



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

20 ноября 2014 года, Москва

Анастасия Киселева

Управляющий директор по репозитарной
деятельности

**РЕПОЗИТАРИЙ НРД:
ИТОГИ И ДОСТИЖЕНИЯ 2014 ГОДА.
ПЛАНЫ РАЗВИТИЯ.**

ОБЩАЯ ИНФОРМАЦИЯ О РЕПОЗИТАРИИ (I)

Репозитарий НРД осуществляет регистрацию сделок РЕПО, сделок с производными финансовыми инструментами и иных видов сделок, которые заключаются на условиях генеральных соглашений на внебиржевом рынке.

ПЕРВЫЙ РЕПОЗИТАРИЙ НА РОССИЙСКОМ РЫНКЕ

Репозитарий НРД начал свою деятельность 5 февраля 2013 года, заявив о готовности регистрировать сделки РЕПО и валютный своп.

В октябре 2013 года НРД был готов принимать от участников информацию обо всех видах ПФИ и иных видах сделок.

ПАРТНЕРСТВО С КЛИЕНТАМИ

Для учета мнений и интересов клиентов в НРД создан Комитет по репозитарной деятельности и рабочая группа по технологическим вопросам, основными задачами которых является определение приоритетов развития Репозитария и обсуждение наиболее важных задач с участниками рынка.

ВЗАИМОДЕЙСТВИЕ С БАНКОМ РОССИИ И СРО НФА

- **Взаимодействие с Банком России** по вопросам совершенствования нормативно-правовой базы и параметров отчетности.
- **Комитет по репозитарной деятельности при СРО НФА.**



ОСНОВНЫЕ СОБЫТИЯ 2014 ГОДА



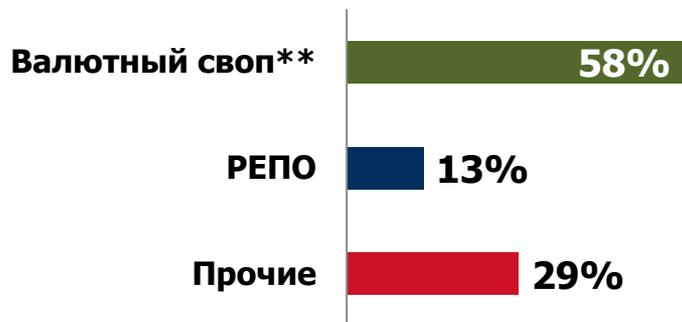
КЛИЕНТЫ И РЕГИСТРАЦИЯ СДЕЛОК

Количество клиентов Репозитария:

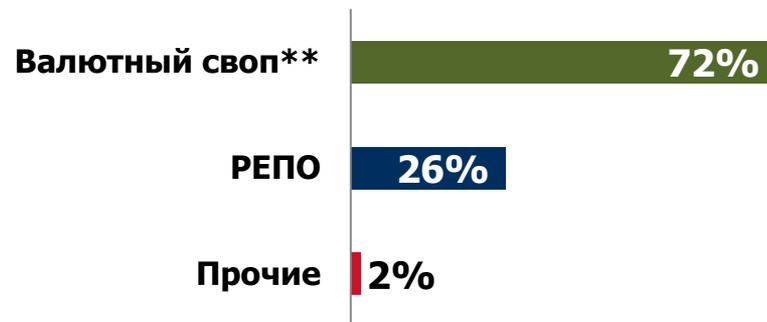


Структура сделок, отчитываемых в Репозитарий НРД*:

по количеству сделок



по объему сделок



* накопленным итогом по состоянию на 01.11.2014

** с учетом квартальной отчетности

ПОДДЕРЖИВАЕМЫЕ ТИПЫ СДЕЛОК

| | | Форварды | Опционы | Свопы | Свопционы | Иные |
|-----------------|------------|----------|-----------|---------|-----------|------|
| Сделки с ПФИ | Валютные | ● | ● | ● | | |
| | Процентные | ● | ● | ● | ● | |
| | Товарные | ● | ● | ● | ● | |
| | Облигации | ● | ● | ● | | |
| | Акции | ● | ● | ● | | |
| | Кредитные | | | ● | ● | |
| | Иные | | | | | ● |
| Сделки РЕПО | | Акции | Облигации | Корзины | | |

● – Информация по сделкам уже направляется в Репозиторий НРД

СПОСОБЫ РЕГИСТРАЦИИ ДАННЫХ

Информация предоставляется в Репозиторий только одним участником. Сверка или подтверждение информации второй стороной не требуется.

Односторонняя регистрация



Оба участника одновременно подают в сообщения, которые будут сверены Репозитарием и зарегистрированы при отсутствии расхождений.

Встречная регистрация



Один из участников инициирует регистрацию сообщения, второй – подтверждает предоставленные сведения. При комбинированной регистрации второй участник вправе проигнорировать запрос на подтверждение данных и направить собственное сообщение для сверки.

Последовательная / Комбинированная регистрация



ПЛАНЫ РАЗВИТИЯ РЕПОЗИТАРИЯ (I) **НА 2015 ГОД**

АДАПТАЦИЯ К ИЗМЕНЕНИЯМ В ЗАКОНОДАТЕЛЬСТВО

В соответствии с запланированными на 2015 год изменениями в законодательство (Указание Банка России 3253-У и/или Федеральный закон «О рынке ценных бумаг»):

- Переход на LEI;
- Отмена квартальной отчетности;
- Запуск обязательной отчетности по всем видам ПФИ;
- Подготовка к регистрации сделок, заключенных вне рамок генеральных соглашений.

ЗАПУСК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С CME TRADE REPOSITORY LIMITED

В рамках взаимодействия планируется предоставить российским участникам рынка возможность отчитываться по трансграничным сделкам в соответствии с требованиями EMIR.

ИНТЕГРАЦИЯ РЕПОЗИТАРИЯ В СХЕМУ РАСЧЕТОВ ПО СДЕЛКАМ РЕПО

В рамках проекта по междилерскому РЕПО предполагается осуществлять одновременную регистрацию сделок в Реестре договоров и подачу поручений для расчетов по сделкам с клирингом в НРД.

РАЗРАБОТКА КОНЦЕПЦИИ ПО АНАЛИТИЧЕСКИМ СЕРВИСАМ



ВЗАИМОДЕЙСТВИЕ С РЕПОЗИТАРИЕМ CME

НРД и CME Trade Repository Limited (Chicago Mercantile Exchange) разрабатывают решение, которое позволит российским участникам рынка отчитываться по трансграничным сделкам в соответствии с требованиями ESMA (EMIR). Предполагается, что взаимодействие будет происходить по схеме, представленной ниже:



Такое решение предоставит клиентам следующие возможности:

Единую «точку входа» для отчетности по требованиям законодательства России и Европейского союза.

Использование стандартного программного обеспечения и форматов НРД для предоставления отчетности без необходимости поддержки дополнительных форматов или каналов связи.

ПРОЕКТ МЕЖДИЛЕРСКОГО РЕПО С СУО НРД С УЧАСТИЕМ РЕПОЗИТАРИЯ



Контакты и полезные ссылки

Репозитарий:

E-mail: repository@nsd.ru

<https://www.nsd.ru/ru/services/repository/> - официальный сайт.

<http://repository.nsd.ru> – информация о форматах сообщений, дополнительные сервисы.

Департамент клиентского обслуживания:

Tel.: +7 (495) 956-27-90/91/92/93; (495) 956-09-40;

(495) 745-81-45; (495) 234-48-65

E-mail: dc@nsd.ru

Адрес:

105066, Москва, ул. Спартаковская, 12

**СПАСИБО
ЗА ВНИМАНИЕ!**



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ**
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

ПРАВОВАЯ ОГОВОРКА

- Настоящая презентация была подготовлена и выпущена НКО ЗАО 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.

