



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

10 декабря 2019, Москва

Светлана ТИМАШЕВА

руководитель направления по развитию СУО и трехсторонних сервисов

Сергей КУЗЬМИН

руководитель направления по развитию СУО и трехсторонних сервисов

РАЗВИТИЕ СУО ДЛЯ ГЛОБАЛЬНЫХ КРЕДИТОРОВ. ПРИМЕНЕНИЕ СЕРВИСОВ ЕДИНОГО СЧЕТА НА ПРАКТИКЕ

РЕПО ГЛОБАЛЬНЫХ КРЕДИТОРОВ С СУО НРД

СУО для РЕПО Глобальных кредиторов



РЕПО с корзиной Банка России
с 2013 г. размещено ~113 трлн руб.



РЕПО с корзиной Федерального казначейства
с 2015 г. размещено ~118 трлн руб.



РЕПО Комитета финансов Санкт-Петербурга
с 2019 (июль) размещено ~ 90 млрд руб.

СУО для РЕПО Комитета финансов Санкт-Петербурга

- Срок сделки: до 14 дней
- Терминал СПВБ (внебиржа)
- Обеспечение: ОФЗ-ПД с фиксированным купоном

РЕПО с фиксированной и плавающей ставкой

Средняя открытая позиция по РЕПО в млрд руб.



СУО для РЕПО Федерального казначейства

- РЕПО с плавающей ставкой
- Переход на терминал МОЕХ (внебиржа)

МАРКИРОВАНИЕ ДЛЯ РЕПО С ГЛОБАЛЬНЫМИ КРЕДИТОРАМИ

Маркирование



Междилерское РЕПО РЕПО с ЦБ РФ РЕПО с ФК Клиринг НКЦ Сделки OVP РЕПО с КФС*

1

2

Скопировать маркирование из группы сделок

Корзина РЕПО: GCFEDBONDS x Оценить ?

Учитывать встречные 2-ые части РЕПО

Анкета маркирования Заемщика

Приоритет	Раздел счета депо поставки	Маркируемый раздел счета депо	Ценная бумага	Количество ?	Оценка
3	11353635 (TS1903040014/0000000000000 x)	11353635 (TS1903040014/0000000000000 x)	Выберите значение ...		32 097 376 305,00 x
					32 097 376 305,00 +

3

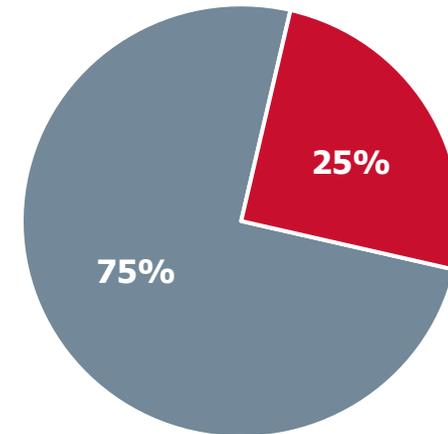
- Новая группа сделок
- Копировать маркирование
- Онлайн оценка ценных бумаг

ПРО ЕДИНЫЙ СЧЕТ



Пользователи постоянного поручения по ценным бумагам

■ Участники клиринга НРД ■ Эмитенты



ПОСТОЯННОЕ ПОРУЧЕНИЕ ПО ЦЕННЫМ БУМАГАМ

Переводы после клиринга НРД



Выпуск и размещение ценных бумаг



Выкуп и погашение ценных бумаг



Возврат бумаг из клиринга НКЦ

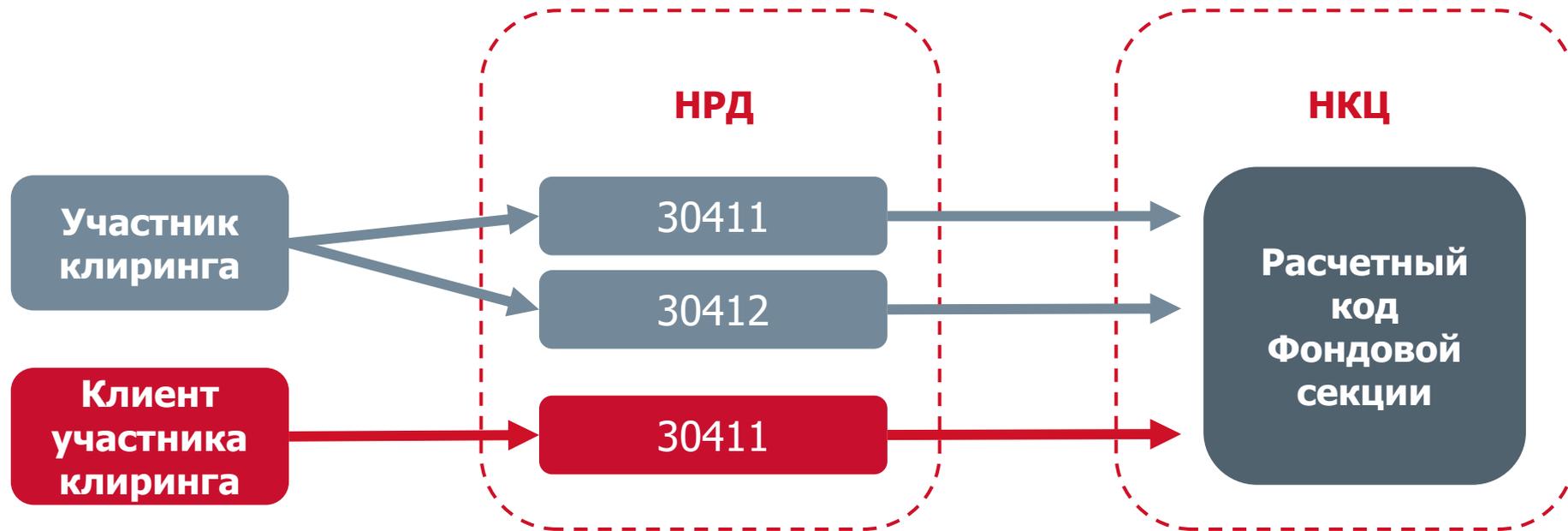


По отдельным ценным бумагам

Переводить только выбранные ценные бумаги ⓘ

Раздел счета депо списания	Ценная бумага
11353635 (TS1903040014/00000000000000000000) x	JE00B6T5S470 (Polymetal Internation_ORD SHS - JE00B6T5S470) x

ЕДИНЫЙ СЧЕТ ПО ДЕНЕЖНЫМ СРЕДСТВАМ



- «Учитывать плановые поставки»
- Автоматические переводы в RUB, USD, EUR

ВОЗМОЖНОСТИ ВК СУО

Остатки по счетам депо | Остатки по банковским счетам

Установленный фильтр

Избранные разделы счетов депо ?

Показывать разделы счетов депо с нулевыми остатками

Применить | Сбросить

Счет	Раздел	Идентификатор	Код ценной б...	ISIN	Наименование	Остаток
TS1903040014	000000000000000000	11353635	JE00B6T5S470	JE00B6T5S470	Polymetal Internation_ORD SHS	150 000 000
TS1903040014	000000000000000000	11353635	SU46005RMFS3	RU0002867631	ОФЗ АД(46005)	10 100 000
TS1903040014	000000000000000000	11353635	SU46012RMFS9	RU0002868001	ОФЗ АД(46012)	10 100 000
TS1903040014	000000000000000000	11353635	SU46011RMFS1	RU0002867854	ОФЗ АД(46011)	10 100 000

Меню «ОСТАТКИ»

- Остатки онлайн
- Выгрузка в Excel
- ISIN ценной бумаги
- Скрыты нулевые остатки

«ИЗБРАННЫЕ СЧЕТА» для каждого пользователя



Избранные торговые банковские счета ?

Торговый банковский счет

Нет данных для отображения



Избранные разделы счетов депо ?

Торговый счет/раздел депо

Нет данных для отображения

ОБМЕН ПОДТВЕРЖДЕНИЯМИ ЧЕРЕЗ ВК СУО

Список подтверждений по сделкам

Создать Редактировать Просмотр Удалить Отменить Копировать Создать поручение

Референс договора РЕПО	Дата сделки	Продавец по договору РЕПО	Покупатель по договору РЕПО	Сумма покупки	Валюта	Дата покупки	Ставка РЕПО, % годовых	Срок РЕПО, дней	Сумма выкупа	Дата выкупа	Тип документа	Статус исходящего документа	Дата и время	Причина ошибки	Статус входящего документа
W2019N2952	05.12.2019	Контрагент 3	Контрагент2	200 000,00	RUB	05.12.2019	11	20	201 205,48	25.12.2019	Подтверждение				Получено
W2019N2924	06.12.2019	Контрагент 3	Контрагент2	200 000 000,00	RUB	09.12.2019	15	10	201 068 493,15	19.12.2019	Подтверждение	Доставлено	06.12.2019 17:36:21		Получено

Подтверждение по Договору РЕПО референс W2019N2952

г. Москва 05.12.2019

Уважаемые господа!

Целью настоящего документа (далее – Подтверждение) является подтверждение условий Договора РЕПО, заключенного между Контрагент 3, именуемым в дальнейшем Сторона А, с одной стороны, и Контрагент2, именуемым в дальнейшем Сторона Б, с другой стороны, в указанную ниже Дату сделки.

1. Настоящее Подтверждение оформляется и Договор РЕПО, к которому оно относится, заключен в соответствии с Генеральным соглашением об общих условиях заключения договоров РЕПО на рынке ценных бумаг № МА0000105331 от 21.11.2012 (далее – Генеральное соглашение РЕПО). Термины, использованные по тексту настоящего Подтверждения, применяются в значении, определенном Генеральным соглашением РЕПО и Документами управления обеспечением.

2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение РЕПО и является его неотъемлемой частью. Все положения Генерального соглашения РЕПО применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Договор РЕПО заключен на следующих условиях:

Дата сделки:	05.12.2019
Продавец по Договору РЕПО:	Контрагент 3
Покупатель по Договору РЕПО:	Контрагент2
Агент по управлению обеспечением:	

Ценные бумаги – произвольная корзина ценных бумаг из следующего списка:

Описание Ценной бумаги (ISIN / наименование эмитента / код)	Количество, шт.	Дисконт, %	Приоритет типа цены
RU0006914488 / ОАО "СОЛЛЕРС" / 1/100_SVAV	15	1	L

Сумма покупки, валюта:	200000,00 RUB
Дата покупки:	05.12.2019
Дата поставки по первой части Договора РЕПО:	05.12.2019
Порядок расчетов по первой части Договора РЕПО:	DVP3
Ставка РЕПО, % годовых	11
Метод расчета процентов	365/366
Срок РЕПО, дней	20
Сумма выкупа, валюта	201205,48 RUB
Дата выкупа	25.12.2019
Дата поставки по второй части Договора РЕПО	25.12.2019
Порядок расчетов по второй части Договора РЕПО:	DVP3
Нижний уровень переоценки	1
Верхний уровень переоценки	1
Дополнительные условия	Начисление процентов по концепции ISDA

Подписант: CN=Сотрудник465, T=Специалист, SNILS=00770000465, INN=007700000465, OGRN=1277000000465, OU=Сектор, O=Предприятие465, L=Москва, C=RU, ST=77 г.Москва

ЭДО НРД

- Онлайн оформление
- Ускорение обмена

Дата сделки:	05.12.2019
Продавец по Договору РЕПО:	Контрагент 3
Покупатель по Договору РЕПО:	Контрагент2
Агент по управлению обеспечением:	

Ценные бумаги – произвольная корзина ценных бумаг из следующего списка:

Описание Ценной бумаги (ISIN / наименование эмитента / код)	Количество, шт.	Дисконт, %	Приоритет типа цены
RU0006914488 / ОАО "СОЛЛЕРС" / 1/100_SVAV	15	1	L

Сумма покупки, валюта:	200000,00 RUB
Дата покупки:	05.12.2019
Дата поставки по первой части Договора РЕПО:	05.12.2019
Порядок расчетов по первой части Договора РЕПО:	DVP3
Ставка РЕПО, % годовых	11
Метод расчета процентов	365/366
Срок РЕПО, дней	20
Сумма выкупа, валюта	201205,48 RUB
Дата выкупа	25.12.2019
Дата поставки по второй части Договора РЕПО	25.12.2019
Порядок расчетов по второй части Договора РЕПО:	DVP3
Нижний уровень переоценки	1
Верхний уровень переоценки	1
Дополнительные условия	Начисление процентов по концепции ISDA

Подписант: CN=Сотрудник465, T=Специалист, SNILS=00770000465, INN=007700000465, OGRN=1277000000465, OU=Сектор, O=Предприятие465, L=Москва, C=RU, ST=77 г.Москва

**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 преимущество 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.