVP, валютам) по итогам периода.

Сценарий:

- Место расчетов EUROCLEAR
- Сумма (1) премии - 8.19 EUR
- Сумма (2) штрафа 10 EUR

По итогам отчетного периода было рассчитано 2 штрафа за срыв расчетов по сделке с участием депонента. (1) штраф LMFP за позднюю квитанцию, (2) премия SEFP за срыв исполнения сделки в ISD от контрагента.

Порядок заполнения отчета:

Форма GS110

Наименование поля	Пример значения	Пояснение
ICSD	MGTCBEBE	Указывается BIC код ICSD, в разрезе которого представлена информация о штрафах за отчетный период.
Операция	36	Указывается код операции из поручения, по которому представлена информация о штрафе/премии.
Поручение: исх. номер	3601	Указывается исходящий номер поручения, по которому представлена информация о штрафе/премии.

Поручение: рег. номер	11738572	Указывается регистрационный номер поручения, по которому представлена информация о штрафе/премии.
Поручение: дата регистрации	2021-03-10	Указывается дата регистрации поручения, по которому представлена информация о штрафе/премии.
Номер счета/раздела счета депо (идентификатор)	MS1234567891/00000000 0000000000	Указывается идентификатор раздела из поручения.
Место расчетов	EUROCLEAR	Указывается BIC или депозитарный код места расчетов по поручению.
Референс штрафа/премии	C21031000000184	Указывается референс штрафа/премии. Референс соответствует номеру, сообщенному ранее в ежедневном отчете.
Индивидуальный референс штрафа/премии	FC21031000000184	Указывается индивидуальный референс штрафа/премии. Референс соответствует номеру, сообщенному ранее в ежедневном отчете.
Тип штрафа/премии	LMFP	Указывается тип штрафа/премии. Соответствует коду, сообщенному ранее в ежедневном отчете.
Сумма (направление) штрафа/премии	- 8.19	Указывается конечная сумма штрафа / премии со знаком (для штрафа указывается знак « - » (минус), для премии знак не указывается).
Валюта штрафа/премии	EUR	Указывается валюта штрафа/премии.
Операция	37	Указывается код операции из поручения, по которому представлена информация о штрафе/премии.
Поручение: исх. Номер	3602	Указывается исходящий номер поручения, по которому представлена информация о штрафе/премии.
Поручение: рег.номер	11738573	Указывается регистрационный номер поручения, по которому представлена информация о штрафе/премии.
Поручение: Дата регистрации	2021-03-25	Указывается дата регистрации поручения, по которому представлена информация о штрафе/премии.
Номер счета/раздела счета депо (идентификатор)	MS1234567891/00000000 0000000000	Указывается идентификатор раздела из поручения.
Место расчетов	EUROCLEAR	Указывается BIC или депозитарный код места расчетов по поручению.
Референс штрафа/премии	C21031000000185	Указывается референс штрафа/премии. Референс соответствует номеру, сообщенному ранее в ежедневном отчете.

Индивидуальный референс штрафа/ премии	NC21031000000185	Указывается индивидуальный референс штрафа/премии. Референс соответствует номеру, сообщенному ранее в ежедневном отчете.
Тип штрафа/ премии	SEFP	Указывается тип штрафа/премии. Соответствует коду, сообщенному ранее в ежедневном отчете.
Сумма (направление) штрафа/ премии	10	Указывается конечная сумма штрафа / премии со знаком (для штрафа указывается знак «-» (минус), для премии знак не указывается).
Валюта штрафа/ премии	EUR	Указывается валюта штрафа/премии.

<...>

Итого по валюте	1.1 EUR	Указывается итоговое нетто значение штрафа /премии с учетом знака (для штрафа указывается знак «-» (минус), для премии знак не указывается) и код валюты.
-----------------	---------	---

Контакты

В случае возникновения вопросов, касающихся адаптации НКО АО НРД к требованиям CSDR, Вы можете обратиться к своему клиентскому менеджеру, а также направить свои вопросы на специальный адрес электронной почты:

csdr@nsd.ru

Правовая оговорка

1. Настоящий документ был подготовлен и выпущен НКО АО НРД (далее — «Компания»).
2. 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.
3. 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.
4. 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.
5. Компания не наделена полномочиями по толкованию положений законодательства Российской Федерации, а также законодательства зарубежных стран. Сведения в документе приведены исключительно в информационных целях и не могут повлечь для Компании никаких юридических последствий.
6. Данный документ содержит прогнозные заявления. Все включенные в настоящий документ заявления, за исключением заявлений об исторических фактах, включая, но, не ограничиваясь, заявлениями, относящимися к нашему финансовому положению, бизнес-стратегии, плану 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:
 - a) восприятие рыночных услуг, предоставляемых Компанией и ее дочерними обществами;
 - b) волатильность (a) Российской экономики и рынка ценных бумаг и (b) секторов с высоким уровнем конкуренции, в которых Компания и ее дочерние общества осуществляют свою деятельность;
 - c) изменения в (a) отечественном и международном законодательстве и налоговом регулировании и (b) государственных программах, относящихся к финансовым рынкам и рынкам ценных бумаг;
 - d) ростом уровня конкуренции со стороны новых игроков на рынке России;
 - e) способность успевать за быстрыми изменениями в научно-технической среде, включая способность использовать расширенные функциональные возможности, которые популярны среди клиентов Компании и ее дочерних обществ;
 - f) способность сохранять преемственность процесса внедрения новых конкурентных продуктов и услуг, равно как и поддержка конкурентоспособности;
 - g) способность привлекать новых клиентов на отечественный рынок и в зарубежных юрисдикциях;
 - h) способность увеличивать предложение продукции в зарубежных юрисдикциях.
7. Прогнозные заявления делаются только на дату публикации настоящего документа, и мы точно отрицаем наличие любых обязательств по обновлению или пересмотру прогнозных заявлений в настоящем документе в связи с изменениями наших ожиданий, или перемен в условиях или обстоятельствах, на которых основаны эти прогнозные заявления.
8. Все данные, использованные в примерах, являются вымышленными, если прямо не указано иное. Любое совпадение данных в каком-либо из полей с реальными данными, связанными с какой-либо операцией или иным событием произошедшими в действительности, случайны.

Приложение 1: Форма GS110 уведомление о штрафах/премиях по расчетам в ICSD

Форма GS110

**УВЕДОМЛЕНИЕ № ___ от ___
о штрафах/премиях по расчетам в ICSD**

Операция: **<Наименование операции>** <код>
 Отправитель отчета: <код анкеты> <Полное наименование>
 Получатель отчета: <код анкеты> <Полное наименование>
 Инициатор поручения: < код анкеты> <Полное наименование>

ICSD < BIC ICSD >

Операция	Поручение			Номер счета/раздела счета депо	Место расчетов	Референс штрафа/премии	Индивидуальный референс штрафа/премии	Тип штрафа/премии	Сумма (направление) штрафа/премии	Валюта штрафа/премии
	Исх. номер	Рег. номер	Дата регистрации							

Итого по валюте: <сумма с направлением> <3х букв. код валюты>

ICSD < BIC ICSD >

Операция	Поручение			Номер счета/раздела счета депо	Место расчетов	Референс штрафа/премии	Индивидуальный референс штрафа/премии	Тип штрафа/премии	Сумма (направление) штрафа/премии	Валюта штрафа/премии
	Исх. номер	Рег. номер	Дата регистрации							

Итого по валюте: <сумма с направлением> <3х букв. код валюты>

Операционист: _____

МП

Подпись: _____

ОТЧЕТ № <№отчета> от <дата> г.