

17.11.2021, г. Москва

АДАПТАЦИЯ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ НКО АО НРД К НОРМАМ CENTRAL SECURITIES DEPOSITORIES REGULATION (CSDR)



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ**
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

ПЛАН МЕРОПРИЯТИЯ

- 1 Что такое CSDR Settlement discipline regime
- 2 Сервис Hold and release при расчетах в ICSD
- 3 Сервис Частичных расчетов при расчетах в ICSD
- 4 Штрафы за неисполнение сделки в дату расчетов: типы и порядок применения
- 5 Отчеты о штрафах: содержание, порядок информирования депонентов
- 6 Процедура апелляции выставленного штрафа
- 7 Расчеты по выставленным штрафам: подход НРД к списанию и зачислению итоговых сумм
- 8 Сопровождение процедуры обязательного Buy-in
- 9 Пробный период информирования о штрафах
- 10 Ответы на вопросы участников

CSDR SETTLEMENT DISCIPLINE REGIME

Central Securities Depositories Regulation (CSDR) – регламент Европейского парламента о совершенствовании процедуры расчетов по ценным бумагам в Европейском Союзе и регулировании деятельности центральных депозитариев.

Settlement discipline regime (SDR) – раздел CSDR, который определяет нормативные стандарты к применению мер по совершенствованию процедуры расчетов по сделкам в европейских CSD¹ и ICSD². Стандарты объединены понятием «расчетная дисциплина».

Положения CSDR SDR определяют следующие требования к европейским (I)CSD:

Внедрение новых расчетных сервисов и правил расчетов

Мониторинг срывов исполнения сделок в ISD³

Применение денежных штрафов за срыв исполнения сделок

Применение процедуры обязательного buy-in

Отчеты о срывах исполнения сделок для европейских субъектов регулирования



Основная цель внедрения расчетной дисциплины – повышение доли сделок, исполняемых в установленную дату расчетов (ISD)

Дата вступления в силу технических требований к SDR установлена на 01.02.2022 г.

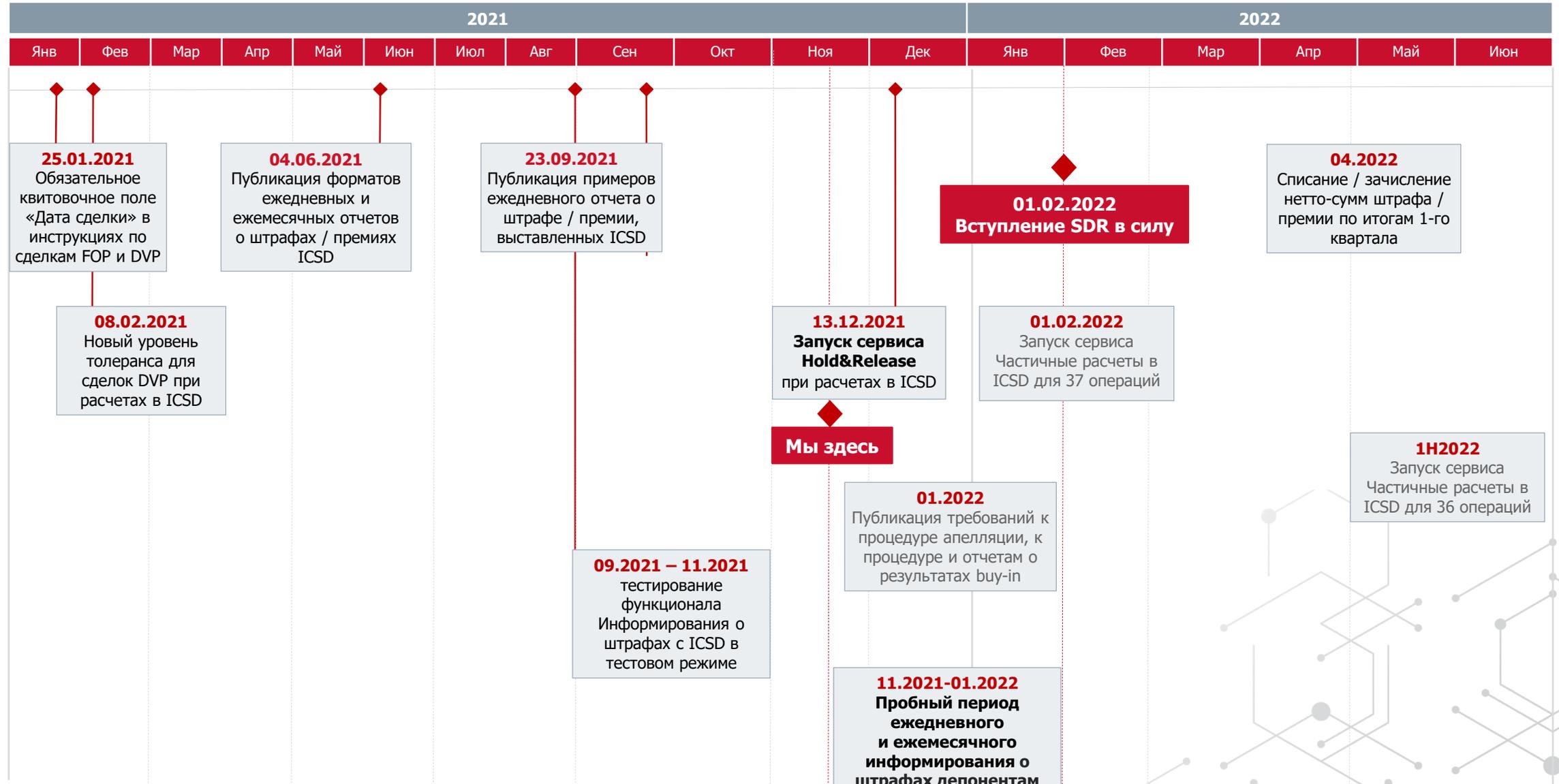
Дата вступления в силу отдельных положений SDR (требования по обязательному buy-in) может быть пересмотрена европейским субъектом регулирования рынка ценных бумаг.

¹ Central securities depository – Центральный депозитарий

² International central securities depository – Международный расчетно-клиринговый центр

³ Intended settlement date – установленная дата расчетов

ДОРОЖНАЯ КАРТА РЕАЛИЗАЦИИ ТРЕБОВАНИЙ CSDR



СЕРВИС HOLD AND RELEASE ПРИ РАСЧЕТАХ В ICSD

Позволяет управлять исполнением сделок в европейских (I)CSDs



Направить расчетную инструкцию в статусе on hold / released		
ФОРМА	ПОЛЕ	ЗНАЧЕНИЕ
MF035/MF036	Статус поручения	NEWM – для исполнения PREA – для сверки
MT540-MT543	23G, посл-ть А	
Изменить статус оригинальной расчетной инструкции		
MF530	Новое значение параметра	NEWM – для исполнения PREA – для сверки
MT530	22F, посл-ть В	YPRE – для исполнения NPRES – для сверки

Расчетная инструкция в статусе «для сверки» будет проходить стандартные проверки НКО АО НРД на соблюдение условий для операций по счетам в ICSDs.

Изменение статуса доступно в течение жизненного цикла инструкции, с учетом ограничений, установленных ICSD и/или локальным рынком.

Изменение статуса допускается в одностороннем порядке. Информирование о статусах инструкции депонента и встречной инструкции по сделке будет реализовано посредством уведомления по форме GS036/MT548 после получения отчета от ICSDs.

К сделкам, неисполненным в Дату расчетов по причине статуса «для сверки» у одной или обеих инструкций, будут применяться денежные штрафы.

Плановая дата запуска сервиса Hold&Release для операций в (I)CSD – 13.12.2021 г.

СЕРВИС ЧАСТИЧНЫХ РАСЧЕТОВ ПРИ РАСЧЕТАХ В ICSD

Частичные расчеты (ЧР) – частичная поставка ценных бумаг в случае их нехватки для полного исполнения сделки (не применимо к расчетам по денежным средствам).

Сделка может быть рассчитана частично, только если оба контрагента допускают ЧР на уровне инструкции и/или счета

Частичные расчеты по сделке		Контрагент В	
		Отказ	Разрешение
Контрагент А	Отказ	Нет	Нет
	Разрешение	Нет	Да

Управление ЧР на уровне инструкции		
ФОРМА	ПОЛЕ	ЗНАЧЕНИЕ
MF035	Дополнительные параметры	PART – разрешить ЧР NPAR – запретить ЧР
MT540-MT541	22F, посл-ть E	

ЧР могут производиться в несколько циклов, пока сделка не будет полностью исполнена. Циклы исполнения ЧР в ICSDs:

EUROCLEAR ВНУТРЕННИЕ РАСЧЕТЫ			CLEARSTREAM ВНУТРЕННИЕ + МОСТ EC - CS
02:30	14:01	16:50	13:40 - 14:25
07:00	15:15	17:15	15:10 - 15:55
10:00	15:50	18:15	16:40 - 17:35
12:30	16:00	19:30	18:20 - 19:05
13:45			

- Сервис доступен только для 37-й операции
- Информирование о частичном исполнении сделки осуществляется согласно текущей процедуре – отчеты MS035 / SWIFT MT544-MT545
- Допускается отмена части сделки, которая не была исполнена по итогам частичных расчетов
- Изменение ранее установленного индикатора ЧР по инструкции не допускается

Запуск сервиса частичных расчетов для операций в (I)CSD планируется с момента вступления SDR в силу.

ШТРАФЫ ЗА НЕИСПОЛНЕНИЕ СДЕЛКИ В ДАТУ РАСЧЕТОВ

ТИПЫ И ПОРЯДОК ПРИМЕНЕНИЯ



Штрафы за срыв исполнения сделки в установленную дату расчетов применяются ICSD к стороне сделки, виновной в срыве, и уплачиваются виновной стороной сделки в пользу пострадавшей стороны сделки в виде «премий»

Критерии применения денежных штрафов

Место расчетов	<ul style="list-style-type: none">Внутренние расчеты (внутри ICSD)Мостовые расчеты (Euroclear – Clearstream)Внешние расчеты (в CSD локальных рынков EEA)
Финансовый инструмент – предмет сделки	<ul style="list-style-type: none">Финансовый инструмент входит в список FIRDS (Financial Instruments Reference Files)Финансовый инструмент не входит в список SSR ESMA (list of exempted shares which primary trading venue is in a third country)
Статус сделки	<ul style="list-style-type: none">Встречные инструкции по сделке сквитованыПо сделке наступил ISDСделка имеет статус расчетов, отличный от «Расчитано» (settled) или «Отменено» (cancelled) (т.е. сделка ожидает расчета)

Валюта денежных штрафов

Тип сделки	Место расчетов	Валюта штрафа
FOP DVP	Внутренние (внутри ICSD)	EUR
	Мостовые (Euroclear – Clearstream)	EUR
	Локальные рынки EEA	На усмотрение CSD локального рынка

Штраф типа LMFP

- Инструкции **сквитованы после ISD**

Штраф типа SEFP

- Сделка **не исполнена в ISD**, или **исполнена только частично**
- Сделка **не исполнена в ISD** из-за установленного статуса **“on hold”** по одной или обеим инструкциям

ОТЧЕТЫ О ШТРАФАХ

СОДЕРЖАНИЕ, ПОРЯДОК ИНФОРМИРОВАНИЯ ДЕПОНЕНТОВ

ЕЖЕДНЕВНОЕ ИНФОРМИРОВАНИЕ О ШТРАФАХ

НКО АО НРД будет ежедневно информировать депонентов о всех новых, измененных, исключенных или вновь включенных денежных штрафах и/или премиях по неисполненным сделкам, в которых одной из сторон расчетов является депонент. Ожидаемые временные рамки информирования:

- Расчёты внутри Euroclear Bank, Clearstream Banking, мост EB – CBL: по завершении процесса формирования отчётов за день N, но не позднее 15:00 (зимнее время)
- Расчёты в CSD локальных рынков EEA: в рамках трёх отчётных циклов – 15:00, 17:00 и 19:00 (зимнее время).

Содержание отчета:

- Краткая информация о поручении депо, по которому рассчитан штраф / премия
- Детали расчета штрафа / премии, полученные от ICSDs

Форма ежедневного отчета:

- отчет по форме GS036
- сообщение SWIFT формата MT537



- 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.

УВЕДОМЛЕНИЕ № 00000001

от 26.10.2021 г. 18:22:37

Операция: Прием ценных бумаг на хранение и/или учет 37

Отправитель отчета: NDC000000000 Небанковская кредитная организация акционерное общество "Национальный расчетный депозитарий"

Получатель отчета: MC0000000000

Инициатор поручения: MC0000000000

Уведомление о:

		штраф/преми, выставленном ICSD по поручению	
Рег. № поручения	12345678	← Номер поручения, к которому привязан штраф	
Исходящий № поручения	A12345678		
Дата формирования	25.10.2021		
Дата штрафа/премии	25.10.2021	← Референс штрафа не меняется	
Номер счета НРД в ICSD	46055		
Референс штрафа/премии	211025000930104	← Индивидуальный референс штрафа может быть изменен	
Индивидуальный референс штрафа/премии	N211025000930104		
Предыдущий референс штрафа/премии	}	← Применяется в случае перевыставления (re-allocation) штрафа по итогам апелляции.	
Предыдущий индивидуальный референс штрафа/премии			
Тип штрафа/премии	LMFP		
Способ расчета штрафа/ премии	CALM//SECU Сумма штрафа рассчитывается только по ценным бумагам		
Статус штрафа/премии	PNST//ACTV активный штраф		
Причина применения статуса	ACTV//NEWP новый штраф		
Сумма штрафа/премии	0.02 EUR	← Только для штрафа типа LMFP – сумма дней просрочки квитовки встречных инструкций	
Признак штраф/премия	премия		
Количество дней штрафа/премии	002		

Пример заполнения ежедневного отчета о штрафе

Легенда:

- Депонент подал поручение 25.10.2021 с установленной датой расчетов 20.10.2021 (ISD).
- Поручение передано в ICSD 25.10.2021
- 25.10.2021 происходит срыв расчетов по поручению в связи с недостатком ценных бумаг.
- 26.10.2021 поступает отчет о штрафах типа LMFP за 2 рабочих дня просроченной квитовки и о штрафе типа SEFP за срыв исполнения сделки в день квитовки. Сделка по-прежнему не исполнена.
- 27.10.2021 поступает отчет о штрафе типа SEFP за неисполнение сделки.
- 29.10.2021 поступает отчет об обновлении ранее сформированной суммы штрафа типа SEFP.

Детали расчета

Дата расчета штрафа/премии	20.10.2021	← Первый день просрочки квитовки
Финансовый инструмент	PTOTETOE0012	
Ставка штрафа/премии по типу актива	GOMB//0.001 государственные и муниципальные облигации	
Ставка штрафа/премии за дату		
Сумма штрафа/премии за дату	SECU 0.01 EUR	← Код типа актива
Признак Штраф/премия за дату	премия	
Референс инструкции	12345678	
Дата принятия поручения к исполнению	25.10.2021	
Дата квитовки инструкций в ICSD	25.10.2021	
Плановая дата расчетов	20.10.2021	
Количество ценных бумаг для расчёта штрафа/премии	1000	
Определитель количества ценных бумаг для расчета штрафа	FAMT	
Сумма сделки для расчета штрафа/премии		

Детали расчета

Дата расчета штрафа/премии	21.10.2021	← Второй день просрочки квитовки
Финансовый инструмент	PTOTETOE0012	
Ставка штрафа/премии по типу актива	GOMB//0.001 государственные и муниципальные облигации	
Ставка штрафа/премии за дату		
Сумма штрафа/премии за дату	SECU 0.01 EUR	
Признак Штраф/премия за дату	премия	
Референс инструкции	12345678	
Дата принятия поручения к исполнению	25.10.2021	
Дата квитовки инструкций в ICSD	25.10.2021	
Плановая дата расчетов	20.10.2021	
Количество ценных бумаг для расчёта штрафа/премии	1000	
Определитель количества ценных бумаг для расчета штрафа	FAMT	

Детали расчета для штрафа LMFP

Легенда:

- Депонент подал поручение 25.10.2021 с установленной датой расчётов 20.10.2021 (ISD).
- Поручение передано в ICSD 25.10.2021
- 25.10.2021 происходит срыв расчётов по поручению в связи с недостатком ценных бумаг.
- 26.10.2021 поступает отчёт о штрафах типа LMFP за 2 рабочих дня просроченной квитовки и о штрафе типа SEFP за срыв исполнения сделки в день квитовки. Сделка по-прежнему не исполнена.
- 27.10.2021 поступает отчёт о штрафе типа SEFP за неисполнение сделки.
- 29.10.2021 поступает отчёт об обновлении ранее сформированной суммы штрафа типа SEFP.

Рег. № поручения	12345678	←	Номер поручения, к которому привязан штраф
Исходящий № поручения	A12345678		
Дата формирования	25.10.2021		
Дата штрафа/премии	25.10.2021		
Номер счета НРД в ICSD	46055		
Референс штрафа/премии	211025000930105		
Индивидуальный референс штрафа/премии	N211025000930105		
Предыдущий референс штрафа/премии			
Предыдущий индивидуальный референс штрафа/премии			
Тип штрафа/премии	SEFP		
Способ расчета штрафа/ премии	CALM//SECU Сумма штрафа рассчитывается только по ценным бумагам		
Статус штрафа/премии	PNST//ACTV активный штраф		
Причина применения статуса	ACTV//NEWP новый штраф		
Сумма штрафа/премии	0.01 EUR		
Признак штраф/премия	премия		
Количество дней штрафа/премии	001		

Детали расчета для штрафа SEFP

Легенда:

- Депонент подал поручение 25.10.2021 с установленной датой расчётов 20.10.2021 (ISD).
- Поручение передано в ICSD 25.10.2021
- 25.10.2021 происходит срыв расчётов по поручению в связи с недостатком ценных бумаг.
- 26.10.2021 поступает отчёт о штрафах типа LMFP за 2 рабочих дня просроченной квитовки и о штрафе типа SEFP за срыв исполнения сделки в день квитовки. Сделка по-прежнему не исполнена.
- 27.10.2021 поступает отчёт о штрафе типа SEFP за неисполнение сделки.
- 29.10.2021 поступает отчёт об обновлении ранее сформированной суммы штрафа типа SEFP.

Для штрафа типа SEFP всегда = 1

Детали расчета

Дата расчета штрафа/премии	25.10.2021
Финансовый инструмент	PTOTETOE0012
Ставка штрафа/премии по типу актива	GOMB//0.001 государственные и муниципальные облигации
Ставка штрафа/премии за дату	
Сумма штрафа/премии за дату	SECU 0.01 EUR
Признак Штраф/премия за дату	премия
Референс инструкции	12345678
Дата принятия поручения к исполнению	25.10.2021
Дата квитовки инструкций в ICSD	25.10.2021
Плановая дата расчетов	20.10.2021
Количество ценных бумаг для расчета штрафа/премии	1000
Определитель количества ценных бумаг для расчета штрафа	FAMT
Сумма сделки для расчета штрафа/премии	
Статус расчёта по сделке	SETT//PEND
Причина применения статуса	PENF//CLAC

Поручение сквитовано 25.10.2021, но не исполнено

Причина срыва исполнения сделки – недостаточность бумаг для расчета у контрагента

УВЕДОМЛЕНИЕ № 00000002
от 27.10.2021 г. 10:28:54

По состоянию на 26.10.2021 сделка по-прежнему не была исполнена, 27.10.2021 сформирован отчет о штрафе

Детали расчета для штрафа SEFP

Легенда:

- Депонент подал поручение 25.10.2021 с установленной датой расчётов 20.10.2021 (ISD).
- Поручение передано в ICSD 25.10.2021
- 25.10.2021 происходит срыв расчётов по поручению в связи с недостатком ценных бумаг.
- 26.10.2021 поступает отчёт о штрафах типа LMFP за 2 рабочих дня просроченной квитанки и о штрафе типа SEFP за срыв исполнения сделки в день квитанки. Сделка по-прежнему не исполнена.
- 27.10.2021 поступает отчёт о штрафе типа SEFP за неисполнение сделки.
- 29.10.2021 поступает отчёт об обновлении ранее сформированной суммы штрафа типа SEFP.

Операция:	Принем ценных бумаг на хранение и/или учет	37
Отправитель отчета:	NDC000000000	Небанковская кредитная организация акционерное общество "Национальный расчетный депозитарий"
Получатель отчета:	MC000000000	
Инициатор поручения:	MC000000000	
Уведомление о:		
	штрафе/премии, выставленном ICSD по поручению	
Рег. № поручения	12345678	
Исходящий № поручения	A12345678	
Дата формирования	25.10.2021	
Дата штрафа/премии	26.10.2021	
Номер счета НРД в ICSD	46055	
Референс штрафа/премии	211026000932582	← Новый референс для нового штрафа SEFP
Индивидуальный референс штрафа/премии	N211026000932582	
Предыдущий референс штрафа/премии		
Предыдущий индивидуальный референс штрафа/премии		
Тип штрафа/премии	SEFP	
Способ расчета штрафа/ премии	CALM//SECU Сумма штрафа рассчитывается только по ценным бумагам	
Статус штрафа/премии	PNST//ACTV активный штраф	
Причина применения статуса	ACTV//NEWP новый штраф	
Сумма штрафа/премии	0.01 EUR	
Признак штраф/премия	премия	
Количество дней штрафа/премии	001	
Детали расчета		
Дата расчета штрафа/премии	26.10.2021	
Финансовый инструмент	PTOTETOЕ0012	
Ставка штрафа/премии по типу актива	GOMB//0.001 государственные и муниципальные облигации	
Ставка штрафа/премии за дату		

Сумма штрафа/премии за дату	SECU 0.01 EUR
Признак Штраф/премия за дату	премия
Референс инструкции	12345678
Дата принятия поручения к исполнению	25.10.2021
Дата квитанки инструкций в ICSD	25.10.2021
Плановая дата расчетов	20.10.2021
Количество ценных бумаг для расчёта штрафа/премии	1000
Определитель количества ценных бумаг для расчета штрафа	FAMT
Сумма сделки для расчета штрафа/премии	
Статус расчёта по сделке	SETT//PENF
Причина применения статуса	PENF//CLAC

УВЕДОМЛЕНИЕ № 00000003
от 29.10.2021 г. 09:46:18

По состоянию на 29.10.2021 сумма штрафа, выставленного 26.10.2021 была обновлена

Детали расчета для обновления штрафа SEFP

Легенда:

- Депонент подал поручение 25.10.2021 с установленной датой расчётов 20.10.2021 (ISD).
- Поручение передано в ICSD 25.10.2021
- 25.10.2021 происходит срыв расчётов по поручению в связи с недостатком ценных бумаг.
- 26.10.2021 поступает отчёт о штрафах типа LMFP за 2 рабочих дня просроченной квитанции и о штрафе типа SEFP за срыв исполнения сделки в день квитанции. Сделка по-прежнему не исполнена.
- 27.10.2021 поступает отчёт о штрафе типа SEFP за неисполнение сделки.
- 29.10.2021 поступает отчёт об обновлении ранее сформированной суммы штрафа типа SEFP.

Операция: Прием ценных бумаг на хранение и/или учет 37
Отправитель отчета: NDC000000000 Небанковская кредитная организация акционерное общество "Национальный расчетный депозитарий"
Получатель отчета: MC0000000000
Инициатор поручения: MC0000000000

Уведомление о:

Reg. № поручения	12345678	штрафа/премии, выставленном ICSD по поручению
Исходящий № поручения	A12345678	
Дата формирования	25.10.2021	← Дата пересчитанного штрафа осталась прежней
Дата штрафа/премии	26.10.2021	
Номер счета НРД в ICSD	46055	
Референс штрафа/премии	211026000932582	← Референс пересчитанного штрафа остался прежним
Индивидуальный референс штрафа/премии	N211026000932582	
Предыдущий референс штрафа/премии		
Предыдущий индивидуальный референс штрафа/премии		
Тип штрафа/премии	SEFP	
Способ расчета штрафа/ премии	CALM//SECU Сумма штрафа рассчитывается только по ценным бумагам	
Статус штрафа/премии	PNST//ACTV активный штраф	
Причина применения статуса	ACTV//UPDT штраф пересчитан или заново включен после предшествующего исключения	
Сумма штрафа/премии	0.02 EUR	← Изменилась сумма штрафа
Признак штраф/премия	премия	
Количество дней штрафа/премии	001	
Детали расчета		
Дата расчета штрафа/премии	26.10.2021	
Финансовый инструмент	PTOTETOE0012	
Ставка штрафа/премии по типу актива	GOMB//0.001 государственные и муниципальные облигации	
Ставка штрафа/премии за дату		

Сумма штрафа/премии за дату	SECU 0.02 EUR
Признак Штраф/премия за дату	премия
Референс инструкции	12345678
Дата принятия поручения к исполнению	25.10.2021
Дата квитанции инструкций в ICSD	25.10.2021
Плановая дата расчетов	20.10.2021
Количество ценных бумаг для расчёта штрафа/премии	1000
Определитель количества ценных бумаг для расчета штрафа	FAMT
Сумма сделки для расчета штрафа/премии	
Статус расчёта по сделке	SETT//PENF
Причина применения статуса	PENF//CLAC

ПРОЦЕДУРА АПЕЛЛЯЦИИ ВЫСТАВЛЕННОГО ШТРАФА

Апелляция денежного штрафа в ICSD допускается в случаях, если:

- В отношении ценной бумаги приостановлены торги и/или расчеты по причине запуска процедуры реконсилляции;
- Денежные расчеты по сделке задействуют платежные системы вне операционной системы (I)CSD, и в Дату расчетов такая платежная система была закрыта;
- Сделка не могла быть исполнена по причине технических неполадок на уровне (I)CSD.

При подаче апелляции необходимо указать:

Референс денежного штрафа	Номер поручения депо
Тип апелляции	Подробное обоснование апелляции

Период подачи апелляции: со дня формирования денежного штрафа в бизнес-день n периода M^1 до 7-го бизнес-дня периода $M+1^2$ включительно.

Если в этот срок не было подано апелляции, принимается, что Депонент согласился с указанными суммами и подтвердил, что начисление штрафа /премии обоснованно и совершено на законных основаниях.

Возможные типы апелляции:

Запрос об отмене штрафа
Запрос об изменении суммы штрафа
Запрос о повторном включении ранее отмененного штрафа

Подача апелляции в НРД: посредством передачи заполненного обращения по установленному шаблону через НТЭД в ДККО. Шаблон будет опубликован на сайте НРД в разделе «Адаптация к CSDR».

Решение по апелляции принимает (I)CSD. При положительном решении (I)CSD депонент получит отчет о соответствующем изменении денежного штрафа. Порядок уведомления об отказе будет определен после получения технических подробностей от обоих ICSD.

¹ Период M – текущий календарный месяц.

² Период $M+1$ – следующий календарный месяц.

ОТЧЕТЫ О ШТРАФАХ

СОДЕРЖАНИЕ, ПОРЯДОК ИНФОРМИРОВАНИЯ ДЕПОНЕНТОВ

ЕЖЕМЕСЯЧНОЕ ИНФОРМИРОВАНИЕ О ШТРАФАХ

В 15-й бизнес-день периода М+1 НРД направит депонентам отчет с итоговой нетто суммой штрафов / премий за период М в соответствующей валюте.

Ежедневные отчёты о денежных штрафах, начисляемых в период М+1

Форма ежемесячного отчета:

- отчет по новой форме GS110
- сообщение SWIFT формата MT537



Содержание ежемесячного отчета:

- Краткая информация о поручении депо, по которому рассчитан штраф / премия;
- Краткая информация по каждому штрафу / премии за отчетный период в разрезе депозитарного кода депонента;
- Итоговая сумма штрафа к списанию / премии к зачислению за период М по каждой валюте и месту расчетов.

Суммы, отраженные в ежемесячном отчете – **окончательные**. Не подлежат апелляции и другим изменениям. Будут использованы для вычисления нетто по итогам квартала для расчета по начисленным суммам штрафов / премий.

ПРИМЕР ЗАПОЛНЕНИЯ ЕЖЕМЕСЯЧНОГО ОТЧЕТА О ШТРАФАХ

Форма GS110

УВЕДОМЛЕНИЕ № 00000000 от 18.11.2021 г. 13:04:58 о штрафах/премиях по расчетам в ICSD

Операция: **Предоставление дополнительной информации** 99
Отправитель отчета: NDC0000000000 Небанковская кредитная организация акционерное общество "Национальный расчетный депозитарий"
Получатель отчета: MC0000000000
Инициатор поручения: MC0000000000

ICSD MGTСВЕВЕХХХ

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							
37	AB12345678	12345678	2021-10-25 10:46:04	MC0000000000/0000000000000000	EUROCLEAR	211025000930104	N211025000930104	LMFP	0.02	EUR
37	AB12345678	12345678	2021-10-25 10:46:04	MC0000000000/0000000000000000	EUROCLEAR	211025000930105	N211025000930105	SEFP	0.01	EUR
37	AB12345678	12345678	2021-10-25 10:46:04	MC0000000000/0000000000000000	EUROCLEAR	211026000932582	N211026000932582	SEFP	0.02	EUR

Итого по валюте: 0.05 EUR

↑
Референсы штрафов,
сообщенных в течение
отчетного периода

↑
Отражены только
активные, актуальные
суммы

РАСЧЕТЫ ПО ВЫСТАВЛЕННЫМ ШТРАФАМ

ПОДХОД НРД К СПИСАНИЮ И ЗАЧИСЛЕНИЮ ИТОГОВЫХ СУММ



Периодичность расчетов: 1 раз в квартал.

Сумма к списанию / зачислению: нетто за отчетный период (квартал).

Валюта расчетов: в валюте штрафа / премии.

Порядок расчетов: безакцептное списание / зачисление нетто суммы¹.

Для списания итоговых сумм штрафов используются денежные счета депонентов в НКО АО НРД. Предпочтительные счета будут согласовываться с депонентами через обращение клиентских менеджеров. Могут быть закреплены депонентами для списаний/зачислений на постоянной основе.

Отсутствие информации о предпочтительном счете для списания – итоговая сумма штрафа будет списана с денежного счета депонента, на котором имеется необходимая сумма для покрытия требования.

Отсутствие необходимой суммы на счету / отсутствие денежного счета в НРД – депоненту будет сформировано требование о возмещении штрафа.

Для зачисления итоговых сумм премий используются только денежные счета, открытые в НРД.



СОПРОВОЖДЕНИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОБЯЗАТЕЛЬНОГО BUY-IN

Требованиями CSDR устанавливается **extension period** – дополнительный расчетный период, который дается участникам расчетов на завершение исполнения сделки.

По истечении дополнительного расчетного периода, если сделка не была исполнена, пострадавшая сторона должна инициировать **процедуру buy-in**.

Функции НРД в процессе исполнения выкупа:

- Исполнять поручение на изменение статуса оригинальной инструкции (сервис Hold&Release)
- Направлять ежедневные отчеты о штрафах, начисляемых по неисполненной сделке в течение исполнения buy-in
- Исполнять поручение на зачисление купленных ценных бумаг по итогам buy-in
- Производить отмену оригинальной сделки по завершении выкупа
- Направлять в ICSD отчет о результатах процедуры выкупа, заполненный депонентом

Заполнение поручения по итогам buy-in

ФОРМА	ПОЛЕ	ЗНАЧЕНИЕ
MF035/MF036	Дополнительные параметры	BYIY – полный buy-in BSSP – частичный buy-in
MT540-MT543	22F, посл-ть E	SETR//BYIY – полный buy-in STCO/REGL/BSSP – частичный buy-in

- Если осуществлен полный buy-in, участник расчетов подает новую инструкцию на зачисление выкупленных ценных бумаг с указанием кода BYIY¹
- Если осуществлен частичный buy-in и участник расчетов желает провести процедуру повторно для оставшейся части бумаг, вместо инструкций по оригинальной сделке должны быть поданы новые инструкции с указанием кода BSSP¹

Порядок подачи отчета о результатах buy-in будет сообщен дополнительно.

НРД не планирует оказывать услуги агента по выкупу, не планирует оказывать услуги по осуществлению коммуникации с агентом по выкупу.

DRY RUN – ПРОБНЫЙ ПЕРИОД ЕЖЕДНЕВНОГО И ЕЖЕМЕСЯЧНОГО ИНФОРМИРОВАНИЯ О ШТРАФАХ



В плане подключение пробного периода информирования о штрафах, выставленных ICSDs по реальным сделкам, в промышленном контуре. **С 22 ноября 2021 года планируется подключение информирования от Euroclear Bank, с декабря 2021 года – Clearstream Banking.**

НРД будет направлять депонентам индивидуальные ежедневные и ежемесячные отчеты о новых и измененных денежных штрафах и/или премиях по неисполненным сделкам, в которых одной из сторон расчетов является депонент.

- Подробная информация о ежедневном и ежемесячном отчете, а также пример такого отчета, опубликованы на сайте НКО АО НРД в разделе «[Адаптация к CSDR](#)».
- Отчеты будут поступать автоматически по каналам, указанным депонентами в анкете участника ЭДО.



Цель пробного периода – испытать новый функционал, работу системы расчета штрафов в ICSD, системы информирования депонентов НРД.

На протяжении пробного периода возможно наличие:

- технических проблем;
- нерегулярного информирования;
- задержек в решении операционных вопросов со стороны НРД и ICSDs, и других ошибок.

В течение пробного периода **не будут производиться списания штрафов / зачисления премий.**

Полная работа функционала по штрафам, в том числе списания и зачисления, будет запущена с момента вступления CSDR Settlement discipline regime в силу **01.02.2022 г.**

МЫ ГОТОВЫ ОТВЕТИТЬ НА ВАШИ ВОПРОСЫ



КОНТАКТЫ

В случае возникновения вопросов, касающихся адаптации НКО АО НРД к требованиям CSDR, Вы можете обратиться к своим персональным RM менеджерам, а также направить свои вопросы на специальный адрес электронной почты:

Тел.: +7 495 232-05-14

E-mail: csdr@nsd.ru

Персональные менеджеры по вопросам текущего обслуживания клиентов:

Тел.: +7 495 956-27-90, +7 495 956-27-91





НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

**Спасибо
за внимание!**



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;
 - способностью успевать за быстрыми изменениями в научно-технической среде, включая способность использовать расширенные функциональные возможности, которые популярны среди клиентов Компании и ее дочерних обществ;
 - способностью сохранять преимущество процесса внедрения новых конкурентных продуктов и услуг, равно как и поддержка конкурентоспособности;
 - способностью привлекать новых клиентов на отечественный рынок и в зарубежных юрисдикциях;
 - способностью 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.