



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

СПРАВЕДЛИВЫЕ ЦЕНЫ

ЦЕНОВОЙ ЦЕНТР НРД

ОФИЦИАЛЬНЫЙ ИСТОЧНИК СПРАВЕДЛИВЫХ ЦЕН

- 1 более **4000*** бумаг
- 2 принципы **МСФО13**
- 3 доступ через **API** и сайт

УПРАВЛЕНЧЕСКАЯ
РЕГУЛЯТОРНАЯ
КЛИЕНТСКАЯ
ОТЧЕТНОСТЬ

РАСЧЕТ СТОИМОСТИ
ЧИСТЫХ АКТИВОВ

ОЦЕНКА ОБЕСПЕЧЕНИЯ
И РАСЧЕТ **ДИСКОНТОВ**

ОЦЕНКА **РЫНОЧНОСТИ**
СДЕЛОК

**Какая цена
справедливая?**



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКОЙ БИРЖИ

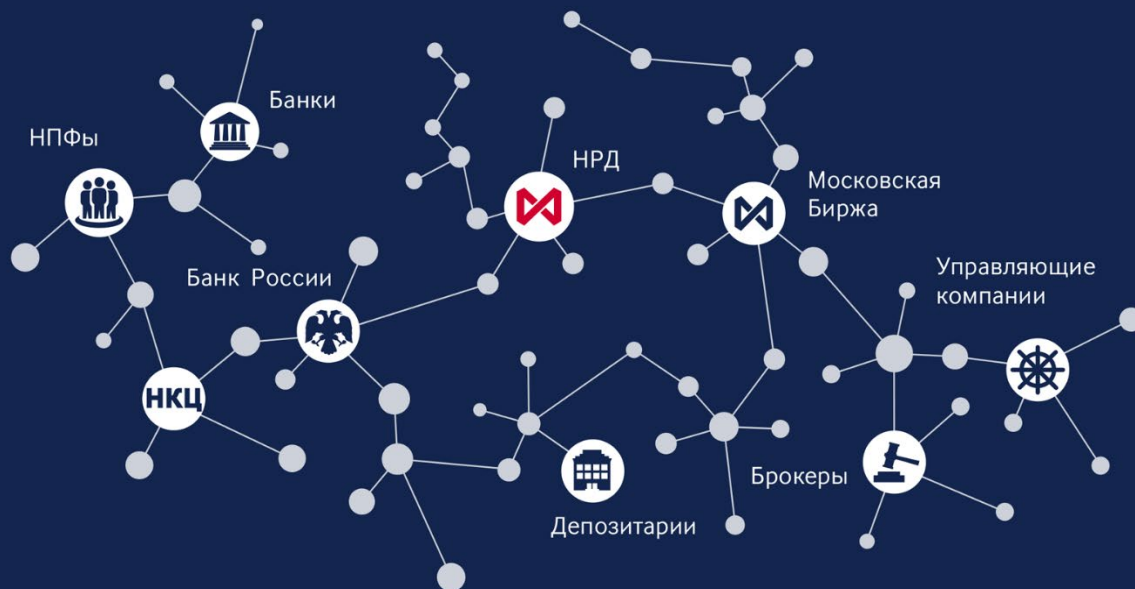
ЦЕНОВОЙ ЦЕНТР НРД: ЕДИНЫЙ БЕНЧМАРК ДЛЯ РЫНКА И РЕГУЛЯТОРА

Ежедневный расчет справедливой стоимости ликвидных и неликвидных бумаг

Экспертный совет ежеквартально собирает крупнейших участников рынка

Независимые экспертизы методик проверяют модели на корректность и воспроизводимость

Полностью автоматизированный сервис на технологической платформе НРД



РАСШИРЕННЫЕ ДАННЫЕ ЦЕНОВОГО ЦЕНТРА НРД В RU DATA PRICE

УРОВЕНЬ ОЦЕНКИ В
СООТВЕТСТВИИ С МСФО13



ПОСТОЯННОЕ РАСШИРЕНИЕ
СПИСКА ПОКАЗАТЕЛЕЙ



ДАННЫЕ ДЛЯ **IN-HOUSE** МОДЕЛЕЙ:
ДЮРАЦИЯ, ДОХОДНОСТЬ, Z- И I-СПРЕДЫ,
ИНДЕКС ЛИКВИДНОСТИ



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

интерфакс
INTERFAX

ИЗМЕНЕНИЕ КРАЕВОГО ВРЕМЕНИ ПУБЛИКАЦИИ ОЦЕНОК

**КРАЕВОЕ ВРЕМЯ ПУБЛИКАЦИИ ОЦЕНОК ЦЦ НРД
СДВИГАЕТСЯ С 9:00 НА 7:00**

БАНК РОССИИ ИЗМЕНИЛ ВРЕМЯ ПОДАЧИ ОТЧЕТНОСТИ ОБ
ОПЕРАЦИЯХ НА ДЕНЕЖНОМ РЫНКЕ

ОЦЕНКА ЛИКВИДНОСТИ ОБЛИГАЦИЙ - TTL

РАСЧЕТ ДИСКОНТА ОБЛИГАЦИИ ПРИ ЛИКВИДАЦИИ
ОПРЕДЕЛЕННОГО ОБЪЕМА ЗА УКАЗАННЫЙ СРОК

ЗАПУСК ТЕСТИРОВАНИЯ ОСЕНЬЮ 2021 ГОДА



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

ПРОИЗВОДНЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ

$$\text{discount}(V, TTL) = \frac{P_{ref} - P_{realized}(V|T \leq TTL)}{P_{ref}}$$

TTL

Количество дней на ликвидацию

ОБЪЕМ

Количество бумаг, которое планируется ликвидировать

ДИСКОНТ

Если известен заранее

ОЦЕНКА ЛИКВИДНОСТИ ОБЛИГАЦИЙ – TTL

- **ДИСКОНТ ДЛЯ РЕПО**
- **ИСПОЛЬЗОВАНИЕ ДЛЯ ОТЧЕТНОСТИ, ПОПРАВКА НА ЛИКВИДНОСТЬ**
- **ОПЕРАТИВНЫЙ МОНИТОРИНГ ЗА ЛИКВИДНОСТЬЮ ПОРТФЕЛЯ**
- **ОЦЕНКА РИСКА**

МОДЕЛЬ LIQUIDITY SURFACE

ДОМ.РФ - RU000A0JQXG0

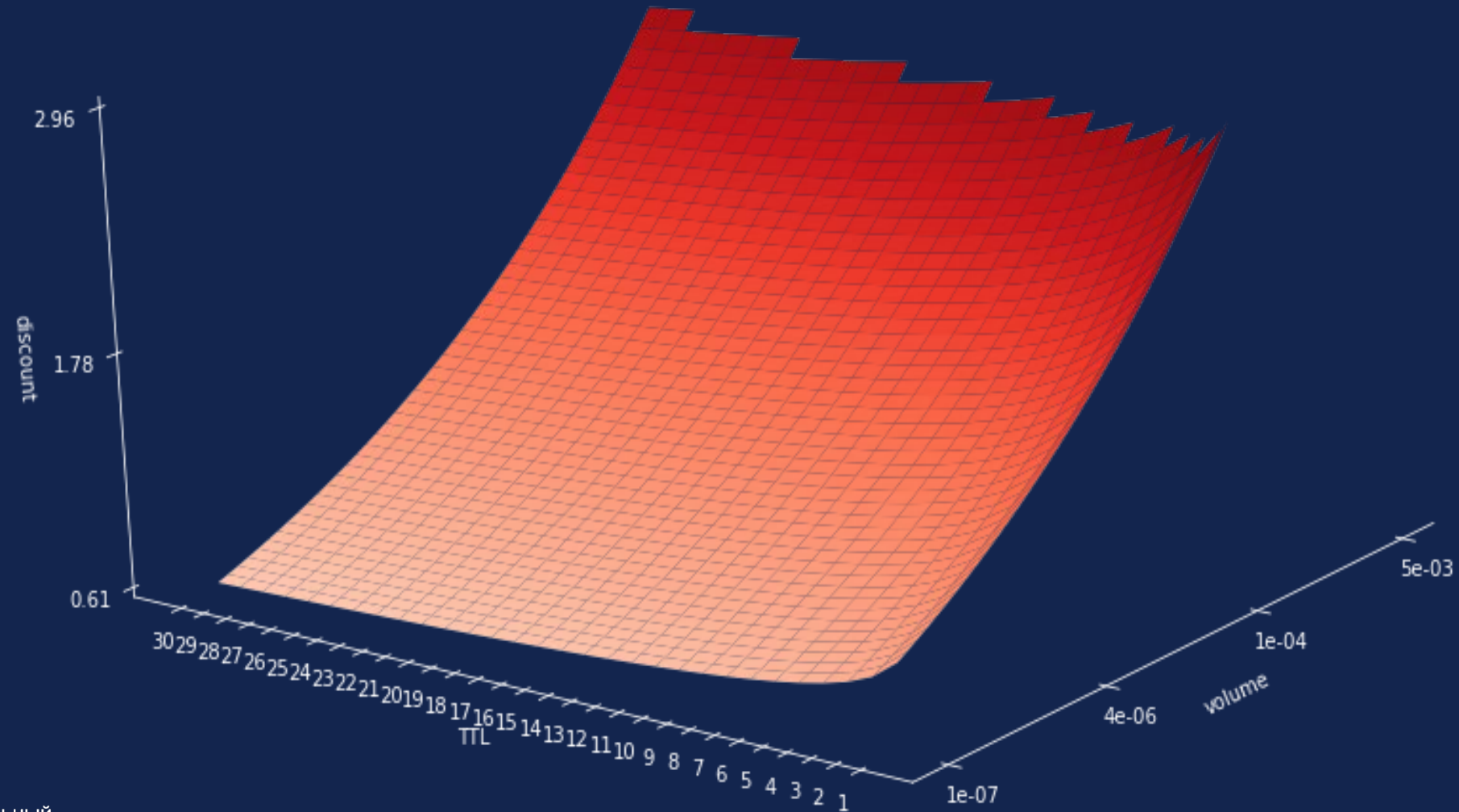
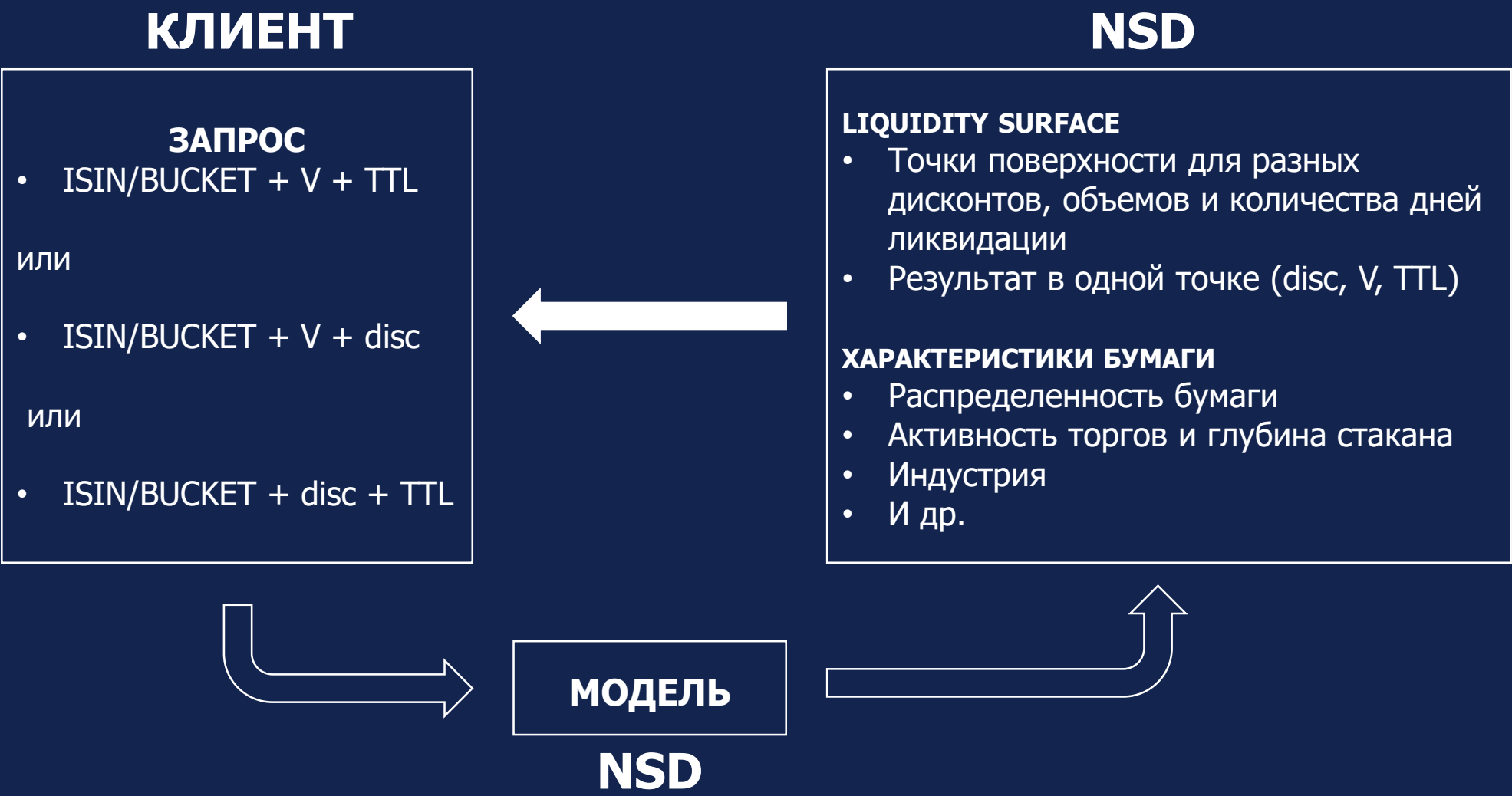


СХЕМА ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ



КОНТАКТЫ

Мария Жданкина – product owner Ценового центра НРД

Телефон: +7 989 756-25-44

E-mail: Zhdankina.MA@nsd.ru

Отдел взаимодействия с клиентами

Телефон: +7 495 232-05-14

E-mail: sales@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.