**Порядок взаимодействия клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением**

Оглавление

[ЧАСТЬ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ 6](#_Toc57969859)

[1. Термины и определения. 6](#_Toc57969860)

[2. Общие положения. 10](#_Toc57969861)

[3. Права и обязанности Сторон Договора 12](#_Toc57969862)

[4. Оплата услуг 12](#_Toc57969863)

[5. Ответственность Сторон Договора 13](#_Toc57969864)

[6. Конфиденциальность 14](#_Toc57969865)

[7. Порядок разрешения споров 15](#_Toc57969866)

[8. Расторжение Договора 15](#_Toc57969867)

[9. Общие принципы взаимодействия 15](#_Toc57969868)

[10. Регистрация корзины РЕПО и дисконтов 16](#_Toc57969869)

[11. Регистрация Порога переоценки 17](#_Toc57969870)

[12. Порядок определения Рыночной цены 17](#_Toc57969871)

[13. Порядок расчета Текущей ставки РЕПО и Текущей стоимости обязательства 18](#_Toc57969872)

[14. Определение обязательств Клиентов по первой части Сделки РЕПО 20](#_Toc57969873)

[15. Подбор ценных бумаг для исполнения обязательств Клиентов по первой части Сделки РЕПО 20](#_Toc57969874)

[16. Регистрация изменений параметров и прекращения учета обязательств по Сделке РЕПО 22](#_Toc57969875)

[17. Переоценка обязательств и Обеспечения 23](#_Toc57969876)

[18. Проверка Обеспеченности обязательств 23](#_Toc57969877)

[19. Внесение Компенсационного взноса 24](#_Toc57969878)

[20. Правила Замены ценных бумаг 24](#_Toc57969879)

[21. Определение и исполнение обязательств Клиентов по второй части Сделки РЕПО 25](#_Toc57969880)

[22. Порядок действий при регистрации Сделок РЕПО в Репозитарии 26](#_Toc57969881)

[23. Порядок действий при проведении корпоративных действий с выпусками ценных бумаг, переданных Кредитору 26](#_Toc57969882)

[ЧАСТЬ II. ОСОБЕННОСТИ ОКАЗАНИЯ УСЛУГ ПО УПРАВЛЕНИЮ ОБЕСПЕЧЕНИЕМ ПО СДЕЛКАМ РЕПО С ГЛОБАЛЬНЫМ КРЕДИТОРОМ 27](#_Toc57969883)

[24. Регистрация Типового генерального соглашения 27](#_Toc57969884)

[25. Регистрация Корзины РЕПО, дисконтов, присвоение Дополнительных идентификаторов Корзины РЕПО 28](#_Toc57969885)

[26. Установление Порога переоценки 30](#_Toc57969886)

[27. Регистрация дополнительных ограничений Банка России в отношении Заемщика 30](#_Toc57969887)

[28. Особенности определения Рыночной цены 31](#_Toc57969888)

[29. Особенности расчета Текущей стоимости обязательства и Стоимости обратного выкупа 32](#_Toc57969889)

[30. Особенности Маркирования и Подбора ценных бумаг для исполнения первой части Сделки РЕПО 32](#_Toc57969890)

[31. Частичное исполнение первой части Сделки РЕПО 34](#_Toc57969891)

[32. Особенности исполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО 34](#_Toc57969892)

[33. Особенности изменения параметров Сделки РЕПО, переоценки обязательств, проверки Обеспеченности обязательств и внесения Компенсационного взноса 35](#_Toc57969893)

[34. Особенности Замены ценных бумаг 36](#_Toc57969894)

[35. Порядок действий при проведении корпоративных действий с выпусками ценных бумаг, переданных по Сделкам РЕПО 38](#_Toc57969895)

[ЧАСТЬ III. ОСОБЕННОСТИ ОКАЗАНИЯ УСЛУГ ПО УПРАВЛЕНИЮ ОБЕСПЕЧЕНИЕМ ПО СДЕЛКАМ МЕЖДИЛЕРСКОГО РЕПО 40](#_Toc57969896)

[36. Особенности регистрации Генерального соглашения 40](#_Toc57969897)

[37. Особенности регистрации Корзины РЕПО и дисконтов 41](#_Toc57969898)

[38. Особенности регистрации порога переоценки 42](#_Toc57969899)

[39. Особенности Определения Рыночной цены 42](#_Toc57969900)

[40. Особенности использования Лимитов 43](#_Toc57969901)

[41. Особенности расчета Текущей стоимости обязательства и Стоимости обратного выкупа 44](#_Toc57969902)

[42. Особенности Маркирования и Подбора ценных бумаг для исполнения первой части Сделки РЕПО 44](#_Toc57969903)

[43. Особенности исполнения обязательств Клиентов по второй части Сделки РЕПО 46](#_Toc57969904)

[44. Особенности переоценки обязательств, изменения параметров Сделки РЕПО, проверки Обеспеченности обязательств и внесения Компенсационного взноса 47](#_Toc57969905)

[45. Особенности замены ценных бумаг 48](#_Toc57969906)

[46. Порядок действий НРД при проведении корпоративных действий с ценными бумагами, переданными в качестве обеспечения по Сделкам РЕПО 49](#_Toc57969907)

[ЧАСТЬ IV. ОСОБЕННОСТИ ОКАЗАНИЯ УСЛУГИ ПО ПОДБОРУ ЦЕННЫХ БУМАГ НА СЧЕТ ДЕПО/РАЗДЕЛ СЧЕТА ДЕПО/СУБСЧЕТ ДЕПО ДЛЯ ОБСЛУЖИВАНИЯ КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ НКЦ 50](#_Toc57969908)

[47. Общие положения 50](#_Toc57969909)

[48. Особенности подбора ценных бумаг для обслуживания клиринговой деятельности НКЦ 50](#_Toc57969910)

[ЧАСТЬ V. ОСОБЕННОСТИ ОКАЗАНИЯ УСЛУГИ ПО ПОДБОРУ ЦЕННЫХ БУМАГ ДЛЯ ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ DVP 53](#_Toc57969911)

[49. Общие положения 53](#_Toc57969912)

[50. Особенности Подбора ценных бумаг 53](#_Toc57969913)

[Приложение 1](#_Toc57969914) [**Алгоритмы Подбора ценных бумаг,**](#_Toc57969915) [**определения обеспеченности обязательств,**](#_Toc57969916) [**расчета размеров и структуры Компенсационного взноса** 56](#_Toc57969917)

[ЧАСТЬ I. АЛГОРИТМ ПОДБОРА ЦЕННЫХ БУМАГ ПРИ УПРАВЛЕНИИ ОБЕСПЕЧЕНИЕМ В СДЕЛКАХ РЕПО. 56](#_Toc57969918)

[2. Общие принципы Алгоритма Подбора ценных бумаг 56](#_Toc57969919)

[3. Алгоритм Подбора ценных бумаг 56](#_Toc57969920)

[4. Алгоритм проверки Обеспеченности обязательств, расчета размеров и структуры Компенсационного взноса 60](#_Toc57969921)

[ЧАСТЬ II. ОСОБЕННОСТИ АЛГОРИТМА ПОДБОРА ЦЕННЫХ БУМАГ, ПРОВЕРКИ ОБЕСПЕЧЕННОСТИ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ И РАСЧЕТА КОМПЕНСАЦИОННОГО ВЗНОСА ДЛЯ СДЕЛОК РЕПО С ГЛОБАЛЬНЫМ КРЕДИТОРОМ 62](#_Toc57969922)

[5. Особенности Алгоритма Подбора ценных бумаг 63](#_Toc57969923)

[6. Особенности проверки Обеспеченности обязательств 65](#_Toc57969924)

[7. Особенности расчета Компенсационного взноса 66](#_Toc57969925)

[8. Перенос даты второй части Сделки РЕПО. 68](#_Toc57969926)

[ЧАСТЬ III. ОСОБЕННОСТИ АЛГОРИТМА ПОДБОРА ЦЕННЫХ БУМАГ, ПРОВЕРКИ ОБЕСПЕЧЕННОСТИ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ И РАСЧЕТА КОМПЕНСАЦИОННОГО ВЗНОСА ДЛЯ СДЕЛОК МЕЖДИЛЕРСКОГО РЕПО 69](#_Toc57969927)

[9. Особенности Алгоритма Подбора ценных бумаг 69](#_Toc57969928)

[10. Особенности проверки Обеспеченности обязательств 70](#_Toc57969929)

[11. Особенности расчета Компенсационного взноса 70](#_Toc57969930)

[ЧАСТЬ IV. АЛГОРИТМ ПОДБОРА ЦЕННЫХ БУМАГ ДЛЯ ОБСЛУЖИВАНИЯ КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ НКЦ 71](#_Toc57969931)

[12. Общие принципы Подбора ценных бумаг 71](#_Toc57969932)

[13. Порядок Подбора ценных бумаг по сумме Подбора. 72](#_Toc57969933)

[14. Порядок Подбора ценных бумаг по списку. 72](#_Toc57969934)

[15. Порядок Подбора ценных бумаг при одновременном указании в Поручении на подбор суммы Подбора и списка ценных бумаг. 72](#_Toc57969935)

[ЧАСТЬ V. АЛГОРИТМ ПОДБОРА ЦЕННЫХ БУМАГ ДЛЯ ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ DVP 73](#_Toc57969936)

[16. Алгоритм Подбора ценных бумаг 73](#_Toc57969937)

[Приложение 2](#_Toc57969938) [Перечень поручений и отчетов, используемых при оказании услуг по Управлению обеспечением. 75](#_Toc57969939)

[Приложение 3](#_Toc57969940) [Образцы поручений и правила их заполнения 78](#_Toc57969941)

[1. Поручение на изменение и прекращение учета обязательства, на Замену ценных бумаг 78](#_Toc57969942)

[2. Поручение на Маркирование ценных бумаг для Подбора Обеспечения 84](#_Toc57969943)

[3. Поручение на регистрацию дополнительных параметров управления Обеспечением Сделок РЕПО 87](#_Toc57969944)

[4. Поручение на автозамену в Сделках РЕПО с Глобальными Кредиторами 89](#_Toc57969945)

[5. Поручение на регистрацию Корзин РЕПО 91](#_Toc57969946)

[6. Поручение на Подбор ценных бумаг для обслуживания клиринговой деятельности НКЦ 93](#_Toc57969947)

[7. Поручение на денежный Компенсационный взнос 95](#_Toc57969948)

[8. Лимитная карта Кредитора 97](#_Toc57969949)

[9. Поручение на передачу цен по ценным бумагам 99](#_Toc57969950)

[10. Отчет о регистрации/изменении и прекращении учета обязательств по Сделке РЕПО 101](#_Toc57969951)

[11. Отчет о Маркировании ценных бумаг для Подбора Обеспечения 103](#_Toc57969952)

[12. Отчет о регистрации дополнительных параметров управления Обеспечением Сделок РЕПО 104](#_Toc57969953)

[13. Отчет о разрешении автозамены ценных бумаг в Сделках РЕПО с Глобальными кредиторами 105](#_Toc57969954)

[14. Отчет о регистрации корзины РЕПО 106](#_Toc57969955)

[15. Отчет о Подборе ценных бумаг для обеспечения клиринговой деятельности НКЦ 107](#_Toc57969956)

[16. Отчет о регистрации Лимитной карты 108](#_Toc57969957)

[17. Отчет о передаче цен по ценным бумагам. 109](#_Toc57969958)

[18. Отчет о составе обязательств и их Обеспеченности 110](#_Toc57969959)

[19. Сводный отчет о регистрации/изменении и прекращении учета обязательств по Сделкам РЕПО за период 112](#_Toc57969960)

[20. Отчет о Заемщиках, обязательства которых не обеспечены 114](#_Toc57969961)

[21. Отчет о компенсации доходов Кредитора 115](#_Toc57969962)

[22. Отчет об обязательствах по прекращенной Сделке РЕПО 116](#_Toc57969963)

[23. Заявление об отказе от предоставления услуги по перечислению дохода по ценным бумагам……………………………………………………………………………………….. 117](#_Toc57969964)

[Приложение 4](#_Toc57969965) [Расписание действий по Управлению обеспечением по Сделкам РЕПО 118](#_Toc57969966)

[Приложение 5](#_Toc57969967) [Перечень выпусков облигаций с запретом на обращение в периоды между датами составления списков для выплаты купонов и датами выплат 120](#_Toc57969968)

[Приложение 6](#_Toc57969969) [УВЕДОМЛЕНИЕ О ДЕФОЛТЕ 121](#_Toc57969970)

[Приложение 7](#_Toc57969971) [Заявление о присоединении](#_Toc57969972) [к договору об оказании услуг по управлению обеспечением 122](#_Toc57969973)

## ЧАСТЬ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

# Термины и определения.

* 1. **Алгоритмы –** Алгоритм Подбора ценных бумаг, Алгоритм проверки обеспеченности обязательств, расчета размеров и структуры компенсационного взноса, а также особенности указанных Алгоритмов для различных Групп сделок.
  2. **Генеральное соглашение –** генеральное соглашение, заключенное между Заемщиком и Кредитором, в том числе по форме Типового генерального соглашения либо Генерального соглашения об общих условиях заключения договоров РЕПО на рынке ценных бумаг.
  3. **Глобальный кредитор** (Банк России или Государственный кредитор) - организация, являющаяся единым покупателем по первым частям всех Сделок РЕПО, заключенных в рамках Генерального соглашения в соответствующей Группе сделок.
  4. **Государственный кредитор** – органы исполнительной власти; финансово-кредитные учреждения, осуществляющие управление денежными средствами, находящимися в собственности Российской Федерации.
  5. **Группа сделок –** совокупность Сделок РЕПО, к которым применяются общие принципы и процедуры управления обеспечением, предусматривающие, в том числе, единые принципы Подбора ценных бумаг, единые правила контроля Обеспеченности обязательств и т.п., и объединенные в единый Пул обязательств при маржировании пула,

В рамках СУО используются следующие Группы сделок:

* «Группа сделок РЕПО с Банком России» – код CBR1;
* «Группа сделок РЕПО с Федеральным казначейством» – код KZN1;
* «Группа сделок РЕПО с Федеральным казначейством (ЕКС)» - код EKS1;
* «Группа сделок РЕПО с Федеральным казначейством» - код MBS1;
* «Группа сделок РЕПО с Федеральным казначейством (ЕКС) – код MBS2;
* «Группа сделок РЕПО с Комитетом финансов Санкт-Петербурга» - код SPB1;
* «Группа сделок РЕПО с Комитетом финансов Ленинградской области» - код LEN1;
* «Группа сделок междилерского РЕПО» – код RMBC;
* «Обслуживание клиринговой деятельности НКЦ» - код GNCC;
* «Группа сделок купли-продажи с клирингом НРД (Группа сделок DVP)» - код BSTT.
  1. **Дата первой части Сделки РЕПО –** дата, в которую должны быть исполнены обязательства Клиентов по первой части Сделки РЕПО**.**
  2. **Дата второй части Сделки РЕПО –** дата, в которую должны быть исполнены обязательства Клиентов по второй части Сделки РЕПО.
  3. **Дефолт –** наступившие в отношении одной из Сторон по Сделке междилерского РЕПО обстоятельства, определенные Генеральным соглашением как обстоятельства, которые повлекли или могут повлечь риск неисполнения Стороной обязательств по Сделке РЕПО.
  4. **Дисконтированная цена (дисконтированная стоимость) –** величина, которая определяется на заданный момент времени путем умножения Рыночной цены ценной бумаги, на значение (1-D/100), где D – дисконт в процентах, устанавливаемый Кредитором по данному выпуску ценной бумаги на текущий рабочий день. Ценная бумага принимается в Обеспечение по Дисконтированной цене.
  5. **Действующая Сделка РЕПО –** Сделка РЕПО, по которой полностью или частично исполнена первая часть и не исполнена вторая часть.
  6. **Договор -** Договор об оказании услуг по управлению обеспечением, заключенный между НРД и Клиентом путем присоединения к указанному договору (в соответствии со статьей 428 Гражданского Кодекса Российской Федерации), условия которого определены Порядком и Тарифами НРД.
  7. **Договор ЭДО -** Договор об обмене электронными документами, заключенный между НРД и Клиентом.
  8. **Дополнительный идентификатор Корзины РЕПО –** указанный в Общем реестре Сделок РЕПО буквенно-цифровой код, соответствующий перечню ценных бумаг, входящих в Корзину РЕПО Банка России, которые НРД вправе использовать при Подборе ценных бумаг для исполнения обязательств Заемщика по Сделке РЕПО.
  9. **Заемщик** - Клиент, заключивший Сделку РЕПО, в том числе в рамках Генерального соглашения, и являющийся продавцом ценных бумаг по первой части Сделки РЕПО.
  10. **Замена ценных бумаг** – замена по требованию Заемщика или Кредитора Ценных бумаг, переданных Кредитору, иными ценными бумагами, входящими в Корзину РЕПО.
  11. **Заменяемые ценные бумаги** – Ценные бумаги, переданные Кредитору, подлежащие замене в случаях, предусмотренных Порядком.
  12. **Заменяющие ценные бумаги** – ценные бумаги, подлежащие передаче взамен Заменяемых ценных бумаг. После передачи Кредитору Заменяющих ценных бумаг последние включаются в состав Ценных бумаг, переданных Кредитору.
  13. **Заявление о присоединении –** Заявление о присоединении к договору об оказании услуг по управлению обеспечением по форме Приложения 7 к Порядку.
  14. **Идентификатор Корзины РЕПО -** уникальный идентификационный код, присваиваемый Корзине РЕПО.
  15. **Индикативная ставка –** параметр, соответствующий валюте Сделки РЕПО, изменение которого используется для расчета и корректировки Ставки РЕПО в случае заключения Сделки РЕПО с Плавающей ставкой РЕПО, и соответствующий одному из денежных индикаторов, использование которых определяется Порядком.
  16. **Клиент –** юридическое лицо, заключившее или планирующее заключить с НРД Договор (в зависимости от того, что применимо).
  17. **Компенсационный взнос –** ценные бумаги и (или) денежные средства, передаваемые Стороной по Сделке РЕПО другой Стороне в результате переоценки при изменении цен ценных бумаг, переданных в качестве Обеспечения по Сделке РЕПО, или Текущей стоимости обязательств.
  18. **Корзина РЕПО –** ценные бумаги, соответствующие требованиям, предъявляемым Глобальным кредитором либо Стороной по Сделке междилерского РЕПО и принимаемые в качестве обеспечения по Сделкам РЕПО, а также дисконты по указанным ценным бумагам. Информация о Корзинах РЕПО и дисконтах размещается на Сайте.
  19. **Кредитор –** Клиент, заключивший Сделку РЕПО с Заемщиком, в том числе в рамках Генерального соглашения, и являющийся покупателем ценных бумаг по первой части Сделки РЕПО. По тексту Порядка Глобальный кредитор также именуется Кредитором, за исключением случаев, когда описываются особенности, связанные с Глобальным кредитором.
  20. **Лимит концентрации (Лимит) –** установленные Кредитором максимальное количество Ценных бумаг, переданных Кредитору, определенное в штуках (Лимит в количественном выражении), и/или максимальная стоимость Ценных бумаг, переданных Кредитору, определенная в российских рублях (Лимит в стоимостном выражении), которое/ая может быть передано/а Кредитору.
  21. **Локальная корзина Сделки РЕПО –** определяемый Сторонами по Сделке во встречных поручениях по форме MF194 перечень выпусков ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения по данной Сделке РЕПО.
  22. **Маркирование –** выделение (предварительное определение) Клиентом на разделах счетов депо ценных бумаг, которые могут быть использованы при Подборе ценных бумаг.
  23. **Междилерское РЕПО –** Сделки РЕПО, заключенные между Клиентами, ни один из которых не является Глобальным кредитором.
  24. **Минимальный лот** – минимальное количество ценных бумаг определенного выпуска, которое может находиться в составе Ценных бумаг, переданных Кредитору. Значения минимального лота в денежном выражении и номинальной стоимости представлены на Сайте в анкете выпуска ценной бумаги.
  25. **НКД** – накопленный купонный доход.
  26. **НКЦ -** Небанковская кредитная организация – центральный контрагент «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).
  27. **НРД –** Небанковская кредитная организация акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий» (НКО АО НРД).
  28. **Обеспечение –** совокупность ценных бумаг, в отношении которых у Кредитора есть обязательства по вторым частям Сделок РЕПО.
  29. **Обеспеченность обязательств –** соблюдение Порога переоценки, установленного в соответствии с Порядком.
  30. **Общий реестр сделок РЕПО** – перечень заявок Заемщика, удовлетворенных Кредитором по результатам аукциона или отбора заявок, содержащий основные условия заключенных Сделок РЕПО.
  31. **Организатор торговли** - юридическое лицо, оказывающее услуги по проведению организованных торгов на финансовых рынках на основании лицензии биржи или лицензии торговой системы.
  32. **Оценочная стоимость –** стоимостьценной бумаги, устанавливаемая НКЦ и используемая при Подборе ценных бумаг для обеспечения клиринговой деятельности НКЦ.
  33. **Перенос даты второй части Сделки РЕПО –** внесение изменений в условия Сделки РЕПО в случаях, указанных в Генеральном соглашении, путем установления даты второй части Сделки РЕПО на рабочий день, следующий за днем не перечисления Заемщиком денежных средств для исполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО.
  34. **Перечень клиринговых документов** - Перечень документов, которые предоставляют и получают Участники клиринга в соответствии с Правилами клиринга, размещенный на Сайте.
  35. **Перечень ценных бумаг** - ценные бумаги, разрешенные НКЦ для подбора для обеспечения клиринговой деятельности НКЦ, с указанием их Оценочной стоимости.
  36. **Подбор ценных бумаг –** определение НРД в порядке, предусмотренном Порядком, ценных бумаг конкретного выпуска (конкретных выпусков) и их количества, необходимых для исполнения обязательств по Сделкам РЕПО, Сделкам DVP, либо для исполнения [Поручения на подбор ценных бумаг для обслуживания клиринговой деятельности НКЦ](#_Поручение_на_Подбор_1).
  37. **Порог переоценки (трешхолд) –** величина допустимого значения необеспеченных (либо переобеспеченных) ценными бумагами обязательств Клиента, при превышении которого возникает основание для внесения Компенсационного взноса.
  38. **Порядок** – Порядок взаимодействия клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением.
  39. **Пул обязательств** - совокупность обязательств Заемщика по всем Действующим Сделкам РЕПО Группы сделок.
  40. **Продавец** – продавец ценных бумаг по Сделке DVP.
  41. **Правила КД -** Правила взаимодействия с НКО АО НРД при обмене корпоративной информацией, проведении корпоративных действий и иных операций.
  42. **Правила клиринга -** Правила клиринга Небанковской кредитной организации акционерного общества «Национальный расчетный депозитарий».
  43. **Правила ЭДО –** Правила электронного документооборота НКО АО НРД.
  44. **Репозитарий –** репозитарий НРД.
  45. **Реюз** – повторное использование Ценных бумаг, переданных Кредитору.
  46. **Рыночная цена –** цена ценной бумаги в российских рублях, определяемая в соответствии с Порядком. Особенности использования Рыночной цены в целях Подбора ценных бумаг, а также переоценки обязательств устанавливаются Порядком.
  47. **Сайт –** официальный сайт НРД, размещенный по URL-адресу: www.nsd.ru.
  48. **Сделка РЕПО –** договор репо, заключенный между Кредитором и Заемщиком как на условиях Генерального соглашения, так и вне рамок Генерального соглашения.
  49. **Сделка РЕПО с открытой датой –** Сделка РЕПО, при заключении которой не устанавливается Дата второй части Сделки РЕПО.
  50. **Сделка DVP –** сделка купли-продажи ценных бумаг, заключённая на условиях «поставка против платежа», клиринг обязательств по которой осуществляет НРД.
  51. **Спред –** величина отклонения Ставки РЕПО от Индикативной ставки, выраженная в процентах годовых.
  52. **Ставка РЕПО –** величина, выраженная в процентах годовых, которая используется для расчета Текущей стоимости обязательств или Стоимости обратного выкупа. Может быть Фиксированной или Плавающей.
      1. **Фиксированная Ставка РЕПО** – параметр, определяемый в момент заключения Сделки РЕПО и выраженный в процентах годовых.
      2. **Плавающая Ставка РЕПО** – условие Сделки РЕПО, при котором Ставка РЕПО может корректироваться в случае изменения Индикативной ставки в течение срока Сделки РЕПО.
  53. **Стоимость обратного выкупа (сумма возврата)** – сумма денежных средств, подлежащая уплате Заемщиком Кредитору за ценные бумаги по второй части Сделки РЕПО, определенная в соответствии с Порядком.
  54. **Сторона Договора** – НРД или Клиент (совместно именуемые **Стороны Договора**).
  55. **Сторона по Сделке РЕПО** – Кредитор или Заемщик, заключившие Сделку РЕПО (совместно именуемые **Стороны по Сделке РЕПО**).
  56. **Сумма РЕПО** – сумма денежных средств, которую Кредитор уплатил Заемщику за ценные бумаги, переданные по первой части Сделки РЕПО, скорректированная с учетом уплаченных денежными средствами в течение срока Сделки РЕПО Компенсационных взносов.
  57. **СУО НРД (Система Управления Обеспечением)** – автоматизированная система, обеспечивающая выполнение функций НРД по Управлению обеспечением и Подбору ценных бумаг.
  58. **СЭД НРД (Система электронного документооборота НРД)** – система электронного документооборота НРД, определенная в Договоре об обмене электронными документами.
  59. **Тарифы НРД** – Тарифы оплаты услуг по договорам об оказании услуг по управлению обеспечением Небанковской кредитной организации акционерного общества «Национальный расчетный депозитарий».
  60. **Текущая стоимость обязательства** – параметр Сделки РЕПО, рассчитываемый НРД каждый день срока Сделки РЕПО.
  61. **Текущая ставка РЕПО** – параметр Сделки РЕПО, рассчитываемый НРД каждый день срока Сделки РЕПО.
  62. **Типовое генеральное соглашение** – утвержденная Глобальным кредитором форма генерального соглашения об общих условиях совершения Глобальным кредитором и Заемщиком сделок РЕПО на организованных торгах либо не на организованных торгах в Российской Федерации, условия которого зарегистрированы в НРД в соответствии с Порядком.
  63. **Уполномоченное лицо** – Глобальный кредитор, Организатор торговли или иное лицо, уполномоченное в соответствии с Правилами клиринга предоставлять Общий реестр сделок РЕПО.
  64. **Управление обеспечением** – совокупность действий НРД, предусмотренных Порядком и выполняемых НРД в интересах Клиентов в соответствии с Федеральным законом «О рынке ценных бумаг».
  65. **Условия** - Условия осуществления депозитарной деятельности Небанковской кредитной организацией акционерным обществом «Национальный расчетный депозитарий».
  66. **Услуги** – услуги по управлению обеспечением, оказываемые НРД в рамках Договора.
  67. **Учетные документы** –первичные учетные документы (счета, документы об оказанных Услугах, иные документы, предусмотренные законодательством Российской Федерации или Договором), формы и документы налогового учета при наличии (счета-фактуры, корректировочные счета-фактуры).
  68. **Ценные бумаги, переданные Кредитору** – ценные бумаги, переданные Кредитору во исполнение обязательств по первой части Сделки РЕПО, а также ценные бумаги, на которые заменены ценные бумаги, переданные по первой части Сделки РЕПО, ценные бумаги, в которые конвертированы ценные бумаги, переданные по первой части Сделки РЕПО, ценные бумаги, переданные Кредитору в качестве Компенсационного взноса.
  69. **DVP-1, DVP-2, DVP-3** - типы расчетов, определенные в соответствии с Правилами клиринга**.**
  70. Иные термины используются в значениях, установленных законодательством Российской Федерации, нормативными правовыми актами, нормативными актами Банка России, Договором ЭДО, Правилами клиринга, Примерными условиями договоров РЕПО на российском финансовом рынке, Типовыми генеральными соглашениями.

# Общие положения.

* 1. Договор регулируется и толкуется в соответствии с законодательством Российской Федерации. Вопросы, не урегулированные Договором, разрешаются в соответствии с законодательством Российской Федерации
  2. НРД заключает Договор с юридическими лицами, заключившими с НРД:
     + - Договор ЭДО;
       - договор об оказании клиринговых услуг с НРД;
       - договор об оказании услуг по предоставлению информации в Репозитарий.
  3. Для присоединения к Договору Клиент предоставляет в НРД:
     + - Заявление о присоединении по форме Приложения 7 к Порядку в виде электронного документа с использованием ЛКУ;
       - документы в соответствии с Перечнем документов, предоставляемых Клиентами - юридическими лицами в НКО АО НРД, размещенном на Сайте.
  4. Если Клиент ранее предоставил комплект документов в соответствии с Перечнем документов, предоставляемых Клиентами - юридическими лицами в НКО АО НРД, Клиенту необходимо предоставить только те документы и (или) изменения к ним, которые не были предоставлены ранее.
  5. НРД в разумный срок осуществляет проверку документов, указанных в пункте 2.2 Порядка, на полноту и достоверность предоставленной информации.
  6. При положительном результате проверки НРД не позднее 2 (двух) рабочих дней с даты её окончания направляет Клиенту уведомление о заключении Договора с использованием ЛКУ или по почтовому адресу.
  7. Договорные отношения возникают с даты, указанной в уведомлении о заключении Договора.
  8. При оказании Услуг в соответствии с Порядком порядок учета прав и (или) перехода прав на ценные бумаги определяется договором счета депо, заключенным Сторонами Договора, а порядок осуществления денежных расчетов определяется заключенным Сторонами Договора договором банковского счета.
  9. Необходимым условием оказания Клиенту Услуг по Договору в отношении Сделок РЕПО, заключенных на основании Генерального соглашения с Глобальным кредитором, определяющего порядок заключения сделок Клиентом, является передача в СУО НРД сведений об указанном Генеральном соглашении.
  10. НРД в одностороннем порядке вносит изменения в Порядок и Тарифы НРД.
  11. Порядок, Тарифы НРД и вносимые в них изменения утверждаются в установленном НРД порядке и вводятся в действие приказом уполномоченного органа НРД.
  12. НРД обязан уведомить Клиентов об изменении Порядка не позднее, чем за 10 (десять) календарных дней, и Тарифов НРД не позднее, чем за 30 (тридцать) календарных дней до даты их вступления в силу.
  13. О внесении изменений в Порядок и (или) Тарифы НРД уведомляет Клиентов путем размещения указанных изменений на Сайте. Датой уведомления считается дата размещения информации на Сайте.

Клиент обязан самостоятельно проверять соответствующую информацию на Сайте. Ответственность за получение указанной информации лежит на Клиенте.

* 1. Клиент, заключивший договор об оказании услуг по управлению обеспечением до 10.01.2020, и не направивший до 01.10.2021 уведомление о его расторжении в связи с соответствующей редакцией Порядка, считается согласившимся с предложением об изменении указанного договора путем изложения в редакции Порядка, за исключением следующих условий, которые сохраняют силу:
* номер и дата заключения Договора;
* условия договора об оказании услуг по управлению обеспечением, заключенного НРД с Банком России.
  1. Если ранее заключенные между НРД и Клиентом дополнительные соглашения к договору об оказании услуг по управлению обеспечением противоречат Порядку, применяются положения, таких дополнительных соглашений.
  2. Сторонами Договора в соответствии с законодательством Российской Федерации разработаны и применяются меры по предупреждению и противодействию коррупции. Стороны Договора не осуществляют действия, квалифицируемые законодательством Российской Федерации как дача и (или) получение взятки, коммерческий подкуп, не выплачивают и не предлагают выплатить какие-либо денежные средства или ценности, прямо или косвенно, любым лицам для оказания влияния на действия или решения этих лиц с целью получить какие-либо неправомерные преимущества или для достижения иных неправомерных целей, а также не предпринимают иные действия, нарушающие требования законодательства Российской Федерации о противодействии коррупции.

# Права и обязанности Сторон Договора

* 1. НРД обязан:
     1. оказывать Клиенту Услуги в соответствии с Договором.
  2. Клиент обязан:
     1. оплачивать в полном объеме Услуги НРД в порядке и сроки, предусмотренные Договором;
     2. в случае внесения изменений в документы (получения новых документов) и/или изменения сведений, ранее представленных в НРД, в течение 3 (трех) рабочих дней представить в НРД документы (сведения), предусмотренные Перечнем документов, предоставляемых клиентами-юридическими лицами в НКО АО НРД;
     3. по запросу НРД предоставлять документы и информацию, необходимые для идентификации Клиента, а также информацию, необходимую для идентификации выгодоприобретателей, бенефициарных владельцев и иных лиц.
  3. НРД вправе:
     1. в случае неоплаты Клиентом услуг более чем за один месяц, приостановить оказание Услуг до момента их оплаты;
     2. прекратить оказание Услуг при невыполнении Клиентом обязательств, предусмотренных Договором.
  4. Клиент вправе:
     1. требовать от НРД оказания Услуг при условии их оплаты в порядке и сроки, установленные Договором.

# Оплата услуг

* 1. Клиент обязан оплачивать Услуги в порядке, установленном Договором, и в размере, установленном Тарифами НРД, действующими на дату оказания услуг. Если в момент вступления в силу изменений в Тарифы НРД оказание какой-либо услуги не было завершено, оплата производится в соответствии с Тарифами НРД, действующими на момент завершения оказания данной услуги.
  2. Для расчета стоимости Услуг в соответствии с Тарифами НРД Сумма РЕПО по Сделке РЕПО, заключенной в иностранной валюте, за каждый из дней периода Сделки РЕПО, начиная с Даты первой части Сделки РЕПО (включая такую дату), до Даты второй части Сделки РЕПО (исключая такую дату), пересчитывается в российские рубли по курсу Банка России, установленному на каждый день периода Сделки РЕПО.
  3. НРД выставляет счет и предоставляет иные Учетные документы, не позднее 5 (пятого) рабочего дня месяца, следующего за расчетным.
  4. Учетные документы предоставляются Клиенту:
     1. в виде электронных документов по Каналам информационного взаимодействия, предусмотренным Договором ЭДО и предназначенным для указанных целей. При этом оригиналы Учетных документов на бумажном носителе предоставляются в офисе НРД. При необходимости НРД вправе направить оригиналы Учетных документов по почтовому адресу;
     2. при отсутствии электронного документооборота между Сторонами – в виде документов на бумажном носителе в офисе НРД. При необходимости НРД вправе направить оригиналы Учетных документов по почтовому адресу;
     3. в случае подключения обмена Учетными документами через информационную систему, оператор которой соответствует требованиям ФНС России, - в порядке, предусмотренном Договором ЭДО.
  5. В случае подключения обмена, предусмотренного пунктом 4.4.3 Порядка, Стороны осуществляют его на условиях, предусмотренных Договором ЭДО. При этом иные способы направления Учетных документов больше не применяются.
  6. Клиент обязан оплатить счет, путем перечисления денежных средств по банковским реквизитам НРД, указанным в счете, не позднее 20 (двадцатого) числа месяца, следующего за расчетным. Счет на оплату Услуг, оказанных Клиенту в декабре, Клиент обязан оплатить не позднее 31 (тридцать первого) января. Если 20 число месяца, следующего за расчетным, или 31 января приходится на нерабочий день, то крайним сроком оплаты считается первый рабочий день, следующий за нерабочим днем. Датой оплаты счета считается дата поступления денежных средств на корреспондентский счет НРД.
  7. При несоблюдении срока оплаты НРД вправе потребовать уплаты неустойки в размере 1 (одного) процента от несвоевременно оплаченной суммы за каждый день просрочки, но не более 10 (десяти) процентов от указанной суммы.
  8. В случае нарушения срока оплаты более чем на один календарный месяц НРД вправе:
  + приостановить оказание Услуг;
  + потребовать оплаты путем внесения авансовых платежей и не оказывать Услуги, если внесенный авансовый платеж недостаточен.
  1. Тарифы НРД не включают налог на добавленную стоимость, который оплачивается Клиентом сверх стоимости Услуг в размере, установленном законодательством Российской Федерации.

# Ответственность Сторон Договора

* 1. Стороны Договора несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение предусмотренных Договором обязательств в соответствии с законодательством Российской Федерации.
  2. НРД не несет ответственности по обязательствам Клиента по Сделкам, по которым Клиент использует Услуги НРД в соответствии с Договором, в том числе за действия (бездействие) Клиента при исполнении им обязательств по сделкам.
  3. НРД несет ответственность перед Клиентом за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по Договору только в размере причиненного реального ущерба в случае:
  + неправильного определения обязательств по первой и (или) второй части Сделки РЕПО;
  + неправильного расчета Текущей стоимости обязательств;
  + неправильного расчета Обеспеченности обязательств Клиента;
  + неправильного расчета Компенсационного взноса.
  1. Клиент несет ответственность за своевременность оплаты Услуг, предоставляемых НРД по Договору.
  2. Стороны Договора освобождаются от ответственности за неисполнение своих обязательств по Договору, если это неисполнение явилось следствием обстоятельств непреодолимой силы: сбоев, неисправностей и отказов оборудования, контроль над которыми не осуществляют Стороны Договора; сбоев, неисправностей и отказов систем связи, энергоснабжения и других систем жизнеобеспечения, которые Стороны Договора не могли предвидеть или предотвратить, и иных чрезвычайных обстоятельств.
  3. Сторона Договора, для которой стало невозможным исполнение своих обязательств из-за обстоятельств непреодолимой силы обязана сообщить другой Стороне Договора об их возникновении/прекращении.
  4. Если в случае необоснованного промедления другая Сторона Договора понесла убытки, такие убытки подлежат возмещению Стороной Договора, допустившей необоснованное промедление.
  5. Если обстоятельства непреодолимой силы продолжают действовать более 2 (двух) месяцев, любая из Сторон Договора вправе заявить о прекращении действия Договора.

# Конфиденциальность

* 1. Сторона Договора не вправе раскрывать третьим лицам условия Договора и информацию, которой Стороны Договора обмениваются при его заключении и (или) которая стала известна Стороне Договора в процессе исполнения Договора, без предварительного письменного согласия другой Стороны Договора, за исключением случаев, предусмотренных законодательством Российской Федерации, а также обязана предпринимать меры для охраны такой информации.
  2. Клиент соглашается с передачей документов и информации, предоставленных им в НРД в соответствии с Договором, следующим компаниям Группы «Московская Биржа»: ПАО Московская Биржа, НКО АО НКЦ, АО НТБ в объеме, необходимом таким компаниям для принятия и дальнейшего обслуживания Клиента в соответствующей компании Группы «Московская Биржа».
     1. Указанным компаниям Группы «Московская Биржа» передаются документы и информация в отношении Клиентов, которые имеют действующий договор с соответствующей компанией Группы «Московская Биржа», а также документы и информация в отношении выгодоприобретателей указанных Клиентов.
     2. Передачей НРД вышеуказанных документов и информации Клиент подтверждает, что им получены необходимые согласия от лиц, персональные данные которых содержатся в документах, на передачу и обработку персональных данных указанными компаниями Группы «Московская Биржа».
     3. Компании Группы «Московская Биржа» используют полученные от НРД документы и информацию (включая персональные данные), в том числе, в целях выполнения требований законодательства по противодействию легализации (отмыванию) доходов, полученных преступных путем, финансированию терроризма и финансированию распространения оружия массового уничтожения в порядке, установленном целевыми правилами внутреннего контроля компаний Группы «Московская Биржа», а также в целях недопущения нарушения указанного законодательства.
  3. В случае передачи одной Стороной Договора другой Стороне Договора персональных данных при заключении и исполнении Договора передающая Сторона Договора обязана обладать правом на их передачу другой Стороне Договора, а принимающая Сторона Договора обязана обеспечить их конфиденциальность и осуществлять их обработку в соответствии с принципами и условиями, предусмотренными законодательством Российской Федерации. При получении мотивированного запроса Стороны Договора другая Сторона Договора обязана предоставить в течение 3 (трех) рабочих дней со дня его получения письменное подтверждение:
     1. права обработки персональных данных;
     2. права на их передачу другой Стороне Договора (в том числе подтверждение уведомления субъекта об обработке его персональных данных);
     3. обеспечения их конфиденциальности.

# Порядок разрешения споров

* 1. Все противоречия, возникающие при исполнении Договора или связанные с ним, Стороны Договора разрешают с соблюдением претензионного порядка. Сторона Договора, которой заявлена претензия, обязана в течение 5 (пяти) рабочих дней со дня получения ее оригинала предоставить ответ на претензию путем вручения представителю другой Стороны Договора или направления регистрируемого почтового отправления по предоставленному клиентом почтовому адресу/адресу места нахождения другой Стороны Договора, указанному в едином государственном реестре юридических лиц. Непредоставление ответа на претензию в указанный срок рассматривается как отказ в ее удовлетворении.
  2. В случае недостижения согласия между Сторонами Договора все споры, разногласия, претензии и требования, возникающие из Договора или прямо или косвенно связанные с ним, в том числе касающиеся его заключения, существования, изменения, исполнения, нарушения, расторжения, прекращения и действительности, подлежат разрешению в порядке арбитража (третейского разбирательства), администрируемого Арбитражным центром при Российском союзе промышленников и предпринимателей (РСПП) в соответствии с его правилами, действующими на дату подачи искового заявления. Вынесенное третейским судом решение будет окончательным, обязательным для Сторон Договора и не подлежит оспариванию.

# Срок действия Договора и порядок его расторжения

* 1. Договор считается заключенным с даты, указанной в уведомлении о заключении Договора, и действует по 31 декабря года (включительно), в котором заключен Договор. Договор считается продленным на каждый последующий календарный год, если ни одна из Сторон за 1 (один) месяц до истечения каждого календарного года не предоставит другой Стороне письменное уведомление об отказе от продления Договора.
  2. Договор, может быть расторгнут по инициативе любой из Сторон Договора, по соглашению Сторон Договора, а также по иным основаниям, предусмотренным законодательством Российской Федерации.
  3. Каждая из Сторон Договора вправе расторгнуть Договор в одностороннем порядке путем направления другой Стороне Договора соответствующего письменного уведомления. Договор считается расторгнутым через 10 (десять) календарных дней со дня направления/получения НРД такого уведомления. Расторжение Договора не освобождает Стороны Договора от выполнения обязательств, возникших в период его действия.
  4. Действие Договора прекращается в случае прекращения действия:
     1. договора об оказании клиринговых услуг в соответствии с Правилами клиринга НКО АО НРД;
     2. договора оказания НКО АО НРД услуг Информирующего лица.

# Общие принципы взаимодействия

* 1. Документооборот между Клиентом и НРД осуществляется с использованием документов в электронной форме (электронные документы), если иное не предусмотрено договором между НРД и Глобальным кредитором.
  2. Обмен электронными документами производится с использованием СЭД НРД (в том числе WEB-сервиса) и/или SWIFT в порядке, установленном Договором ЭДО.
  3. Если иное не предусмотрено Договором ЭДО, электронные документы, которыми обмениваются Стороны Договора в соответствии с Порядком, относятся в соответствии с Правилами ЭДО Организатора СЭД к следующим категориям:

| **Наименование электронного документа (типа документа)** | **Категория электронного документа** |
| --- | --- |
| Поручения (приложения к поручениям - при необходимости) | Г |
| Отчет об операциях (отчет о неисполнении поручения) | В |
| Уведомление о принятии (непринятии) поручения к исполнению |
| Учетные документы |

* 1. При использовании WEB-сервиса следует руководствоваться Техническими рекомендациями по использованию Web-сервиса (REST) НРД, опубликованными на Сайте.
  2. В случае невозможности использования электронных документов, а также в случаях, предусмотренных договором между НРД и Глобальным кредитором, документооборот между Клиентом и НРД осуществляется с использованием документов на бумажном носителе (документы в бумажной форме).
  3. При взаимодействии Сторон Договора используются:
     1. адреса и реквизиты Клиента, указанные в Анкете АА001;
     2. адреса и реквизиты НРД, указанные на Сайте.
  4. При изменении данных, указанных в Анкете АА001, Клиент обязан предоставить обновленную Анкету АА001 и документы, подтверждающие изменения, в соответствии с Перечнем документов, не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты таких изменений.
  5. НРД уведомляет Клиента об изменении адресов и реквизитов путем размещения информации на Сайте.
  6. Все значения времени в Порядке указываются по московскому времени (UTC (SU) +3).
  7. Подбор ценных бумаг, в том числе для Замены ценных бумаг, проверка Обеспеченности обязательств, расчет размера и структуры Компенсационного взноса осуществляется НРД в соответствии с [Алгоритмами](#_ЧАСТЬ_I._АЛГОРИТМ) (Приложение [1](#_Алгоритмы_Подбора_ценных) к Порядку) с учетом особенностей для каждой Группы сделок, за исключением случаев, установленных Порядком.

# Регистрация корзины РЕПО и дисконтов

* 1. Регистрация Корзины РЕПО заключается в присвоении НРД Корзине РЕПО Идентификатора Корзины РЕПО.
  2. НРД регистрирует Корзину РЕПО и дисконты, а также изменения Корзины РЕПО и дисконтов до 10:30 текущего операционного дня при условии предоставления такой информации до указанного времени.

Если информация об изменении Корзины РЕПО и/или дисконтов поступила в НРД после 10:30 текущего операционного дня, НРД может применять такие изменения в 10:30 следующего операционного дня. Зарегистрированные дисконты применяются при Подборе ценных бумаг, определении Дисконтированной цены ценных бумаг, передаваемых/переданных во исполнение обязательств по Сделкам РЕПО, Замене ценных бумаг.

* 1. Изменение Корзины РЕПО и/или дисконтов допускается не чаще одного раза в день, за исключением предусмотренных Порядком случаев.
  2. Зарегистрированные значения дисконтов действуют до регистрации НРД новых значений дисконтов.
  3. Дисконт устанавливается в отношении каждого отдельного выпуска ценных бумаг, входящего в Корзину РЕПО. В отношении одного выпуска ценных бумаг могут быть установлены различные дисконты в случае включения указанного выпуска в разные Корзины РЕПО.
  4. Дисконт в отношении ценных бумаг может принимать значение от 0% до 100%. Дисконт в 100% означает, что ценные бумаги учитываются в совокупном обеспечении по цене 0 (ноль) рублей.
  5. Информация о зарегистрированных Корзинах РЕПО и дисконтах, включая информацию о требованиях к ценным бумагам, включаемым в Корзины РЕПО, и Идентификаторах/Дополнительных идентификаторах Корзин РЕПО, раскрывается в соответствующем разделе на Сайте или доступна в WEB-кабинете СУО.

# Регистрация Порога переоценки

* 1. Порог переоценки является величиной, определяющей предельное отклонение Обеспеченности обязательств по Сделкам РЕПО, при превышении которой возникает обязательство Стороны по Сделке РЕПО по внесению Компенсационного взноса.
  2. Порог переоценки может быть установлен в виде единого процента от объема обязательств Заемщика либо в виде абсолютного значения в российских рублях.
  3. В случаях, установленных Порядком, возможна регистрация верхнего и нижнего Порогов переоценки.

# Порядок определения Рыночной цены

* 1. При определении Рыночной цены могут использоваться следующие типы цен:
     1. цена типа «B» - цена, рассчитываемая по данным предыдущего торгового дня Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее – ПАО Московская биржа) в соответствии с Порядком определения рыночной цены ценных бумаг, расчетной цены ценных бумаг, а также предельной границы колебаний рыночной цены ценных бумаг в целях 23 главы Налогового кодекса Российской Федерации, утв. Приказом ФСФР России от 09.11.2010 № 10-65/пз-н, а в случае ее отсутствия - цена, рассчитываемая по данным предыдущего торгового дня Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» в соответствии с Порядком определения рыночной цены;
     2. цена типа «M» - средневзвешенная цена от ПАО Московская Биржа по данным предыдущего торгового дня;
     3. цена типа «L» - индикативная цена ценной бумаги, сформированная Саморегулируемой организацией «Национальная фондовая ассоциация» по данным предыдущего рабочего дня (цена MIRP);
     4. цена типа «Q» - цена ценового центра НРД по данным предыдущего календарного дня;
     5. цена типа «R» - цена, использовавшаяся для Подбора ценных бумаг по Сделкам РЕПО с Банком России с использованием СУО НРД в предыдущий рабочий день;
     6. цена типа «C» – цена, рассчитываемая ПАО Московская Биржа для торгов в режимах «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» и «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» по данным предыдущего торгового дня;
     7. типы цен по данным различных информационных источников, определяемых НРД на дату предыдущего календарного дня;
     8. типы цен, переданные Клиентами в Поручении на передачу цен по ценным бумагампо форме [MF18VAL](#_Поручение_на_передачу_1) (далее – Поручение на передачу цен), на дату предыдущего календарного дня.
  2. Рыночная цена определяется на каждый рабочий день по каждой Группе сделок в соответствии с Порядком.
  3. При переоценке ценных бумаг, являющихся Обеспечением по Действующим Сделкам РЕПО, в случае отсутствия ненулевой Рыночной цены текущего дня, для всех Групп сделок используется последняя по времени ненулевая Рыночная цена.
  4. При Подборе и переоценке ценных бумаг, по которым осуществляется частичное погашение суммы основного долга, для расчета Рыночной цены используется рыночная цена, выраженная в процентах от исходной номинальной стоимости, примененная к значению номинальной стоимости, определяемой на текущий торговый день.
  5. Для купонных облигаций ненулевая рассчитанная Рыночная цена увеличивается на сумму НКД. Значение НКД определяется на текущий торговый день.
  6. Информация о Рыночных ценах с учетом НКД, используемых при определении стоимости Обеспечения Сделок РЕПО с Глобальными кредиторами, раскрывается в соответствующем разделе на Сайте.
  7. В случае, когда цена ценной бумаги определена в валюте, отличной от российских рублей (далее по тексту Порядка также «рубль»), цена ценной бумаги пересчитывается в российские рубли по установленному Банком России на день пересчета курсу.

# Порядок расчета Текущей ставки РЕПО и Текущей стоимости обязательства

* 1. Для Сделки РЕПО, заключенной с Плавающей Ставкой РЕПО, Текущая ставка РЕПО равна сумме значений Индикативной ставки, действующей в календарный день, за который начисляются проценты, и значения Спреда по Сделке РЕПО. Для сделки, заключенной с Фиксированной Ставкой РЕПО, Текущая ставка РЕПО равна Ставке РЕПО.
  2. При определении Текущей ставки РЕПО для Сделок РЕПО, заключенных с Плавающей ставкой, допускается использование следующих денежных индикаторов.
     1. Для Сделок РЕПО, заключенных в долларах США:
        + - Средневзвешенная ставка, рассчитанная по итогам аукциона РЕПО Банка России в иностранной валюте на срок 28 дней (CBORDW28);
          - Средневзвешенная ставка, рассчитанная по итогам аукциона РЕПО Банка России в иностранной валюте на срок 1 неделя (CBORDW1W);
          - Иные денежные индикаторы по данным различных информационных источников, перечень которых устанавливает НРД (перечень доступен для клиентов, использующих WEB-кабинет СУО).
     2. Для Сделок РЕПО, заключенных в российских рублях:
        1. Ключевая ставка Банка России (RREFKEYR);
        2. Индикативная взвешенная рублевая депозитная ставка «овернайт» российского межбанковского рынка, рассчитанная Банком России (RUONIA);
        3. Индикатор ставки РЕПО с центральным контрагентом (облигации) с типом расчетов 1 день, рассчитанный в 12:30 в соответствии с методикой ПАО Московская биржа (MXREPOB);
        4. Индикатор ставки РЕПО с центральным контрагентом (облигации) с типом расчетов 1 день, рассчитанный в 19:00 в соответствии с методикой ПАО Московская биржа (MXREPOBE);
        5. При расчете процентов по Сделкам РЕПО, заключенных с Плавающей ставкой РЕПО с использованием денежных индикаторов, указанных в пунктах 13.2.2.1 - 13.2.2.4 применяется значение денежного индикатора, действующего на календарный день, за который начисляются проценты. Действующим является последнее имеющееся опубликованное значение Индикативной ставки.
        6. Индикативная ставка (RUONmDS), определяемая как разница между Индикативной ставкой RUONIA, выраженной в процентах, опубликованной на официальном сайте Банка России в сети Интернет в день, предшествующий дню, за который начисляются проценты[[1]](#footnote-1), и дисконтом DS, выраженным в процентах и рассчитанным по следующей формуле с округлением до двух десятичных знаков:

DS = RREFKEYR \* RBRSOLER / 100, где

RREFKEYR - значение ключевой ставки Банка России, выраженное в процентах;

RBRSOLER - значение норматива обязательных резервов по иным обязательствам кредитных организаций для банков с универсальной лицензией (за исключением долгосрочных) в валюте Российской Федерации, выраженное в процентах.

* + - 1. Индикативная ставка (RUONmDS2), определяемая как разница между Индикативной ставкой RUONIA, выраженной в процентах, опубликованной на официальном сайте Банка России в сети Интернет в день, предшествующий дню, за который начисляются проценты, и дисконтом DS2, выраженным в процентах и рассчитанным по следующей формуле:

DS2 = DS + FDS, где

DS – дисконт, выраженный в процентах и рассчитанный по указанной выше формуле с округлением до двух десятичных знаков;

FDS – фиксированный дисконт, выраженный в процентах, указанный в Решении о проведении отбора Заявок, публикуемом на сайте Федерального казначейства, и округленный до двух десятичных знаков;

* + - 1. Индикативная ставка (RREFKmDS), определяемая как разница между Индикативной ставкой RREFKEYR, выраженной в процентах, действующей в календарный день, за который начисляются проценты, и опубликованной на официальном сайте Банка России в сети Интернет, и дисконтом DS, выраженным в процентах и рассчитанным по следующей формуле с округлением до двух десятичных знаков:

DS = RREFKEYR \* RBRSOLER / 100

При расчете дисконта DS используются значения RREFKEYR и RBRSOLER, действующие на календарный день, за который начисляются проценты, и опубликованные на официальном сайте Банка России в сети Интернет.

* + - 1. Иные денежные индикаторы по данным различных информационных источников, перечень которых устанавливает НРД (перечень доступен для клиентов, использующих WEB-кабинет СУО).
  1. НРД осуществляет расчет Текущей ставки РЕПО ежедневно по операционным дням:
     1. в 10:30 – по Сделкам РЕПО, заключенным с фиксированной ставкой, а также по Сделкам РЕПО, заключенным с Плавающей Ставкой РЕПО с использованием Индикативных ставок RUONmDS, RREFKmDS и RREFKEYR;
     2. перед закрытием операционного дня – по Сделкам РЕПО, заключенным с Плавающей Ставкой РЕПО, за исключением Сделок РЕПО, заключенных с использованием Индикативных ставок, указанных в пункте 13.3.1 Порядка.
  2. Текущая стоимость обязательства рассчитывается как сумма денежных средств по первой части Сделки РЕПО, увеличенная на сумму начисленных по Текущей ставке РЕПО процентов за каждый из дней, предшествующих дате расчета Текущей стоимости обязательств, начиная с Даты первой части Сделки РЕПО до даты расчета данного параметра, уменьшенная либо увеличенная на сумму уплаченных денежных Компенсационных взносов и сумму процентов, рассчитанных исходя из суммы каждого Компенсационного взноса за период с даты уплаты Компенсационного взноса до даты расчета.
     1. Расчет Текущей стоимости обязательства осуществляется по формуле:

LRiр + ∑ (LRi \* ri / N / 100), где:

LRiр – Сумма РЕПО по i-ой Сделке РЕПО на дату расчета;

LRi – Сумма РЕПО по i-ой Сделке РЕПО определяемая на каждую календарную дату за период расчета;

N – Количество дней в году, на который попадает день, за который начисляются проценты, в соответствии с применяемым методом расчета процентов;

ri – Текущая ставка РЕПО по i-ой Сделке РЕПО, в % годовых.

∑ – суммирование по числу дней за период расчета, за которые начисляются проценты, в соответствии с применяемым методом расчета процентов.

* + 1. Выбор метода расчета процентов для различных Групп сделок, осуществляется в соответствии с Порядком.
    2. Значение начисленных процентов за каждый календарный день периода расчета рассчитывается без округления суммы, а значение итоговой суммы всех начисленных процентов округляется с точностью до двух десятичных знаков.
    3. В Дату первой части Сделки РЕПО Текущая стоимость обязательств равна Сумме РЕПО.

# Определение обязательств Клиентов по первой части Сделки РЕПО

* 1. НРД осуществляет регистрацию Сделок РЕПО и определяет обязательства по первым частям Сделок РЕПО при выполнении следующих условий:
     1. в Общем реестре Сделок РЕПО либо в поручениях по форме [MF194](https://www.nsd.ru/ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов) указан Идентификатор Корзины РЕПО, с которой заключается Сделка РЕПО, или Локальная корзина Сделки РЕПО;
     2. Клиентами успешно пройдена регистрация в соответствии с Правилами клиринга.
  2. По результатам определения обязательств по первой части Сделки РЕПО Клиентам направляется Отчет о регистрации/изменении и прекращении обязательств по сделке (Отчет о регистрации обязательств) по форме [MS018](#_Отчет_о_регистрации/изменении_1) (Приложение [3](#_Отчет_о_регистрации/изменении) к Порядку), при этом:
     1. в качестве даты исполнения обязательств указывается Дата первой части Сделки РЕПО;
     2. в качестве обязательства Заемщика указываются обязательства по поставке ценных бумаг для обеспечения, в качестве обязательства Кредитора – обязательства по перечислению денежной суммы по первой части Сделки РЕПО с указанием валюты;
     3. в поле «Дополнительная сумма» электронного документа указывается предполагаемая Стоимость обратного выкупа по Сделке РЕПО (в печатной форме не отражается). В случае регистрации Сделки РЕПО с открытой датой Стоимость обратного выкупа указывается на дату текущего операционного дня.

# Подбор ценных бумаг для исполнения обязательств Клиентов по первой части Сделки РЕПО

* 1. Подбор ценных бумаг для исполнения первой части Сделки РЕПО осуществляется в Дату первой части Сделки РЕПО в следующем порядке:
     1. в случае выбора типа расчетов DVP-1 – непосредственно после регистрации Сделки РЕПО, но не ранее 11:00 текущего операционного дня, а при отсутствии или недостаточности ценных бумаг, подлежащих передаче по первой части Сделки РЕПО – периодически в течение операционного дня до окончания последнего клирингового сеанса. При этом последний сеанс определяется в соответствии с расписанием и особенностями осуществления клиринговых сеансов, установленными Приложением 2 к Правилам клиринга;
     2. в случае выбора типа расчетов DVP-3 – однократно непосредственно перед каждым клиринговым сеансом с учетом условий Подбора ценных бумаг по каждой Группе сделок.
  2. Заемщик определяет ценные бумаги из состава Корзины РЕПО, которые могут быть использованы для исполнения обязательства по Сделкам РЕПО в каждой Группе сделок, в том числе для исполнения обязательств по первой части Сделки РЕПО. Маркирование ценных бумаг осуществляется путем подачи Заемщиком в НРД Поручения на маркирование ценных бумаг для Подбора обеспечения по форме [MF18М](#_Поручение_на_Маркирование_1) (Приложение [3](#_Поручение_на_изменение) к Порядку) (далее – [Поручение на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1)).
  3. Осуществление Клиентом Маркирования разделов счетов депо и/или ценных бумаги, находящихся на разделах счетов депо, означает, что Клиент поручил НРД осуществлять в соответствии с Порядком списание промаркированных ценных бумаг и/или ценных бумаг, находящихся на промаркированных разделах счетов депо, без дополнительных инструкций Клиента, в том числе на основании полученного от НКЦ [Поручения на подборценных бумаг для обслуживания клиринговой деятельности НКЦ](#_Поручение_на_Подбор_1).
  4. При регистрации каждого последующего [Поручения на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1) информация из предыдущего [Поручения на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1) аннулируется в отношении Групп сделок, указанных в новом [Поручении на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1). Информация в отношении Групп сделок, не указанных в новом [Поручении на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1), не изменяется.
  5. Допустимо Маркирование как разделов счетов депо, так и конкретных ценных бумаг на разделах счетов депо. При Маркировании ценных бумаг на разделах счетов депо допустимо указание максимального количества ценных бумаг для Подбора. При указании максимального количества ценных бумаг для Подбора в строке Маркирования, в которой указано несколько Групп сделок, данное максимальное количество целиком соотносится с каждой из данных Групп сделок и ограничивает Подбор по каждой из них в указанном количестве.
  6. После регистрации [Поручения на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1) Клиентам направляется Отчет о Маркировании ценных бумаг для Подбора обеспечения по форме [MS18M](#_Отчет_о_маркировании) (Приложение [3](#_Образцы_поручений_и)).
  7. Подбор ценных бумаг осуществляется НРД только с промаркированных счетов Заемщика, тип счета которых совпадает с типом торгового счета Заемщика, используемого для расчетов по данной Сделке РЕПО.
  8. Подбор ценных бумаг производится по каждой Группе сделок в соответствии с Алгоритмами с учетом особенностей Подбора для каждой Группы.
  9. При отсутствии ценных бумаг, определенных Заемщиком в соответствии с пунктом 15.2 Порядка, НРД не осуществляет Подбор ценных бумаг.
  10. Подбор ценных бумаг производится на полную сумму Сделки РЕПО, либо на часть, если возможность частичного исполнения первой части Сделки РЕПО предусмотрена Генеральным соглашением с Глобальным кредитором.
  11. Результатом Подбора ценных бумаг является перевод, в случае необходимости, и блокировка НРД подобранных ценных бумаг на разделе торгового счета депо Заемщика, который используется для расчетов по данной Сделке РЕПО, до момента проведения расчетов. Информация о ценных бумагах, заблокированных в результате Подбора ценных бумаг, отражается в отчете НРД по форме [MS101](https://www.nsd.ru/documents/depo/) (Приложение 2 к Условиям).
  12. В случае перевода на один торговый счет депо ценных бумаг, подобранных в качестве обеспечения обязательств по Сделкам РЕПО различных Групп сделок, возможно исполнение обязательств по первой части Сделки РЕПО за счет ценных бумаг, подобранных со счетов, промаркированных для Подбора в Сделки РЕПО другой Группы сделок.
  13. В случае исключения первой части Сделки РЕПО из расчетов Подбор ценных бумаг отменяется. Переведенные на торговый счет депо в результате выполнения Подбора ценные бумаги НРД возвращает на исходные разделы счета депо Заемщика. Информация о возвращенных ценных бумагах отражается в отчете НРД по форме [MS101](https://www.nsd.ru/documents/depo/) (Приложение 2 к Условиям). Перед следующей попыткой выполнения расчетов по первой части Сделки РЕПО Подбор ценных бумаг выполняется заново.

# Регистрация изменений параметров и прекращения учета обязательств по Сделке РЕПО

* 1. Регистрация изменений параметров Сделок РЕПО (далее – регистрация изменений) или прекращения учета обязательств по Сделкам РЕПО производится НРД:
     1. на основании поручений Клиентов;
     2. на основании служебных поручений НРД;
     3. в случае исполнения (частичного исполнения) обязательств в ходе клиринга.
  2. Регистрация изменений и прекращение учета обязательств по Сделкам РЕПО по поручениям Клиентов производится на основании:
     1. поручения на изменение и прекращение обязательства Кредитора или Заемщика по форме [MF018](#_Поручение_на_изменение_1) (Приложение 3 к Порядку) с кодом операции 18/54 (далее – [Одностороннее поручение](#_Поручение_на_изменение_1)) при одностороннем изменении условий Сделки РЕПО в случаях, предусмотренных Порядком.
     2. встречных поручений на изменение и прекращение обязательства Кредитора и Заемщика по форме [MF018](#_Поручение_на_изменение_1) на операции с кодами 18/4 (для Заемщика) и 18/5 (для Кредитора) (далее - [Встречные поручения](#_Поручение_на_изменение_1)).

Порядок заполнения указанных поручений приведен в Приложении 3 к Порядку.

* 1. Прекращение учета обязательств по Сделке РЕПО на основании [Одностороннего поручения](#_Поручение_на_изменение_1) Кредитора допускается в случаях, установленных Порядком. НРД не регламентирует основания подачи Стороной по Сделке РЕПО [Одностороннего поручения](#_Поручение_на_изменение_1). Ответственность за соблюдение законодательства Российской Федерации и условий заключенного с другой Стороной соглашения при подаче [Одностороннего поручения](#_Поручение_на_изменение_1) возлагается на Сторону по Сделке РЕПО, подавшую указанное поручение.
  2. По результатам сверки [Встречных поручений](#_Поручение_на_изменение) Клиентам направляется отчет по форме [GS116](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов).
  3. По результатам исполнения любого из перечисленных в пункте 16.2 Порядка поручений Клиентам направляется [Отчет о регистрации обязательств](#_Отчет_о_регистрации/изменении) с информацией об изменении обязательства или о прекращении обязательства с указанием признака прекращения учета обязательств.
  4. В случае прекращения НРД учета обязательств по Сделке РЕПО на основании поручений, перечисленных в пункте 16.2, Клиентам направляется Отчет об обязательствах по прекращенной Сделке РЕПО по форме [MS318 (Приложение [3](#_Отчет_об_обязательствах) к](#_Отчет_об_обязательствах_1) Порядку).
  5. Регистрация изменений обязательства по Сделке РЕПО на основании служебного поручения НРД осуществляется в следующих случаях:
     1. уплаты Заемщиком Компенсационных взносов в виде денежных средств;
     2. передачи Компенсационных взносов в виде ценных бумаг;
     3. замены Ценных бумаг, переданных Кредитору, которые участвуют в корпоративном действии, предусмотренном Правилами КД;
     4. замены ценных бумаг, исключенных Кредитором из Корзины РЕПО или при наложении Кредитором дополнительных ограничений по отношению к Заемщику;
     5. Переноса даты второй части Сделки РЕПО.
  6. По результатам исполнения служебного поручения, указанного в пунктах 16.7.2 - 16.7.4 Порядка, НРД формирует служебные поручения депо. Об исполнении служебных поручений депо Клиентам направляется отчет по форме [MS101](https://www.nsd.ru/documents/depo/) (Приложение 2 к Условиям).
  7. Регистрация прекращения учета обязательств по Сделке РЕПО на основании служебного поручения НРД осуществляется в случае:
     1. неисполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО и невозможности Переноса даты второй части Сделки РЕПО, при этом Клиентам, использующим WEB-кабинет СУО, также направляется уведомление о прекращении учета обязательства по Сделке РЕПО;
     2. невозможности замены в Обеспечении Сделки РЕПО ценных бумаг, по которым НРД получено уведомление о проведении выкупа ценных бумаг публичного общества в соответствии со статьей 84.8 Федерального закона от 26 декабря 1995 г. № 208-ФЗ «Об акционерных обществах»;
     3. получения [Уведомления о Дефолте](#_УВЕДОМЛЕНИЕ_О_ДЕФОЛТЕ_1) от Стороны по Сделке междилерского РЕПО;
     4. в иных случаях, в установленных Правилами клиринга.
  8. По результатам исполнения служебного поручения Клиентам направляется [Отчет об обязательствах по прекращенной Сделке РЕПО](#_Отчет_об_обязательствах_1). Дальнейшее урегулирование обязательств по Сделке Стороны осуществляют самостоятельно.

# Переоценка обязательств и Обеспечения

* 1. Переоценка обязательств заключается в определении Текущей стоимости обязательств по всем Действующим Сделкам РЕПО.
  2. НРД проводит переоценку обязательств и Обеспечения Клиентов:
     1. при определении и регистрации обязательств и их изменении;
     2. каждый операционный день в 10:30:
     3. после последнего клирингового сеанса текущего дня.
  3. Переоценка Обеспечения заключается в определении Дисконтированной стоимости каждой ценной бумаги, являющейся Обеспечением по Действующим Сделкам РЕПО, и в последующем суммировании Дисконтированных стоимостей ценных бумаг по всем Действующим Сделкам РЕПО при маржировании пула либо по каждой Действующей Сделке РЕПО при посделочном маржировании.
  4. При переоценке ценных бумаг, являющихся Обеспечением по Действующим Сделкам РЕПО, в случае отсутствия ненулевой Рыночной цены текущего дня, рассчитанной в соответствии с Порядком, используется последняя по времени ненулевая Рыночная цена.
  5. В период с начала операционного дня до проведения процедуры переоценки обязательств в 10:30 в СУО НРД для целей определения стоимости Обеспечения применяются Рыночные цены предыдущего дня.

# Проверка Обеспеченности обязательств

* 1. Процедура проверки Обеспеченности обязательств осуществляется НРД в отношении совокупности обязательств и Обеспечения Клиентов по всем Действующим Сделкам РЕПО:
     1. в 10:30 каждого операционного дня (на основании переоценки обязательств);
     2. после каждого клирингового сеанса (на основании переоценки обязательств);
     3. при расчете Компенсационных взносов;
     4. при проведении Замены ценных бумаг;
     5. перед закрытием операционного дня.
  2. Процедура проведения проверки Обеспеченности обязательств осуществляется путем сравнения Текущей стоимости обязательств Заемщика с Дисконтированной стоимостью ценных бумаг, являющихся Обеспечением.
  3. При каждой проверке Обеспеченности обязательств, кроме проверки в ходе операции Замены ценных бумаг и в ходе последнего клирингового сеанса, Клиентам направляется [Отчет о составе обязательств и их обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1) (далее - Отчет об Обеспеченности) по форме [MS118](#_Отчет_о_составе_1) (Приложение [3](#_Отчет_о_составе) к Порядку), включающий в себя информацию обо всех обязательствах Клиентов по Сделкам РЕПО и информацию об обязанности по внесению Компенсационного взноса.
  4. Перед закрытием операционного дня НРД осуществляет итоговую проверку Обеспеченности Сделок РЕПО и направляет Сторонам по Сделке итоговый [Отчет об обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1) c указанием степени Обеспеченности Сделок РЕПО.

# Внесение Компенсационного взноса

* 1. Обязанность по внесению Компенсационного взноса исполняется сразу по окончании процедуры проверки Обеспеченности обязательств или включается в клиринговый пул ближайшего клирингового сеанса. Сторона по Сделке РЕПО, имеющая обязанность по внесению Компенсационного взноса, должна обеспечить его исполнение не позднее момента начала последнего клирингового сеанса текущего дня.
  2. В предусмотренных Порядком случаях допускается возможность исполнения Компенсационного взноса денежными средствами.
  3. При регистрации изменений обязательств по Сделке РЕПО Текущая стоимость обязательства изменяется на сумму исполненного денежными средствами Компенсационного взноса, а Стоимость обратного выкупа уменьшается либо увеличивается на сумму исполненного денежными средствами Компенсационного взноса и сумму процентов, рассчитанных исходя из суммы такого Компенсационного взноса по Ставке РЕПО за оставшийся период.
  4. В случае неисполнения обязательства по внесению Компенсационного взноса Клиентам, использующим WEB-кабинет СУО, направляются соответствующие уведомления:
     1. Клиенту, допустившему неисполнение обязательства по внесению Компенсационного взноса по Сделке РЕПО, - уведомление о необходимости уплаты неисполненного Компенсационного взноса;
     2. Клиенту, в отношении которого допущено неисполнение обязательства по внесению Компенсационного взноса, - уведомление о неисполненном Компенсационном взносе по Сделке РЕПО либо по необеспеченному пулу Сделок.

# Правила Замены ценных бумаг

* 1. Замена ценных бумаг может осуществляться в отношении ценных бумаг, являющихся Обеспечением как по одной Сделке РЕПО, так и по нескольким Сделкам РЕПО.
  2. Для Замены ценных бумаг Клиент подает Поручение на замену по форме [MF018](#_Отчет_о_регистрации/изменении_1) с кодами операций 18/Z ([Замена ценных бумаг с Подбором](#_Поручение_на_изменение_1)) и/или 18/Y (Замена ценных бумаг без Подбора) (далее – [Поручение на замену](#_Поручение_на_изменение_1)).
  3. Замена ценных бумаг, являющихся Обеспечением по Сделкам РЕПО одной Группы, с одновременным переводом их в Обеспечение по Сделкам РЕПО другой Группы осуществляется только с использованием [Поручения на замену без Подбора](#_Поручение_на_изменение_1).
  4. Замена ценных бумаг производится при соблюдении нижеперечисленных условий.
     1. Условия Замены ценных бумаг определены Клиентами в Генеральном соглашении с Глобальным кредитором или предусмотрены в Порядке с учетом особенностей для каждой Группы сделок.
     2. Заменяющими ценными бумагами могут быть только ценные бумаги, входящие в Корзину РЕПО, определенную для данной Сделки РЕПО, за исключением предусмотренных Порядком случаев.
     3. Заменяющими ценными бумагами могут быть только ценные бумаги, промаркированные Заемщиком как доступные для данной Группы, за исключением замены ценных бумаг по [Поручению на замену без Подбора](#_Поручение_на_изменение_1), при которой Заменяющими ценными бумагами могут быть непромаркированные, но разрешенные для Маркирования ценные бумаги.
     4. В [Поручении на замену](#_Поручение_на_изменение) без Подбора Заменяющими ценными бумагами могут быть только ценные бумаги, не входящие в число выпусков ценных бумаг, исключаемых из списка доступных для Подбора выпусков ценных бумаг в соответствии с Порядком.
     5. Замена ценных бумаг осуществляется в порядке, при котором перевод ценных бумаг по счетам депо производится после проверки достаточности количества Заменяющих ценных бумаг, то есть на условиях «поставка против поставки».
  5. Замена ценных бумаг производится НРД:
     1. по поручению Заемщика;
     2. по служебному поручению НРД в интересах Кредитора в случаях, установленных Порядком.
  6. Подбор Заменяющих ценных бумаг осуществляется в порядке, установленном [Алгоритмами](#_АЛГОРИТМ_подборА_ценных), за исключением случаев, когда [Поручение на Замену](#_Поручение_на_изменение_1) содержит указание на конкретные Заменяющие ценные бумаги.
  7. По результатам проведения Замены ценных бумаг НРД направляет Клиентам [Отчет о регистрации обязательств](#_Отчет_о_регистрации/изменении). По результатам исполнения служебных поручений НРД на Замену ценных бумаг Клиентам направляются стандартные отчеты об исполнении поручения по форме [MS101](https://www.nsd.ru/ru/documents/depo/) (Приложение 2 к Условиям).

# Определение и исполнение обязательств Клиентов по второй части Сделки РЕПО

* 1. Определение обязательств Клиентов по второй части Сделки РЕПО осуществляется НРД после исполнения Клиентами обязательств по первой части Сделки РЕПО.
  2. При частичном исполнении обязательства по первой части Сделки РЕПО в нескольких клиринговых сеансах (в случаях, предусмотренных Порядком), обязательство по второй части Сделки РЕПО определяется после каждого клирингового сеанса с учетом размера частичного исполнения обязательства по первой части Сделки РЕПО.
  3. По итогам определения обязательств по второй части Сделки РЕПО Клиентам направляется [Отчет о регистрации обязательств](#_Отчет_о_регистрации/изменении_1).
  4. Стороны вправе изменить тип расчетов по второй части Сделки РЕПО с DVP-3 на DVP-1 путем подачи [Встречных поручений](#_Поручение_на_изменение_1). Изменение возможно осуществить следующими способами:
     1. если изменение необходимо произвести в Дату второй части Сделки РЕПО, Стороны подают [Встречные поручения](#_Поручение_на_изменение_1) только на изменение типа расчетов. При этом если по результатам однократных расчетов DVP-1 обязательства по второй части Сделки РЕПО остаются неисполненными, тип расчетов снова меняется на DVP-3 и обязательства по второй части Сделки РЕПО включаются в клиринговый пул ближайшего клирингового сеанса.
     2. если изменение необходимо произвести до ранее установленной Даты второй части Сделки РЕПО, Стороны подают:
        + либо последовательно две пары [Встречных поручений](#_Поручение_на_изменение) (сначала на изменение Даты второй части на текущую дату, затем на изменение типа расчетов). При этом если по результатам однократных расчетов DVP-1 обязательства по второй части Сделки РЕПО остаются неисполненными, Дата второй части остается измененной на текущую, тип расчетов снова меняется на DVP-3 и обязательства по второй части Сделки РЕПО включаются в клиринговый пул ближайшего клирингового сеанса;
        + либо одну пару [Встречных поручений](#_Поручение_на_изменение) на изменение обоих параметров (Даты второй части и типа расчетов). При этом если по результатам однократных расчетов DVP-1 обязательства по второй части Сделки РЕПО остаются неисполненными, изменения считаются незарегистрированными. Клиентам направляется отчет о неисполнении поручения по форме [GS001](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) ([Перечень клиринговых документов](https://www.nsd.ru/documents/clearing/)).
  5. В случае неисполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО и невозможности Переноса Даты второй части Сделки РЕПО, Клиентам, использующим WEB-кабинет СУО, дополнительно направляется уведомление о прекращении учета обязательства по Сделке РЕПО.
  6. Подбор ценных бумаг для исполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО осуществляется только после проведения процедуры переоценки и расчета Текущей стоимости обязательства в 10:30.

# Порядок действий при регистрации Сделок РЕПО в Репозитарии

* 1. Информация о Сделках РЕПО, заключенных не на организованных торгах в Российской Федерации, в отношении которых клиентам оказываются Услуги, подлежит внесению в реестр договоров Репозитария.
  2. НРД оказывает услуги по передаче сведений, подлежащих внесению в реестр договоров (далее – Услуги Информирующего лица), при регистрации Сделок РЕПО, заключенных не на организованных торгах в Российской Федерации, при условии заключения хотя бы одной из Сторон по Сделке РЕПО договора об оказании репозитарных услуг.
  3. По сделкам, заключенным на основании Генерального соглашения, заключённого не с Глобальным кредитором, Клиенты самостоятельно производят регистрацию Генерального соглашения в установленном документами Репозитария порядке.
  4. После регистрации Сделок РЕПО в СУО НРД оказывает по ним Услуги Информирующего лица в порядке и объеме, предусмотренных действующим законодательством Российской Федерации, нормативными актами Банка России и Правилами оказания репозитарных услуг НКО АО НРД в соответствии с Порядком оказания НКО АО НРД услуг Информирующего лица .
  5. НРД, выполняя обязанности в соответствии с Порядком, взаимодействует с Репозитарием один раз в день, передавая в Репозитарий информацию по Сделкам РЕПО по состоянию на конец предыдущего рабочего дня.

# Порядок действий при проведении корпоративных действий с выпусками ценных бумаг, переданных Кредитору

* 1. Информирование Клиентов о корпоративных действиях с ценными бумагами, осуществляется НРД в порядке, установленном Порядком взаимодействия Депозитария и Депонентов при реализации Условий осуществления депозитарной деятельности Небанковской кредитной организацией акционерным обществом «Национальный расчетный депозитарий».
  2. В случае если в период оказания Услуг будут производиться корпоративные действия с Ценными бумагами, переданными Кредитору (за исключением Ценных бумаг, переданных Кредитору по Сделкам междилерского РЕПО, заключенных с использованием Реюза), и такие корпоративные действия приведут к изменению остатков по счетам депо Клиентов, НРД предпринимает предусмотренные Порядком меры по отражению результатов данных корпоративных действий на зарегистрированных в НРД обязательствах Клиентов и Обеспечении, а также меры по соблюдению договорных условий Обеспеченности обязательств. Перевод ценных бумаг по торговым счетам депо и/или денежных средств по торговым банковским счетам Клиентов, открытым в НРД, осуществляется НРД без дополнительных инструкций Клиентов в соответствии с полномочиями, предоставленными НРД в соответствии с законодательством Российской Федерации и соответствующими договорами с Клиентами, в том числе договорами счета депо и договорами банковского счета.

## ЧАСТЬ II. ОСОБЕННОСТИ ОКАЗАНИЯ УСЛУГ ПО УПРАВЛЕНИЮ ОБЕСПЕЧЕНИЕМ ПО СДЕЛКАМ РЕПО С ГЛОБАЛЬНЫМ КРЕДИТОРОМ

# Регистрация Типового генерального соглашения

* 1. Регистрация условий Типового генерального соглашения.
     1. Необходимым условием оказания Клиенту Услуг по Сделкам РЕПО с Глобальным кредитором является регистрация условий Типового генерального соглашения, которая осуществляется НРД в соответствии с текстом Типового генерального соглашения, предоставленного Глобальным кредитором.
     2. Условия Типового генерального соглашения должны быть зарегистрированы (или принято решение об отказе в регистрации) в срок, не превышающий 3 (трех) рабочих дней с даты получения от Глобального кредитора текста Типового генерального соглашения.
     3. НРД отказывает в регистрации условий Типового генерального соглашения при отсутствии технической возможности оказания Услуг в порядке, предусмотренном Типовым генеральным соглашением.
     4. В случае принятия положительного решения о возможности регистрации условий Типового генерального соглашения, НРД осуществляет регистрацию условий Типового генерального соглашения, присваивает условиям Типового генерального соглашения индивидуальный 4-хзначный код и при необходимости информирует об этом Глобального кредитора.
     5. При использовании нескольких Групп сделок в рамках одного Типового генерального соглашения НРД присваивает индивидуальный 4-хзначный код для каждой Группы сделок. Объединение Сделок РЕПО с Глобальными кредиторами в различные Группы Сделок в рамках одного Генерального соглашения осуществляется НРД по указанию Глобального кредитора.
     6. В случае отказа в регистрации условий Типового генерального соглашения НРД незамедлительно информирует об этом Глобального кредитора с указанием причин отказа.
  2. Регистрация изменений условий Типового генерального соглашения.
     1. В случае внесения изменений в платежные реквизиты Глобального кредитора, реквизиты для перечисления денежных средств и реквизиты для исполнения обязательств по передаче ценных бумаг, указанные в Типовом генеральном соглашении и предназначенные для исполнения обязательств вне клиринга и СУО НРД, Глобальный кредитор направляет в НРД изменения в Типовое генеральное соглашение (c проставлением признака внесения изменений в документ), а также указывает индивидуальный 4-хзначный код зарегистрированных условий Типового генерального соглашения и дату вступления в силу соответствующих изменений условий Типового генерального соглашения.
     2. Платежные реквизиты Клиентов, а также реквизиты для перечисления денежных средств и исполнения обязательств по передаче ценных бумаг, предназначенные для исполнения обязательств по результатам клиринга и СУО НРД, регистрируются и изменяются в порядке, определенном Правилами клиринга.
     3. Изменения в условия Типового генерального соглашения должны быть зарегистрированы (или принято решение об отказе в их регистрации) в течение 3 (трех) рабочих дней с даты получения документов и информации, указанных в пункте 24.2.1 Порядка.
     4. В случае принятия положительного решения, НРД осуществляет регистрацию изменений условий Типового генерального соглашения (ранее присвоенный индивидуальный 4-хзначный код при этом не меняется) и информирует об этом Глобального кредитора.
     5. В случае отказа в регистрации изменений условий Типового генерального соглашения, НРД незамедлительно информирует об этом Глобального кредитора с указанием причин отказа.
     6. Регистрация изменений условий Типового генерального соглашения возможна не чаще 1 раза в течение 3 (трех) рабочих дней после регистрации действующих условий Типового генерального соглашения, если иное не предусмотрено решением НРД.
     7. В случае внесения в зарегистрированные условия Типового генерального соглашения иных изменений, помимо предусмотренных пунктом 24.2.1 Порядка, Глобальный кредитор направляет в НРД новую редакцию Типового генерального соглашения, а также указывает индивидуальный 4-хзначный код зарегистрированных условий Типового генерального соглашения и дату вступления в силу новой редакции Типового генерального соглашения. Новая редакция Типового генерального соглашения регистрируется как новые условия Типового генерального соглашения в порядке, предусмотренном пунктом 24.1 Порядка.

# Регистрация Корзины РЕПО, дисконтов, присвоение Дополнительных идентификаторов Корзины РЕПО

* 1. Регистрация первой Корзины РЕПО Глобального кредитора осуществляется НРД одновременно с регистрацией условий Типового генерального соглашения. Регистрацию последующих Корзин РЕПО и (или) присвоение Дополнительных идентификаторов Корзины РЕПО НРД вправе осуществлять по письменному запросу Глобального кредитора.
  2. *Особенности регистрации Корзины РЕПО Банка России.*
     1. Идентификатор Корзины РЕПО GCOLLATERAL.
     2. Корзина РЕПО формируется как перечень выпусков ценных бумаг. Исходный перечень ценных бумаг и все дальнейшие его изменения передаются НРД Банком России в порядке, установленном Договором об информационном взаимодействии при оказании Услуг.
     3. При регистрации или изменении Корзины РЕПО НРД одновременно определяет требования и осуществляет регистрацию или изменение состава следующих Дополнительных идентификаторов Корзины РЕПО Банка России:
        + GCBONDS - только облигации российских эмитентов, входящие в Корзину РЕПО;
        + GCSHARES - только акции российских эмитентов, входящие в Корзину РЕПО;
        + GCFOREIGN - только еврооблигации российских эмитентов и облигации иностранных эмитентов, входящие в Корзину РЕПО;
        + GCNOSHARES - все ценные бумаги, входящие в Корзину РЕПО, кроме акций российских эмитентов;
        + GCUSD - ценные бумаги, входящие в Корзину РЕПО, используемые для Подбора обеспечения Сделок РЕПО, обязательства по которым выражены в иностранной валюте, сроком не более 90 дней;
        + GCUSDLONG - ценные бумаги, входящие в Корзину РЕПО, используемые для Подбора обеспечения Сделок РЕПО, обязательства по которым выражены в иностранной валюте, сроком более 90 дней;
        + GCFORUSD - только еврооблигации российских эмитентов и облигации иностранных эмитентов, используемые для Подбора обеспечения Сделок РЕПО, обязательства по которым выражены в иностранной валюте, сроком не более 90 дней;
        + GCFORUSDLONG - только еврооблигации российских эмитентов и облигации иностранных эмитентов, используемые для Подбора обеспечения Сделок РЕПО, обязательства по которым выражены в иностранной валюте, сроком более 90 дней;
        + GCRUBLONG и GCRUBFLOAT - ценные бумаги, включаемые в Корзину РЕПО, определяются Банком России и используются для Подбора обеспечения в Сделки РЕПО, обязательства по которым выражены в российских рублях, в зависимости от срока Сделки РЕПО.

Информация о сроках Сделок РЕПО, для Подбора обеспечения которых используются ценные бумаги, соответствующие каждому из указанных Дополнительных идентификаторов, размещается на Сайте на основании информации, полученной НРД от Банка России, не позднее операционного дня, предшествующего дате проведения первого аукциона Банка России или торгов с фиксированной ставкой с применением таких Дополнительных идентификаторов.

При получении Общего реестра сделок с указанием Идентификатора Корзины РЕПО GCOLLATERAL указанный Идентификатор изменяется на Дополнительный идентификатор (GCRUBLONG или GCRUBFLOAT) в соответствии с полученной от Банка России информацией.

* + 1. При заключении Сделок РЕПО, обязательства по которым выражены в иностранной валюте, в Общем реестре сделок РЕПО допускается указание Идентификатора корзины РЕПО GCOLLATERAL либо Дополнительного идентификатора GCFOREIGN, указание иных Дополнительных идентификаторов Корзины РЕПО не допускается.
    2. После получения Общего реестра сделок РЕПО НРД, в зависимости от срока сделок, обязательства по которым выражены в иностранной валюте, изменяет указанный в Сделках РЕПО идентификатор Корзины РЕПО на соответствующий Дополнительный идентификатор Корзины РЕПО, используемый для Подбора ценных бумаг - обеспечения Сделок РЕПО, обязательства по которым выражены в иностранной валюте.
  1. *Особенности регистрации Корзин РЕПО Федерального казначейства.*
     1. Идентификаторы Корзин РЕПО:
* [GCFEDBONDS](https://www.nsd.ru/ru/db/lists/basket_repo_br/#data), GCUSDBONDS - для Подбора ценных бумаг в Группах сделок KZN1 и EKS1;
* GCMBS - для Подбора ценных бумаг в Группах сделок MBS1 и MBS2.
  + 1. Корзины РЕПО формируются как перечни выпусков ценных бумаг. Исходные перечни ценных бумаг и все дальнейшие их изменения передаются НРД Казначейством в порядке, установленном Договором о взаимодействии при проведении Федеральным казначейством операций РЕПО.
    2. В Корзинах РЕПО, указанных в пункте 25.3.1 Порядка, в отношении одного выпуска облигаций могут быть установлены различные дисконты.
    3. НРД при Подборе ценных бумаг использует Корзину РЕПО, указанную в Общем реестре Сделок РЕПО с Федеральным казначейством.
    4. Перечень выпусков ценных бумаг, удовлетворяющих требованиям Корзины РЕПО и подлежащим включению в нее, ежедневно автоматически определяется НРД.
  1. *Особенности регистрации Корзин РЕПО Комитета финансов Санкт-Петербурга и Комитета финансов Ленинградской области.*
     1. Идентификаторы Корзин РЕПО:

- GCSPBBONDS – для Группы сделок с Комитетом финансов Санкт-Петербурга;

- LENOBBONDS – для Группы сделок с Комитетом финансов Ленинградской области.

* + 1. Корзины РЕПО формируются как перечень выпусков ценных бумаг. Исходный перечень ценных бумаг и все дальнейшие его изменения передаются в НРД в порядке, установленном соответствующим договором между НРД и Государственным кредитором.
    2. Право установления дисконтов принадлежит Глобальному кредитору. Регистрация дисконтов осуществляется на основании специального сообщения в соответствии с форматом, определенным договором взаимодействия с Глобальным кредитором.

# Установление Порога переоценки

* 1. В Группах сделок РЕПО с Глобальным кредитором Порог переоценки применяется к совокупности обязательств Заемщика по всем действующим Сделкам РЕПО данной Группы. Порог переоценки равен установленному Глобальным кредитором значению уровня переоценки в отношении не обеспеченных ценными бумагами обязательств Заемщика.
  2. Глобальный кредитор передает НРД сведения об установленном Пороге переоценки способом, предусмотренным договором или контрактом между Глобальным кредитором и НРД.
  3. Для определения Порога переоценки, выраженного в процентах, применяется единое текущее значение процента от совокупного объема обязательств Заемщика, размер которого установлен Глобальным кредитором. Информация об установленном Глобальным кредитором размере Порога переоценки, выраженного в процентах, раскрывается в соответствующем разделе на Сайте.
  4. В Группе сделок с Банком России Порог переоценки может быть установлен в отношении Заемщика в виде абсолютного значения в рублях. В этом случае информация о текущем Пороге переоценки указывается в [Отчете об обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1).
  5. В случае одновременного установления Порога переоценки, выраженного в процентах, и абсолютного значения Порога переоценки в отношении Заемщика при переоценке Действующих Сделок РЕПО применяется меньшее из двух вышеуказанных значений Порога переоценки.

# Регистрация дополнительных ограничений Банка России в отношении Заемщика

* 1. Банк России вправе устанавливать дополнительные ограничения в отношении Заемщика. Установленные Банком России дополнительные ограничения в отношении Заемщика подлежат регистрации в НРД. Регистрация дополнительных ограничений осуществляется аналогично порядку, установленному пунктом 10.2 Порядка.
  2. Дополнительные ограничения в отношении Заемщика действуют до момента регистрации НРД новых дополнительных ограничений в отношении Заемщика либо до момента отмены указанных ограничений Банком России.
  3. Банком России в отношении Заемщика могут быть установлены дополнительные ограничения на совершение Сделок РЕПО с отдельными выпусками ценных бумаг, входящих в Корзину РЕПО Банка России.
  4. Ценные бумаги, по которым Банком России в отношении Заемщика наложены дополнительные ограничения на совершение Сделок РЕПО с Банком России, не могут быть также использованы в качестве Компенсационного взноса и в качестве Заменяющих ценных бумаг по Сделкам РЕПО данной Группы.

# Особенности определения Рыночной цены

* 1. *Определение Рыночной цены текущего дня для Группы сделок РЕПО с Банком России.*
     1. Банк России вправе передать НРД информацию о приоритетах типов цен ценных бумаг, при этом для определения Рыночной цены могут быть использованы следующие типы цен ценных бумаг:
        + - цена типа «B»;
          - цена типа «M»;
          - цена типа «L»;
          - цена типа «Q»;
          - цена типа «R».
     2. В случае отсутствия Рыночной цены, определяемой согласно указанной Банком России последовательности, Рыночная цена ценных бумаг, подбираемых в качестве Обеспечения, принимается равной 0 (нулю), за исключением установленных Порядком случаев.
     3. В случае отсутствия информации от Банка России о приоритете типов цен ценных бумаг Рыночная цена в СУО определяется согласно следующей последовательности:
        + цена типа «C»;
        + цена типа «B»;
        + цена типа «L».
     4. В случае отсутствия цены типа «L» Рыночная цена ценных бумаг, подбираемых в качестве Обеспечения, принимается равной 0 (нулю), за исключением установленных Порядком случаев.
     5. При Подборе облигаций, выпущенных от имени Российской Федерации, и облигаций Банка России в качестве Обеспечения в случае отсутствия в предшествующий операционный день Рыночной цены, используется последняя по времени ненулевая Рыночная цена.
  2. *Определение Рыночной цены текущего дня для Групп сделок РЕПО с Федеральным казначейством.*
     1. При Подборе в качестве Обеспечения облигаций, выпущенных от имени Российской Федерации и облигаций Банка России Рыночная цена в СУО определяется согласно следующей последовательности:
        + цена типа «B»;
        + цена типа «L».

В случае отсутствия цены типа «L» используется последняя по времени ненулевая Рыночная цена.

* + 1. При Подборе в качестве Обеспечения облигаций внешнего облигационного займа Российской Федерации Рыночная цена в СУО определяется в следующей последовательности:
    - цена типа «Q»;
    - цена типа «B»;
    - цена типа «L».

В случае отсутствия цены типа «L» используется последняя по времени ненулевая Рыночная цена.

* + 1. При Подборе в качестве Обеспечения облигаций с ипотечным покрытием, обеспеченных поручительством АО «ДОМ.РФ» Рыночная цена в СУО определяется в следующей последовательности:
    - цена типа «B»;
    - цена типа «Q».

В случае отсутствия цены типа «Q» используется последняя по времени ненулевая Рыночная цена.

* 1. *Для Групп сделок РЕПО с другими Государственными кредиторами:*
     1. Рыночная цена в СУО определяется согласно следующей последовательности:
        + цена типа «B»;
        + цена типа «L».
     2. В случае отсутствия цены типа «L» Рыночная цена ценных бумаг, подбираемых в качестве Обеспечения, принимается равной 0 (нулю).

# Особенности расчета Текущей стоимости обязательства и Стоимости обратного выкупа

* 1. При расчете Текущей стоимости обязательства и Стоимости обратного выкупа используется метод расчета процентов, при котором начисление процентов осуществляется за каждый календарный дней периода расчета, включая начальную дату периода расчета и исключая последнюю дату.
  2. Фактическое число календарных дней в году принимается равным 365 или 366.
  3. При расчете Текущей стоимости обязательства и Стоимости обратного выкупа используется Текущая ставка РЕПО, действующая на каждый календарный день, за который начисляются проценты.

# Особенности Маркирования и Подбора ценных бумаг для исполнения первой части Сделки РЕПО

* 1. НРД производит регистрацию Сделок РЕПО в СУО на основании Общих реестров Сделок РЕПО по каждому Глобальному кредитору, полученных от Уполномоченного лица, при этом отправителям направляются отчеты о приеме Общих реестров Сделок РЕПО. Регистрация Сделок РЕПО в СУО и последующий Подбор ценных бумаг для исполнения обязательств по первой части Сделок РЕПО производится последовательно в соответствии с порядком их расположения в Общем реестре Сделок РЕПО.
  2. В [Отчете о регистрации обязательств](#_Отчет_о_регистрации/изменении_1), направляемом Клиентам по результатам определения обязательств по первой части Сделки РЕПО, в поле «Дополнительная информация» указывается номер торгового казначейского счета Банка России, на котором будут учитываться переданные по первым частям Сделок РЕПО облигации Банка России.
  3. Подбор ценных бумаг происходит в соответствии с Приложением [1](#_Алгоритмы_Подбора_ценных) к Порядку с учетом следующих условий.
     1. При указании в Общем реестре Сделок РЕПО с Банком России Дополнительного идентификатора Корзины РЕПО Банка России НРД при Подборе ценных бумаг для исполнения обязательств по конкретной Сделке РЕПО использует только ценные бумаги из перечня, соответствующего указанному Дополнительному идентификатору Корзины РЕПО Банка России, в том числе и при распределении Компенсационного взноса между Сделками РЕПО.
     2. При указании в [Поручении на регистрацию](#_Поручение_на_регистрацию_2) дополнительных параметров управления Обеспечением Сделок РЕПО (далее – Поручение на регистрацию параметров) по форме [MF18P](#_Поручение_на_регистрацию) (Приложение [3](#_Поручение_на_регистрацию) к Порядку) признака «Считать указанную в сделке корзину переменной» НРД при Подборе ценных бумаг для исполнения обязательств по конкретной Сделке РЕПО с Банком России, внесения Компенсационного взноса либо Замены ценных бумаг использует в первую очередь ценные бумаги из перечня, соответствующего Дополнительному идентификатору Корзины РЕПО Банка России, указанному в Общем реестре Сделок РЕПО, а затем ценные бумаги, входящие в Корзину РЕПО Банка России.
     3. В случае указания в Общем реестре Сделок РЕПО с Банком России Дополнительных идентификаторов GCFOREIGN, GCRUBLONG или GCRUBFLOAT, НРД при Подборе ценных бумаг для исполнения обязательств по конкретной Сделке РЕПО, использует ценные бумаги только из указанного перечня, независимо от указания признака «Считать указанную в сделке корзину переменной» в [Поручении на регистрацию параметров](#_Поручение_на_регистрацию_2).
     4. В случае указания в Общем реестре Сделок РЕПО с Банком России ISIN одной ценной бумаги, НРД при Подборе ценных бумаг для исполнения обязательств по конкретной Сделке РЕПО подбирает указанную бумагу в первую очередь, а дальнейший Подбор ценных бумаг осуществляет из Корзины РЕПО (GCOLLATERAL).
     5. В Группе сделок РЕПО с Банком России при наличии установленного для ценной бумаги Минимального лота, Подбор ценных бумаг такого выпуска осуществляется с учетом Минимального лота. Количество ценных бумаг, входящих в Минимальный лот, рассчитывается как денежное выражение Минимального лота, деленное на номинальную стоимость ценной бумаги.
  4. Подбор ценных бумаг для исполнения обязательств по Сделкам РЕПО с типом расчетов DVP-3 проводится в рамках клиринговых сеансов, осуществляемых с использованием Торговых банковских счетов, открытых в НРД, и корреспондентских счетов, открытых в Банке России.
  5. Если к началу последнего клирингового сеанса обязательства Заемщика по первой части Сделки РЕПО с типом расчетов DVP-1, заключенной с Банком России, не были исполнены либо были исполнены частично, НРД самостоятельно осуществляет смену типа расчетов с DVP-1 на DVP-3 без дополнительных инструкций Клиента. При этом Клиентам направляется [Отчет о регистрации обязательств](#_Отчет_о_регистрации/изменении) с изменением типа расчетов по первой части Сделки РЕПО с указанием объема обязательств и суммы частичного исполнения.
  6. Разрешены для Маркирования и участвуют в Подборе ценных бумаг только разделы счетов депо следующих типов:
* на счетах депо владельца (S):
  + Основной (00);
  + Основной (дополнительный) (73);
  + Раздел длительного хранения (IN);
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги в собственности депонента»:
* Клиринговая организация НРД (TS):
  + Основной (00);
  + Основной (дополнительный) (73);
* Клиринговая организация НКЦ (HS):
  + Блокировано для клиринга в НКЦ (31);

- Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36).

* 1. Определение обязательств (установление параметров обязательств на основании заключенной сделки) Клиентов по первой части Сделки РЕПО осуществляется на основании полученных Общих реестров Сделок РЕПО, являющихся двухсторонними поручениями (клиринговыми поручениями) Клиентов на осуществление клиринга и расчетов по заключенным Сделкам РЕПО.
  2. Ценные бумаги, переданные по первым частям Сделок РЕПО, учитываются и блокируются на разделе «Для расчетов по сделкам РЕПО» торгового счета депо Глобального кредитора, открытого в НРД. Облигации Банка России, переданные по первым частям Сделок РЕПО с Банком России, учитываются и блокируются на разделе «Для расчетов по сделкам РЕПО» на торговом казначейском счете депо Банка России, открытом в НРД.
  3. Использование Реюза в Сделках РЕПО с Глобальным кредитором не предусмотрено.

# Особенности исполнения обязательств по первой части Сделки РЕПО

* 1. В Группе сделок РЕПО с Банком России.
     1. В соответствии с Генеральным соглашением с Банком России обязательства Заемщика по первой части Сделки РЕПО могут быть исполнены частично в порядке, установленном Порядком.
     2. Если в Дату исполнения первой части Сделки РЕПО на счете депо Заемщика недостаточно промаркированных Заемщиком и соответствующих Идентификатору Корзины РЕПО/ Дополнительному идентификатору Корзины РЕПО ценных бумаг, первая часть Сделки РЕПО исполняется частично в объеме Дисконтированной стоимости ценных бумаг, подобранных НРД в соответствии с Алгоритмами. Частичное исполнение первой части Сделки РЕПО возможно, если на счете депо Заемщика учитывается хотя бы 1 (одна) промаркированная ценная бумага, соответствующая Идентификатору Корзины РЕПО/Дополнительному идентификатору Корзины РЕПО. Оставшаяся часть неисполненного Заемщиком обязательства по первой части Сделки РЕПО исполняется в ходе следующих клиринговых сеансов, проводимых в Дату первой части Сделки РЕПО.
     3. В случае совершения Заемщиком в течение Даты исполнения первой части Сделки РЕПО действий, в результате которых на его счете депо появляются промаркированные ценные бумаги, соответствующие Идентификатору Корзины РЕПО/Дополнительному идентификатору Корзины РЕПО, НРД автоматически осуществляет Подбор ценных бумаг перед каждым последующим клиринговым сеансом. Оставшаяся часть неисполненного обязательства Заемщика по первой части Сделки РЕПО исполняется в ходе следующих клиринговых сеансов, проводимых в Дату первой части Сделки РЕПО.
     4. На момент завершения последнего клирингового сеанса в Дату первой части Сделки РЕПО обязательство Заемщика по первой части Сделки РЕПО считается исполненным на сумму, эквивалентную объему подобранных ценных бумаг в течение дня.
  2. НРД осуществляет расчеты, связанные с исполнением обязательств Заемщика по первым частям Сделок РЕПО с Федеральным казначейством c типом расчетов DVP-3, только при условии исполнения Заемщиком обязательств по вторым частям Сделок РЕПО во всех Группах Сделок РЕПО с Федеральным казначейством, дата которых приходится на текущий операционный день.
  3. В случае неисполнения Заемщиком обязательств по первой части Сделки РЕПО, НРД направляет Клиентам отчет, содержащий информацию о неисполненных обязательствах по форме [MS007](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов).
  4. Частичное исполнение первой части Сделок РЕПО в Группах сделок с Государственными кредиторами не предусмотрено.

# Особенности исполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО

* 1. В случае неперечисления Заемщиком денежных средств по второй части Сделки РЕПО с Банком России или с Комитетом финансов Ленинградской области в Дату второй части Сделки РЕПО НРД осуществляет Перенос даты второй части Сделки РЕПО при соблюдении условий, установленных Порядком.
  2. При Переносе даты второй части Сделки РЕПО, обязательства по которой выражены в российских рублях, в период между датой неперечисления Заемщиком денежных средств по второй части Сделки РЕПО до Даты второй части Сделки РЕПО, измененной в результате Переноса даты второй части Сделки РЕПО, используется фиксированная ставка, установленная Банком России на дату осуществления Переноса даты второй части Сделки РЕПО для проведения операции РЕПО по фиксированной ставке.
  3. При Переносе даты второй части Сделки РЕПО, обязательства по которой выражены в иностранной валюте, в период между датой неперечисления Заемщиком денежных средств по второй части Сделки РЕПО до Даты второй части Сделки РЕПО, измененной в результате Переноса даты второй части Сделки РЕПО, используется удвоенная Ставка РЕПО, установленная на дату заключения Сделки РЕПО.
  4. В Группах сделок РЕПО с Федеральным казначейством и Комитетом финансов Санкт-Петербурга Перенос даты второй части Сделки РЕПО не допускается.
  5. Ценные бумаги, являющиеся Обеспечением по Сделке РЕПО, по которой прекращено исполнение, и заблокированные на разделе «Для расчетов по сделкам РЕПО» торгового счета депо Глобального кредитора, разблокируются и переводятся служебным поручением НРД без дополнительных инструкций Клиента на основной раздел счета депо владельца Глобального кредитора или на раздел «Выкуплено» казначейского счета депо Глобального кредитора. Клиентам направляется [Отчет об обязательствах по прекращенной Сделке РЕПО](#_Отчет_об_обязательствах_1). Дальнейшее урегулирование обязательств по Сделке РЕПО Стороны осуществляют самостоятельно.
  6. После урегулирования обязательств по прекращенной Сделке РЕПО Глобальный кредитор направляет в НРД [Одностороннее поручение](#_Поручение_на_изменение_1) с указанием даты исполнения обязательств по данной Сделке РЕПО.

# Особенности изменения параметров Сделки РЕПО, переоценки обязательств, проверки Обеспеченности обязательств и внесения Компенсационного взноса

* 1. В Сделках РЕПО с Глобальным кредитором изменение в одностороннем порядке Даты второй части сделки РЕПО на более раннюю (но не ранее текущего операционного дня) допускается только на основании [Одностороннего поручения](#_Поручение_на_изменение) Глобального кредитора.  НРД не регламентирует основания подачи Глобальным кредитором такого поручения. Ответственность за соблюдение законодательства Российской Федерации и условий заключенного с Заемщиком соглашения при одностороннем изменении Даты второй части сделки РЕПО возлагается на Глобального кредитора.
  2. В Группе Сделок РЕПО с Комитетом финансов Ленинградской области Глобальный кредитор вправе направить [Одностороннее поручение](#_Поручение_на_изменение_1) для изменения Ставки РЕПО по Сделке РЕПО.
     1. При поступлении указанного поручения НРД осуществляет перерасчет Текущей стоимости обязательств Заемщика и Стоимости обратного выкупа с учетом новой Ставки РЕПО за период Сделки РЕПО с Даты первой части Сделки РЕПО до даты предоставления Глобальным кредитором Одностороннего поручения. По итогам перерасчета Клиентам направляется Отчет о регистрации обязательств, а также [Отчет о составе обязательств и их обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1).
     2. НРД не регламентирует основания подачи Глобальным кредитором [Одностороннего поручения](#_Поручение_на_изменение_1) для изменения Ставки РЕПО. Ответственность за соблюдение условий заключенного с Заемщиком Генерального соглашения при подаче указанного [Одностороннего поручения](#_Поручение_на_изменение_1) возлагается на Глобального кредитора.
  3. Переоценку обязательств, расчет и внесение Компенсационных взносов между Глобальным кредитором и Заемщиком НРД осуществляет по Группе сделок в совокупности (маржирование пула).
  4. В Группе сделок РЕПО с Банком России и Группе сделок РЕПО с Комитетом финансов Ленинградской области предусмотрена возможность уплаты Заемщиком Компенсационного взноса денежными средствами. Уплата Компенсационного взноса денежными средствами Глобальным кредитором не предусмотрена.

В Группах сделок РЕПО с Федеральным казначейством и Комитетом финансов Санкт-Петербурга уплата Компенсационного взноса денежными средствами любой из Сторон по Сделке не допускается.

* 1. НРД осуществляет взимание Компенсационного взноса с Глобального кредитора в пользу Заемщика только при условии исполнения Заемщиком обязательств по вторым частям Сделок РЕПО, заключенных с данным Глобальным кредитором, дата которых приходится на текущий операционный день.
  2. Если по окончании последнего клирингового сеанса, обязательства по второй части хотя бы одной Сделки РЕПО, заключенной между Заемщиком и Глобальным кредитором, остались неисполненными, НРД приостанавливает взимание Компенсационных взносов с данного Глобального кредитора в пользу Заемщика до получения от Глобального кредитора информации об урегулировании обязательств по Сделке РЕПО вне СУО НРД.
  3. В Группах сделок РЕПО с Глобальным кредитором Обязательства Заемщика признаются необеспеченными, если по окончании операционного дня Пул обязательств по Сделкам РЕПО Заемщика остался необеспеченным.
  4. В случае, если Обязательства Заемщика признаны необеспеченными, то Глобальный кредитор может в одностороннем порядке:
     1. изменить Дату второй части Сделки РЕПО на более раннюю;
     2. прекратить исполнение одной или нескольких Сделок РЕПО с Заемщиком.

При этом Глобальный кредитор направляет в НРД [Одностороннее поручение](#_Поручение_на_изменение).

* 1. По Сделкам РЕПО с Государственными кредиторами НРД после процедуры переоценки, по итогам клиринговых сеансов, а также в конце операционного дня направляет Государственному кредитору [Отчет о Заемщиках, обязательства которых не обеспечены](#_Отчет_о_Заемщиках,_1), по форме [NFX35 (Приложение [3](#_Образцы_поручений_и) к Порядку).](#_Отчет_о_Заемщиках,_1)
  2. При наличии у Заемщика действующих Сделок РЕПО, заключенных с Плавающей ставкой, НРД в последний рабочий день недели либо в предпраздничный день в соответствии с Приложением [4](#_Расписание_действий_по_1) к Порядку направляет такому Заемщику [Отчет об Обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1) за каждый предстоящий нерабочий (выходной или праздничный) день с указанием обновленных значений Текущей стоимости обязательств в рублях и в валюте Сделки, Текущей ставки РЕПО и Стоимости обратного выкупа по каждой Сделке РЕПО. Иная информация, содержащаяся в [Отчете об Обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1), предоставляемом за предстоящий нерабочий день, не обновляется.

# Особенности Замены ценных бумаг

* 1. Замена ценных бумаг по служебному поручению НРД или по [Поручению на замену с Подбором](#_Поручение_на_изменение_1) допустима при условии, что стоимость Обеспечения после Замены ценных бумаг будет не ниже стоимости Пула обязательств Заемщика.
  2. Для Сделок РЕПО с Государственными кредиторами Замена ценных бумаг по [Поручению на замену без Подбора](#_Поручение_на_изменение_1) допустима, если верно одно из следующих условий:
     1. при обеспеченности или переобеспеченности Пула обязательств стоимость Обеспечения после Замены ценных бумаг должна быть не ниже стоимости Пула обязательств Заемщика;
     2. при необеспеченности Пула обязательств совокупная дисконтированная стоимость Заменяемых ценных бумаг должна быть меньше совокупной дисконтированной стоимости Заменяющих ценных бумаг.
  3. Для Сделок РЕПО с Банком России Замена ценных бумаг по [Поручению на замену без Подбора](#_Поручение_на_изменение_1) не допускается.
  4. При Замене ценных бумаг в Сделках РЕПО с Банком России при наличии установленного для Заменяющей и/или Заменяемой ценной бумаги Минимального лота, операция допустима, если количество таких ценных бумаг, находящихся в Обеспечении Сделки РЕПО, в результате Замены не становится меньше Минимального лота.
  5. НРД производит Замену ценных бумаг по служебному поручению НРД в интересах Глобального кредитора в следующих случаях:
     1. при получении НРД уведомления о проведении выкупа ценных бумаг публичного общества в соответствии со статьей 84.8 Федерального закона «Об акционерных обществах», в период с даты получения указанного уведомления, до даты, отстоящей от даты фиксации на 2 рабочих дня. Проверка наличия в Обеспечении действующих Сделок РЕПО подлежащих выкупу ценных бумаг осуществляется каждый рабочий день в течение указанного периода; в случае невозможности замены таких ценных бумаг НРД за 2 рабочих дня до даты фиксации прекращает учет обязательств по Сделке РЕПО;
     2. для Сделок РЕПО с Банком России:
        + в дату фиксации состава участников запланированных корпоративных действий с Ценными бумагами, переданными Кредитору (включая составление списков лиц, осуществляющих права по ценным бумагам, осуществление выплат по ценным бумагам), либо в рабочий день, предшествующий такой дате, если согласно решению о выпуске ценной бумаги и/или действующему законодательству фиксация производится по состоянию на начало операционного дня.

Информация о корпоративных действиях, в даты фиксации которых НРД осуществляет замену ценных бумаг, переданных в Обеспечение по Сделкам РЕПО с Банком России, раскрывается на Сайте в разделе «Состав корзин и цены по сделкам РЕПО Глобальных кредиторов» - «Рыночные цены, НКД и корпоративные действия ценных бумаг для сделок с Банком России».

В случае отсутствия в вышеуказанном разделе информации о типе и дате текущего/планового корпоративного действия по ценным бумагам Замена их в Обеспечении Сделок РЕПО с Банком России в даты фиксации таких корпоративных действий не осуществляется.

* + - * + при исключении Ценной бумаги, переданной Кредитору, из Корзины РЕПО или установлении для нее 100% дисконта;
        + при наложении Кредитором дополнительных ограничений в отношении Заемщика, если такие ограничения касаются Ценных бумаг, переданных Кредитору;
    1. для Сделок РЕПО с Федеральным казначейством:
       - * при изменении даты фиксации состава участников запланированных корпоративных действий с Ценными бумагами, переданными Кредитору, за исключением выплаты купонного дохода, если новая дата фиксации приходится на период с даты первой части сделки до даты, предшествующей дате исполнения второй части сделки, либо до даты исполнения второй части сделки, если согласно решению о выпуске ценной бумаги и/или действующему законодательству фиксация состава участников указанных корпоративных действий производится по состоянию на начало операционного дня;
    2. для Сделок РЕПО с Комитетом финансов Санкт-Петербурга и Комитетом финансов Ленинградской области:
       - * при изменении даты фиксации состава участников запланированных корпоративных действий с Ценными бумагами, переданными Кредитору, если новая дата фиксации приходится на период с Даты первой части сделки до даты, предшествующей дате исполнения второй части сделки, либо до даты исполнения второй части сделки, если согласно решению о выпуске ценной бумаги и/или действующему законодательству фиксация состава участников указанных корпоративных действий производится по состоянию на начало операционного дня.
    3. НРД производит Замену ценных бумаг по служебному поручению НРД в случае, когда Заемщик в Сделке с Глобальным кредитором является Кредитором по Сделке междилерского РЕПО и Заменяемые ценные бумаги должны быть переведены для исполнения обязательств по второй части Сделки междилерского РЕПО, либо для исполнения [Поручения на замену](#_Поручение_на_изменение), поданного Заемщиком по Сделке междилерского РЕПО, либо для внесения компенсационного взноса Кредитором по Сделке междилерского РЕПО. Возможность осуществления такой замены определяется Кредитором по Сделке междилерского РЕПО в [Поручении на автозамену ценных бумаг в Сделках РЕПО с Глобальными кредиторами](#_Поручение_на_регистрацию_3)  (далее – [Поручение на автозамену](#_Отчет_об_автозамене)) по форме [MF18C](#_Поручение_на_регистрацию_3) (Приложение [4](#_Toc8652621) к Порядку).

# Порядок действий при проведении корпоративных действий с выпусками ценных бумаг, переданных по Сделкам РЕПО

* 1. НРД предпринимает действия по Замене ценных бумаг в дату фиксации состава участников запланированных корпоративных действий с Ценными бумагами, переданными Кредитору (включая составление списков лиц, осуществляющих права по ценным бумагам, осуществление выплат по ценным бумагам), либо в рабочий день, предшествующий такой дате, если согласно решению о выпуске ценной бумаги и/или действующему законодательству фиксация производится по состоянию на начало операционного дня, в случае, когда:
     1. по корпоративному действию заранее известна такая дата;
     2. ценная бумага исключается из Подбора в такую дату в соответствии с пунктом 5.1 Алгоритмов;
     3. в результате действий по Замене ценных бумаг обязательства Заемщика останутся обеспеченными.
  2. При получении Банком России денежных средств в российских рублях, или долларах США, или евро, или в фунтах стерлингов, или в швейцарских франках в качестве выплат по Ценным бумагам, переданным Кредитору, НРД осуществляет функции по передаче Заемщикам доходов путем перевода соответствующих сумм с торгового банковского счета Банка России, определенного Банком России в порядке, установленном Условиями, в качестве счета для получения выплат по Ценным бумагам, переданным Кредитору (далее – Счет Банка России для получения выплат) на банковские счета Заемщиков.
  3. При получении Федеральным казначейством денежных средств в валюте Российской Федерации, или долларах США, или евро в качестве выплат по Ценным бумагам, переданным Кредитору, НРД осуществляет функции по передаче Заемщикам доходов путем перевода соответствующих сумм с Торгового банковского счета Федерального казначейства, определенного Федеральным казначейством в порядке, установленном Условиями, в качестве счета для получения выплат по Ценным бумагам, переданным Кредитору (далее – Счет Федерального казначейства для получения выплат), на банковские счета Заемщиков.
  4. НРД осуществляет перевод денежных средств, указанных в пунктах 35.2 и 35.3 Порядка:
     1. при поступлении денежных средств в российских рублях - не позднее окончания следующего рабочего дня со дня поступления соответствующих денежных сумм на Счет Банка России или Федерального казначейства для получения выплат – в отношении ценных бумаг, по которым НРД осуществляет обязательное централизованное хранение/централизованный учет и выплату доходов или с эмитентом которых НРД заключен договор о выполнении функций платежного агента;
     2. при поступлении денежных средств в иностранной валюте - не позднее окончания четвертого рабочего дня, следующего за днем поступления соответствующих денежных сумм на Счет Банка России или Федерального казначейства для получения выплат – в отношении ценных бумаг, по которым НРД осуществляет обязательное централизованное хранение/ централизованный учет и выплату доходов, или с эмитентом которых НРД заключен договор о выполнении функций платежного агента, при этом при перечислении выплат на банковский счет, открытый не в НРД, под рабочим днем понимается день, в который открыта для расчетов платежная система НРД и который является одновременно рабочим днем в стране - эмитенте валюты платежа, в которой находятся банки-корреспонденты НРД;
     3. при поступлении денежных средств в российских рублях или иностранной валюте - не позднее 5 (пяти) рабочих дней со дня поступления соответствующих денежных сумм от эмитентов или платежных агентов (не НРД) на Счет Банка России или Федерального казначейства для получения выплат – в отношении иных ценных бумаг.
  5. При передаче доходов, выплаченных Банку России либо Федеральному казначейству в российских рублях в качестве выплаты по Ценным бумагам, переданным Кредитору, НРД осуществляет перевод соответствующих денежных сумм на торговые банковские счета Заемщиков, открытые в НРД, либо на корреспондентские счета Заемщиков, открытые в Банке России.
  6. При передаче доходов, выплаченных Банку России либо Федеральному казначейству в иностранной валюте в качестве выплаты по Ценным бумагам, переданным Кредитору, НРД осуществляет выбор счета Заемщика в соответствующей валюте для зачисления денежных средств в следующем порядке:
     1. торговый банковский счет, зарегистрированный Заемщиком в качестве банковских реквизитов для расчетов по клирингу НРД в отношении раздела торгового счета депо/торгового счета депо Заемщика, с которого осуществлялось списание ценных бумаг, являющихся Обеспечением по Сделке РЕПО;
     2. банковский счет, зарегистрированный Заемщиком в качестве банковских реквизитов для перечисления доходов по ценным бумагам в отношении раздела торгового счета депо/торгового счета депо Заемщика, с которого осуществлялось списание ценных бумаг, являющихся Обеспечением по Сделке РЕПО.
  7. По итогам перечисления указанных средств НРД направляет Банку России и Федеральному казначейству [Отчет о компенсации доходов Кредитора](#_Отчет_о_компенсации_1) по форме [NFX36](#_Отчет_о_компенсации_1) (Приложение [3](#_Образцы_поручений_и) к Порядку).
  8. Особенности возврата выплат по Ценным бумагам, переданным Кредитору, по Сделкам РЕПО с Банком России.
     1. В случае отсутствия в НРД банковских реквизитов, зарегистрированных в соответствии с пунктом 35.6 Порядка, денежные средства, полученные Банком России в качестве выплат по Ценным бумагам, переданным Кредитору, не перечисляются Заемщикам, и Банк России самостоятельно осуществляет возврат выплат Заемщику.
     2. При получении Банком России денежных средств в иностранной валюте, не указанной в пунктах 35.2 Порядка, в качестве выплаты по Ценным бумагам, переданным Кредитору, Банк России самостоятельно перечисляет полученные денежные средства Заемщику в порядке, определенном Генеральным соглашением.
     3. При невыполнении Заемщиком до момента начала последнего клирингового сеанса текущего рабочего дня условий Обеспеченности обязательств, указанные в пункте 35.2 Порядка денежные средства, перечисляемые на торговый банковский счет или корреспондентский счет Заемщика, используются для уплаты Компенсационного взноса.
     4. НРД приостанавливает перечисление Заемщику денежных средств, полученных в качестве выплат по Ценным бумагам, переданным Кредитору, если по окончании последнего клирингового сеанса текущего дня хотя бы по одной из Сделок РЕПО, заключенной между Заемщиком и Банком России, не исполнены обязательства по второй части Сделки РЕПО и невозможно осуществить Перенос даты второй части сделки РЕПО в соответствии с Порядком. Указанные денежные средства переводятся на счета Банка России.
  9. Особенности возврата выплат по Ценным бумагам, переданным Кредитору, по Сделкам РЕПО с Федеральным казначейством.
     1. В случае отсутствия в НРД банковских реквизитов, зарегистрированных в соответствии с пунктом 35.6 Порядка, НРД перечисляет денежные средства, полученные Федеральным казначейством в качестве выплат по Ценным бумагам, переданным Кредитору, только после предоставления Заемщиком соответствующих реквизитов.
     2. НРД без дополнительных инструкций Федерального казначейства перечисляет Заемщикам денежные средства в сумме выплат по Ценным бумагам, переданным Кредитору, до конца операционного дня при одновременном соблюдении следующих условий:
        + Пул обязательств Заемщика в соответствии с Порядком признается обеспеченным;
        + у Заемщика отсутствуют неисполненные обязательства по вторым частям Сделок РЕПО, Дата второй части которых совпадает с датой перечисления денежных средств.
     3. НРД приостанавливает перечисление Заемщику денежных средств, полученных в качестве выплат по Ценным бумагам, переданным Кредитору, если по окончании последнего клирингового сеанса хотя бы по одной из Сделок РЕПО, заключенной между Заемщиком и Федеральным казначейством, не исполнены обязательства по второй части Сделки РЕПО. Указанные денежные средства остаются на Счете Федерального казначейства для получения выплат и распределяются Федеральным казначейством самостоятельно.
  10. После получения от Банка России или Федерального казначейства информации об урегулировании обязательств по Сделке РЕПО вне СУО НРД, в случае отсутствия других сделок РЕПО, заключенных между Заемщиком и соответствующим Глобальным кредитором, по которым не были исполнены обязательства по второй части сделки РЕПО и невозможно было осуществить Перенос даты второй части сделки РЕПО в соответствии с Порядком, возобновляет возврат выплат Заемщику в соответствующей Группе сделок.

## ЧАСТЬ III. ОСОБЕННОСТИ ОКАЗАНИЯ УСЛУГ ПО УПРАВЛЕНИЮ ОБЕСПЕЧЕНИЕМ ПО СДЕЛКАМ МЕЖДИЛЕРСКОГО РЕПО

# Особенности регистрации Генерального соглашения

* 1. НРД не осуществляет регистрацию в СУО условий Генерального соглашения об общих условиях совершения Кредитором и Заемщиком Сделок РЕПО не на организованных торгах в Российской Федерации, на основании которого заключаются Сделки междилерского РЕПО.
  2. При оказании Услуг НРД не проверяет соответствие предоставленных Сторонами по Сделке РЕПО в НРД сведений о Сделке РЕПО содержанию заключенного Генерального соглашения (договора РЕПО), а также допустимость использования, согласно условиям такой Сделки, предоставляемого в соответствии с Порядком инструментария, в том числе, но не ограничиваясь, Замены ценных бумаг, исполнения Компенсационных взносов, Переноса даты второй части сделки РЕПО и пр. Обязанность по соблюдению условий Сделки РЕПО при использовании СУО НРД возлагается на Стороны по Сделке РЕПО.

# Особенности регистрации Корзины РЕПО и дисконтов

* 1. Регистрация Корзины РЕПО осуществляется на основании поданного Клиентом в НРД [Поручения на регистрацию Корзин РЕПО](#_Поручение_на_регистрацию_4) по форме [MF18B](#_Отчет_о_регистрации_4) (Приложение 4 к Порядку).
  2. Изменять состав зарегистрированной Корзины РЕПО может только зарегистрировавший ее Клиент при условии отсутствия Действующих сделок РЕПО, заключенных с данной Корзиной РЕПО.
  3. Изменение состава Корзины РЕПО, зарегистрированной в НРД, возможно только путем подачи в НРД [Поручения на регистрацию Корзин РЕПО](#_Поручение_на_регистрацию_4).
  4. НРД аннулирует регистрацию Корзины РЕПО в следующих случаях:
     1. с момента регистрации в НРД данная Корзина РЕПО ни разу не использовалась в Сделках РЕПО в течение 1000 (тысячи) календарных дней;
     2. с момента закрытия последней Сделки РЕПО с данной Корзиной РЕПО прошло 1000 (тысяча) календарных дней.

При этом Клиентам направляется [Отчет о регистрации Корзины РЕПО](#_Отчет_о_регистрации_4) по форме [MS18B](#_Отчет_о_регистрации_4) (Приложение 3 к Порядку).

* 1. Регистрация дисконтов осуществляется одновременно с регистрацией Корзины РЕПО. При отсутствии дисконта в Корзине РЕПО, дисконт принимается равным 0%.
  2. Стороны по Сделке вправе указать в поручениях по форме [MF194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов) Локальную корзину Сделки РЕПО без предварительной регистрации Корзины РЕПО на основании [Поручения на регистрацию корзин РЕПО](#_Поручение_на_регистрацию_4).
  3. Изменение Локальной корзины Действующей Сделки РЕПО, а также дисконтов и типов цен для определения Рыночной цены ценных бумаг и/или приоритетов их использования (в случае их указания в поручениях по форме [MF194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/)) (Перечень клиринговых документов) допускается в течение всего операционного дня на основании [Встречных поручений](#_Поручение_на_изменение).
  4. Допускается указание количества ценных бумаг для каждого из указанных в Локальной корзине Сделки РЕПО выпусков. Указание количества ценных бумаг для отдельных выпусков из числа указанных в Локальной корзине Сделки РЕПО не допускается.
  5. В случае если Сделка РЕПО заключена между резидентами и ни одна из Сторон по Сделке не являются уполномоченным банком или профессиональным участником рынка ценных бумаг, не допускается включение в Корзину РЕПО, указанную в Сделке РЕПО, внешних ценных бумаг. Ответственность за соблюдение валютного законодательства Российской Федерации при указании Корзины РЕПО в поручениях по форме [MF194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов) возлагается на Стороны по Сделке РЕПО.
  6. НРД вправе не зарегистрировать Сделку РЕПО с Локальной корзиной ценных бумаг в СУО при одновременном соблюдении следующих условий:
     1. хотя бы одна из Сторон по Сделке РЕПО входит в список лиц, в отношении которых введены Санкции[[2]](#footnote-2);
     2. Сторона по Сделке РЕПО, входящая в список лиц, в отношении которых введены Санкции, указала в клиринговом поручении в качестве счета для зачисления ценных бумаг торговый счет депо владельца;
     3. в Локальную корзину Сделки РЕПО с указанием количества ценных бумаг входят Иностранные ценные бумаги[[3]](#footnote-3).

# Особенности регистрации порога переоценки

* 1. В Сделках междилерского РЕПО используются верхний и нижний Пороги переоценки. Для их определения применяется значение процента от объема обязательств Заемщика по данной Сделке РЕПО. Пороги переоценки устанавливаются Кредитором и Заемщиком в поручениях по форме [MF194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов) при регистрации Сделки РЕПО в СУО.

# Особенности Определения Рыночной цены

* 1. Рыночная цена для всех выпусков ценных бумаг определяется на каждый операционный день по умолчанию с использованием следующих типов цен в порядке приоритета:
     + цена типа «B»;
     + цена типа «L».
  2. В случае отсутствия цены типа «L» Рыночная цена ценных бумаг, подбираемых в качестве Обеспечения, принимается равной 0 (нулю), за исключением установленных Порядком случаев.
  3. При определении Рыночной цены ценных бумаг Клиенты также могут использовать:
     1. типы цен по данным различных информационных источников, перечень которых устанавливает НРД для каждого выпуска ценных бумаг;
     2. типы цен, устанавливаемые Клиентами в [Поручении на передачу цен по ценных бумагам](#_Поручение_на_передачу_1) (далее - Поручение на передачу цен) по форме [MF18VAL](#_Поручение_на_передачу_1) (Приложение 3). Использование типов цен, установленных в [Поручении на передачу цен](#_Поручение_на_передачу), возможно:
        + - в Локальной корзине Сделки РЕПО в случае, если:

одной из Сторон по Сделке РЕПО является Клиент, [подавший Поручение на передачу цен](#_Поручение_на_передачу_1);

Сторонами по Сделке РЕПО являются Клиенты, которым лицом, подавшим [Поручение на передачу цен](#_Поручение_на_передачу_1), дано право использования установленных данным поручением типов цен на ценные бумаги.

* + - * + при регистрации Корзины РЕПО на основании [Поручение на регистрацию корзин РЕПО](#_Поручение_на_регистрацию_4) в случае, если Корзину РЕПО регистрирует:

Клиент, подавший [Поручение на передачу цен](#_Поручение_на_передачу_1);

Клиент, которому дано право использования установленных данным поручением типов цен на ценные бумаги.

* 1. Для купонных облигаций цены, устанавливаемые Клиентами в [Поручение на передачу цен по ценным бумагам](#_Поручение_на_передачу_1), передаются без учета суммы НКД.
  2. Клиенты могут указать в Локальной корзине РЕПО или в [Поручении на регистрацию Корзин РЕПО](#_Поручение_на_регистрацию_4) приоритетную последовательность использования типов цен, указанных в пунктах 39.1 и 39.3.
  3. Приоритетная последовательность типов цен может быть установлена как по определенному выпуску ценных бумаг, так и по совокупности одного типа ценных бумаг эмитента.
  4. При указании приоритетной последовательности типов цен допускается использование не более 3 (трех) типов цен.
  5. В случае отсутствия Рыночной цены по всем типам цен, установленных приоритетной последовательностью, Рыночная цена ценной бумаги, подбираемой в качестве Обеспечения, принимается равной 0 (нулю), за исключением установленных Порядком случаев.
  6. Если Клиент, которому лицом, подавшим [Поручение на передачу цен](#_Поручение_на_передачу_1), было дано право использования установленных данным поручением типов цен на ценные бумаги, утратит такое право, то при переоценке ценных бумаг, являющихся Обеспечением по Действующим Сделкам РЕПО данного Клиента (за исключением Сделок РЕПО с лицом, подавшим [Поручение на передачу цен](#_Поручение_на_передачу_1)), для указанных типов цен будет использоваться Рыночная цена на дату утраты такого права.
  7. Установленный в соответствии с пунктом 39 Порядка порядок определения Рыночной цены будет использоваться НРД при Подборе ценных бумаг для расчета первой части Сделки РЕПО, для внесения Компенсационного взноса, для Замены ценных бумаг, при переоценке ценных бумаг, являющихся Обеспечением по Действующим Сделкам РЕПО, а также для контроля использования Лимита и определения его свободного остатка.

# Особенности использования Лимитов

* 1. Лимиты концентрации ценных бумаг устанавливаются, изменяются и аннулируются Кредитором путем подачи в НРД [Лимитной карты Кредитора](#_Лимитная_карта_Кредитора_1) (далее – Лимитная карта) по форме поручения [MF18Q](#_Отчет_о_регистрации_5) (Приложение [3](#_Лимитная_карта_Кредитора) к Порядку).
  2. При регистрации [Лимитной карты](#_Лимитная_карта_Кредитора_1) НРД присваивает ей идентификационный код. Количество [Лимитных карт](#_Лимитная_карта_Кредитора_1) одного Кредитора, регистрируемых в НРД, не ограничено. Установленные Лимиты вступают в действие непосредственно после регистрации [Лимитной карты](#_Лимитная_карта_Кредитора_1) и являются действительными до регистрации новых Лимитов, установленных в данной [Лимитной карте](#_Лимитная_карта_Кредитора_1), либо до аннулирования данной [Лимитной карты](#_Лимитная_карта_Кредитора_1). После регистрации [Лимитной карты](#_Лимитная_карта_Кредитора_1) Кредитору направляется [Отчет о регистрации Лимитной карты](#_Отчет_о_регистрации_5) по форме [MS18Q](#_Отчет_о_регистрации_5) (Приложение [3](#_Отчет_о_регистрации_3) к Порядку).
  3. Лимит может быть установлен:
     1. для совокупности одного типа ценных бумаг эмитента;
     2. для определенного выпуска ценных бумаг эмитента.
  4. Совокупная стоимость ценных бумаг при осуществлении контроля Лимита определяется с использованием Рыночной цены, определенной для данных ценных бумаг в Сделках РЕПО.
  5. Для совокупности ценных бумаг одного типа Лимит может быть установлен только в денежном выражении.
  6. Для определенного выпуска ценных бумаг Лимит может быть установлен одновременно в количественном и стоимостном выражении, причем как в одной, так и в разных [Лимитных картах](#_Лимитная_карта_Кредитора_1). В этом случае при Подборе ценных бумаг НРД осуществляет контроль Лимита по двум параметрам, при этом количество ценных бумаг, подбираемых в качестве Обеспечения по Сделке РЕПО, не должно превышать установленные Лимиты как в количественном, так и в стоимостном отношении.
  7. Лимит может быть установлен как в отношении одного раздела счета депо, так и в отношении совокупности нескольких разделов счета депо. При этом контроль Лимита осуществляется суммарно по всем разделам счета(ов) депо, указанным в [Лимитной карте](#_Лимитная_карта_Кредитора_1), на которые переводятся Ценные бумаги, переданные Кредитору, в отношении которых установлен Лимит.
  8. Допускается превышение Лимита вследствие увеличения количества ценных бумаг либо их стоимости, не связанного с Подбором ценных бумаг, осуществляемым НРД при управлении Обеспечением, либо с Заменой ценных бумаг без Подбора (например, при переоценке ценных бумаг, изменении Лимитов Кредитором, корпоративных действий с ценными бумагами и пр.). НРД не осуществляет действия по приведению количества ценных бумаг, в отношении которых Кредитором установлены Лимиты, в соответствие с установленными Лимитами.
  9. В случае зафиксированного превышения установленного Лимита НРД не осуществляет дальнейший Подбор таких ценных бумаг. НРД не несет ответственности за неисполнение Подбора ценных бумаг при управлении обеспечением Сделок РЕПО вследствие превышения Лимита ценных бумаг, установленного Кредитором.
  10. В случае превышения Лимита в отношении хотя бы одной ценной бумаги Клиентам, использующим WEB-кабинет СУО, направляется соответствующее уведомление.
  11. Контроль установленного Лимита осуществляется при Подборе ценных бумаг для исполнения обязательств по первой части Сделки РЕПО, для внесения Компенсационного взноса, а также для Замены ценных бумаг.

# Особенности расчета Текущей стоимости обязательства и Стоимости обратного выкупа

* 1. При расчете Текущей стоимости обязательства и Стоимости обратного выкупа по Сделке РЕПО начисление процентов осуществляется в соответствии с методом расчета процентов, установленным в поручениях по форме [MF194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/). В зависимости от выбранного метода, НРД при начислении процентов за каждый день Сделки РЕПО либо включает в расчет начальную дату периода расчета и исключает последнюю дату, либо исключает начальную дату периода расчета и включает последнюю дату.
  2. Количество дней в году, на который попадает день, за который начисляются проценты, определяется в зависимости от выбранного метода расчета процентов.
     1. При начислении процентов по методу расчета, предусматривающему включение начальной даты периода расчета и исключение последней даты, используется Текущая ставка РЕПО, действующая на календарный день, за который начисляются проценты.
     2. При начислении процентов по методу расчета, предусматривающему исключение начальной даты периода расчета и включение последней даты, используется Текущая ставка РЕПО, действующая на календарный день, предшествующий дню, за который начисляются проценты.
  3. В Сделках междилерского РЕПО, обязательства по которым выражены в иностранной валюте, НРД не осуществляет расчет текущей стоимости и начислении процентов в рабочий день, который является нерабочим в стране - эмитенте валюты Сделки.

# Особенности Маркирования и Подбора ценных бумаг для исполнения первой части Сделки РЕПО

* 1. НРД производит регистрацию Сделок РЕПО в СУО на основании [поручений](#_Поручение_на_изменение) по форме [MF194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов) Кредитора и Заемщика.
  2. Период исполнения поручений по форме [MF194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) составляет 1 день.
  3. Подбор ценных бумаг для исполнения обязательств по Сделкам междилерского РЕПО с типом расчетов DVP-3, проводится:
* перед клиринговыми сеансами НРД, осуществляемыми с использованием торговых банковских счетов, открытых в НРД, и (или) корреспондентских счетов, открытых в Банке России, - для исполнения обязательств по Сделкам РЕПО, в которых Стороны по Сделке используют для расчетов торговые банковские счета, открытые в НРД, и (или) корреспондентские счета, открытые в Банке России;
  + перед клиринговыми сеансами, осуществляемыми с использованием как торговых банковских счетов, открытых в НРД, так и банковских счетов, открытых в иностранных банках - для исполнения обязательств по Сделкам РЕПО, в которых хотя бы одна из Сторон по Сделке использует для расчетов банковский счет в Иностранном банке.
  1. При указании в Сделке РЕПО Локальной корзины, НРД при Подборе ценных бумаг для исполнения обязательств по Сделке РЕПО, а также для Замены ценных бумаг и внесения Компенсационного взноса, использует только ценные бумаги из Локальной корзины.
  2. В случае указания в Локальной корзине Сделки РЕПО количества ценных бумаг, при Подборе используется только указанное количество, независимо от Суммы РЕПО и Рыночной цены ценных бумаг. Если не удалось осуществить Подбор хотя бы одной ценной бумаги из Локальной корзины в соответствии с указанным количеством, то дальнейший Подбор ценных бумаг не осуществляется.
  3. Если одна из Сторон по Сделке РЕПО не участвует либо уклоняется от идентификации в соответствии с требованиями FATCA[[4]](#footnote-4), то указание в Локальной корзине ценных бумаг, попадающих под требования FATCA, не допускается.
  4. В Группе сделок междилерского РЕПО контроль Минимального лота при Подборе ценных бумаг не осуществляется.
  5. Разрешены для Маркирования и участвуют в Подборе ценных бумаг только разделы счетов депо следующих типов:
* на счетах депо владельца (S):
  + Основной (00);
  + Основной (дополнительный) (73);
  + Раздел длительного хранения (IN);
* на счетах депо доверительного управляющего (D):
  + Основной (00);
  + Основной (дополнительный) (73);
  + Раздел длительного хранения (IN);
* на счетах депо номинального держателя (L):
  + Основной (00);
  + Основной (клиентский) (70);
  + Раздел длительного хранения (IN);
* на счетах депо иностранного номинального держателя. ICSD (LF):
* Основной (00);
* Основной (клиентский) (70);
* на счетах депо иностранного номинального держателя. ЦД/РД (LW):
* Основной (00);
* Основной (клиентский) (70);
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги в собственности депонента»:
* Клиринговая организация НРД (TS):
  + Основной (00);
  + Основной (дополнительный) (73);
* Клиринговая организация НКЦ (HS):
  + Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
    - Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36);
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги в доверительном управлении»:
* Клиринговая организация НРД (TD):
  + Основной (00);
  + Основной (дополнительный) (73);
* Клиринговая организация НКЦ (HD):
  + - Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
* Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36);
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги номинального держателя»:
* Клиринговая организация НРД (TL):
  + Основной (00);
  + Основной (клиентский) (70);
* Клиринговая организация НКЦ (HL):
  + Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
  + Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36);
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги иностранного номинального держателя. ICSD»:
* Клиринговая организация НРД (ТF):
  + Основной (00);
  + Основной (клиентский) (70);
* Клиринговая организация НКЦ (HF):
  + Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
  + Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36);
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги иностранного номинального держателя ЦД/РД»:
* Клиринговая организация НРД (ТW):
  + Основной (00);
  + Основной (клиентский) (70);
* Клиринговая организация НКЦ (HW):
  + Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
  + Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36).
  1. Ценные бумаги, находящиеся на разделе торгового счета депо, на который осуществляется перевод ценных бумаг, подобранных в качестве Обеспечения по Сделкам РЕПО, участвуют в Подборе ценных бумаг для таких Сделок РЕПО, даже если такие ценные бумаги либо указанный раздел счета депо не промаркированы Клиентом как доступные для Подбора. В этом случае непромаркированные бумаги будут подбираться в Сделки РЕПО с минимальным приоритетом.
  2. Определение обязательств (установление параметров обязательств на основании заключенной сделки) Клиентов по первой части Сделки РЕПО осуществляется на основании поручений по форме [MF194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/), (Перечень клиринговых документов), поданных Кредитором и Заемщиком, без учета принципа толерантности и без резервирования денежных средств в соответствии с Правилами клиринга.
  3. Ценные бумаги, переданные Кредитору, учитываются и блокируются на разделе «Для расчетов по сделкам РЕПО» торгового счета депо Кредитора при условии, что по данной Сделке РЕПО установлен запрет на Реюз.
  4. В случае если по Сделке РЕПО не установлен запрет на использование Реюза, то Ценные бумаги, переданные Кредитору, переводятся на раздел торгового счета депо Кредитора, который используется для расчетов по данной Сделке РЕПО, и не блокируются.
  5. Частичное исполнение первых частей Сделок междилерского РЕПО не предусмотрено.

# Особенности исполнения обязательств Клиентов по второй части Сделки РЕПО

* 1. Подбор ценных бумаг для исполнения второй части Сделки РЕПО проводится с учетом промаркированных Кредитором ценных бумаг для исполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО.
  2. В Сделках междилерского РЕПО Перенос даты второй части Сделки РЕПО не допускается.
  3. В случае неисполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО НРД прекращает учет обязательств по такой Сделке РЕПО, а ценные бумаги, являющиеся Обеспечением по данной Сделке РЕПО, разблокируются (в случае, если в Сделке РЕПО был установлен запрет на использование Реюза) и переводятся служебным поручением НРД без дополнительных инструкций Клиента на основной раздел торгового счета депо Кредитора. Клиентам направляется [Отчет об обязательствах по прекращенной Сделке РЕПО](#_Отчет_об_обязательствах_1). Дальнейшее урегулирование обязательств по Сделке РЕПО Стороны осуществляют самостоятельно.

# Особенности переоценки обязательств, изменения параметров Сделки РЕПО, проверки Обеспеченности обязательств и внесения Компенсационного взноса

* 1. Переоценку обязательств, расчет и исполнение обязательств по внесению Компенсационных взносов между Кредитором и Заемщиком НРД осуществляет по каждой Сделке РЕПО (посделочное маржирование).
  2. Стороны по Сделке РЕПО могут отказаться от автоматического исполнения Компенсационных взносов путем указания в поручениях по форме [MF194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов) параметра «Без автоматического маржирования».
  3. Допускается исполнение Компенсационного взноса денежными средствами. При этом Сторона по Сделке вправе самостоятельно подать в НРД [Поручение на денежный компенсационный взнос](#_Поручение_на_денежный_1) по форме [MF18X](#_Поручение_на_денежный_1) (Приложение [3](#_Поручение_на_денежный) к Порядку) на исполнение Компенсационного взноса денежными средствами с указанием суммы денежных средств, не превышающей рассчитанную сумму такого Компенсационного взноса.
  4. Клиент вправе предоставить в НРД [Поручение на регистрацию параметров](#_Поручение_на_регистрацию_2) с указанием типа Компенсационного взноса и времени начала исполнения обязательства по его внесению в Сделках РЕПО с определенным контрагентом.
  5. В соответствии с выбранным параметром в поле «Право переопределения даты исполнения» в поручениях Клиентов по форме [MF194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов), на основании [Одностороннего поручения](#_Поручение_на_изменение_1) допускается изменение Стороной по Сделке РЕПО Даты второй части Сделки РЕПО на более раннюю (но не ранее текущего операционного дня) либо установление Даты второй части Сделки РЕПО с открытой датой. При этом если в таком поручении не указан номер Сделки РЕПО, то изменение Даты второй части Сделки РЕПО применяется ко всем Действующим Сделкам РЕПО между Сторонами при условии, что по всем таким Сделкам РЕПО инициатору поручения предоставлено право изменения Даты второй части Сделки РЕПО.
  6. Если по окончании последнего клирингового сеанса Сторона по Сделке РЕПО не исполнила обязательства по второй части Сделки РЕПО, либо до закрытия операционного дня обязательства по Сделке РЕПО остались необеспеченными (переобеспеченными), другая Сторона имеет возможность подать [Одностороннее поручение](#_Поручение_на_изменение_1) и изменить на более раннюю как Дату второй части данной Сделки РЕПО, так и Даты вторых частей всех Действующих Сделок РЕПО между Сторонами, вне зависимости от выбранного параметра в поле «Право переопределения даты исполнения». Указанное поручение может быть подано в течение следующего операционного дня вне зависимости от Обеспеченности обязательств по данной Сделке РЕПО, при этом обязанность по контролю соблюдения условий Сделки РЕПО возлагается на Сторону, подающую указанное поручение.
  7. Устанавливаемая в соответствии с пунктом 44.6 новая Дата второй части сделки РЕПО не может быть ранее операционного дня, следующего за датой неисполнения обязательств по Сделке РЕПО.
  8. Количество подаваемых в соответствии с пунктом 44.6 [Односторонних поручений](#_Поручение_на_изменение) для изменения Даты второй части Сделки РЕПО не ограничено. При подаче нескольких указанных поручений исполняться будут только поручения, которые изменяют Дату второй части Сделки РЕПО на более раннюю.
  9. Сторона по Сделке РЕПО, имеющая возможность изменять Дату второй части Сделки РЕПО в одностороннем порядке, указывается в [Отчете об Обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1) в поле «Право установить/приблизить дату исполнения сделки» в период обеспечения такой возможности.
  10. Сторона по Сделке РЕПО вправе на основании [Одностороннего поручения](#_Поручение_на_изменение_1) изменять параметры Сделки РЕПО, если данное право установлено в поручениях Клиентов по форме [MF194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов) при заполнении поля «Право одностороннего изменения параметров сделки».
  11. Прекращение учета обязательств по Сделке РЕПО на основании [Одностороннего поручения](#_Поручение_на_изменение) допускается в случае, когда Сторонами по Сделке РЕПО является одно и то же лицо. В других случаях одностороннее прекращение учета обязательств по Сделке РЕПО не допускается.
  12. Сторона по Сделке РЕПО вправе в одностороннем порядке предоставить в НРД [Уведомление о Дефолте](#_УВЕДОМЛЕНИЕ_О_ДЕФОЛТЕ_1) другой Стороны по Сделке, оформленное в соответствии с требованиями НРД (Приложение [7](#_УВЕДОМЛЕНИЕ_О_ДЕФОЛТЕ) к Порядку). При получении такого уведомления НРД прекращает учет обязательств по Сделкам РЕПО, указанным в уведомлении. При этом Сторонам по Сделке РЕПО направляется [Отчет об обязательствах по прекращенной Сделке РЕПО](#_Отчет_об_обязательствах). Дальнейшее урегулирование обязательств по таким Сделкам РЕПО Стороны осуществляют самостоятельно.
  13. НРД не осуществляет контроль правомерности и/или обоснованности подачи Стороной по Сделке [Уведомления о Дефолте](#_УВЕДОМЛЕНИЕ_О_ДЕФОЛТЕ_1) другой Стороны. Ответственность за соблюдение законодательства Российской Федерации и условий Генерального соглашения об общих условиях заключения договоров РЕПО на рынке ценных бумаг возлагается на Сторону по Сделке РЕПО, предоставившую [Уведомление о Дефолте](#_УВЕДОМЛЕНИЕ_О_ДЕФОЛТЕ_1).
  14. В случае наличия в Обеспечении действующих Сделок междилерского РЕПО ценных бумаг публичного общества, подлежащих выкупу в соответствии со статьей 84.8 Федерального закона «Об акционерных обществах», НРД за 2 рабочих дня до даты фиксации состава участников указанного корпоративного действия прекращает учет обязательств по таким Сделкам РЕПО.
  15. В Сделках междилерского РЕПО, обязательства по которым выражены в иностранной валюте, НРД не осуществляет проверку Обеспеченности обязательств и расчет Компенсационного взноса в рабочий день, который является нерабочим в стране - эмитенте валюты Сделки.

# Особенности замены ценных бумаг

* 1. Замена ценных бумаг по [Поручению на Замену с Подбором](#_Поручение_на_изменение_1) возможна при соблюдении следующих условий:
     1. стоимость Обеспечения после Замены ценных бумаг должна быть не ниже стоимости обязательств Заемщика по данной Сделке РЕПО;
     2. после Замены ценных бумаг не нарушаются установленные Кредитором Лимиты.
  2. Заемщик вправе подать [Поручение на Замену без Подбора](#_Поручение_на_изменение_1), при этом операция допустима, если по результатам операции не нарушаются установленные Кредитором Лимиты, и соблюдается одно из следующих условий:
     1. при Обеспеченности или переобеспеченности обязательств по Сделке РЕПО стоимость Обеспечения после Замены ценных бумаг должна быть не ниже стоимости обязательств Заемщика по данной Сделке РЕПО;
     2. при необеспеченности обязательств по Сделке РЕПО совокупная дисконтированная стоимость Заменяемых ценных бумаг должна быть меньше совокупной дисконтированной стоимости Заменяющих ценных бумаг.
  3. Замена ценных бумаг по служебному поручению НРД в интересах Кредитора не осуществляется.

# Порядок действий НРД при проведении корпоративных действий с ценными бумагами, переданными в качестве обеспечения по Сделкам РЕПО

* 1. При поступлении в НРД информации об осуществлении корпоративного действия по Ценным бумагам, переданным Кредитору по Действующей Сделке РЕПО (за исключением ценных бумаг, попадающих под требования FATCA), НРД не позднее рабочего дня, следующего за датой поступления вышеуказанной информации, без дополнительных инструкций Клиента формирует поручение на исполнение обязательства Кредитора по перечислению Заемщику денежных средств и включает его в клиринговый пул ближайшего клирингового сеанса. Поручение формируется с учетом количества Ценных бумаг, переданных Кредитору по Сделке РЕПО, на дату фиксации корпоративного действия. Перевод денежных средств по сформированному поручению будет осуществлен по торговым банковским счетам Кредитора и Заемщика, зарегистрированным для расчетов по данной Сделке РЕПО.
  2. В случае если выплата по ценным бумагам осуществляется в валюте, отличной от валюты Сделки РЕПО, по первой части которой были переданы указанные ценные бумаги, НРД формирует поручение на исполнение обязательства Кредитора по перечислению денежных средств на торговый банковский счет в соответствующей валюте, зарегистрированный Заемщиком для исполнения обязательств, допущенных к клирингу НРД. В случае отсутствия у Заемщика торгового банковского счета в валюте выплаты, зарегистрированного Заемщиком для исполнения обязательств, допущенных к клирингу НРД, НРД направляет Заемщику уведомление по форме [GS036](https://www.nsd.ru/documents/depo/) (Приложение 2 к Условиям), при этом поручение на исполнение обязательства Кредитора по перечислению денежных средств не формируется, и Стороны по Сделке РЕПО урегулируют перечисление выплаты самостоятельно.
  3. НРД определяет сумму перечисления дохода с учетом информации, указанной в поле «Вариант возврата доходов» в поручениях по форме [MF194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов) по каждой Сделке РЕПО. Вариант «Возврат 100% доходов по российским и иностранным ценным бумагам» предусмотрен по умолчанию.
  4. До Даты второй части Сделки РЕПО, в рамках которой было сформировано поручение по обязательствам Кредитора перед Заемщиком по перечислению дохода по ценным бумагам, переданным Кредитору, указанное поручение исполняется в клиринговых сеансах ранее, чем обязательства по Сделкам междилерского РЕПО Кредитора. После Даты второй части Сделки РЕПО указанное поручение исполняется в последнюю очередь.
  5. В случае неисполнения поручения по обязательствам Кредитора по перечислению дохода по ценным бумагам вследствие недостаточности денежных средств на торговом банковском счете Кредитора, Заемщик вправе предоставить в НРД [Заявление об отказе от предоставления услуги по перечислению дохода по Ценным бумагам, переданным Кредитор](#_Заявление_об_отказе)у. Заявление предоставляется на бумажном носителе по форме [LN018](#_Заявление_об_отказе) (Приложение [3](#_Заявление) к Порядку). При его получении НРД аннулирует обязательство с указанием Заявления в качестве основания для отмены. Если поручение по обязательству Кредитора уже было исполнено, НРД уведомляет Заемщика о невозможности исполнения Заявления с указанием причины.

## ЧАСТЬ IV. ОСОБЕННОСТИ ОКАЗАНИЯ УСЛУГИ ПО ПОДБОРУ ЦЕННЫХ БУМАГ НА СЧЕТ ДЕПО/РАЗДЕЛ СЧЕТА ДЕПО/СУБСЧЕТ ДЕПО ДЛЯ ОБСЛУЖИВАНИЯ КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ НКЦ

# Общие положения

* 1. НРД оказывает услугу по Подбору ценных бумаг, учитываемых на счетах депо Клиента в НРД, и переводу их на определенный счет депо/раздел счета депо/субсчет депо для обслуживания клиринговой деятельности НКЦ. Подбор ценных бумаг осуществляется на основании поручения Клиента либо НКЦ.
  2. НРД при Подборе ценных бумаг использует информацию из зарегистрированного Перечня ценных бумаг, передаваемого НКЦ в НРД. Перечень ценных бумаг определяет список ценных бумаг, разрешенных НКЦ для Подбора, а также перечень счетов депо/разделов счета депо/субсчетов депо, на которые могут быть подобраны ценные бумаги, указанные в Перечне ценных бумаг.
  3. Оценочная стоимость ценных бумаг, указанных в Перечне ценных бумаг, устанавливается НКЦ. Оценочная стоимость ценной бумаги может составлять 0 (ноль) рублей.
  4. Зарегистрированный Перечень ценных бумаг действует до момента регистрации нового Перечня ценных бумаг. НРД использует только информацию из Перечня ценных бумаг, полученную в текущий операционный день. Если информация о Перечне ценных бумаг не поступила в НРД в текущий операционный день, НРД не осуществляет Подбор ценных бумаг на счет депо/раздел счета депо/субсчет депо для обслуживания клиринговой деятельности НКЦ.
  5. НКЦ вправе установить дополнительные ограничения по Перечню ценных бумаг, допустимых к Подбору на конкретный счет депо/раздел счета депо/субсчет депо Клиента. НРД при Подборе ценных бумаг использует информацию из Перечня ценных бумаг с учетом полученной от НКЦ информации о дополнительных ограничениях.

# Особенности подбора ценных бумаг для обслуживания клиринговой деятельности НКЦ

* 1. Для осуществления Подбора ценных бумаг на определенный счет депо/раздел счета депо/субсчет депо Клиент либо НКЦ подает [Поручение на подбор для обслуживания клиринговой деятельности НКЦ](#_Поручение_на_Подбор_1) (далее – Поручение на подбор) по форме [MF18G](#_Поручение_на_Подбор_1) (Приложение [3](#_Поручение_на_подбор) к Порядку).
  2. Разрешены для Маркирования и участвуют в Подборе ценных бумаг только разделы счетов депо следующих типов:
* на счетах депо владельца (S):
  + Основной (00);
  + Основной (дополнительный) (73);
  + Раздел длительного хранения (IN);
* на счетах депо доверительного управляющего (D):
  + Основной (00);
  + Основной (дополнительный) (73);
  + Раздел длительного хранения (IN);
* на счетах депо номинального держателя (L):
  + Основной (00);
  + Основной (клиентский) (70);
  + Раздел длительного хранения (IN);
* на счетах депо иностранного номинального держателя. ICSD (LF):
  + - Основной (00);
    - Основной (клиентский) (70);
* на счетах депо иностранного номинального держателя. ЦД/РД (LW):
  + - Основной (00);
    - Основной (клиентский) (70);
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги в собственности депонента»:
* Клиринговая организация НРД (TS):
  + Основной (00);
  + Основной (дополнительный) (73);
  + Клиринговая организация НКЦ (HS):
  + Блокировано для клиринга в НКЦ (31);

- Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36);

* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги в доверительном управлении»
* Клиринговая организация НРД (TD):
  + Основной (00);
  + Основной (дополнительный) (73);
* Клиринговая организация НКЦ (HD):
  + - Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
    - Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36).
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги номинального держателя»:
* Клиринговая организация НРД (TL):
  + Основной (00);
  + Основной (клиентский) (70);
* Клиринговая организация НКЦ (HL):
  + Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
  + Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36);
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги иностранного номинального держателя. ICSD»:
* Клиринговая организация НРД (ТF):
* Основной (00);
* Основной (клиентский) (70);
* Клиринговая организация НКЦ (HF):
* Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
* Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36)
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги иностранного номинального держателя ЦД/РД»:
* Клиринговая организация НРД (ТW):
* Основной (00);
* Основной (клиентский) (70);
* Клиринговая организация НКЦ (HW):
* Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
* Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36).
  1. Ожидаемый результат Подбора ценных бумаг в [Поручении на подбор](#_Поручение_на_Подбор_1) может указываться в виде:
     1. Суммы Подбора, т.е. суммы денежных средств в российских рублях, соответствующей суммарной стоимости подбираемых ценных бумаг;
     2. Списка ценных бумаг с указанием их количества по каждой ценной бумаге.
  2. В Подборе ценных бумаг участвуют только ценные бумаги, включенные в Перечень ценных бумаг и промаркированные Клиентом для Подбора ценных бумаг в данной Группе сделок. При этом Подбор осуществляется на счета депо/разделы счета депо/субсчета депо, указанные в [Поручении на подбор](#_Поручение_на_Подбор_1).
  3. Подбор ценных бумаг осуществляется с использованием Оценочной стоимости ценных бумаг, установленной в Перечне ценных бумаг.
  4. Подбор ценных бумаг осуществляется:
     + в имущественный пул КСУ OFZ;
     + в имущественный пул КСУ GC Bonds;
     + в имущественный пул КСУ GC Shares;
     + в имущественный пул КСУ GC Expanded;
     + в индивидуальное клиринговое обеспечение;
     + в коллективное клиринговое обеспечение (гарантийный фонд);
     + в обеспечение под стресс;
     + в обеспечение под риски концентрации на эмитентов.
  5. Подбор ценных бумаг осуществляется на следующие разделы счета депо/субсчета депо.
     1. Для имущественных пулов:
     + «Субсчет депо. Ценные бумаги владельца, переданные НКЦ в имущественный пул» (8S);
     + «Субсчет депо. Ценные бумаги Д.У., переданные НКЦ в имущественный пул» (8D);
     + «Субсчет депо. Ценные бумаги Н.Д., переданные НКЦ в имущественный пул» (8L);
     + «Субсчет депо. Ценные бумаги иностранного Н.Д., переданные НКЦ в имущественный пул» (8W),

открытые на следующих клиринговых счетах депо:

* «КСУ OFZ» (HU);
* «КСУ GC Bonds» (HB);
* «КСУ GC Shares» (HX);
* «КСУ GC GC Expanded» (HE).
  + 1. Для индивидуального клирингового обеспечения:
* «Блокировано для клиринга в НКЦ» (31);
* «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение» (36),

открытые на следующих торговых счетах депо:

* «Торговый. НКЦ. Ценные бумаги в собств.депонента» (HS);
* «Торговый. НКЦ. Ценные бумаги номинального держателя» (HL);
* «Торговый. НКЦ. Ценные бумаги иностранного номинального бумаги иностранного номинального держателя. ЦД/РД» (HW);
* «Торговый. НКЦ. Ценные бумаги иностранного номинального держателя. ICSD)» (HF):
* «Торговый. НКЦ. Ценные бумаги в доверительном управлении» (HD)».
  + 1. Для коллективного клирингового обеспечения (гарантийный фонд):
* «Субсчет депо. Ценные бумаги владельца, переданные НКЦ в коллективное обеспечение» (9H),

открытый на счете депо «Клиринговый счет депо» (HH).

* + 1. Для обеспечения под стресс:
* «Субсчет депо. Ценные бумаги владельца, переданные НКЦ в индивидуальное обеспечение» (HC),

открытый на счете депо «Клиринговый счет депо» (HH).

* + 1. Для обеспечения под риски концентрации на эмитентов:
* «Субсчет депо. Ценные бумаги владельца, переданные НКЦ в индивидуальное клиринговое обеспечение под риски концентрации на эмитентов» (HG),

открытый на счете депо «Клиринговый счет депо» (HH).

* 1. По итогам Подбора ценных бумаг НРД переводит подобранные ценные бумаги на указанные в [Поручении на подбор](#_Поручение_на_Подбор_1) разделы счетов депо/субсчета депо. При этом Клиентам направляется [Отчето подборе ценных бумаг для обеспечения клиринговой деятельности НКЦ](#_Отчет_о_Подборе_1) по форме [MS18G](#_Отчет_о_Подборе_1) (Приложение 3 к Порядку).
  2. Если на момент исполнения [Поручения на подбор](#_Поручение_на_Подбор_1) на промаркированных счетах Клиента недостаточно промаркированных и включенных в Перечень ценных бумаг, Подбор ценных бумаг на указанный в [Поручении на подбор](#_Поручение_на_Подбор_1) счет депо/раздел счет депо/субсчет депо осуществляется частично в максимально возможном размере. В дальнейшем повторный Подбор по данному [Поручению на подбор](#_Поручение_на_Подбор_1) не производится.
  3. При Подборе ценных бумаг на разделы счетов депо владельцев, возможно использование ценных бумаг, находящихся в Обеспечении Сделок РЕПО с Глобальными кредиторами.
  4. Изъятие ценных бумаг из Обеспечения Сделок РЕПО с Глобальными кредиторами возможно при одновременном соблюдении следующих условий:
     1. недостаточное для исполнения [Поручения на подбор](#_Поручение_на_Подбор_1) количество ценных бумаг, включенных в Перечень ценных бумаг и промаркированных на счетах Клиента для данной Группы сделок;
     2. указание Клиентом в [Поручении](#_Поручение_на_регистрацию_3) на автозамену признака «Y» в поле «Автозамена ценных бумаг в сделках с Глобальными кредиторами»;
     3. возможность Замены ценных бумаг, изымаемых из Сделок РЕПО с Глобальными кредиторами.

## ЧАСТЬ V. ОСОБЕННОСТИ ОКАЗАНИЯ УСЛУГИ ПО ПОДБОРУ ЦЕННЫХ БУМАГ ДЛЯ ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ DVP

# Общие положения

* 1. НРД оказывает услуги по Подбору ценных бумаг для исполнения обязательств по Сделкам DVP с типом расчетов DVP-1, DVP-2 и DVP-3.
  2. НРД осуществляет Подбор ценных бумаг при условии заполнения Продавцом в клиринговом поручении по форме [MF190](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов) с кодом операции 19/0 поля «Осуществлять подбор ценных бумаг».
  3. НРД вправе не зарегистрировать Сделку DVP в СУО при одновременном соблюдении следующих условий:
     1. Покупатель входит в список лиц, в отношении которых введены Санкции;
     2. Покупатель указал в клиринговом поручении в качестве счета для зачисления ценных бумаг торговый счет депо владельца;
     3. в Сделке DVP указаны Иностранные ценные бумаги.
  4. До момента исполнения НРД клирингового поручения по форме [MF190](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) с видом операции 19/0 с заполненным полем «Осуществлять подбор ценных бумаг» может изменить параметр в указанном поле путем подачи поручения по форме MF530 (Перечень клиринговых документов).

# Особенности Подбора ценных бумаг

* 1. Подбор ценных бумаг для исполнения обязательств по Сделке DVP осуществляется в дату Сделки DVP в следующем порядке:
  2. в случае выбора типа расчетов DVP-1 – непосредственно после регистрации Сделки DVP, а при отсутствии или недостаточности ценных бумаг, необходимых для исполнения обязательств по Сделке DVP – периодически в течение операционного дня в соответствии с расписанием, установленным НРД;
  3. в случае выбора типа расчетов DVP-2 и DVP-3 – непосредственно перед ближайшим клиринговым сеансом, а при отсутствии или недостаточности ценных бумаг, необходимых для исполнения обязательств по Сделке DVP, повторно перед каждым последующим клиринговым сеансом.
  4. Подбор ценных бумаг осуществляется до исполнения/отмены Сделки DVP или отмены параметра «Осуществлять подбор ценных бумаг» соответствующим поручением Продавца.
  5. Подбор осуществляется в соответствии с перечнем ценных бумаг, указанных в клиринговом поручении, с учетом их количества.
  6. В Подборе участвуют только ценные бумаги, промаркированные Продавцом для Подбора в данной Группе.
  7. Разрешены для Маркирования и участвуют в Подборе ценных бумаг только счета депо (разделы счетов депо) следующих типов:
* на счетах депо владельца (S):
  + Основной (00);
  + Основной (дополнительный) (73);
  + Раздел длительного хранения (IN);
* на счетах депо доверительного управляющего (D):
  + Основной (00);
  + Основной (дополнительный) (73);
  + Раздел длительного хранения (IN);
* на счетах депо номинального держателя (L):
  + Основной (00);
  + Основной (клиентский) (70);
  + Раздел длительного хранения (IN);
* на счетах депо иностранного номинального держателя. ICSD (LF):
* Основной (00);
* Основной (клиентский) (70);
* на счетах депо иностранного номинального держателя. ЦД/РД (LW):
  + - Основной (00);
    - Основной (клиентский) (70);
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги в собственности депонента», Клиринговая организация НКЦ (HS):
  + Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
    - Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36);
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги в доверительном управлении», Клиринговая организация НКЦ (HD):
  + - Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
    - Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36);
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги номинального держателя», Клиринговая организация НКЦ (HL):
  + Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
  + Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36);
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги иностранного номинального держателя. ICSD», Клиринговая организация НКЦ (HF):
* Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
* Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36);
* на счетах депо «Торговый. Ценные бумаги иностранного номинального держателя. ЦД/РД», Клиринговая организация НКЦ (HW):
* Блокировано для клиринга в НКЦ (31);
* Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (36).
  1. Результатом Подбора ценных бумаг является перевод подобранных ценных бумаг НРД на торговый счет депо Продавца в количестве, достаточном для исполнения клирингового поручения по форме [MF190](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов) с выбранной опцией «Осуществлять подбор ценных бумаг».

Приложение 1 к порядку взаимодействия

клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением

**Алгоритмы Подбора ценных бумаг,**

**определения Обеспеченности обязательств,**

**расчета размеров и структуры Компенсационного взноса**

## ЧАСТЬ I. АЛГОРИТМ ПОДБОРА ЦЕННЫХ БУМАГ ПРИ УПРАВЛЕНИИ ОБЕСПЕЧЕНИЕМ В СДЕЛКАХ РЕПО.

1. **НРД производит Подбор ценных бумаг в следующих случаях**:
   1. при формировании поручений для исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО;
   2. при определении структуры Компенсационных взносов в виде ценных бумаг, подлежащих передаче Заемщиком в пользу Кредитора;
   3. при определении структуры Компенсационных взносов в виде ценных бумаг, подлежащих передаче Кредитором в пользу Заемщика;
   4. при Замене ценных бумаг;
   5. при формировании поручений для исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО по Группе сделок междилерского РЕПО;
   6. при обслуживании клиринговой деятельности НКЦ;
   7. при формировании поручений для исполнения обязательств по Cделке DVP.

# Общие принципы Алгоритма Подбора ценных бумаг

* 1. Для всех случаев Подбора ценных бумаг для исполнения обязательства Заемщика используется единый алгоритм.
  2. Подбор ценных бумаг производится с учетом следующей информации:
     1. Требований к ценным бумагам, входящим в Корзину РЕПО;
     2. Установленных дисконтов;
     3. Дисконтированной стоимости ценных бумаг, входящих в Корзину РЕПО;
     4. Дополнительных ограничений (при наличии), установленных Кредитором, в отношении Заемщика на совершение Сделок РЕПО с отдельными выпусками ценных бумаг, входящих в Корзину РЕПО;
     5. Дат планируемых выплат доходов по входящим в Корзину РЕПО ценным бумагам;
     6. Лимитов концентрации ценных бумаг, установленных Кредитором.

# Алгоритм Подбора ценных бумаг

* 1. Составление упорядоченного списка доступных для Подбора выпусков ценных бумаг в целях обеспечения обязательств по Сделкам РЕПО.
     1. Упорядоченный список составляется в соответствии с предоставленным Клиентом [Поручением на маркирование](#_Поручение_на_маркирование).
     2. В упорядоченный список включаются как промаркированные ценные бумаги (если промаркирован непосредственно выпуск ценной бумаги), так и ценные бумаги, хранящиеся на промаркированных разделах счетов депо Заемщика (если промаркирован раздел счета депо).
     3. Ценные бумаги ранжируются в соответствии с приоритетными значениями, указанными в [Поручении на маркирование](#_Поручение_на_маркирование). При включении в упорядоченный список ценных бумаг с промаркированного раздела счета депо для всех бумаг данного раздела используется установленный для раздела счета депо приоритет.
     4. Ценные бумаги, включенные в упорядоченный список с промаркированного раздела счета депо, ранжируются с учетом следующих условий:
        + В первую очередь подбираются ценные бумаги, номинированные в валюте, соответствующей валюте Сделки РЕПО, затем ценные бумаги, номинированные в иной валюте.
        + Список выпусков ценных бумаг, номинированных в одной валюте, распределяется по возрастанию размера дисконта (в первую очередь подбираются ценные бумаги Корзины РЕПО с наименьшим дисконтом).
        + Список выпусков ценных бумаг с одинаковым дисконтом распределяется по убыванию их Дисконтированной стоимости (в первую очередь подбираются ценные бумаги Корзины РЕПО с наибольшей Дисконтированной стоимостью).
     5. При Подборе ценных бумаг из упорядоченного списка выпусков ценных бумаг исключаются:
        + выпуски ценных бумаг, не входящие в Корзину РЕПО;
        + выпуски ценных бумаг, стоимость которых установлена НРД равной 0 (нулю) в соответствии с Порядком;
        + выпуски ценных бумаг, по которым НРД получено уведомление о проведении выкупа ценных бумаг публичного общества в соответствии со статьей 84.8 Федерального закона «Об акционерных обществах»;
        + выпуски ценных бумаг, включенные в список ценных бумаг, в отношении обязательств по которым НРД не оказывает клиринговые услуги (Список предметов обязательств из договоров, заключенных не на организованных торгах, Небанковской кредитной организации акционерного общества «Национальный расчетный депозитарий»);
        + выпуски Иностранных ценных бумаг, если хотя бы одна из Сторон по Сделке РЕПО включена в список лиц, в отношении которых введены Санкции, и указала в Сделке РЕПО в качестве счета для зачисления ценных бумаг торговый счет депо владельца.
  2. Приоритетный для Подбора выпуск ценных бумаг.

Если Подбор ценных бумаг осуществляется для исполнения обязательств по первой части Сделки РЕПО, и для данной Сделки РЕПО указан ISIN одной ценной бумаги в Общем реестре Сделок РЕПО либо перечень ценных бумаг в поручениях по форме [MF194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов), Подбор указанных ценных бумаг соответствующего выпуска со всех разделов, указанных в пункте 3.1 настоящего Приложения, выполняется ранее, чем Подбор прочих ценных бумаг.

* 1. При Подборе ценных бумаг, промаркированных Заемщиком одновременно для нескольких Групп сделок, такие бумаги подбираются в различные Группы в следующей очередности:
* Сделки РЕПО с Банком России;
* Сделки РЕПО с Федеральным казначейством (Группа сделок KZN1);
* Сделки РЕПО с Федеральным казначейством (Группа сделок EKS1);
* Сделки РЕПО с Федеральным казначейством (Группа сделок MBS1);
* Сделки РЕПО с Федеральным казначейством (Группа сделок MBS2);
* Сделки РЕПО с Комитетом финансов Санкт-Петербурга;
* Сделки РЕПО с Комитетом финансов Ленинградской области;
* Сделки междилерского РЕПО;
* Сделки DVP.
  1. Порядок расчета включаемого в Подбор количества ценных бумаг каждого выпуска с распределением ценных бумаг по разделам счетов депо, с которых будет производиться списание ценных бумаг.
     1. Подбор начинается с определения на разделах счетов депо из упорядоченного списка маркированных разделов счетов депо остатков маркированного выпуска ценных бумаг с максимальным приоритетом.
     2. Определяется максимально возможное количество ценных бумаг выпуска с максимальным приоритетом, которое может быть использовано для исполнения обязательства в результате списания с максимально приоритетного маркированного раздела счета депо:
        1. Определяется максимально возможное количество ценных бумаг данного выпуска, которое может быть использовано для исполнения обязательства;
        2. Если количество ценных бумаг, учитываемых на разделе счета депо, превышает количество ценных бумаг, необходимое для исполнения обязательства, то используется количество ценных бумаг данного выпуска, необходимое для исполнения обязательства, сумма Подбора ценных бумаг уменьшается на Дисконтированную стоимость использованных для исполнения обязательства ценных бумаг данного выпуска.
        3. Если количество ценных бумаг, учитываемых на разделе счета депо, меньше или равно количеству ценных бумаг, необходимого для исполнения обязательства, берется весь маркированный остаток ценных бумаг данного выпуска, сумма Подбора ценных бумаг уменьшается на Дисконтированную стоимость использованных для исполнения обязательства ценных бумаг данного выпуска. Если нераспределенная сумма Подбора ценных бумаг больше 0 (нуля), производится следующая итерация расчетов количества ценных бумаг выпуска со следующим приоритетом для исполнения обязательства.
        4. Если при Маркировании было указано максимальное количество ценных бумаг конкретного выпуска, доступное для Подбора, то используется количество, не превышающее максимально указанное в Поручении на маркирование. При осуществлении Подбора максимальное количество для Подбора уменьшается на число подобранных ценных бумаг.
        5. Если для выпуска ценной бумаги Кредитором установлен Лимит, то используется количество ценных бумаг, не превышающее (по количеству или по суммарной стоимости) величину неизрасходованного Лимита. При осуществлении Подбора величина неизрасходованного Лимита уменьшается на число подобранных ценных бумаг либо на величину суммарной стоимости подобранных бумаг. Ценные бумаги, зачисляемые Заемщику по вторым частям Сделок РЕПО, не учитываются при определении величины неизрасходованного Лимита.
        6. Если для выпуска ценной бумаги осуществляется контроль Минимального лота, то используется такое количество ценных бумаг, чтобы по результатам Подбора количество ценных бумаг данного выпуска, находящееся в Обеспечении Сделки РЕПО, было не менее Минимального лота, даже если указанная Сделка РЕПО будет при этом переобеспечена. Если данное условие не может быть соблюдено при Подборе ценной бумаги в связи с иными условиями Подбора (например, контроль Лимита, указание в [Поручении на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1) максимального количества ценной бумаги и т.д.), то такая бумага исключается из Подбора.
        7. Подбор ценных бумаг прекращается, когда суммарная Дисконтированная стоимость подобранных ценных бумаг превысит сумму Подбора на величину, не превышающую Дисконтированную стоимость одной ценной бумаги выпуска, участвующего в текущей итерации расчетов.
  2. При Подборе ценных бумаг на торговых разделах торговых счетов депо, открытых с указанием в качестве клиринговой организации НКЦ, количество ценных бумаг, в том числе КСУ, доступных для совершения операций на разделе определяет НКЦ по запросу НРД. При этом если к моменту Подбора ценных бумаг был осуществлен выпуск новых КСУ, НКЦ может включить их в число КСУ, доступных для подбора, с предварительным зачислением НРД новых КСУ на торговый раздел торгового счета депо Клиента.
  3. При Подборе ценных бумаг для исполнения первой части Сделки РЕПО c типом расчетов DVP-3, в первую очередь (в том числе ранее, чем выполнение действий, описанных в пункте 3.2 настоящего Приложения) для исполнения обязательств подбираются ценные бумаги, зачисляемые Заемщику в текущий операционный день по вторым частям Сделок РЕПО из той же Группы. При Подборе указанных ценных бумаг для исполнения первой части Сделки РЕПО, вторые части Сделок РЕПО ранжируются по уменьшению Текущей стоимости обязательств (в первую очередь подбираются ценные бумаги из вторых частей Сделок РЕПО с наибольшей Текущей стоимостью обязательств). Ценные бумаги, зачисляемые Заемщику в текущий операционный день по вторым частям Сделок РЕПО из других Групп, подбираются в последнюю очередь (после действий, описанных в пункте 3.4 настоящего Приложения). При Подборе ценных бумаг из вторых частей Сделок РЕПО приоритетность выпуска ценных бумаг, ISIN которого указан в Общем реестре Сделок РЕПО, не применяется.

В случае Подбора ценных бумаг из вторых частей Сделок РЕПО возможно возникновение ситуации, когда неисполнение обязательств по вторым частям Сделок РЕПО приведет к тому, что:

* + - * обязательства по первой части Сделки РЕПО не будут исполнены;
      * обязательства по первой части Сделки РЕПО будут исполнены за счет ценных бумаг, подобранных для Сделок РЕПО другой Группы и переведенных на тот же торговый счет депо, что приведет к неисполнению указанных Сделок РЕПО такой Группы.

НРД не несет ответственности за последствия неисполнения Сделок в указанных случаях.

* 1. При Подборе ценных бумаг для внесения Компенсационного взноса в случае выявления необеспеченности обязательств по итогам клирингового сеанса, в первую очередь подбираются ценные бумаги, зачисленные на раздел торгового счета депо Заемщика в результате расчетов по вторым частям сделок РЕПО в прошедшем клиринговом сеансе, независимо от того, промаркирован ли данный раздел торгового счета депо и ценные бумаги для Подбора в Обеспечение Сделок РЕПО.
  2. При Подборе ценных бумаг для Замены ценных бумаг, инициированной Заемщиком, указанная им предпочтительная ценная бумага подбирается в первую очередь при выполнении хотя бы одного из следующих условий:
     1. указанная ценная бумага имеет наивысший приоритет в соответствии с [Поручением на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1);
     2. Подбор указанной ценной бумаги осуществляется с промаркированного раздела, имеющего наивысший приоритет в соответствии с [Поручением на маркирование;](#_Поручение_на_Маркирование_1)
     3. ценные бумаги, имеющие более высокий приоритет в соответствии с [Поручением на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1), отсутствуют.
  3. При Замене ценных бумаг Заменяемые ценные бумаги выводятся в первую очередь из Сделок РЕПО, в которых Заменяемые ценные бумаги имеют наименьшую Дисконтированную стоимость.
  4. При Замене ценных бумаг без Подбора используются только ценные бумаги со счетов депо или разделов счетов депо, указанных в [Поручении на замену](#_Поручение_на_изменение) без Подбора.
  5. Порядок формирования клиринговых поручений или поручений на перевод ценных бумаг по результатам Подбора ценных бумаг.
     1. По результатам Подбора ценных бумаг НРД формирует служебные поручения на перевод ценных бумаг:
  + для исполнения обязательств по первой части Сделки РЕПО – поручение на перевод на раздел торгового счета депо Заемщика, который используется для расчетов по данной Сделке РЕПО.
  + для внесения Компенсационного взноса Заемщиком в пользу Кредитора – поручение на перевод на раздел торгового счета депо Кредитора, который используется для расчетов по данной Сделке РЕПО.
  + для внесения Компенсационного взноса Кредитором в пользу Заемщика – поручение на перевод на раздел торгового счета депо Заемщика, который используется для расчетов по данной Сделке РЕПО.
  + при Замене ценных бумаг – поручения на перевод Заменяющих ценных бумаг на раздел торгового счета депо Кредитора, который используется для расчетов по данной Сделке РЕПО, и поручение на перевод Заменяемых ценных бумаг на раздел счета депо Заемщика, указанный Заемщиком, или на раздел торгового счета депо Заемщика, который используется для расчетов по данной Сделке РЕПО.
  + для исполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО в Группе сделок междилерского РЕПО – поручение на перевод на раздел торгового счета депо Кредитора, который используется для расчетов по данной Сделке РЕПО.
  + кроме того, для расчета первых частей Сделок РЕПО с Глобальным кредитором, зарегистрированным в соответствии с полученным Реестром Сделок, в формируются клиринговые поручения на расчет первой части Сделки РЕПО и определяются обязательства по второй части Сделки РЕПО.

# Алгоритм проверки Обеспеченности обязательств, расчета размеров и структуры Компенсационного взноса

* 1. Стоимость обязательств и Обеспечения рассчитываются в российских рублях отдельно по каждой Группе сделок.
  2. Объектами проверки Обеспеченности обязательств являются:
  + при маржировании пула - Пул обязательств. Применяется для Групп сделок РЕПО с Глобальными кредиторами.
  + при посделочном маржировании - каждая Действующая Сделка РЕПО. Применяется для Группы сделок междилерского РЕПО.
  1. Дисконтированная стоимость ценных бумаг рассчитывается в российских рублях с применением официальных курсов валют Банка России, установленных на дату дисконтирования.
  2. Со стоимостью, равной 0 (нулю), учитываются следующие ценные бумаги:
  + не входящие в Корзину РЕПО;
  + ценные бумаги, по которым Кредитором в отношении Заемщика установлены дополнительные ограничения по совершению Сделок РЕПО (при наличии таких ограничений);
  + ценные бумаги с дисконтом, равным 100%.
  1. Дополнительно для каждой ценной бумаги, входящей в Обеспечение Сделки РЕПО, рассчитывается балансовая Расчетная стоимость, определяемая как СВ = СD \* LRi / Ci, где:

СD – Дисконтированная цена ценной бумаги, входящей в Обеспечение по i-ой Сделке РЕПО,

LRi – Сумма РЕПО по i-ой Сделке РЕПО, определенная на момент расчета,

Сi – Дисконтированная стоимость всех ценных бумаг, входящих в Обеспечение обязательства по i-ой Сделке РЕПО.

* 1. Дополнительно для каждой Сделки РЕПО рассчитывается Стоимость обратного выкупа, равная Li + ∑ LRi \* ri / Ni / 100 %, где

Li – Текущая стоимость обязательства по i-ой Сделке РЕПО,

LRi – Сумма РЕПО по i-ой Сделке РЕПО, определенная на момент расчета,

ri – Текущая ставка РЕПО по i-ой Сделке РЕПО в % годовых,

Ni – число дней в календарном году, соответствующее дате суммирования.

∑ - суммирование по числу календарных дней между текущей датой и датой второй части i-ой Сделки РЕПО, за которые начисляются проценты.

Определение числа таких дней, осуществляется в соответствии с Порядком.

* 1. При превышении отклонения размера обязательств от текущей стоимости Обеспечения на величину, превышающую Порог переоценки, возникает основание для внесения Стороной по Сделке Компенсационного взноса.
  2. Особенности Алгоритма проверки Обеспеченности обязательств по Сделкам РЕПО и расчета Компенсационного взноса по каждой Группе сделок определяются типом маржирования в данной Группе сделок.
  3. После каждой проверки Обеспеченности обязательств, кроме проверки в ходе Замены ценных бумаг, Клиентам выдается [Отчет об обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1).
  4. Если проверка Обеспеченности обязательств проводилась для расчета Компенсационных взносов[, Отчеты об обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1) направляются Клиентам только после определения НРД размера Компенсационных взносов.
  5. При исполнении Компенсационных взносов ценными бумагами в первую очередь исполняются обязательства Кредиторов по Компенсационным взносам, а затем обязательства Заемщиков.
  6. [Отчет об обеспеченности](#_Отчет_о_составе) выдается Заемщику и Кредитору и содержит следующую информацию:
     1. ***для Групп сделок с маржированием пула:***
        + Стоимость пула обязательств;
        + Стоимость Обеспечения пула обязательств;
        + Степень Обеспеченности пула обязательств;
        + Даты двух ближайших запланированных корпоративных действий, в связи с которыми ценные бумаги, входящие в Обеспечение, будут исключаться из Подбора в порядке, установленном пунктом 5 настоящего Приложения;
     2. ***для Групп сделок с посделочным маржированием:***
        + Стоимость обязательств по всем Действующим сделкам РЕПО;
        + Стоимость Обеспечения всех Действующих сделок РЕПО;
        + Сумму Компенсационного взноса в валюте Сделки РЕПО. Для Стороны по Сделке, у которой возникла обязанность по внесению Компенсационного взноса, размер Компенсационного взноса имеет отрицательное значение, для противоположной Стороны – положительное;
     3. ***для всех Групп сделок:***
        + Валюту, в которой выражены обязательства по Сделке РЕПО;
        + Структуру и Текущую стоимость каждого обязательства в российских рублях и в валюте Сделки РЕПО, срок исполнения, реквизиты счетов депо и банковских счетов;
        + Структуру и Дисконтированную стоимость ценных бумаг, входящих в Обеспечение каждого обязательства, в российских рублях;
        + Стоимость обратного выкупа по каждому обязательству в валюте Сделки РЕПО. Для Сделок РЕПО, заключенных с Плавающей ставкой РЕПО c использованием Индикативных ставок RUONmDS, RREFKmDS и RREFKEYR, по которым Датой расчета второй части является следующий операционный день, Стоимость обратного выкупа, указываемая в отчетах после утренней переоценки, является окончательной, за исключением случаев последующей уплаты денежных компенсационных взносов;
        + Сумму РЕПО в валюте Сделки;
        + Курс иностранной валюты, в которой выражены обязательства по Сделке РЕПО, к российскому рублю;
        + Ставку РЕПО (Фиксированную или Плавающую);
        + Обеспеченность каждого обязательства;
        + Поле «Право установить/приблизить Дату второй части Сделки РЕПО»[[5]](#footnote-5) (указывается Сторона по Сделке, имеющая возможность изменять Дату второй части Сделки РЕПО в соответствии с выбранным параметром в поле «Право переопределения даты исполнения» в поручениях Клиентов по форме MF194 (Перечень клиринговых документов), а также Сторона по Сделке, в отношении которой не были исполнены обязательства по Сделке РЕПО);
        + Курс иностранной валюты, в которой выражен номинал долговой ценной бумаги или цена ценной бумаги, переданной Кредитору, к российскому рублю, используемый при расчете Дисконтированной цены, по которой ценная бумага принимается в Обеспечение;
        + Расчетную стоимость ценных бумаг, входящих в Обеспечение каждого обязательства, в российских рублях и в валюте Сделки РЕПО;
        + Рыночную стоимость ценных бумаг, входящих в Обеспечение каждого обязательства (в печатной форме не отражается);
        + Место и дату заключения Сделки РЕПО.
        + Цена ценных бумаг, указанная в полях «Рыночная цена в рублях» и «Дисконтированная цена», является Рыночной ценой текущего дня, рассчитанной при переоценке ценных бумаг в соответствии с Порядком.

## 

## ЧАСТЬ II. ОСОБЕННОСТИ АЛГОРИТМА ПОДБОРА ЦЕННЫХ БУМАГ, ПРОВЕРКИ ОБЕСПЕЧЕННОСТИ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ И РАСЧЕТА КОМПЕНСАЦИОННОГО ВЗНОСА ДЛЯ СДЕЛОК РЕПО С ГЛОБАЛЬНЫМ КРЕДИТОРОМ

# Особенности Алгоритма Подбора ценных бумаг

* 1. При Подборе ценных бумаг дополнительно из упорядоченного списка выпусков ценных бумаг исключаются:
     1. ***По Группе сделок с Банком России:***
        + выпуски ценных бумаг, не входящие в перечень ценных бумаг, соответствующий Дополнительному идентификатору Корзины РЕПО Банка России, указанному в Общем реестре Сделок РЕПО, направленном в НРД при регистрации соответствующей Сделки РЕПО, за исключением случаев, когда указанная в Сделке Корзина РЕПО считается переменной;
        + ценные бумаги, по которым Кредитором в отношении Заемщика установлены дополнительные ограничения по совершению Сделок РЕПО;
        + ценные бумаги в дату фиксации состава участников запланированных корпоративных действий с ними, либо в рабочий день, предшествующий такой дате, если согласно Решению о выпуске Ценной бумаги и/или действующему законодательству фиксация производится по состоянию на начало операционного дня.

Информация о корпоративных действиях, в даты фиксации состава участников по которым НРД осуществляет исключение ценных бумаг из Подбора по Сделкам РЕПО Банка России, раскрывается в разделе «Состав корзин и цены по сделкам РЕПО Глобальных кредиторов» - «Рыночные цены, НКД и корпоративные действия ценных бумаг для сделок с Банком России» на Сайте. В случае отсутствия в вышеуказанном разделе информации о типе и дате текущего/планового корпоративного действия по ценным бумагам их исключение из Подбора по Сделкам РЕПО Банка России в даты фиксации состава участников таких корпоративных действий не осуществляется;

* + - * облигации Банка России, дата фиксации состава участников запланированных корпоративных действий по которым приходится на период с Даты первой части Сделки РЕПО до второго рабочего дня, следующего за Датой второй части Сделки РЕПО, либо до третьего рабочего дня, следующего за Датой второй части Сделки РЕПО, если согласно Решению о выпуске Ценной бумаги и/или действующему законодательству фиксация состава участников указанных корпоративных действий производится по состоянию на начало операционного дня;
      * облигации, если текущий операционный день, в который происходит Подбор ценных бумаг, приходится на период с даты, следующей за датой фиксации участников запланированного корпоративного действия по выплате купонного дохода либо по частичному погашению номинальной стоимости, до запланированной даты такого корпоративного действия, исключая такую дату;
      * ценные бумаги, выпуски которых должны быть списаны со счетов депо в результате корпоративных действий (погашение, конвертация и т.п.), и фиксация состава участников таких корпоративных действий осуществляется в текущий операционный день или состоялась ранее;
      * ценные бумаги из перечня, приведенного в [Приложении](#_Перечень_выпусков_облигаций_1) [5](#_Перечень_выпусков_облигаций_1) к Порядку, если текущий операционный день либо дата второй части Сделки РЕПО, с которой связан Подбор ценных бумаг, попадает в период, когда, согласно Решению о выпуске этих ценных бумаг, операции по счетам депо, связанные с их обращением, запрещены;
      * Заменяемые ценные бумаги, если Подбор ценных бумаг осуществляется для Замены ценных бумаг.
    1. ***По Группам сделок с Федеральным казначейством:***
       - облигации, выпущенные от имени Российской Федерации, дата фиксации состава участников запланированных корпоративных действий по которым, за исключением выплаты купонного дохода, приходится на период с Даты первой части Сделки РЕПО до даты, предшествующей Дате исполнения второй части Сделки РЕПО, либо до Даты исполнения второй части Сделки РЕПО, если согласно Решению о выпуске Ценной бумаги и/или действующему законодательству фиксация состава участников указанных корпоративных действий производится по состоянию на начало операционного дня;
       - облигации с ипотечным покрытием, обеспеченные поручительством АО «ДОМ.РФ», дата фиксации состава участников запланированных корпоративных действий по которым, за исключением выплаты купонного дохода и частичного погашения номинальной стоимости, приходится на период с Даты первой части Сделки РЕПО до даты, предшествующей Дате исполнения второй части Сделки РЕПО, либо до Даты исполнения второй части Сделки РЕПО, если согласно Решению о выпуске Ценной бумаги и/или действующему законодательству фиксация состава участников указанных корпоративных действий производится по состоянию на начало операционного дня;
       - облигации, если текущий операционный день, в который происходит Подбор ценных бумаг, приходится на период с даты, следующей за датой фиксации участников запланированного корпоративного действия по выплате купонного дохода либо по частичному погашению номинальной стоимости, до запланированной даты такого корпоративного действия, исключая такую дату;
       - ценные бумаги, выпуски которых должны быть списаны со счетов депо в результате корпоративных действий (погашение, конвертация и т.п.), и фиксация состава участников таких корпоративных действий осуществляется в текущий операционный день или состоялась ранее;
       - Заменяемые ценные бумаги, если Подбор ценных бумаг осуществляется для Замены ценных бумаг по поручению Заемщика.
    2. ***По Группе сделок с Комитетом финансов Санкт-Петербурга:***
       - ценные бумаги, дата фиксации состава участников запланированных корпоративных действий по которым приходятся на период с Даты первой части Сделки РЕПО до даты, предшествующей Дате второй части Сделки РЕПО, либо до Даты второй части Сделки РЕПО, если согласно Решению о выпуске Ценной бумаги и/или действующему законодательству фиксация состава участников указанных корпоративных действий производится по состоянию на начало операционного дня;
       - облигации, если текущий операционный день, в который происходит Подбор ценных бумаг, приходится на период с даты, следующей за датой фиксации участников запланированного корпоративного действия по выплате купонного дохода либо по частичному погашению номинальной стоимости, до запланированной даты такого корпоративного действия, исключая такую дату;
       - ценные бумаги, выпуски которых должны быть списаны со счетов депо в результате корпоративных действий (погашение, конвертация и т.п.), и фиксация состава участников таких корпоративных действий осуществляется в текущий операционный день или состоялась ранее;
       - Заменяемые ценные бумаги, если Подбор ценных бумаг осуществляется для Замены ценных бумаг по поручению Заемщика;
       - ценные бумаги из перечня, приведенного в [Приложении](#_Расписание_действий_по_2) [5](#_Перечень_выпусков_облигаций_1) к Порядку, если текущий операционный день либо дата второй части Сделки РЕПО, с которой связан Подбор ценных бумаг, попадает в период, когда, согласно Решению о выпуске этих ценных бумаг, операции по счетам депо, связанные с их обращением, запрещены.
    3. ***По Группе сделок с Комитетом финансов Ленинградской области:***
       - ценные бумаги, дата фиксации состава участников запланированных корпоративных действий по которым приходятся на период с Даты первой части Сделки РЕПО до даты, предшествующей Дате второй части Сделки РЕПО, либо до Даты второй части Сделки РЕПО, если согласно Решению о выпуске Ценной бумаги и/или действующему законодательству фиксация состава участников указанных корпоративных действий производится по состоянию на начало операционного дня;
       - облигации, выпущенные от имени Ленинградской области, дата фиксации состава участников запланированных корпоративных действий по которым приходится на период с Даты первой части Сделки РЕПО до второго рабочего дня, следующего за Датой второй части Сделки РЕПО, либо до третьего рабочего дня, следующего за Датой второй части Сделки РЕПО, если согласно Решению о выпуске Ценной бумаги и/или действующему законодательству фиксация состава участников указанных корпоративных действий производится по состоянию на начало операционного дня;
       - облигации, если текущий операционный день, в который происходит Подбор ценных бумаг, приходится на период с даты, следующей за датой фиксации участников запланированного корпоративного действия по выплате купонного дохода либо по частичному погашению номинальной стоимости, до запланированной даты такого корпоративного действия, исключая такую дату;
       - ценные бумаги, выпуски которых должны быть списаны со счетов депо в результате корпоративных действий (погашение, конвертация и т.п.), и фиксация состава участников таких корпоративных действий осуществляется в текущий операционный день или состоялась ранее;
       - Заменяемые ценные бумаги, если Подбор ценных бумаг осуществляется для Замены ценных бумаг по поручению Заемщика;
       - ценные бумаги из перечня, приведенного в [Приложении](#_Перечень_выпусков_облигаций_1) [5](#_Перечень_выпусков_облигаций) к Порядку, если текущий операционный день либо дата второй части Сделки РЕПО, с которой связан Подбор ценных бумаг, попадает в период, когда, согласно Решению о выпуске этих ценных бумаг, операции по счетам депо, связанные с их обращением, запрещены.
  1. Подбор ценных бумаг для обеспечения первой части Сделок РЕПО с Банком России осуществляется с учетом следующей приоритетности Сделок РЕПО:
     + - Сделки РЕПО, обязательства по которым выражены в иностранной валюте, заключенные на срок более 90 дней;
       - Сделки РЕПО, обязательства по которым выражены в иностранной валюте, заключенные на срок менее 90 дней;
       - Сделки РЕПО, обязательства по которым выражены в российских рублях.
  2. В Группе сделок с Банком России Подбор ценных бумаг осуществляется с учетом контроля Минимального лота ценных бумаг.
  3. При Подборе ценных бумаг для внесения Компенсационного взноса в случае выявления необеспеченности обязательств по итогам клирингового сеанса, в первую очередь подбираются ценные бумаги, зачисленные на раздел торгового счета депо Заемщика в результате расчетов по вторым частям сделок РЕПО в прошедшем клиринговом сеансе, независимо от того, промаркирован ли данный раздел торгового счета депо и ценные бумаги для Подбора в Обеспечение Сделок РЕПО.

# Особенности проверки Обеспеченности обязательств

* 1. Объектом проверки Обеспеченности обязательств является Пул обязательств – маржирование пула.
  2. При маржировании пула стоимость Пула обязательств Заемщика (Lp) определяется как сумма Текущих стоимостей обязательств Заемщика по всем Действующим Сделкам РЕПО с одним Кредитором на дату расчета;
  3. Стоимость Обеспечения Пула обязательств Заемщика (Сp) определяется, как сумма Дисконтированных стоимостей всех ценных бумаг, входящих в Обеспечение Пула обязательств.
  4. Для каждого Заемщика определяется Порог переоценки «X».
  5. Степень Обеспеченности Пула обязательств Заемщика перед Кредитором определяется разностью между стоимостью пула обязательств и стоимостью Обеспечения Пула обязательств (Lp – Cp):

Если Lp – Cp > X, то Пул обязательств считается необеспеченным;

Если Lp – Cp < -Х, то пул обязательств считается переобеспеченным;

Если Х ≥ Lp - Cp ≥ -X, то Пул обязательств считается обеспеченным.

* 1. Степень Обеспеченности обязательств Заемщика перед Кредитором по конкретной Сделке РЕПО, входящей в Пул обязательств, является справочной величиной. Максимально допустимый размер необеспеченности обязательства i-ой Сделки РЕПО Xi рассчитывается по формуле:

Xi = X \* Li / Lp, где

Li – Текущая стоимость обязательства Заемщика i-ой Сделки РЕПО;

Ci – Дисконтированная стоимость ценных бумаг, входящих в Обеспечение обязательства i-ой Сделки РЕПО.

Если Li – Ci > Xi, то обязательства по Сделке РЕПО считается необеспеченным.

Если Li – Ci < -Хi, то обязательство по Сделке РЕПО считается переобеспеченным.

Если Хi ≥ Li – Ci ≥ -Xi, то обязательство по Сделке РЕПО считается обеспеченным.

# Особенности расчета Компенсационного взноса

* 1. Если Пул обязательств не обеспечен, возникает **обязательство Заемщика** по Компенсационному взносу.
     1. Размер Компенсационного взноса равен разности стоимости Пула обязательств и стоимости Обеспечения Пула обязательств (Lp – Cp). При Подборе ценных бумаг для Компенсационного взноса его размер может быть увеличен, но не более, чем на Дисконтированную стоимость одной ценной бумаги Обеспечения, в соответствии с Алгоритмами.
     2. При определении состава и количества ценных бумаг конкретных выпусков, необходимых для внесения Компенсационного взноса Сделки РЕПО ранжируются по возрастанию степени Обеспеченности обязательств (Li – Ci) (в первую очередь исполняется внесение Компенсационного взноса по Сделкам РЕПО с наименьшей степенью Обеспеченности). Подбор ценных бумаг производится в каждую Сделку РЕПО последовательно в соответствии с Алгоритмами.
     3. Ценные бумаги, в отношениии выпусков которых установлен контроль Минимального лота и количество которых в Обеспечении Сделки РЕПО меньше Минимального лота, подбираются в первую очередь.
     4. Подбор ценных бумаг прекращается, когда суммарная Дисконтированная стоимость подобранных во все Сделки РЕПО ценных бумаг достигнет размера определенного Компенсационного взноса либо превысит его на величину меньшую, чем Дисконтированная стоимость одной ценной бумаги выпуска, участвующего в текущей итерации расчетов.
     5. Если по окончании последнего клирингового сеанса Подбор ценных бумаг для Компенсационного взноса не привел к исполнению обязательства по внесению Компенсационного взноса, то Компенсационный взнос в Группе сделок РЕПО с Банком России может быть уплачен в виде денежных средств.
     6. Компенсационный взнос дополнительно выплачивается в виде денежных средств на сумму разности стоимости Пула обязательств и стоимости Обеспечения обязательств пула (Lp – Cp) в ходе последнего клирингового сеанса текущего дня. При расчёте суммы Компенсационного взноса в виде денежных средств также учитывается, что она не может превышать общего объема всех Сумм РЕПО Заемщика, уменьшенных на минимальную Сумму РЕПО, равную 1 (одной) денежной единице в валюте Сделки РЕПО. Компенсационный взнос в виде денежных средств уплачивается за счет денежных средств на торговых банковских счетах Заемщика.
     7. Компенсационный взнос в виде денежных средств формируется в валюте, в которой выражены обязательства по Сделке РЕПО. В случае недостаточности денежных средств для уплаты Компенсационного взноса Компенсационный взнос по Сделкам РЕПО, обязательства по которым выражены в российских рублях, может быть уплачен в иностранной валюте при условии, что у Заемщика и Кредитора открыты торговые банковские счета в соответствующей иностранной валюте, зарегистрированные для исполнения обязательств, допущенных к клирингу НРД.
     8. Уплата Компенсационного взноса в российских рублях по Сделкам РЕПО, обязательства которых выражены в иностранной валюте, не осуществляется.
     9. Для Сделок РЕПО, обязательства по которым выражены в иностранной валюте, уплата Компенсационного взноса в иной иностранной валюте не осуществляется.
     10. Сумма денежных средств Компенсационного взноса, выплаченная в иностранной валюте, для дальнейшего распределения по обязательствам Заемщика пересчитывается в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату выплаты Компенсационного взноса.
     11. При уплате Компенсационного взноса денежными средствами Сделки РЕПО ранжируются по возрастанию степени Обеспеченности обязательств (Li – Ci) (в первую очередь уплачивается Компенсационный взнос по Сделкам РЕПО с наименьшей степенью Обеспеченности).
     12. Уплата Компенсационного взноса прекращается при достижении суммы денежных средств, уплаченных по всем Сделкам РЕПО, размера определенного Компенсационного взноса в виде денежных средств.
     13. По Группам сделок с Федеральным казначейством уплата Компенсационного взноса в виде денежных средств не допускается.
  2. **Обязательство Кредитора** по Компенсационному взносу возникает, если пул обязательств переобеспечен. Количество ценных бумаг для исполнения обязательства по внесению Компенсационного взноса определяется следующим путем:
     1. выбирается Сделка РЕПО с наибольшей Обеспеченностью обязательств, и в которой более чем 1 (одна) ценная бумага. Если таких сделок несколько, выбирается Сделка РЕПО с наименьшим референсом;
     2. из выпусков ценных бумаг, входящих в Обеспечение обязательств по данной Сделке РЕПО, выбираются выпуски ценных бумаг, количество которых меньше Минимального лота (для Группы сделок РЕПО с Банком России). Из них выбираются выпуски ценных бумаг с наименьшим дисконтом. Из них выбирается ценная бумага с наибольшей Дисконтированной стоимостью. В случае отсутствия в Обеспечении Сделок РЕПО с Банком России ценных бумаг, количество которых меньше Минимального лота, в первую очередь выбираются ценные бумаги с наименьшим дисконтом, а из них выбирается ценная бумага с наибольшей Дисконтированной стоимостью;
     3. данный выпуск ценной бумаги определяется входящим в Компенсационный взнос. Стоимость Обеспечения обязательства по данной Сделке РЕПО уменьшается на суммарную Дисконтированную стоимость ценных бумаг данного выпуска;
     4. действия пунктов 7.2.1-7.2.3 настоящего Приложения повторяются до тех пор, пока стоимость Обеспечения превышает суммарную стоимость обязательства больше чем на величину Дисконтированной стоимости одной ценной бумаги выпуска, участвующего в текущей итерации расчетов.
  3. По результатам внесения Компенсационного взноса Клиентам направляется [Отчет о регистрации обязательств](#_Отчет_о_регистрации/изменении).

# Перенос даты второй части Сделки РЕПО.

* 1. Если обязательства по второй части Сделки РЕПО с текущей Датой второй части Сделки РЕПО, не были исполнены в последний клиринговый сеанс, то Перенос даты второй части Сделки РЕПО осуществляется при одновременном соблюдении следующих условий:
     1. Возможность Переноса даты второй части Сделки РЕПО предусмотрена Генеральным соглашением с Глобальным кредитором.
     2. Количество Переносов даты второй части Сделки РЕПО по Сделке РЕПО меньше трех.
     3. Срок РЕПО с учетом Переноса даты второй части Сделки РЕПО не превышает 365 дней.
     4. Обязательства по Действующим Сделкам РЕПО не являются необеспеченными.
     5. Не поступало [Одностороннее поручение](#_Поручение_на_изменение_1) от Кредитора, в котором дата исполнения Сделки РЕПО изменена на более раннюю или оставлена без изменения.
  2. Если результаты проверки по условиям, предусмотренным пунктом 8.1 настоящего Приложения, положительные, НРД:
     1. формирует служебное поручение на изменение Даты второй части Сделки РЕПО на следующий операционный день;
     2. направляет Клиентам [Отчет о регистрации обязательств](#_Отчет_о_регистрации/изменении_1) с информацией о Переносе даты второй части Сделки РЕПО.
  3. Стоимость обратного выкупа за период между датой неперечисления Заемщиком денежных средств по второй части Сделки РЕПО и Датой второй части Сделки РЕПО, измененной в результате Переноса даты второй части Сделки РЕПО, по Сделке РЕПО, обязательства по которой выражены в российских рублях, рассчитывается по формуле:

S2 = L + ∑ LR \* r / N / 100 %, где

S2 – Стоимость обратного выкупа за период между датой неперечисления Заемщиком денежных средств по второй части Сделки РЕПО и Датой второй части Сделки РЕПО, измененной в результате Переноса даты второй части Сделки РЕПО,

L – Текущая стоимость обязательства по Сделке РЕПО,

LR – Сумма РЕПО по Сделке РЕПО, определенная на момент расчета,

r – значение в % годовых фиксированной ставки, установленной Банком России для проведения операций РЕПО с Банком России по фиксированной ставке на дату осуществления Переноса даты второй части Сделки РЕПО,

∑ – суммирование по фактическому числу календарных дней, между текущей датой, включая указанную дату, и Датой второй части i-ой Сделки РЕПО, измененной в результате Переноса даты второй части Сделки РЕПО, исключая такую дату,

N – число дней в календарном году, соответствующем дате суммирования.

* 1. Стоимость обратного выкупа за период между датой неперечисления Заемщиком денежных средств по второй части Сделки РЕПО и Датой второй части Сделки РЕПО, измененной в результате Переноса даты второй части Сделки РЕПО, по Сделке РЕПО, обязательства по которой выражены в иностранной валюте, рассчитывается по формуле:

S2 = L + ∑ LR \* 2 \* r / N / 100 %, где

S2, L, LR, ∑ и N приведены в пункте 8.3 настоящего Приложения,

r – Текущая ставка РЕПО в % годовых на дату заключения Сделки РЕПО.

* 1. Если результаты проверки по условиям, предусмотренным пунктом 8.1 настоящего Приложения, отрицательные, то Перенос даты второй части Сделки РЕПО не осуществляется и Обязательства по второй части Сделки РЕПО считаются неисполненными. Клиентам направляется [Отчет о регистрации обязательств](#_Отчет_о_регистрации/изменении_1) с информацией о прекращении учета обязательств по Сделке РЕПО без расчета, [Отчет об обязательствах по прекращенной Сделке РЕПО](#_Отчет_об_обязательствах_1) и отчет по форме [MS194](https://www.nsd.ru/documents/clearing/) (Перечень клиринговых документов).

## ЧАСТЬ III. ОСОБЕННОСТИ АЛГОРИТМА ПОДБОРА ЦЕННЫХ БУМАГ, ПРОВЕРКИ ОБЕСПЕЧЕННОСТИ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ И РАСЧЕТА КОМПЕНСАЦИОННОГО ВЗНОСА ДЛЯ СДЕЛОК МЕЖДИЛЕРСКОГО РЕПО

# Особенности Алгоритма Подбора ценных бумаг

* 1. При Подборе ценных бумаг дополнительно из упорядоченного списка выпусков ценных бумаг исключаются:
     1. ценные бумаги из перечня, приведенного в [Приложении](#_Перечень_выпусков_облигаций_1) [5](#_Перечень_выпусков_облигаций_1) к Порядку, если текущий операционный день либо Дата второй части Сделки РЕПО, с которой связан Подбор ценных бумаг, попадает в период, когда, согласно Решению о выпуске этих ценных бумаг, операции по счетам депо, связанные с их обращением, запрещены;
     2. клиринговые сертификаты участия;
     3. ценные бумаги, эмитентом которых является Кредитор, если в Сделке РЕПО в качестве счета депо Кредитора указан счет депо владельца;
     4. инвестиционные паи паевого инвестиционного фонда, управляющей компанией которого является Кредитор;
     5. иностранные ценные бумаги, попадающие под требования FATCA в случае, если одна из Сторон по Сделке РЕПО не участвует либо уклоняется от идентификации в соответствии с требованиями FATCA;
     6. ценные бумаги, предназначенные для квалифицированных инвесторов, если хотя бы одна из Сторон по Сделке РЕПО не является квалифицированным инвестором по данному виду ценной бумаги, но при этом в Сделке РЕПО в качестве счета депо Кредитора или Заемщика указан счет депо владельца;
     7. ценные бумаги, по которым установлены ограничения на проведение операций по счетам депо[[6]](#footnote-6).
  2. В случае использования Реюза в Сделке междилерского РЕПО при Подборе ценных бумаг перед расчетом второй части Сделки РЕПО, при исполнении [Поручения на замену](#_Поручение_на_изменение), а также для внесения Кредитором Компенсационного взноса, используются ценные бумаги с разделов счетов депо, промаркированных в [Поручении на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1) с типом Маркирования CRED, начиная с раздела счета депо с максимальным приоритетом.

# Особенности проверки Обеспеченности обязательств

* 1. Объектом проверки Обеспеченности обязательств при посделочном маржировании является каждая Действующая Сделка РЕПО.
  2. Стоимость Обеспечения Сделки РЕПО (Ci) определяется как сумма Дисконтированных стоимостей всех ценных бумаг, входящих в Обеспечение Сделки РЕПО.
  3. Максимально допустимый размер необеспеченности обязательства Сделки РЕПО Xin рассчитывается по формуле:

Xin = Li\* Ti, где

Тi – нижний Порог переоценки по Сделке РЕПО в %;

Li – Текущая стоимость обязательства Заемщика по i-ой Сделки РЕПО.

Максимально допустимый размер переобеспеченности обязательств Сделки РЕПО Xip рассчитывается по формуле:

Xip = Li\* Ti, где

Тi – верхний Порог переоценки по Сделке РЕПО в %;

Li – Текущая стоимость обязательства Заемщика по i-ой Сделки РЕПО.

* 1. Степень Обеспеченности обязательств Заемщика по конкретной Сделке междилерского РЕПО, определяется разностью между Текущей стоимостью обязательств и стоимостью Обеспечения по данной Сделке РЕПО (Li – Ci):

Если Li – Ci > Xin, то обязательство по Сделке РЕПО считается необеспеченным.

Если Li–Ci<-Хip, то обязательство по Сделке РЕПО считается переобеспеченным.

Если Хin ≥ Li – Ci ≥ -Xip, то обязательство по Сделке РЕПО считается обеспеченным.

# Особенности расчета Компенсационного взноса

* 1. **Обязанность Заемщика** по внесению Компенсационного взноса возникает, если обязательства по Действующей сделке РЕПО не обеспечены.
     1. Размер Компенсационного взноса равен разности стоимости обязательства по данной Сделке РЕПО и стоимости Обеспечения обязательств по Сделке РЕПО (Li – Ci).
     2. Подбор ценных бумаг производится в Сделку РЕПО в соответствии с Алгоритмами и прекращается, когда суммарная Дисконтированная стоимость подобранных ценных бумаг в Сделке РЕПО достигнет размера определенного Компенсационного взноса либо превысит его на величину, меньшую Дисконтированной стоимости одной ценной бумаги выпуска, участвующего в текущей итерации расчетов.
  2. **Обязанность Кредитора** по внесению Компенсационного взноса возникает, если обязательства по Действующей Сделке РЕПО переобеспечены.
     1. Размер Компенсационного взноса равен разности стоимости Обеспечения обязательств по Сделке РЕПО и стоимости обязательства по данной Сделке РЕПО (Сi – Li).
     2. Для формирования Компенсационного взноса из выпусков ценных бумаг, входящих в Обеспечение обязательств по данной Сделке РЕПО, выбираются выпуски ценной бумаги с наименьшим дисконтом.
     3. Подбор продолжается до тех пор, пока стоимость Обеспечения отличается от суммарной стоимости обязательства больше чем на Дисконтированную стоимость одной ценной бумаги выпуска, участвующего в текущей итерации расчетов.
  3. Если по окончании последнего клирингового сеанса обязательства по Сделке РЕПО остались необеспеченными, то Компенсационный взнос может быть уплачен денежными средствами.
     1. Компенсационный взнос дополнительно выплачивается денежными средствами на сумму разности стоимости обязательств и стоимости Обеспечения Сделки РЕПО (Li-Ci или Ci-Li) в ходе последнего клирингового сеанса текущего операционного дня.
     2. Компенсационный взнос в виде денежных средств формируется в валюте, в которой выражены обязательства по Сделке междилерского РЕПО.
     3. При расчёте суммы денежных средств Компенсационного взноса Заемщика учитывается, что она не может превышать Сумму РЕПО Заемщика по данной Сделке РЕПО, уменьшенную на минимальную Сумму РЕПО, равную 1 (одной) денежной единице в валюте сделки.
     4. Компенсационный взнос денежными средствами уплачивается за счет денежных средств на торговых банковских счетах Стороны по Сделке РЕПО.
     5. При уплате Компенсационного взноса денежными средствами Сделки РЕПО ранжируются по возрастанию степени обеспеченности (переобеспеченности) обязательств (в первую очередь уплачивается Компенсационный взнос по Сделкам РЕПО с наименьшей степенью обеспеченности либо с наибольшей степенью переобеспеченности).
     6. Уплата Компенсационного взноса прекращается при достижении суммы денежных средств, уплаченных по Сделке РЕПО, размера определенного Компенсационного взноса в виде денежных средств либо при отсутствии денежных средств на торговых банковских счетах Клиента.
  4. По результатам уплаты Компенсационного взноса Клиентам направляется [Отчет о регистрации обязательств](#_Отчет_о_регистрации/изменении_1).
  5. При уплате Компенсационных взносов денежными средствами в первую очередь исполняются обязательства Кредиторов по внесению Компенсационных взносов, а затем обязательства Заемщиков.

## ЧАСТЬ IV. АЛГОРИТМ ПОДБОРА ЦЕННЫХ БУМАГ ДЛЯ ОБСЛУЖИВАНИЯ КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ НКЦ

# Общие принципы Подбора ценных бумаг

* 1. Подбор ценных бумаг производится с учетом следующей информации:
     + оценочной стоимости ценных бумаг, входящих в Перечень.
     + дополнительных ограничений, установленных НКЦ в отношении ценных бумаг, подбираемых на определенный счет депо/раздел счета депо/субчет депо.
     + согласия Клиента на Подбор ценных бумаг из Обеспечения Сделок РЕПО с Глобальными кредиторами.
  2. Упорядоченный список доступных для Подбора выпусков ценных бумаг составляется в соответствии с предоставленным Клиентом [Поручением на маркирование](#_Поручение_на_маркирование) с учетом указанных в нем приоритетов и максимального количества ценных бумаг.
  3. В случаях, установленных пунктом 48.10 Порядка, составляется дополнительный упорядоченный список выпусков ценных бумаг, находящихся в Обеспечении Сделок РЕПО с Глобальными кредиторами.
  4. Из упорядоченных списков выпусков ценных бумаг исключаются ценные бумаги, не входящие в Перечень ценных бумаг НКЦ.
  5. Подбор осуществляется последовательно по каждому из упорядоченных списков (сначала по списку, составленному в соответствии с [Поручением на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1), затем по дополнительному списку).
  6. При Подборе ценные бумаги ранжируются по Оценочной стоимости (в первую очередь подбираются ценные бумаги с наибольшей Оценочной стоимостью).
  7. При Подборе ценных бумаг из Обеспечения Сделок РЕПО с Глобальными кредиторами ценные бумаги подбираются из Групп сделок в последовательности, определенной в пункте 3.3 настоящего Приложения.

# Порядок Подбора ценных бумаг по сумме Подбора.

* 1. Из упорядоченного списка доступных для Подбора выпусков ценных бумаг (а также из дополнительного списка при его наличии) дополнительно исключаются:
     + ценные бумаги, по которым НКЦ установлены дополнительные ограничения в отношении Подбора на счет депо/раздел счета депо/субсчет депо Клиента;
     + ценные бумаги с нулевой Оценочной стоимостью.
  2. Подбор ценных бумаг, включенных в упорядоченный список доступных для Подбора выпусков, осуществляется последовательно и прекращается при выполнении одного из условий:
     + превышении суммарной Оценочной стоимости подобранных ценных бумаг требуемой суммы Подбора на величину, меньшую Оценочной стоимости одной ценной бумаги выпуска, участвующего в текущей итерации расчетов;
     + включении в число подобранных всех ценных бумаг из упорядоченного списка доступных для Подбора выпусков ценных бумаг (осуществление частичного Подбора в максимально возможном размере от суммы Подбора).

# Порядок Подбора ценных бумаг по списку.

* 1. Из упорядоченного списка доступных для Подбора выпусков ценных бумаг (а также из дополнительного списка при его наличии) дополнительно исключаются:
     + ценные бумаги, не указанные в [Поручении на подбор](#_Поручение_на_Подбор_1);
     + ценные бумаги, указанные в [Поручении на подбор](#_Поручение_на_Подбор_1) с максимально возможным для Подбора количеством, равным 0.
  2. Подбор ценных бумаг, включенных в упорядоченный список доступных для Подбора выпусков, осуществляется последовательно и прекращается при выполнении одного из условий:
     + включении в число подобранных всех указанных в [Поручении на подбор](#_Поручение_на_Подбор_1) выпусков ценных бумаг в указанном количестве;
     + включении в число подобранных всех ценных бумаг из упорядоченного списка доступных для Подбора выпусков ценных бумаг (осуществление частичного Подбора в максимально возможном размере от указанного в [Поручении на подбор](#_Поручение_на_подбор) списка ценных бумаг).

# Порядок Подбора ценных бумаг при одновременном указании в [Поручении на подбор](#_Поручение_на_подбор) суммы Подбора и списка ценных бумаг.

* 1. Дополнительно из упорядоченного списка выпусков ценных бумаг (а также из дополнительного списка при его наличии) исключаются:
     + ценные бумаги, по которым НКЦ установлены дополнительные ограничения в отношении Подбора на счет депо/раздел счета депо/субсчет депо Клиента;
     + ценные бумаги с нулевой Оценочной стоимостью;
     + ценные бумаги, указанные в [Поручении на подбор](#_Поручение_на_подбор) с максимально возможным для Подбора количеством, равным 0.
  2. При указании в [Поручении на подбор](#_Поручение_на_Подбор_1) суммы Подбора и списка ценных бумаг, указанные в списке ценные бумаги, подбираются в первую очередь.
  3. Если суммарная Оценочная стоимость всех подобранных ценных бумаг в соответствии со списком, указанном в [Поручении на подбор](#_Поручение_на_Подбор_1), меньше суммы подбора, то производится дальнейший Подбор ценных бумаг до достижения суммарной стоимости подобранных ценных бумаг суммы подбора.
  4. Подбор ценных бумаг, включенных в упорядоченный список доступных для подбора выпусков, осуществляется последовательно и прекращается при выполнении одного из условий:
     + превышении суммарной Оценочной стоимости подобранных ценных бумаг требуемой суммы подбора на величину, меньшую Оценочной стоимости одной ценной бумаги выпуска, участвующего в текущей итерации расчетов;
     + включении в число подобранных всех ценных бумаг из упорядоченного списка доступных для Подбора выпусков ценных бумаг (осуществление частичного Подбора в максимально возможном размере от суммы подбора).
  5. По результатам Подбора ценных бумаг НРД формирует служебное поручение на перевод подобранных ценных бумаг на указанный в [Поручении на подбор](#_Поручение_на_Подбор_1) раздел счета депо/субсчет депо.
  6. При Подборе ценных бумаг с торговых разделов торговых счетов депо, открытых с указанием в качестве клиринговой организации НКЦ, количество ценных бумаг, доступных для Подбора, определяет НКЦ по запросу НРД.

## ЧАСТЬ V. АЛГОРИТМ ПОДБОРА ЦЕННЫХ БУМАГ ДЛЯ ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ DVP

# Алгоритм Подбора ценных бумаг

* 1. Подбор ценных бумаг производится последовательно по каждой ценной бумаге в соответствии с количеством, указанном в клиринговом поручении Продавца ценных бумаг.
  2. Упорядоченный список доступных для Подбора выпусков ценных бумаг составляется в соответствии с [Поручением на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1), поданным Продавцом, с учетом указанных в [Поручении на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1) приоритетов и максимального количества ценных бумаг, доступных для Подбора.
  3. Из упорядоченного списка ценных бумаг исключаются ценные бумаги, не указанные в клиринговом поручении.
  4. В случае наличия на торговом счете Продавца ценных бумаг из указанного в клиринговом поручении выпуска, требуемое для подбора количество ценных бумаг данного выпуска уменьшается на количество имеющихся ценных бумаг.
  5. Подбор ценных бумаг прекращается при выполнении одного из условий:
     1. включение в число подобранных всех указанных в клиринговом поручении выпусков ценных бумаг в требуемом для подбора количестве;
     2. включение в число подобранных всех указанных в клиринговом поручении выпусков ценных бумаг, доступных для Подбора в соответствии с [Поручением на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1).
  6. По результатам Подбора ценных бумаг НРД формирует служебное поручение на перевод подобранных ценных бумаг на торговый счет депо Продавца.
  7. При Подборе ценных бумаг с торговых разделов торговых счетов депо, открытых с указанием в качестве клиринговой организации НКЦ, количество ценных бумаг, доступных для Подбора, определяет НКЦ по запросу НРД.

Приложение 2 к порядку взаимодействия клиентов

и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением

# Перечень поручений и отчетов, используемых при оказании услуг по Управлению обеспечением.

|  |  |
| --- | --- |
| Отчеты, предоставляемые НРД | Код  формы |
| Отчет о регистрации, изменении и прекращении учета обязательств по сделке.  Предоставляется по каждой Сделке РЕПО после регистрации Сделки РЕПО в СУО НРД, каждого изменения обязательств, внесения Компенсационных взносов, Замены ценных бумаг, в случае Переноса даты второй части Сделки РЕПО либо прекращения учета обязательств по Сделке РЕПО без расчета, а также при изменении параметров Сделки РЕПО.  Коды, используемые в поле «Статус действия»:   * INIT – регистрация обязательств по первой части Сделки РЕПО после приема Общего реестра сделок РЕПО либо по второй части Сделки РЕПО после полного или первого частичного исполнения первой части Сделки РЕПО; * TERM – прекращение учета обязательств по Сделке РЕПО; * AADJ – изменение набора ценных бумаг при внесении Компенсационного взноса, возврате бумаг со 100% дисконтом или бумаг, по которым Кредитором в отношении Заемщика установлены дополнительные ограничения по совершению Сделок РЕПО, а также в при замене Ценных бумаг, переданных Кредитору, по служебному поручению НРД в случаях, предусмотренных Порядком; * CDTA – изменение даты прекращения обязательства по Сделке РЕПО по поручению Кредитора либо Перенос даты второй части Сделки РЕПО; * CADJ – изменение набора ценных бумаг при замене Ценных бумаг, переданных Кредитору, по поручению Заемщика; * PADJ – изменение обязательства по второй части Сделки РЕПО после второго и последующих частичных исполнений обязательств по первой части Сделки РЕПО, изменение денежного обязательства при уплате Компенсационного взноса денежными средствами; * MADJ – изменение предельного значения Порога переоценки; * RATA – изменение Ставки РЕПО, Спреда или денежного индикатора; * DADJ – изменение типа расчетов по первой либо второй части Сделки РЕПО, а также иные изменения | [MS018](#_Отчет_о_регистрации/изменении_1) |
| Отчет о составе обязательств и их Обеспеченности. Предоставляется по Группе сделок после каждой проверки Обеспеченности обязательств.  Утренний и итоговый отчеты предоставляются в обязательном порядке в соответствии с расписанием действий по Управлению обеспечением.  Промежуточные отчеты предоставляются в ходе клиринговых сеансов, осуществляемых с использованием только торговых банковских счетов, открытых в НРД, в случае, если обязательства были изменены с момента предоставления предыдущего отчета.  В случаях, предусмотренных Порядком, предоставляются дополнительные отчеты за каждый предстоящий нерабочий день в соответствии с расписанием действий по Управлению обеспечением.  Коды, указывающие степень Обеспеченности пула обязательств (в поле «Обеспеченность»):   * DEFI – пул обязательств/Сделка РЕПО необеспечен/а * EXCS – пул обязательств/Сделка РЕПО переобеспечен/а * FLAT – пул обязательств/Сделка РЕПО обеспечен/а | [MS118](#_Отчет_о_составе_1) |
| Сводный отчет о регистрации/изменении и прекращении обязательств по Сделкам РЕПО за период. Предоставляется после процедуры переоценки, по итогам клиринговых сеансов, если обязательства были изменены с момента предыдущего отчета, а также в конце операционного дня. | [MS218](#_Сводный_отчет_о_1) |
| Отчет о маркировании ценных бумаг для Подбора обеспечения. Предоставляется по результатам исполнения поручения MF18М. | [MS18M](#_Отчет_о_Маркировании_1) |
| Отчет о регистрации дополнительных параметров управления Обеспечением Сделок РЕПО. Предоставляется по результатам исполнения поручения MF18P. | [MS18P](#_Отчет_о_регистрации_6) |
| Отчет о разрешении автозамены в Сделках РЕПО с Глобальными Кредиторами. Предоставляется по результатам исполнения поручения MF18C. | [MS18C](#_Отчет_об_автозамене) |
| Отчет о регистрации Корзины РЕПО и дисконтов. Предоставляется по результатам исполнения поручения MF18B. | [MS18B](#_Отчет_о_регистрации_4) |
| Отчет об исполнении Поручения на подбор ценных бумаг для обслуживания клиринговой деятельности НКЦ. Предоставляется по результатам Подбора ценных бумаг на указанный счет депо/раздел счета депо/субсчет депо. | [MS18G](#_Отчет_о_Подборе_1) |
| Отчет о регистрации Лимитной карты Кредитора. Предоставляется по результатам исполнения поручения MF18Q. | [MS18Q](#_Отчет_о_регистрации_5) |
| Отчет о передаче цен по ценным бумагам. Предоставляется по результатам исполнения Поручения MF18VAL. | [MS18V](#_Отчет_о_передаче_1) |
| Отчет об обязательствах по прекращенной Сделке РЕПО. Предоставляется при прекращении учета обязательств по Сделке РЕПО по основаниям, предусмотренным Порядком. | [MS318](#_Отчет_об_обязательствах_1) |
| Отчет о Заемщиках, обязательства которых не обеспечены. Предоставляется Государственному кредитору после процедуры переоценки, по итогам клиринговых сеансов, а также в конце операционного дня. | [NFX35](#_Отчет_о_Заемщиках,_1) |
| Отчет о компенсации доходов Кредитора. Предоставляется Банку России и Федеральному казначейству по итогам перечисления денежных средств в сумме выплат по Ценным бумагам, переданным Кредитору. | [NFX36](#_Отчет_о_компенсации_1) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Документы, предоставляемые Клиентом | | Код  формы |
| Замена обеспечения | Поручение на операцию «Замена обеспечения» | [MF018](#_Поручение_на_изменение_1) |
| Изменение даты исполнения обязательств и (или) иных параметров Сделки РЕПО, прекращение учета обязательств | Поручение на операцию «Регистрация изменения и прекращения учета обязательства» | [MF018](#_Поручение_на_изменение) |
| Маркирование ценных бумаг для Подбора обеспечения | Поручение на операцию «Маркирование ценных бумаг для Подбора обеспечения» | [MF18М](#_Поручение_на_Маркирование_1) |
| Регистрация дополнительных параметров управления Обеспечением Сделок РЕПО | Поручение на операцию «Регистрация дополнительных параметров управления Обеспечением Сделок РЕПО» | [MF18P](#_Поручение_на_регистрацию_2) |
| Регистрация Поручения на Автозамену ценных бумаг в Сделках РЕПО с Глобальными Кредиторами | Поручение на операцию «Автозамена ценных бумаг в Сделках РЕПО с Глобальными кредиторами» | [MF18С](#_Поручение_на_регистрацию_3) |
| Регистрация Корзины РЕПО и установление дисконтов | Поручение на операцию «Регистрация корзин РЕПО» | [MF18B](#_Поручение_на_регистрацию_4) |
| Подбор ценных бумаг на указанный счет депо/раздел счета депо/субсчет депо | Поручение на операцию «Подбор обеспечения» | [MF18G](#_Поручение_на_Подбор_1) |
| Исполнение денежного Компенсационного взноса | Поручение на операцию «Денежный компенсационный взнос» | [MF18X](#_Поручение_на_денежный_1) |
| Регистрация Лимитной карты Кредитора | Поручение на операцию «Лимитная карта Кредитора» | [MF18Q](#_Лимитная_карта_Кредитора_1) |
| Регистрация цен по ценным бумагам | Поручение на операцию «Передача цен по ценным бумагам» | [MF18VAL](#_Поручение_на_передачу_1) |

Прочие документы и формы их заполнения приведены в приложениях к договорам, заключенным Клиентами с НРД.

Приложение 3 к Порядку взаимодействия Клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением

# Образцы поручений и правила их заполнения

### Поручение на изменение и прекращение учета обязательства, на Замену ценных бумаг

**Форма MF018**

**ПОРУЧЕНИЕ № \_\_\_**

**от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 201\_ г.**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция*** |  |  |  | |
|  | *Наименование* | | | *Код* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Получатель поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Инициатор поручения:* |  |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | |
|  |  |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование* | | | | | | | | |
| *Сторона по обязательству* |  |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | |
|  |  |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование* | | | | | | | | |
| *Счет депо* |  |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | |
|  |  |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | |
|  | ***Счет депо*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование депонента* | | | | | | | | |
| *Раздел счета депо:* |  | |  | | |  |  | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  | |  |
|  |  | |  | | |  |  | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  | |  |
| *Идентификатор раздела* |  |  | |  | | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Контрагент:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |
| *Группа сделок:* |  |  |  |  |  |  | | | | | | | | | |
|  |  |  |  |  |  |  | | | | | | | | | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Дата исполнения обязательства:* | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  | *Прекращение обязательства* | |  |
|  |
|  | |  |  | **.** |  |  | **.** |  |  |  |  |  | |  |  | |  |
| *Регистрационный номер сделки* |  | | | | | | | | | | | | *Референс обязательства* |  | |  | |
|  |  | | | | | | | | | | | |  |  | |  | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Ставка РЕПО:* |  |  |  | **,** |  |  |  |  |  |  | *Код корзины* |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | | | | | | | | | | |
| *Спред плавающей ставки РЕПО* |  |  |  | **,** |  |  |  |  | *Код денежного индикатора:* |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| *Нижний порог переоценки* | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | *Верхний порог переоценки* | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |

|  |  |
| --- | --- |
| *Способ расчетов по второй части РЕПО:* | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Движение ценных бумаг* | | **Код ценной бумаги** | |  | | | | **Количество** *(в штуках)* | | | |  | **Дисконт** *(в %)* | | |  |  |
|  |  | |  |  |  | |  | |  | | | | | | | | |
|  |  | |  |  | | | |  | | | |  |  | | |  |  |
|  | |  | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | *Количество прописью (шт.)* | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | |  | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | *Приоритет типа цены* | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | |  | |  | | | | | |  | | | | |  | | |
|  | | *Счет депо, раздел счета депо или идентификатор раздела* | |  | | *Группа сделок СУО* | | | |  | *Референс* | | |  | *Регистрационный*  *номер сделки* | | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  | |  | |  |  | | | | | | | | |
|  |  |  | | | | |  | | |  |  | | |  |  |
|  |  | | | | | | | | | | | | | | |
|  | *Количество прописью (шт.)* | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  | | | | | | | | | | | | | | |
|  | *Приоритет типа цены* | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | *Счет депо, раздел счета депо или идентификатор раздела* | |  | | *Группа сделок СУО* | | |  | *Референс* | | |  | *Регистрационный*  *номер сделки* | | |

|  |  |
| --- | --- |
| **Дополнительная информация:** |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Дата/период исполнения поручения с:** | | | | |  | | | | | | | | **по** | | | | | |  | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | |  | | | | |  | | | | |
| (должность) |  | (ФИО) | | | | | | | | | | |  | | | | | (подпись) | | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | | М.П. | | | | |  | | | | |
| *Заполняется сотрудником Депозитария* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Рег. номер поручения** |  | | | | |  | | **Дата ввода поручения:** | | | | |  | | | | | | | | | |
| **Дата приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | |  | |  | | | | |  | | |
| **Время приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | |  |  | | | | |  | | | |
| **Операционист** |  | | | | |  | | **Оператор** | | | | |  | | | | | | | | | |
|  | подпись | | | | |  | |  | | | | | подпись | | | | | | | | | |
| Отчет о проведении операции № | | |  | Дата: | | | « | |  | » |  |  | | | | Контролер: | | | | | |  |
|  | | |  |  | | |  | |  |  |  |  | | | | |  | | | | подпись | |

* 1. Правила заполнения поручения MF018 для операций с кодами 18/4, 18/5, 18/54

| **Наименование полей** | **Пояснения** | **Обязательность** |
| --- | --- | --- |
| *Операция* | Указывается код и наименование операции:   * 18/4 – «Регистрация изменения и прекращения обязательства» * 18/5 - «Регистрация изменения и прекращения обязательства. Встречное поручение» * 18/54 - «Регистрация изменения и прекращения обязательства» - применяется в случаях, установленных Порядком. | **О** |
| *Сторона по обязательству* | Указывается код анкеты участника клиринга *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* Клиента. | **О** |
| *Контрагент:* | Указывается код анкеты участника клиринга *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* контрагента по Сделке РЕПО. | **О** |
| *Дата исполнения обязательства\*\** | Указывается дата исполнения обязательства для Сделки РЕПО с открытой Датой второй части Сделки РЕПО либо новая дата исполнения обязательства по Сделке РЕПО с установленной Датой второй части Сделки РЕПО. | **Н** |
| *Тип обязательства\** | Указывается код Группы *(например, «CBR1», «RMBC»)* и наименование *(не более 120 символов).* | **Н** |
| *Референс обязательства\** | Указывается номер обязательства Сделки РЕПО, допустимо использовать только латинские буквы и цифры. | **Н** |
| *Регистрационный номер сделки\** | Указывается регистрационный номер Сделки РЕПО (*не более 12 символов*), присваиваемый НРД при регистрации Сделки РЕПО в СУО НРД. Допустимо использовать только цифры. | **Н** |
| \* обязательно должны быть заполнена хотя бы одна из следующих комбинаций полей:   * «Тип обязательства» и «Референс обязательства» * «Регистрационный номер сделки»   Для Группы сделок междилерского РЕПО в поручении с кодом операции 18/54 возможно заполнение только поля «Тип обязательства» при условии указания Даты исполнения обязательства. | | |
| *Прекращение обязательства* | Для прекращения учета обязательств по Сделке устанавливается значение «Y» («Истина»).  При указании значения «Y» и заполненному полю Дата исполнения обязательства сделке, по которой ранее был прекращен учет обязательств, устанавливается статус «Урегулировано» с указанной в поручении датой. Данное изменение передается в Репозитарий только по внебиржевым Сделкам РЕПО. | **Н** |
| *Ставка РЕПО\*\** | Указывается новая Ставка РЕПО для Сделки РЕПО. Не заполняется, если заполнено поле «Спред плавающей ставки РЕПО» и «Код денежного индикатора». | **Н** |
| *Нижний порог переоценки\*\** | Указывается новое максимально возможное уменьшение стоимости Обеспечения, выраженное в процентах от стоимости обязательства. | **Н** |
| *Верхний порог переоценки\*\** | Указывается новое максимально возможное увеличение стоимости Обеспечения, выраженное в процентах от стоимости обязательства. | **Н** |
| *Код корзины\*\** | Указывается новая Корзина по Сделке РЕПО. При указании кода Корзины не заполняется «Блок по ценным бумагам». | **Н** |
| *Спред Плавающей ставки РЕПО\*\** | Указывается Спред по Сделке РЕПО с Плавающей Ставкой РЕПО. Не заполняется, если заполнено поле «Ставка РЕПО». | **Н** |
| *Код денежного индикатора\*\** | Указывается Индикативная ставка, используемая при заключении Сделки РЕПО с Плавающей Ставкой. | **Н** |
| *Способ расчетов по 2-й части РЕПО* | Указывается DVP-1 для изменения способа расчета по второй части Сделки РЕПО. | **Н** |
| \*\* возможно изменение на основании одностороннего поручения с кодом операции 18/54 в случаях, установленных Порядком. | |  |
| ***Блок по ценным бумагам*** | |  |
| Блок используется для изменения Локальной корзины Сделки междилерского РЕПО | | |
| *Код ценной бумаги или код корзины* | Указывается депозитарный код ценной бумаги *(12 символов)* и ее краткое наименование *(не более 120 символов*) или код корзины. | **Н** |
| *Направление движения* | Указывается:  - по исключаемым из Локальной корзины ценным бумагам – «COLO» («-»)  - по включаемым в Локальную корзину ценным бумагам – «COLI» («+») | **Н** |
| *Количество ценных бумаг* | Всегда указывается «0» | **Н** |
| *Дисконт* | Указывается дисконт в процентах. Не допускается указание по исключаемым из Локальной корзины ценным бумагам | **Н** |
| *Приоритет типа цены* | Указывается новая последовательность приоритетов цен, предусмотренных Порядком, не более 3-х типов.  Указывается только по включаемым в Локальную корзину ценным бумагам – «COLI» («+») | **Н** |

* 1. Правила заполнения поручения MF018 для операции с кодом 18/Z

| **Наименование полей** | **Пояснения** | **Обязательность** |
| --- | --- | --- |
| *Операция* | Указывается код и наименование операции:   * 18/Z – «Замена обеспечения обязательства» | **О** |
| *Сторона по обязательству* | Указывается код анкеты участника клиринга *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* Заемщика (владельца требования по ценным бумагам). | **О** |
| *Счет депо стороны\** | Указывается номер счета депо, на который будут переведены Заменяемые ценные бумаги.  При изъятии из Обеспечения КСУ допускается указание только торгового счета депо из действующего поручения по форме AF005 с приложением уведомления о банковских реквизитах по форме GF088 (код операции – 07, код назначения банковских реквизитов – 17) либо торгового счета депо владельца типа HS.  При отсутствии информации либо указания некорректной информации по КСУ ценные бумаги будут переведены на торговый счет депо, который используется для учета обязательства по ценным бумагам по данной Сделке РЕПО. Не заполняется при указании идентификатора раздела. | **Н** |
| *Раздел счета депо стороны\** | Указывается раздел счета депо, на который будут переведены Заменяемые ценные бумаги.  При изъятии из Обеспечения КСУ допускается указание только торгового раздела счета депо из действующего поручения по форме AF005 с приложением уведомления о банковских реквизитах по форме GF088 (код операции – 07, код назначения банковских реквизитов – 17) либо раздела 36 «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение» торгового счета депо владельца типа HS.  При отсутствии информации либо указания некорректной информации по КСУ ценные бумаги будут переведены на раздел счета депо, который используется для учета обязательства по ценным бумагам по данной Сделке РЕПО.  Не заполняется при указании идентификатора раздела. | **Н** |
| *Идентификатор раздела\** | Указывается идентификатор раздела счета депо (*8 символов*). Не заполняется при указании номера счета депо и раздела счета депо. | **Н** |
| *Контрагент:* | Указывается код анкеты участника клиринга *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* Контрагента по Сделке РЕПО. | **О** |
| *Тип обязательства\*\** | Указывается код Группы *(например, «CBR1», «RMBC»)* и наименование *(не более 120 символов)* при желании осуществить замену во всех Сделках РЕПО данной Группы СУО. | **Н** |
| *Референс обязательства\*\** | Указывается референс Сделки при желании осуществить замену ценных бумаг в Обеспечении только одной Сделки РЕПО. | **Н** |
| *Регистрационный номер сделки\*\** | Указывается регистрационный номер Сделки РЕПО (*не более 12 символов*), присваиваемый НРД при регистрации Сделки РЕПО в СУО НРД, при желании осуществить замену ценных бумаг в Обеспечении только одной Сделки РЕПО. Допустимо использовать только цифры. | **Н** |
| \* Допускается указание счета и раздела счета депо, допустимого для Маркирования в Группе СУО, в которой выполняется Замена ценных бумаг.  \*\* Обязательно должна быть заполнена хотя бы одна из следующих комбинаций полей:   * «Тип обязательства» * «Тип обязательства» и «Референс обязательства» * «Регистрационный номер сделки» | | |
| ***Блок по ценным бумагам*** | | |
| *Код ценной бумаги* | Указывается депозитарный код ценной бумаги *(12 символов)* и ее краткое наименование *(не более 120 символов).*  Для проведения замены обязательно указывается одна Заменяемая ценная бумага. Для проведения принудительного компенсационного взноса Заменяемая ценная бумага не указывается.  Могут быть указаны ценные бумаги, предпочтительные для замещения. | **О** |
| *Направление движения* | По изымаемой бумаге – «COLO» («-»)  По бумаге или корзине, предпочтительной для замещения – «COLI» («+») | **O** |
| *Количество ценных бумаг* | * По Заменяемой ценной бумаге указывается: * «0», если требуется изъять максимальное количество ценных бумаг; * количество, отличное от «0», если требуется изъять строго указанное количество ценных бумаг; * по бумаге, предпочтительной для замещения, указывается: * «0», если требуется использовать максимальное количество Заменяющих ценных бумаг; * количество, отличное от «0», если требуется использовать максимальное количество Заменяющих ценных бумаг, но не более указанного числа.   По Корзине РЕПО, бумаги которой предпочтительны для замещения, всегда указывается «0».  Допускается указание одного направления движения ценных бумаг.  По обоим направлениям движения бумаг допускается указание нескольких записей с количеством как отличным от «0», так и равным «0». | **O** |

* 1. Правила заполнения поручения MF018 для операции с кодом 18/Y

| **Наименование полей** | **Пояснения** | **Обязательность** |
| --- | --- | --- |
| *Операция* | Указывается код и наименование операции:  18/Y – «Замена обеспечения без подбора» | **О** |
| *Сторона по обязательству* | Указывается код анкеты участника клиринга *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* Заемщика (владельца требования по ценным бумагам). | **О** |
| *Контрагент:* | Указывается код анкеты участника клиринга *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* Контрагента по Сделке РЕПО. | **Н** |
| ***Блок по ценным бумагам*** | | |
| *Код ценной бумаги* | Указывается депозитарный код ценной бумаги *(12 символов)* и ее краткое наименование *(не более 120 символов).*  Для проведения замены обязательно указывается одна Заменяемая ценная бумага. Для проведения принудительного компенсационного взноса Заменяемая ценная бумага не указывается.  Могут быть указаны ценные бумаги, предпочтительные для замещения.  Указание кода корзины не допускается. | **О** |
| *Направление движения* | По Заменяемой ценной бумаге – «COLO» («-»)  По бумаге, предпочтительной для замещения – «COLI» («+») | **O** |
| *Количество ценных бумаг* | Указывается количество ценных бумаг, отличное от «0», которое требуется либо изъять из обеспечения, либо использовать для замещения – в соответствии с указанным направлением.  Допускается указание одного направления движения ценных бумаг.  По обоим направлениям движения бумаг допускается указание нескольких записей с количеством как отличным от «0», так и равным «0». | **O** |
| *Счет депо\** | Указывается номер счета депо, на который будут переведены Заменяемые ценные бумаги либо с которого будут переведены Заменяющие ценные бумаги – в соответствии с указанным направлением. Не заполняется при указании идентификатора раздела. | **У** |
| *Раздел счета депо\** | Указывается раздел счета депо, на который будут переведены Заменяемые ценные бумаги либо с которого будут переведены Заменяющие ценные бумаги – в соответствии с указанным направлением. Не заполняется при указании идентификатора раздела. | **У** |
| *Идентификатор раздела\** | Указывается идентификатор раздела *(8 символов).* Не заполняется при указании номера счета депо и раздела депо. | **У** |
| Обязательно должна быть заполнена хотя бы одна из следующих комбинаций полей:   * Номер счета депо и раздел счета депо * Идентификатор раздела | | |
| *Референс обязательства\*\** | Указывается референс обязательства. | **У** |
| *Группа сделок СУО\*\** | Указывается код Группы СУО *(например, «CBR1», «RMBC»)* и наименование *(не более 120 символов).* | **У** |
| *Регистрационный номер сделки\*\** | Указывается регистрационный номер Сделки РЕПО (*не более 12 символов*), присваиваемый НРД при регистрации Сделки РЕПО в СУО НРД. Допустимо использовать только цифры. | **У** |
| \* Допускается указание счета и раздела счета депо, допустимого для маркирования в Группе СУО, в которой заключена данная Сделка РЕПО.  \*\* Обязательно должны быть заполнена хотя бы одна из следующих комбинаций полей:   * «Группа сделок СУО» и «Референс обязательства» * «Регистрационный номер сделки» | | |

Спецификации поручения MF018 в электронном виде и правила заполнения сообщения MT527 SWIFT приведены в Правилах ЭДО НРД.

### Поручение на Маркирование ценных бумаг для Подбора Обеспечения

**Форма MF18M**

**ПОРУЧЕНИЕ № \_\_\_**

от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция*** |  |  | |  |
|  | *Наименование* |  | *Код* | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Получатель поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Инициатор поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |
| *Депонент:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

***Распределение ресурсов***

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Приори-тет* | *Тип маркирования* | *Правило* | *Группы сделок СУО* | *Номер счета депо* | *Раздел счета депо* | *Иденти*  *фикатор раздела* | *Код ценной бумаги* | *Коли*  *чество* | *Счет депо поставки* | *Раздел счета депо поставки* | *Иденти фикатор раздела* |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Дата/период исполнения поручения с:** | | | |  | | | | | | | | **по** | | |  | | | | | | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | |  | | | | | | |  | | | |
| (должность) |  | (ФИО) | | | | | | | | | | |  | | | | | | | (подпись) | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | | М.П. | | | | | | |  | | | |
| *Заполняется сотрудником Депозитария* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Рег. номер поручения** |  | | | | |  | | **Дата ввода поручения:** | | | | | | | |  | | | | | | | |
| **Дата приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | | | | |  | | |  | | | |  |
| **Время приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | | | | |  | |  | | |  | | |
| **Операционист** |  | | | | |  | | **Оператор** | | | | | | | |  | | | | | | | |
|  | подпись | | | | |  | |  | | | | | | | | подпись | | | | | | | |
| Отчет о проведении операции № | | |  | | Дата: | | « | |  | » |  | | |  | | | Контролер: | | | | | |  |
|  | | |  | |  | |  | |  |  |  | | |  | | | |  | | | | подпись | |

* 1. Правила заполнения поручения по форме MF18М

| **Наименование полей** | **Пояснения** | **Обязатель**  **ность** |
| --- | --- | --- |
| *Операция* | Указывается код и наименование операции:  18/MARK – «Маркирование ценных бумаг для Подбора обеспечения» | **О** |
| *Депонент* | Указывается код анкеты участника клиринга *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* Владельца счета | **О** |
| *Приоритет* | Указывается приоритет строки Маркирования от 1 и далее (1 – наиболее приоритетное значение). Повторение введенных значений допускается только для разных Групп СУО, а внутри одной Группы СУО - для различных типов Маркирования (при этом DEBT и ALL считаются одним типом Маркирования). Строка Маркирования, определяющая исключение ценной бумаги из Подбора, имеет наивысший приоритет, независимо от приоритетного значения, указанного в данном поле (в такой строке Маркирования возможно указание приоритетного значения 0). | **О** |
| *Тип маркирования* | Указывается один из двух типов:   * CRED – используется только в Группе сделок междилерского РЕПО организацией, выступающей в роли Кредитора по Сделке РЕПО, для Маркирования разделов счетов депо, с которых осуществляется Подбор ценных бумаг перед расчетом второй части Сделки РЕПО, Подбор Заменяемых ценных бумаг для передачи Заемщику при исполнении [Поручения на замену](#_Поручение_на_изменение), а также Подбор ценных бумаг для внесения Компенсационного взноса Кредитором; * DEBT или ALL (рекомендуется – DEBT) – используется:   - организацией, выступающей в роли Заемщика по сделке РЕПО, для Маркирования разделов счетов депо, с которых осуществляется Подбор ценных бумаг для расчета первой части Сделки РЕПО, для внесения Компенсационного взноса, а также для Замены ценных бумаг;  - организацией, выступающей в роли поставщика ценных бумаг на определенный счет депо/раздел счета депо/субсчет депо для обслуживания клиринговой деятельности НКЦ;  - организацией, являющейся Продавцом по Сделке DVP. | **О** |
| *Правило* | Указываются значения:   * «включить в Подбор» (установлено по умолчанию) – доступны все поля в поручении; * «исключить из Подбора» - недоступны поля «Счет депо поставки», «Раздел счета депо поставки». | **О** |
| *Группы сделок СУО\** | Указывается код (*4 символа*) и наименование (*не более 120 символов*) Группы. | **О** |
| *Номер счета депо\** | Указывается номер счета депо (*12 символов*), к которому подается Маркирование. Не заполняется при указании идентификатора раздела. | **У** |
| *Раздел счета депо\** | Указывается раздел счета депо (*17 символов*), к которому подается Маркирование. Не заполняется при указании идентификатора раздела. | **У** |
| *Идентификатор раздела\** | Указывается идентификатор раздела (*8 символов*), к которому подается Маркирование. Не указывается при указании номера счета депо и раздела счета депо. | **У** |
| *Код ценной бумаги\** | Указывается депозитарный код ценной бумаги *(12 символов)* | **Н** |
| *Количество* | Указывается количество ценных бумаг для Подбора. Заполняется только при указании кода ценной бумаги. Не допускается указание количества ценных бумаг при указании в данной строке Маркирования более одной Группы СУО. | **Н** |
| В случае наличия в Поручении нескольких строк с одинаковым заполнением всех полей, отмеченных «\*», и различным приоритетом, учитывается только строка с наиболее высоким приоритетом.  Обязательно должна быть заполнена хотя бы одна из следующих комбинаций полей:   * Номер счета депо и раздел счета депо * Идентификатор раздела | | |
| *Счет депо поставки* | Указывается номер счета депо (12 символов). Ценные бумаги с промаркированного раздела, указанного в строке маркирования, подбираются для перевода только на указанный счет депо поставки.  Для Групп сделок междилерского РЕПО и Сделок DVP вид счета депо поставки должен совпадать с видом счета депо, указанного в данной строке Маркирования.  Не заполняется при указании идентификатора раздела. | **У** |
| *Раздел счета депо поставки* | Указывается раздел счета депо/субсчет депо (17 символов). В этом случае ценные бумаги с промаркированного счета или раздела, указанного в строке Маркирования, подбираются для перевода только на раздел счета депо/субсчет депо поставки.  Не заполняется при указании идентификатора раздела. | **У** |
| *Идентификатор раздела* | Указывается идентификатор раздела (*8 символов*), Не указывается при указании номера счета депо и раздела счета депо. | **У** |
| Обязательно должна быть заполнена хотя бы одна из следующих комбинаций полей:   * Номер счета депо и раздел счета депо * Идентификатор раздела | | |

### Поручение на регистрацию дополнительных параметров управления Обеспечением Сделок РЕПО

**Форма MF18P**

**ПОРУЧЕНИЕ № \_\_\_**

от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| ***Операция*** |  |  |  |
|  | *Наименование* |  | *Код* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Получатель поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Инициатор поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |
| *Депонент:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Параметры автомаржирования по умолчанию***   |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | | ***Код контрагента*** | ***Краткое наименование контрагента*** | ***Тип актива*** | ***Начало исполнения*** | |  |  |  |  | |  |  |  |  |   *Считать указанную в сделке корзину переменной □* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Дата/период исполнения поручения с:** | | | |  | | | | | | | | | **по** | | |  | | | | | | | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | | |  | | | | | | | |  | | | |
| (должность) |  | (ФИО) | | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | (подпись) | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | | | М.П. | | | | | | | |  | | | |
| *Заполняется сотрудником Депозитария* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Рег. номер поручения** |  | | | | |  | | **Дата ввода поручения:** | | | | | | | | |  | | | | | | | | |
| **Дата приема поручения** | |  | | | | |  | | |  | | | | | | | | |  | | |  | | | |  |
| **Время приема поручения** | |  | | | | |  | | |  | | | | | | | | |  | |  | | |  | | |
| **Операционист** | |  | | | | |  | | | **Оператор** | | | | | | | | |  | | | | | | | |
|  | | подпись | | | | |  | | |  | | | | | | | | | подпись | | | | | | | |
| Отчет о проведении операции № | | | |  | | Дата: | | « | | |  | » |  | | |  | | | | Контролер: | | | | | |  |
|  | | | |  | |  | |  | | |  |  |  | | |  | | | | |  | | | | подпись | |

* 1. Правила заполнения поручения по форме MF18P

| **Наименование полей** | **Пояснения** | **Обязательность** |
| --- | --- | --- |
| *Операция* | Указывается код и наименование операции:  18/PAR – «Регистрация дополнительных параметров управления Обеспечением Сделки РЕПО» | **О** |
| *Депонент* | Указывается код анкеты участника клиринга *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* Владельца счета, по счетам которого подается Маркирование | **О** |
| **Режимы автомаржирования\*** | | |
| *Контрагент* | Указывается код анкеты участника клиринга (12 символов) и краткое наименование (не более 120 символов) контрагента по Сделке РЕПО, | **О** |
| *Тип актива* | Указывается способ взимания Компенсационного взноса:   * DEFAULT: * **без указания времени начала** Компенсационный взнос взимается в соответствии с Порядком (проставляется по умолчанию): * **при указании времени начала** Компенсационный взнос взимается в соответствии с Порядком, начиная с указанного времени; * CASH\_FULL: * **без указания времени начала** Компенсационный взнос взимается только в денежных средствах на полную сумму и только после последнего Клирингового сеанса; * **при указании времени начала** Компенсационный взнос взимается только в денежных средствах на полную сумму, начиная с указанного времени. | **О** |
| *Время начала исполнения* | Указывается время из списка допустимых значений:  10:30; 12:00; 14:00; 16:00; 19:40. | **Н** |
| *Считать указанную в сделке корзину переменной* | Указывается:   * N – при Подборе ценных бумаг для исполнения обязательств по Сделке РЕПО используются только ценные бумаги из перечня, соответствующего Дополнительному идентификатору Корзины РЕПО Банка России, указанному в общем реестре Сделок РЕПО; * Y - при Подборе ценных бумаг для исполнения обязательств по Сделке РЕПО используются в первую очередь ценные бумаги из перечня, соответствующего Дополнительному идентификатору Корзины РЕПО Банка России, указанному в Общем реестре Сделок РЕПО, а затем ценные бумаги из Корзины РЕПО Банка России (за исключением случаев, предусмотренных Порядком). | **О** |

\* Для Сделок РЕПО с Глобальными кредиторами возможность выбора режимов автомаржирования определяется Глобальным кредитором. При недопустимости установления определенного режима автомаржирования соответствующие значения параметров полей не доступны для выбора.

### Поручение на автозамену ценных бумаг в Сделках РЕПО с Глобальными кредиторами

**Форма MF18C**

**ПОРУЧЕНИЕ № \_\_\_**

от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция*** |  |  | |  |
|  | *Наименование* |  | *Код* | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Получатель поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Инициатор поручения:* | |  | | | |  | | |  | | | |  | |  | |  | |  | | | | |  | |  | |  | | | |  | | | |  |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | |
|  | |  | | | |  | | |  | | | |  | |  | |  | |  | | | | |  | |  | |  | | | |  | | | |  |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | |
|  | | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | |
| *Депонент:* | | |  | | | |  | | |  | | | |  | |  | |  | |  | | | | |  | |  |  | | | |  | | | |  |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | |
|  | | |  | | | |  | | |  | | | |  | |  | |  | |  | | | | |  | |  |  | | | |  | | | |  |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | |
|  | | | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | |
|  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | |  | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Автозамена ценных бумаг в сделках с Глобальными кредиторами* □ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Дата/период исполнения поручения с:** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | **по** | |  | | | | | | | | |
|  | | |  | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | | | |  | | |
| (должность) | | |  | | | | (ФИО) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | | | | (подпись) | | |
|  | | |  | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | М.П. | | | | | | |  | | |
| *Заполняется сотрудником Депозитария* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Рег. номер поручения** | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | **Дата ввода поручения:** | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | | |
| **Дата приема поручения** | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |  | |  |  | |
| **Время приема поручения** | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |  | |  |  | |
| **Операционист** | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | | **Оператор** | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | |
|  | | | | | подпись | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | подпись | | | | |
| Отчет о проведении операции № | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | | Дата: | | | | | | | « | | | | |  | | | | » | | |  | | | | | |  | | | | Контролер: | |  | |
|  | | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | |  | | | | | | |  | | | | |  | | | |  | | |  | | | | | |  | | | |  | подпись | |

* 1. Правила заполнения поручения по форме MF18C

| **Наименование полей** | **Пояснения** | **Обязательность** |
| --- | --- | --- |
| *Операция* | Указывается код и наименование операции:  18/CAR – «Автозамена ценных бумаг в сделках с Глобальными кредиторами» | **О** |
| *Депонент* | Указывается код анкеты участника клиринга *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* Владельца счета, по счетам которого подается Маркирование | **О** |
| *Поиск заменяемых бумаг в сделках с конечными кредиторами \** | Указывается:   * Y – разрешена замена ценных бумаг в сделках РЕПО с Глобальным кредитором на основании служебного поручения НРД при необходимости использования Заменяемых ценных бумаг в следующих случаях: * исполнение обязательств по второй части Сделки междилерского РЕПО; * исполнение [Поручения на замену](#_Поручение_на_изменение) по Сделке междилерского РЕПО; * внесение Компенсационного взноса Кредитором по Сделке междилерского РЕПО; * исполнение [Поручения на Подбор](#_Поручение_на_подбор) при соблюдении условий, предусмотренным пунктом 48.11 Порядка; * N - Замена ценных бумаг в сделках РЕПО с Глобальным кредитором на основании служебного поручения НРД в указанных выше случаях не разрешена. | **О** |

\* Не рекомендуется указывать признак «Y» в случае наличия в [Поручении на маркирование](#_Поручение_на_Маркирование_1) для Групп сделок с Глобальными кредиторами раздела счета депо, на котором хранятся ценные бумаги, требующие обособленного учета, во избежание нарушения такого учета.

### Поручение на регистрацию Корзин РЕПО

**Форма MF18B**

**ПОРУЧЕНИЕ № \_\_\_**

от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция*** |  |  | |  |
|  | *Наименование* |  | *Код* | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Получатель поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Инициатор поручения:* | | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |
|  | | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |
|  | | | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | |
|  | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |  |  | |
| *Владелец корзины:* | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |
|  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |
|  | | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | |
|  |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  |  | |
| ***Код корзины****:* | | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |  | ***Название корзины****:* | | |  |
|  | | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |  |

***Требования к корзине***

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Приоритет* | *Вид ценной бумаги* | *Код эмитента* | *Страна эмитента* | *Код ценной бумаги* | *ISIN* | *Валюта номинала* | *Включение в корзину* | *Дисконт* | *Приоритет типа цены* |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Дата/период исполнения поручения с:** | | | |  | | | | | | | | **по** | | |  | | | | | | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | |  | | | | | | |  | | | |
| (должность) |  | (ФИО) | | | | | | | | | | |  | | | | | | | (подпись) | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | | М.П. | | | | | | |  | | | |
| *Заполняется сотрудником Депозитария* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Рег. номер поручения** |  | | | | |  | | **Дата ввода поручения:** | | | | | | | |  | | | | | | | |
| **Дата приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | | | | |  | | |  | | | |  |
| **Время приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | | | | |  | |  | | |  | | |
| **Операционист** |  | | | | |  | | **Оператор** | | | | | | | |  | | | | | | | |
|  | подпись | | | | |  | |  | | | | | | | | подпись | | | | | | | |
| Отчет о проведении операции № | | |  | | Дата: | | « | |  | » |  | | |  | | | Контролер: | | | | | |  |
|  | | |  | |  | |  | |  |  |  | | |  | | | |  | | | | подпись | |

* 1. Правила заполнения поручения по форме MF18B

| **Наименование полей** | **Пояснения** | **Обязательность** |
| --- | --- | --- |
| *Операция* | Указывается код и наименование операции:  18/BASK – «Регистрация корзины РЕПО» | **О** |
| *Владелец корзины* | Указывается код анкеты *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* участника клиринга, от чьего имени регистрируется корзина | **О** |
| *Код корзины* | Указывается код корзины (*не более 12 символов*), присвоенный при регистрации. При регистрации новой корзины код не указывается. | **Н** |
| *Наименование корзины* | Указывается название корзины (*не более 64 символов).* При регистрации новой корзины является обязательным. | **У** |
| ***Требования к корзине*** | | |
| *Приоритет* | Указывается приоритет корзины от 1 и далее (1 – наиболее приоритетное значение). | **О** |
| *Вид ценной бумаги\** | Указывается вид ценной бумаги *(12 символов)* (например, акции, облигации, депозитарные расписки и т.д.) | **Н** |
| *Код эмитента\** | Указывается код эмитента *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* эмитента | **Н** |
| *Страна эмитента* | Указывается код страны (*2 символа*) согласно справочнику | **Н** |
| *Код ценной бумаги\** | Указывается код НРД (*12 символов*), присвоенный ценной бумаге | **Н** |
| *ISIN\** | Указывается полный ISIN ценной бумаги либо первые две буквы кода | **Н** |
| \* Обязательно должно быть заполнено, как минимум, одно из следующих полей или комбинаций полей:   * ISIN или * Код ценной бумаги или * Код эмитента и Вид ценной бумаги. | | |
| *Валюта номинала* | Указывается код валюты *(3 символа)* согласно справочнику «Валюты» | **Н** |
| *Включение в корзину* | Указывается:   * Y – ценные бумаги, указанные в строке, включаются в состав корзины РЕПО * N - ценные бумаги, указанные в строке, исключаются из состава корзины РЕПО | **О** |
| *Дисконт* | Указывается дисконт в отношении ценной бумаги в % (от 0 до 100). Не допускается указание дисконта для ценной бумаги, исключаемой из состава корзины РЕПО. | **Н** |
| *Приоритет типа цены* | Допускается указание типов цен, предусмотренных Порядком.  Не допускается указание приоритета типа цены для ценной бумаги, исключаемой из состава корзины РЕПО. | **Н** |

### Поручение на Подбор ценных бумаг для обслуживания клиринговой деятельности НКЦ

**Форма MF18G**

**ПОРУЧЕНИЕ № \_\_\_**

**от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ г.**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция*** |  |  |  | |
|  | *Наименование* | | | *Код* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Получатель поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Инициатор поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

**Параметры подбора**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Счет депо:* |  | |  | | | |  | | | | |  | | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | |
|  |  | |  | | | |  | | | | |  | | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | |
|  | ***Счет депо*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование депонента* | | | | | | | | |
| *Раздел счета депо/субсчет депо:* |  | | |  | | | |  |  | | | |  | | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  | |
|  |  | | |  | | | |  |  | | | |  | | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  | |
| *Идентификатор раздела/субсчета:* | |  | | |  | | | | |  | | | |  | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | |  | | | |  | | | | |  | | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | | |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| *Сумма к подбору, руб.:* |  |  |
| ***Цифрами*** | ***Прописью*** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Код ценной бумаги** | | | | | | | | | | | | | | **Количество** *(в штуках)* | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Количество прописью (шт.)* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Количество прописью (шт.)* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Количество прописью (шт.)* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Количество прописью (шт.)* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Дата/период исполнения поручения с:** | | | |  | | | | | | | | **по** | | |  | | | | | | | | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | |  | | | | | | | |  | | | | |
| (должность) |  | (ФИО) | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | (подпись) | | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | | М.П. | | | | | | | |  | | | | |
| *Заполняется сотрудником Депозитария* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Рег. номер поручения** |  | | | | |  | | **Дата ввода поручения:** | | | | | | | |  | | | | | | | | | |
| **Дата приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | | | | |  | |  | | | | |  | | |
| **Время приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | | | | |  |  | | | | |  | | | |
| **Операционист** |  | | | | |  | | **Оператор** | | | | | | | |  | | | | | | | | | |
|  | подпись | | | | |  | |  | | | | | | | | подпись | | | | | | | | | |
| Отчет о проведении операции № | | |  | | Дата: | | « | |  | » |  | | |  | | | | | Контролер: | | | | | |  |
|  | | |  | |  | |  | |  |  |  | | |  | | | | | |  | | | | подпись | |

6.1. Правила заполнения поручения по форме MF18G

| **Наименование полей** | **Пояснения** | **Обязательность** |
| --- | --- | --- |
| *Операция* | Указывается код и наименование операции:  18/GET – «Подбор обеспечения» | **О** |
| *Счет депо* | Указывается номер счета депо, на который будут переведены подобранные ценные бумаги. Не заполняется при указании идентификатора раздела. | **О** |
| *Раздел/субсчет счета депо* | Указывается раздел счета депо/субсчет депо, на который будут переведены подобранные ценные бумаги. Не заполняется при указании идентификатора раздела. | **О** |
| *Идентификатор раздела/субсчета депо* | Указывается идентификатор раздела счета депо/субсчета депо *(8 символов).* Не заполняется при указании номера счета депо и раздела счета депо/субсчета депо. | **О** |
| *Сумма к подбору* | Указывается сумма в российских рублях, в рамках которой осуществляется Подбор ценных бумаг. | **Н** |
| ***Блок по ценным бумагам*** | | **Н** |
| *Код ценной бумаги* | Указывается депозитарный код ценной бумаги *(12 символов)* и ее краткое наименование *(не более 120 символов).* | **О** |
| *Количество ценных бумаг* | Указывается количество, отличное от «0», если требуется использовать для Подбора максимальное количество ценных бумаг, но не более указанного числа.  Указывается «0», если требуется исключить возможность Подбора ценных бумаг указанного выпуска.  Заполняется в обязательном порядке, если не заполнено поле «Сумма к подбору». | **У** |

### Поручение на денежный Компенсационный взнос

**Форма MF18X**

**ПОРУЧЕНИЕ № \_\_\_**

от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция*** |  |  | |  |
|  | *Наименование* |  | *Код* | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Получатель поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Инициатор поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

***Денежный компенсационный взнос***

|  |  |
| --- | --- |
| *Регистрационный номер сделки:* | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |
|  |
|  |

|  |  |
| --- | --- |
| *Референс обязательства:* | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |
|  |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Сторона по обязательству:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |
| *Контрагент:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |
| --- | --- |
| *Счет отправителя денежных средств:* | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |
|  |
|  |
| *BIC Банка отправителя:* | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |
|  |
|  |
| *Валюта платежа:* | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |
|  |
|  |
| *Сумма платежа:* | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Дата/период исполнения поручения с:** | | | |  | | | | | | | | **по** | | |  | | | | | | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | |  | | | | | | |  | | | |
| (должность) |  | (ФИО) | | | | | | | | | | |  | | | | | | | (подпись) | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | | М.П. | | | | | | |  | | | |
| *Заполняется сотрудником Депозитария* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Рег. номер поручения** |  | | | | |  | | **Дата ввода поручения:** | | | | | | | |  | | | | | | | |
| **Дата приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | | | | |  | | |  | | | |  |
| **Время приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | | | | |  | |  | | |  | | |
| **Операционист** |  | | | | |  | | **Оператор** | | | | | | | |  | | | | | | | |
|  | подпись | | | | |  | |  | | | | | | | | подпись | | | | | | | |
| Отчет о проведении операции № | | |  | | Дата: | | « | |  | » |  | | |  | | | Контролер: | | | | | |  |
|  | | |  | |  | |  | |  |  |  | | |  | | | |  | | | | подпись | |

7.1. Правила заполнения поручения по форме MF18X

| **Наименование полей** | **Пояснения** | **Обязательность** |
| --- | --- | --- |
| *Операция* | Указывается код и наименование операции:  18/X – «Денежный компенсационный взнос» | **О** |
| *Регистрационный номер сделки* | Указывается регистрационный номер Сделки РЕПО (*не более 12 символов*), присваиваемый НРД при регистрации Сделки РЕПО в СУО НРД. Допустимо использовать только цифры.  Указывается обязательно, если не заполнено поле «Референс обязательства». | **У** |
| *Сторона по обязательству* | Указывается код анкеты участника клиринга *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* инициатора Поручения. | **О** |
| *Контрагент:* | Указывается код анкеты участника клиринга *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* Контрагента по Сделке РЕПО. | **О** |
| *Счет отправителя денежных средств* | Указывается номер банковского счета *(20 цифр*) для списания денежных средств для исполнения денежного компенсационного взноса.  Обязательно при заполнении поля «BIC Банка отправителя».  Допускается указание номера торгового банковского счета, либо корреспондентского счета, открытого в Банке России, зарегистрированного для исполнения обязательств, допущенных к клирингу НРД.  Если поле не заполнено, списание денежных средств для исполнения денежного компенсационного взноса, указанного в действующем поручении осуществляется с торгового банковского счета, указанного в поручениях по форме MF194 (Перечень клиринговых документов). | **У** |
| *BIC Банка отправителя* | Указывается SWIFT или BIC код НРД («*NADCRUMM» или «MICURUM0» или 044525505»)*  Обязательно при заполнении поля «Счет отправителя денежных средств». | **У** |
| *Валюта платежа* | Указывается международный код валюты платежа. Валюта платежа должна соответствовать валюте Сделки РЕПО.  Обязательно при заполнении поля «Сумма платежа» | **У** |
| *Сумма платежа* | Указывается сумма денежного Компенсационного взноса. Исполнение поручения возможно только на полную сумму денежных средств, указанную в данном поле.  Обязательно при заполнении поля «Валюта платежа».  При не заполнении данного поля денежный Компенсационный взнос исполняется на максимально возможную сумму с учетом наличия денежных средств на счете отправителя. | **У** |

### Лимитная карта Кредитора

**Форма MF18Q**

**ПОРУЧЕНИЕ № \_\_\_**

от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция*** | |  | | | | | | | | | | | | | | | |  | |  |
|  | | *Наименование* | | | | | | | | | | | | | | | |  | *Код* | |
| *Получатель поручения:* | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  | | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | | | |
| *Инициатор поручения:* | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  | | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | | | |

|  |  |
| --- | --- |
| ***Код лимитной карты:*** |  |
| ***Название лимитной карты:*** |  |

***Разделы счетов депо:***

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| *Номер счета депо* | *Номер раздела счета депо* | *Идентификатор раздела счетов депо* |
|  |  |  |

***Требования к лимитам:***

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Код ценной бумаги* | *Код эмитента* | *Вид ценной бумаги* | *Лимит в штуках* | *Лимит в деньгах* | *Валюта лимита* |
|  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Дата/период исполнения поручения с:** | | | |  | | | | | | | | **по** | | |  | | | | | | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | |  | | | | | | |  | | | |
| (должность) |  | (ФИО) | | | | | | | | | | |  | | | | | | | (подпись) | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | | М.П. | | | | | | |  | | | |
| *Заполняется сотрудником Депозитария* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Рег. номер поручения** |  | | | | |  | | **Дата ввода поручения:** | | | | | | | |  | | | | | | | |
| **Дата приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | | | | |  | | |  | | | |  |
| **Время приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | | | | |  | |  | | |  | | |
| **Операционист** |  | | | | |  | | **Оператор** | | | | | | | |  | | | | | | | |
|  | подпись | | | | |  | |  | | | | | | | | подпись | | | | | | | |
| Отчет о проведении операции № | | |  | | Дата: | | « | |  | » |  | | |  | | | Контролер: | | | | | |  |
|  | | |  | |  | |  | |  |  |  | | |  | | | |  | | | | подпись | |

8.1. Правила заполнения поручения по форме MF18Q

| **Наименование полей** | **Пояснения** | **Обязательность** |
| --- | --- | --- |
| *Операция* | Указывается код и наименование операции:  18/Q – «Изменение Лимитов концентрации ценных бумаг» | **О** |
| *Код лимитной карты\** | Не заполняется при создании новой Лимитной карты. При изменении существующей Лимитной карты указывается ее код (*12 символов)* | **У** |
| *Название лимитной карты* | Указывается наименование Лимитной карты *(не более 64 символов)* | **Н** |
| \* Если в поручении заполнено только поле *«Код лимитной карты»,* а все остальные поля не заполнены, это означает, что данная Лимитная карта подлежит удалению. | | |
| *Номер счет депо* | Указывается номер торгового счета депо, в отношении которого устанавливается Лимит концентрации ценных бумаг. Не заполняется при указании идентификатора раздела. | **У** |
| *Номер раздела счета депо* | Указываются разделы торгового счета депо, в отношении которых устанавливается Лимит концентрации ценных бумаг. Не заполняется при указании идентификатора раздела. | **У** |
| *Идентификатор раздела счета депо* | Указывается идентификаторы разделов счета депо, в отношении которых устанавливается Лимит концентрации ценных бумаг. Не заполняется при указании номеров счета депо и разделов счета депо. | **У** |
| Обязательно должна быть заполнена хотя бы одна из следующих комбинаций полей:   * Номер счета депо и раздел счета депо * Идентификатор раздела | | |
| ***Требования к лимитам*** | | |
| *Код ценной бумаги* | Указывается депозитарный код ценной бумаги *(12 символов)* и ее краткое наименование *(не более 120 символов).* Не указывается при указании кода эмитента. | **У** |
| *Код эмитента* | Указывается код эмитента *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* эмитента. Не указывается при указании кода ценной бумаги. | **У** |
| *Вид ценной бумаги* | Указывается вид ценной бумаги *(12 символов).* Допустимы следующие виды ценных бумаг:  BOND – облигации;  SHAR – акции;  RDRP – депозитарные расписки;  MFUN – паи.  Не указывается при указании кода ценной бумаги.  Является обязательным при указании кода эмитента. | **У** |
| *Лимит в штуках* | Указывается максимально возможное для перевода на указанный раздел счета депо (либо совокупность разделов счетов депо) количество Ценных бумаг, переданных Кредитору.  Не допустимо при указании кода эмитента.  Является обязательным, если поле «*Лимит в деньгах*» не заполнено. | **У** |
| *Лимит в деньгах* | Указывается максимально возможная суммарная стоимость Ценных бумаг, переданных Кредитору, переводимых на указанный раздел счета депо (либо совокупность разделов счетов депо).  Является обязательным при указании кода эмитента. | **У** |
| *Валюта лимита* | Указываются российские рубли. Обязательно при указании Лимита в денежном выражении. | **У** |

### Поручение на передачу цен по ценным бумагам

**Форма MF18VAL**

**ПОРУЧЕНИЕ № \_\_\_**

от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция*** | |  | | | | | | | | | | | | | | | |  | |  |
|  | | *Наименование* | | | | | | | | | | | | | | | |  | *Код* | |
| *Получатель поручения:* | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  | | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | | | |
| *Инициатор поручения:* | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  | | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | | | |

***Подписчики на цены:***

|  |  |
| --- | --- |
| *Код депонента* | *Краткое наименование депонента* |
|  |  |

***Рыночные цены для ценных бумаг:***

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Код ценной бумаги* | *Регистрационный номер* | *Краткое наименование ц/б* | *Рыночная цена* | *Тип котировки* | *Валюта цены /*  *% от номинала* | *Дата цены* |
|  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Дата/период исполнения поручения с:** | | | |  | | | | | | | | **по** | | |  | | | | | | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | |  | | | | | | |  | | | |
| (должность) |  | (ФИО) | | | | | | | | | | |  | | | | | | | (подпись) | | | |
|  |  |  | | | | | | | | | | | М.П. | | | | | | |  | | | |
| *Заполняется сотрудником Депозитария* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Рег. номер поручения** |  | | | | |  | | **Дата ввода поручения:** | | | | | | | |  | | | | | | | |
| **Дата приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | | | | |  | | |  | | | |  |
| **Время приема поручения** |  | | | | |  | |  | | | | | | | |  | |  | | |  | | |
| **Операционист** |  | | | | |  | | **Оператор** | | | | | | | |  | | | | | | | |
|  | подпись | | | | |  | |  | | | | | | | | подпись | | | | | | | |
| Отчет о проведении операции № | | |  | | Дата: | | « | |  | » |  | | |  | | | Контролер: | | | | | |  |
|  | | |  | |  | |  | |  |  |  | | |  | | | |  | | | | подпись | |

* 1. Правила заполнения поручения по форме MF18VAL

| **Наименование полей** | **Пояснения** | **Обязательность** |
| --- | --- | --- |
| *Операция* | Указывается код и наименование операции:  18/VAL – «Передача цен по ценным бумагам» | **О** |
| ***Подписчики на цены\**** | | **Н** |
| *Код депонента* | Указывается код анкеты *(12 символов)* и краткое наименование *(не более 120 символов)* участника клиринга, которому инициатором поручения дано право применения цен. | **О** |
| *Наименование депонента* | **О** |
| При подаче поручения с незаполненным блоком список подписчиков, установленный предыдущими поручениями, аннулируется.  При подаче поручения с заполненным блоком из списка подписчиков исключаются участники клиринга, не вошедшие в список в данном поручении.  При исключении блока из поручения список подписчиков не изменяется. | |  |
| ***Цены по ценным бумагам\**** | | **Н** |
| *Код ценной бумаги* | Указывается депозитарный код ценной бумаги *(12 символов)* и ее краткое наименование *(не более 120 символов).* | **О** |
| *Рыночная цена* | Указывается цена ценной бумаги. Для облигаций возможно указание цены в процентах от номинальной стоимости ценной бумаги. В этом случае в поле «*Валюта цены*» указывается код PRC. Цена купонных облигаций указывается без учета НКД. | **О** |
| *Тип котировки* | Указывается код котировки для указанной ценной бумаги. | **О** |
| *Валюта цены* | Указывается код валюты по международной классификации. При установлении в поле «*Рыночная цена*» цены облигации в процентах от ее номинальной стоимости указывается код PRC. | **О** |
| *Дата цены* | Указывается дата, в которую должна использоваться указанная цена ценной бумаги. | **О** |

\* В поручении обязательно должен быть заполнен хотя бы один из двух блоков повторяющихся полей.

Спецификации поручений MF18M, MF18P, MF18C, MF18B, MF18G, MF18X, MF18Q, MF18VAL в электронном виде приведены в Правилах ЭДО НРД.

### Отчет о регистрации/изменении и прекращении учета обязательств по Сделке РЕПО

**Форма MS018**

**ОТЧЕТ/ВЫПИСКА № \_\_\_**

**от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 201\_ г. <**время составления отчета**>**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция*** |  |  |  | |
|  | *Наименование* | | | *Код* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Отправитель отчета* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Получатель отчета* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Инициатор поручения* |  |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Сторона по обязательству* |  |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Счет депо* |  |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | |
|  | ***Счет депо*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование депонента* | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Раздел счета депо* |  | |  | |  |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  | |  | |  |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

*код раздела (идентификатор раздела)*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Контрагент* |  |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Счет депо* |  |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | |
|  | ***Счет депо*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование депонента* | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Раздел счета депо* |  | |  | |  |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  | |  | |  |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

*код раздела (идентификатор раздела)*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| *Дата исполнения обязательства* |  | *Дата заключения сделки* |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| *Регистрационный*  *номер сделки* | ***\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_*** | *Референс обязательства* |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| *Тип обязательства* |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| *Группа сделок СУО* |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Статус действия* |  |  | *Способ расчетов*  *по первой части РЕПО* |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Код корзины обеспечения:* |  |  | *Место заключения*  *сделки* |  |

|  |  |
| --- | --- |
| *Способ расчетов*  *по второй части РЕПО:* |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Ставка РЕПО:* |  |  |  | **,** |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| *Нижний порог переоценки \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_* | *Верхний порог переоценки \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Спред плавающей ставки РЕПО:* | | | |  | | |  | | |  | **,** |  |  |  |  | *Код денежного индикатора:* | | | |  | | | | | | *С реюзом* □ | |  |
|  | | |  | | | | | | | | | | | | | |  | |  | | | | | | | | | |
| *Движение ценных бумаг* **[[7]](#footnote-7)** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | **Код ценной бумаги** | | | |  | | | **Краткое наименование** | | | | | | | | | | | | | |  | | | | | **Количество** *(шт)* | | | |
|  |  | | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | |  | |  |  | |  | | | |
|  |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | *Количество прописью (шт.)* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  | | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | |  | |  |  | |  | | | |
|  |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | *Количество прописью (шт.)* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  | | | | |  | | |  | | | | | | | | | | | |  | |  | |  | |  | | | |
|  |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | *Количество прописью (шт.)* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Движение денег[[8]](#footnote-8)* | | **Изменение обязательствa** | | | | | | | | | | | | | | | | **Исполнение обязательствa** | | | | | | | | | | | | |
|  | | Валюта Сумма | | | | | | | | | | | | | | | | Валюта Сумма | | | | | | | | | | | | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | |  | | | | | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | , |  |  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  | | , |  |  |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

**Дополнительная информация: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | | *Дата исполнения операции:* | | <Дата> <время> |
|  | | *Дата операционного дня исполнения операции:* | | <Дата> | |

***Основание*:**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| ПОРУЧЕНИЕ № | |  | От «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. | | | | | |
|  | | | | | | | | | |
| *Рег. № поручения:* | |  | *Дата регистрации поручения:* | | | <Дата> <время> | | | |
|  | | | | | | | |
|  | | | *Дата принятия на исполнение:* | | | <Дата> <время> | | | |
| *Операционист:* |  | | | МП | *Подпись:* | |  | | |

ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_\_\_\_ от «\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г.

### Отчет о Маркировании ценных бумаг для Подбора Обеспечения

**Форма MS18M**

**ОТЧЕТ № \_\_\_\_\_\_**

**от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_ г. <**время составления отчета**>**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| ***Операция****:* |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Отправитель отчета:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Инициатор поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Депонент:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Получатель отчета:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

***Распределение ресурсов***

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Приоритет* | *Тип маркиро-вания* | *Правило* | *Группы сделок СУО* | *Номер счета депо* | *Код раздела счета депо* | *Код ценной бумаги* | *Количество* | *Счет депо поставки* | *Раздел счета депо поставки* |
|  |  |  |  |  | <код раздела> (<идентификатор раздела>) |  |  |  | <код раздела> (<идентификатор раздела>) |

***Основание*:**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **ПОРУЧЕНИЕ №** |  | от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. | | |
|  | | | | | |
| *Рег. № поручения:* |  | *Дата регистрации поручения:* | <Дата> <время> | | |
|  | | | |
|  | | *Дата принятия на исполнение:* | <Дата> <время> | | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Операционист:* |  | МП | *Подпись:* |  |

ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_\_\_\_ от «\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г.

### Отчет о регистрации дополнительных реквизитов управления Обеспечением Сделок РЕПО

**Форма MS18P**

**ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_**

**от « \_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_ г. <**время составления отчета**>**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| ***Операция****:* |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Отправитель отчета:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Инициатор поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Депонент:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Получатель отчета:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | | ***Код контрагента*** | ***Краткое наименование контрагента*** | ***Тип актива*** | ***Начало исполнения*** | |  |  |  |  | |  |  |  |  |   *Считать указанную в сделке корзину переменной □* |

***Основание*:**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **ПОРУЧЕНИЕ №** |  | от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. | | |
|  | | | | | |
| *Рег. № поручения:* |  | *Дата регистрации поручения:* | <Дата> <время> | | |
|  | | | |
|  | | *Дата принятия на исполнение:* | <Дата> <время> | | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Операционист:* |  | МП | *Подпись:* |  |

### Отчет о разрешении автозамены ценных бумаг в Сделках с Глобальными кредиторами

**Форма MS18C**

**ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_**

**от « \_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_ г. <**время составления отчета**>**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| ***Операция****:* |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Отправитель отчета:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Код анкеты*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Инициатор поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Код анкеты*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Депонент:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Получатель отчета:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  | | |  | **0** |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |
|  |  | | |  |  |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |
| *Автозамена ценных бумаг в сделках с Глобальными кредиторами* □ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  | | |  |  |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | |  |  | | |  |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |

***Основание*:**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **ПОРУЧЕНИЕ №** |  | от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. | | |
|  | | | | | |
| *Рег. № поручения:* |  | *Дата регистрации поручения:* | <Дата> <время> | | |
|  | | | |
|  | | *Дата принятия на исполнение:* | <Дата> <время> | | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Операционист:* |  | МП | *Подпись:* |  |

ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_\_\_\_ от «\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. 1/1

### Отчет о регистрации корзины РЕПО

**Форма MS18B**

**ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_**

**от « \_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_ г. <**время составления отчета**>**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| ***Операция****:* |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Отправитель отчета:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Код анкеты*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |
| *Получатель отчета:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |
| *Инициатор поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Код анкеты*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |
| *Владелец корзины:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Код анкеты*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Код корзины****:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | ***Название корзины****:* |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

***Требования к корзине***

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Приоритет* | *Вид ценной бумаги* | *Код эмитента* | *Страна эмитента* | *Код ценной бумаги* | *ISIN* | *Валюта номинала* | *Включение в корзину* | *Дисконт* | *Приоритет типа цены* |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

***Основание*:**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **ПОРУЧЕНИЕ №** |  | от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. | | |
|  | | | | | |
| *Рег. № поручения:* |  | *Дата регистрации поручения:* | <Дата> <время> | | |
|  | | | |
|  | | *Дата принятия на исполнение:* | <Дата> <время> | | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Операционист:* |  | МП | *Подпись:* |  |

ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_\_\_\_ от «\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. 1/1

### Отчет о Подборе ценных бумаг для обеспечения клиринговой деятельности НКЦ

**Форма MS18G**

**ОТЧЕТ/ВЫПИСКА № \_\_\_**

**от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ г. <**время составления отчета**>**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция*** |  | | | | | | | | | | | | | | |  |  | |
|  |  | | | | | | | | | | | | | | | | |  |
| *Отправитель отчета:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | | | |
| *Получатель отчета:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | | | |
| *Инициатор поручения:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | | |
|  | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | | | |

**Результаты подбора**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Счет депо:* |  | |  | | | |  | | | | |  | | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | |
|  |  | |  | | | |  | | | | |  | | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | |
|  | *Счет депо* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование депонента* | | | | | | | | |
| *Раздел/субсчет счета депо:* |  | | |  | | | |  |  | | | |  | | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  | |
|  |  | | |  | | | |  |  | | | |  | | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  | |
| *Идентификатор раздела/субсчета:* | |  | | |  | | | | |  | | | |  | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | |  | | | |  | | | | |  | | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | | |

|  |  |
| --- | --- |
| *Оценочная стоимость подобранных бумаг, руб[[9]](#footnote-9).:* |  |

*Подобранные ценные бумаги:*

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **Код ценной бумаги** |  | **Краткое наименование** |  | **Количество** *(шт)* |
|  |  |  |  |  |  |
|  | | | | | |
|  |  |  |  |  |  |
|  | | | | | |
|  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | | *Дата исполнения операции:* | | <Дата> <время> | |
|  | | *Дата операционного дня исполнения операции:* | | <Дата> | |

***Основание***

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ПОРУЧЕНИЕ № |  | От «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. | | |
|  | | | | | |
| *Рег. № поручения:* |  | *Дата регистрации поручения:* | <Дата> <время> | | |
|  | | | |
|  | | *Дата принятия на исполнение:* | <Дата> <время> | | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Операционист:* |  | МП | *Подпись:* |  |

ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_\_\_\_ от «\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. 1/1

### Отчет о регистрации Лимитной карты

**Форма MS18Q**

**ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_**

**от « \_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_ г. <**время составления отчета**>**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция****:* | |  | | | | | | | | | | | | | | |  |  |
| *Отправитель отчета:* |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |
|  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | | |
| *Получатель отчета:* |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |
|  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |
|  | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | | |
| *Инициатор поручения:* |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |
|  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | | |
|  |  | | | | | | | | | | | | | |  |  | | |

|  |  |
| --- | --- |
| ***Код лимитной карты:*** |  |
| ***Название лимитной карты:*** |  |

***Разделы счетов депо:***

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| *Номер счета депо* | *Номер раздела счета депо* | *Идентификатор раздела счетов депо* |
|  |  |  |

***Требования к лимитам:***

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Код ценной бумаги* | *Код эмитента* | *Вид ценной бумаги* | *Лимит в штуках* | *Лимит в деньгах* | *Валюта лимита* |
|  |  |  |  |  |  |

***Основание*:**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **ПОРУЧЕНИЕ №** |  | от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. | | |
|  | | | | | |
| *Рег. № поручения:* |  | *Дата регистрации поручения:* | <Дата> <время> | | |
|  | | | |
|  |  | *Дата принятия на исполнение:* | <Дата> <время> | | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Операционист:* |  | МП | *Подпись:* |  |

ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_\_\_\_ от «\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г.

### Отчет о передаче цен по ценным бумагам.

**Форма MS18V**

**ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_**

**от « \_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_ г. <**время составления отчета**>**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция****:* | |  | | | | | | | | | | | | | | |  |  |
| *Отправитель отчета:* |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |
|  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |
|  | ***Код анкеты*** | | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | | |
| *Получатель отчета:* |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |
|  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | | |
| *Инициатор поручения:* |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |
|  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |
|  | ***Код анкеты*** | | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* | | |

***Подписчики на цены:***

|  |  |
| --- | --- |
| *Код депонента* | *Краткое наименование депонента* |
|  |  |

***Рыночные цены для ценных бумаг:***

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Код ценной бумаги* | *Регистрационный номер* | *Краткое наименование ц/б* | *Рыночная цена* | *Тип котировки* | *Код типа цены НРД* | *Валюта цены /*  *% от номинала* | *Дата цены* |
|  |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | | *Дата исполнения операции:* | | <Дата> <время> |
|  | | *Дата операционного дня исполнения операции:* | | <Дата> | |

***Основание*:**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **ПОРУЧЕНИЕ №** |  | от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. | | |
|  | | | | | |
| *Рег. № поручения:* |  | *Дата регистрации поручения:* | <Дата> <время> | | |
|  | | | |
|  |  | *Дата принятия на исполнение:* | <Дата> <время> | | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Операционист:* |  | МП | *Подпись:* |  |

ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_\_\_\_ от «\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. 1/1

### Отчет о составе обязательств и их Обеспеченности

**Форма MS118**

**ОТЧЕТ № \_\_\_**

**от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 201\_ г. <**время составления отчета**>**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция*** |  |  |  | |
|  | *Наименование* | | | *Код* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Дата и время оценки:* |  | . |  | . |  | . |  |  | : |  | : |  | < *на конец операционного дня/операционный день не закончен* > |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Отправитель отчета:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Инициатор поручения:* |  |  | |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  | |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Сторона по обязательствам:* |  |  | |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  | |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Контрагент:* |  |  | |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  | |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Счет депо обеспечения:* |  |  | |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  |  |  | |  | |  | | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | ***Счет депо*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Раздел счета депо:* | | |  | |  | |  |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | | |  | |  | |  |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

*код раздела (идентификатор раздела)*

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| ***Группа сделок СУО*** | *Код* | *Наименование Группы сделок* |

|  |  |
| --- | --- |
| ***Тип ГС*** | ***Наименование ГС ( Генерального соглашения)*** |
|  |  |
|  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| ***Общая сумма обеспечения*** |  | ***Порог переоценки в рублях*** |  |
| ***Общая сумма обязательств*** |  | ***Обеспеченность*** |  |

*Обеспечение в ценных бумагах*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Код ценной бумаги* | *Краткое наименование* | *Количество* | *Рыночная цена в рублях с учетом НКД* | *Для всех сделок Группы исключается из*  *подбора по КД* | *Текущие/плановые корпоративные действия* | | | | *Блокируемая в период КД* |
| *КД 1* | *Дата фиксации* | *КД 2* | *Дата фиксации* |
|  |  |  |  |  |  | | | |  |
|  |  |  |  |  |  | | | |  |

***Перечень сделок***

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Дата закрытия* | *Право установить/приблизить дату исполнения сделки* | *Дата открытия* | *Референс* | *Регистрац. номер* | *Контрагент* | *Краткое наименование* | *Дата*  *заключения сделки* | *Место заключения сделки* | *Код ГС* | *Обеспе-*  *ченность* | *Нижний порог переоценки в рублях* | *Верхний порог переоценки в рублях* |
|  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Дополнительные условия** |  | *Размер Компенсационного взноса, <Код валюты сделки>* |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Денежные средства:* | *Валюта сделки* | | *Курс валюты сделки к рублю* | | *SWIFT BIC* | | *Номер счета* | | | *Фикс.ставка* | | |  | | *Индикатор* | |  | | | *Спред* | |  | | *Текущая стоимость в рублях:* | | | |  | | | |
| *<обязательство/требование>* | *<Код валюты сделки>* | | *< Курс валюты сделки к рублю >* | | <BIC> | | <счет> | | | *Текущая*  *Стоимость, <код валюты сделки>* | | |  | | *Сумма РЕПО, <код валюты сделки>* | |  | | | *Ставка РЕПО* | |  | | *Метод* |  | | | *Стоимость обратного выкупа, <код валюты сделки>* | |  | |
| *Ценные бумаги:* | | ***<обязательство/требование>*** | | | | | | *Вариант возврата дохода* | |  | | *Код корзины* | | | |  | | | *Дисконтированная стоимость в рублях:* | | | | | | | |  | | | |
| *Счет депо* | | *Раздел счета депо* | | *С реюзом* | | *Код ценной бумаги* | | | *Краткое наименование* | | *Количество* | | | *Дисконт* | | *Курс валюты номинала ценной бумаги к рублю* | | *Дисконтированная цена в рублях* | | | *Расчетная цена,*  *<код валюты сделки>* | | *Расчетная цена, RUB* | | | *НКД в рублях* | *Расчетная стоимость, <код валюты сделки>* | | *Расчетная стоимость. RUB* | |
|  | | <код раздела> (<идентификатор раздела>) | |  | |  | | |  | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  |  | |  | |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Связанные денежные обязательства по сделке** | | | | | | |
| *Дата открытия* | *Регистрац. номер* | *Направление* | *Сумма* | *Валюта* | *Тип об-ва* | *Дополнительная информация* |
|  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Дата закрытия* | *Право установить/приблизить дату исполнения сделки* | *Дата открытия* | *Референс* | *Регистрац. номер* | *Контрагент* | *Краткое наименование* | *Дата заключения сделки* | *Место заключения*  *сделки* | *Код ГС* | *Обеспе-*  *ченность* | *Нижний порог переоценки в рублях* | *Верхний порог переоценки в рублях* |
|  |  |  |  |  |  |  | |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Дополнительные условия** |  | *Размер Компенсационного взноса, <код валюты сделки>* |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Денежные средства:* | *Валюта сделки* | *Курс валюты сделки к рублю* | *SWIFT BIC* | *Номер счета* | *Фикс.ставка* |  | *Индикатор* |  | *Спред* |  | *Текущая стоимость в рублях:* | |  | |
| *<обязательство/требование>* | *<Код валюты сделки>* | *< Курс валюты сделки к рублю >* | <BIC> | <счет> | *Текущая*  *Стоимость, <код валюты сделки>* |  | *Сумма РЕПО, <код валюты сделки>* |  | *Ставка РЕПО* |  | *Метод* |  | *Стоимость обратного выкупа,*  *<код валюты сделки>* |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Ценные бумаги:* | ***<обязательство/требование>*** | | | *Вариант возврата дохода* | |  | | *Код корзины* | | |  | | *Дисконтированная стоимость в рублях:* | | | |  | |
| *Счет депо* | *Раздел счета депо* | *С реюзом* | *Код ценной бумаги* | | *Краткое наименование* | | *Количество* | | *Дисконт* | *Курс валюты номинала ценной бумаги к рублю* | | *Дисконтированная цена в рублях* | | *Расчетная цена, <код валюты сделки>* | *Расчетная цена, RUB* | *НКД в рублях* | *Расчетная стоимость, <код валюты сделки>* | *Расчетная стоимость. RUB* |
|  | <код раздела> (<идентификатор раздела>) |  |  | |  | |  | |  |  | |  | |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Связанные денежные обязательства по сделке** | | | | | | |
| *Дата открытия* | *Регистрац. номер* | *Направление* | *Сумма* | *Валюта* | *Тип об-ва* | *Дополнительная информация* |
|  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  |  | *Дата исполнения операции:* | <Дата> <время> |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  |  | *Дата операционного дня исполнения операции:* | <Дата> |

***Основание:***

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ПОРУЧЕНИЕ № |  | От «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. | | |
|  | | | | | |
| *Рег. № поручения:* |  | *Дата регистрации поручения:* | <Дата> <время> | | |
|  | | | |
|  | | *Дата принятия на исполнение:* | <Дата> <время> | | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Операционист:* |  |  | *Подпись:* |  |

МП

ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_\_\_\_ от «\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г.

### Сводный отчет о регистрации/изменении и прекращении учета обязательств по Сделкам РЕПО за период

**Форма MS218**

**ОТЧЕТ/ВЫПИСКА № \_\_\_**

**от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ г. <**время составления отчета**>**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| ***Операция*** | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | |  | |
|  | | | *Наименование* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | *Код* | |
| *Период формирования:* | | | | с “\_\_\_” \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_\_г. по “\_\_\_\_” \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_\_г. | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | < на конец операционного дня /операционный день не закончен > | | | | | | | | | | |
|  | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | |
| *Отправитель отчета:* | | | |  | | | |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | |  | | | |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | | | |
| *Получатель отчета:* | | | |  | | | |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | |  | | | |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | | | |
| *Инициатор поручения:* | | | |  | | | |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | |  | | | |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | |
| *Сторона по обязательству* | | | | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | |  | | | |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | | | |
| *Контрагент:* | | | |  | | | |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | |  | | | |  | | |  | | | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | *Депозитарный код* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | | | |
| *Группа сделок СУО:* | | | | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | |  | | |  | | | | |
|  | | | | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | |  | | |  | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Перечень обязательств* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Референс обязательства:* |  | | | | | | | | *Регистрационный номер сделки* | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | *Место заключения:* | | | | | | | | | | |  | | | | | *Дата исполнения* | | | |  | | |
|  | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | | |
| *Тип обязательства:* | | |  | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | |  | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | |  | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Код корзины обеспечения:* | | |  | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | |  | |  | | | *Ставка текущая:* | | | | | | | | | | |  | | *Код валюты* | | | |  | | | | |
|  | |  | | | |  | | | |  | | |  | | |  | | |  | |  | |  | | |  | |  | |  | |  | | |  | | | | | | | | | | |  | |  | | | |  | | | | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Метод расчета %:* |  | *Код денежного индикатора:* |  | *Спред:* |  | *Фикс. ставка* | *С реюзом* |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Нижний порог переоценки \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | *Верхний порог переоценки \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_* | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Изменения*  *обязательства* | | | | | | | *Способ расчетов по*  *первой части РЕПО:* | | | | | | | | | | | | | | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | | | | | | | | | | | | | *Способ расчетов по*  *второй части РЕПО:* | | | | | | | | | | | | | | | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | | | | |
|  | *Статус действия:* | | | | | | | | |  | | | | | | | | | *Номер отчета:* | | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | | *Код операции:* | | | | | | | | | | |  |
|  |  | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | *Номер операции:* | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | | *Дата и время исполнения:* | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | |
|  | |  | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | *Поручение депо №:* | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | | *Дата составления поручения:* | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | |
|  | |  | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | *Инициатор поручения:* | | | | | | | | |  | | | |  |  |  |  | | |  | |  | |  | |  | |  |  | |  | |  | | |  | |  | | | | | | | | | | | | |
|  | |  | | | | | | | | |  | | | |  |  |  |  | | |  | |  | |  | |  | |  |  | |  | |  | | |  |  | | | | | | | | | | | | | |
|  | |  | | | | | | | | | | | | ***Депозитарный код*** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | *Краткое наименование* | | | | | | | | | | | | | |
|  | | *Дополнительная информация:* | | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | *Движение ценных бумаг* **[[10]](#footnote-10)** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | **Код ценной бумаги** | | | | |  | | **Краткое наименование** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | | | | | | | **Количество** *(шт)* | | |
|  | |  | | | | |  | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | |  | |  | | |  | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | |  | | | | |  | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | |  | |  | | |  | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | |  | | | | |  | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |  | | |  | |  | | |  | |
|  | | | | |  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| *Движение денег***[[11]](#footnote-11)** | | | | | Изменение обязательства Исполнение обязательства | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | Валюта Сумма | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | Валюта Сумма | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  | | | | | | |  |  |  | |  |  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |
|  |  |  | |  |  |  |  |  |  | |  |  |  | | ю |  |  |  |  |  |  |  |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  | ю |  |  | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | |  | | | | | | | | | | | *Дата исполнения операции:* | | | | | | | | | | | | <Дата> <время> | | | | | | | | | | |
| *Дата операционного дня исполнения операции:* | | | | | | | | | | | | <Дата> | | | | | | | | | | | | | |

***Основание*:**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| ПОРУЧЕНИЕ № | |  | От «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. | | | | | |
|  | | | | | | | | | |
| *Рег. № поручения:* | |  | *Дата регистрации поручения:* | | | <Дата> <время> | | | | |
|  | | | | | | | |
|  | | | *Дата принятия на исполнение:* | | | <Дата> <время> | | | | |
| *Операционист:* |  | | | МП | *Подпись:* | |  | | |

ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_\_\_\_ от «\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г.

### Отчет о Заемщиках, обязательства которых не обеспечены

**Форма NFX35**

**ОТЧЕТ ОБО ВСЕХ НЕОБЕСПЕЧЕННЫХ ЗАЕМЩИКАХ №\_\_\_\_\_\_**

**от «\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_ г. <**время составления отчета**>**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| ***Операция****:* |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| *Отправитель отчета:* | <код анкеты> |  | <краткое наименование> |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| *Получатель отчета:* | < код анкеты> |  | <краткое наименование> |

**Список необеспеченных заемщиков**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Заемщик* | | *Сумма обязательств* | *Сумма обеспечения* | *Предел необеспеченности* |
| *Код* | *Краткое наименование* |
|  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Номер операции:* |  | *Дата исполнения операции:* | | <Дата> <время> | |
|  |  | *Дата операционного дня исполнения операции:* | <Дата> | |

***Основание:***

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ПОРУЧЕНИЕ № |  | От «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 200\_г. | | |
|  | | | | | |
| *Рег. № поручения:* |  | *Дата регистрации поручения:* | <Дата> <время> | | |
|  | | | |
|  | | *Дата принятия на исполнение:* | <Дата> <время> | | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Операционист:* |  |  | *Подпись:* |  |

МП

ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_\_\_\_ от «\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г.

### Отчет о компенсации доходов Кредитора

**Форма NFX36**

**ОТЧЕТ О КОМПЕНСАЦИИ ДОХОДОВ КРЕДИТОРА №\_\_\_\_\_\_**

**от « \_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_ г. <**время составления отчета**>**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| ***Операция****:* |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| *Отправитель отчета:* | <код анкеты> |  | <краткое наименование> |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| *Получатель отчета:* | <код анкеты> |  | <краткое наименование> |

**Атрибуты корпоративного действия**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Тип корпоративного действия:* | | |  | | | *Наименование корпоративного действия:* | | | |  | | | |
| *Референс корпоративного действия:* | | |  | | | *Назначение платежа:* | | | |  | | | |
| *ISIN бумаги:* | | |  | | | *Краткое наименование ценной бумаги:* | | | |  | | | |
| *Количество бумаг:* |  | | | *Сумма выплаты на одну бумагу:* | | | |  | | | *Сумма к выплате:* |  | |
| *Дата фиксации остатков:* | |  | | | *Время фиксации остатков:* | |  | | *Дата выплаты:* | |  | *Валюта выплаты:* |  |

**Список сделок, связанных с корпоративным действием**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Номер сделки* | *Тип Генерального соглашения(код)* | *Контрагент по сделке* | | *Место заключения сделки* | *Количе*  *ство бумаг* | *Сумма к выплате* | *Номер платежного поручения* | *Дата возврата дохода* | *Дата исполнения первой части* | *Дата исполнения второй части* |
| *Код* | *Краткое наименование* |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| *Результат проведения выплаты* | *Причина отказа* |
|  |  |

**Сумма выплаты, не отождествленная ни с одним Участником**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Количество бумаг:* |  | *Код счета депо (на дату фиксации):* |  | *Сумма :* |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | *Дата исполнения операции:* | | <Дата> <время> | |
|  |  | *Дата операционного дня исполнения операции:* | <Дата> | |

***Основание:***

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ПОРУЧЕНИЕ № |  | От «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 200\_г. | | |
|  | | | | | |
| *Рег. № поручения:* |  | *Дата регистрации поручения:* | <Дата> <время> | | |
|  | | | |
|  | | *Дата принятия на исполнение:* | <Дата> <время> | | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Операционист:* |  |  | *Подпись:* |  |

МП

ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_\_\_\_ от «\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г.

### Отчет об обязательствах по прекращенной Сделке РЕПО

**Форма MS318**

**ОТЧЕТ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬСТВАХ ПО ПРЕКРАЩЕННОЙ СДЕЛКЕ №\_\_\_\_\_\_**

**от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_ г. <**время составления отчета**>**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| ***Операция****:* |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Отправитель отчета:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Получатель отчета:* |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Код анкеты* | | | | | | | | | | | | |  | *Краткое наименование* |

**Атрибуты сделки, учет обязательств по которой прекращен <дата прекращения>**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Дата заключения* | *Место* | *Референс* | *Регистра-ционный №* | *Группа сделок СУО НРД* | | *Контрагент по сделке* | | *Генеральное соглашение* | |
| *Код* | *Наименование* | *Код* | *Краткое наименование* | *№* | *Дата* |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Дата первой части* | *Валюта* | *Сумма первой части* | *Дата второй части* | | *Ставка по сделке в %* | | *Причина прекращения* |
| *Начальная* | *Конечная* | *Начальная* | *Конечная* |
|  |  |  |  |  |  |  |  |

**Обязательства по сделке на дату прекращения. <Роль в сделке>: <код анкеты стороны по обязательству>, <краткое наименование>**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *Сумма* | *Валюта* | *Стоимость обязательства в руб.* | | *Код ценной бумаги* | *ISIN* | *Наименование* | *Количество* | *Цена в руб.* | *НКД в руб.* |
| *Обязанности* | *Требования* |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | *Стоимость обязательства в руб.* | | *Нетто в руб.* |
| *Обязанности* | *Требования* |
|  | ***Итого:*** |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | *Дата исполнения операции:* | | <Дата> <время> |
|  |  | *Дата операционного дня исполнения операции:* | <Дата> | |

***Основание:***

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ПОРУЧЕНИЕ № |  | От «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г. | | |
|  | | | | | |
| *Рег. № поручения:* |  | *Дата регистрации поручения:* | <Дата> <время> | | |
|  | | | |
|  | | *Дата принятия на исполнение:* | <Дата> <время> | | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *Операционист:* |  | МП | *Подпись:* |  |

ОТЧЕТ №\_\_\_\_\_\_\_\_\_ от «\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_г.

### Заявление об отказе от предоставления услуги по перечислению дохода по ценным бумагам

**Форма LN018**

**Заявление**

**об отказе от предоставления услуги**

**по перечислению дохода по ценным бумагам**

Полное и/или сокращенное наименование Заявителя (в соответствии Уставом):

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Прошу прекратить учет обязательства Участника клиринга

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

(полное наименование и код анкеты Участника клиринга)

по перечислению денежных средств для выплаты дохода, полученного по корпоративному действию:

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Тип | Референс  НРД | Дата фиксации | Валюта выплаты | Сумма выплаты на 1 ценную бумагу |
|  |  |  |  |  |

по ценной бумаге,

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| ISIN | Количество | Наименование |
|  |  |  |

переданной Участнику клиринга \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ в

(полное наименование и код анкеты Участника клиринга)

качестве обеспечения по Сделке РЕПО № \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ от \_\_»\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_20\_\_\_ г.

Обязательство зарегистрировано в клиринговой организации НРД в \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

(валюта обязательства

по перечислению дохода)

на сумму \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ (\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_)

(сумма цифрами и прописью)

Урегулирование порядка возврата выплаты доходов вне СУО НРД

Отсутствие необходимости перечисления дохода клиринговой организацией НРД (нужное отметить)

по указанной ценной бумаге по данной Сделке РЕПО подтверждаю.

Руководитель (Уполномоченный представитель):

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

(Должность) (подпись) (И.О. Фамилия)

М.П.

«\_\_\_»\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_20\_\_\_г.

Приложение 4 к Порядку взаимодействия Клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением

# Расписание действий по Управлению обеспечением по Сделкам РЕПО

1. НРД принимает уведомления Кредитора, содержащие список выпусков ценных бумаг либо перечень требований к ценным бумагам, дисконты и иные ограничения в порядке, определенным Порядком либо Договором об информационном взаимодействии с Глобальным кредитором при оказании Услуг.
2. НРД ежедневно по операционным дням в 10:30 проводит:
   1. Расчет Текущей ставки РЕПО по каждой Сделке РЕПО, заключенной с Плавающей Ставкой РЕПО с использованием Индикативных ставок RUONmDS, RREFKmDS и RREFKEYR.
   2. Расчет Текущей стоимости обязательства по каждой Сделке РЕПО.
   3. Переоценку обязательств и Обеспечения. По результатам переоценки Клиентам выдается утренний [Отчет об Обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1).
   4. Проверку Обеспеченности обязательств с последующим исполнением обязательств по Компенсационным взносам в виде ценных бумаг, за исключением случаев, когда Клиент предоставил в НРД [Поручени](#_Отчет_о_регистрации)е на регистрацию параметров. в соответствии с которым Компенсационный взнос в указанное время не взимается,
   5. Формирование для Государственных кредиторов [Отчета о Заемщиках, обязательства которых не обеспечены](#_Отчет_о_Заемщиках,_1).
   6. Замену ценных бумаг по служебному поручению НРД по указанным в пункте 34.5 Порядка основаниям.
   7. Формирование [Отчетов о регистрации обязательств](#_Отчет_о_регистрации/изменении_1), промежуточных [Отчетов об Обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1) при наличии изменений с момента выдачи утреннего отчета, а также [Сводных отчетов о регистрации обязательств](#_Сводный_отчет_о_1) по форме [MS218](#_Сводный_отчет_о_1) (Приложение 3) за период с начала текущего дня (только при наличии изменений).
3. В ходе клиринговых сеансов, осуществляемых с использованием только торговых банковских счетов, открытых в НРД, НРД также производит:
   1. Расчет обязательств по второй части Сделки РЕПО, если текущая дата является Датой второй части Сделки РЕПО.
   2. Проверку Обеспеченности обязательств с последующим взиманием Компенсационных взносов в виде ценных бумаг, за исключением случаев, когда Клиент предоставил в НРД [Поручение на регистрацию параметров](#_Поручение_на_регистрацию_2), в соответствии с которым Компенсационный взнос в данный клиринговый сеанс не взимается.
   3. Формирование [Отчетов о регистрации обязательств](#_Отчет_о_регистрации/изменении_1), промежуточных [Отчетов об Обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1) при наличии изменений с момента выдачи предыдущего отчета, за исключением последнего клирингового сеанса, [Сводных отчетов о регистрации обязательств](#_Сводный_отчет_о_1) за период с предыдущего такого сеанса или процедуры переоценки (при наличии изменений).
   4. Формирование для Государственных кредиторов [Отчета о Заемщиках, обязательства которых не обеспечены](#_Отчет_о_Заемщиках,_1).
   5. Федеральному казначейству перед началом клирингового сеанса дополнительно предоставляется [Отчет об Обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1) в случае наличия в клиринговом пуле Сделок РЕПО с текущей Датой второй части Сделки РЕПО, по которым произошли изменения Обеспеченности обязательств за период времени от выдачи предыдущего [Отчета об Обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1) до текущего клирингового сеанса.
4. Расписание клиринговых сеансов приведено в Правилах клиринга.
5. В ходе последнего клирингового сеанса дополнительно осуществляется:
   1. Перевод в соответствии с Порядком денежных средств со Счетов Банка России и Федерального казначейства для получения выплат на счета Заемщиков для перечисления дохода по Ценным бумагам, переданным Кредитору:
      1. в российских рублях, зачисленных на Счет Банка России и (или) Федерального казначейства для получения выплат в текущий или предыдущий операционный день, в отношении ценных бумаг, указанных в пункте 35.4.1 Порядка;
      2. в иностранной валюте, зачисленной на Счет Банка России и (или) Федерального казначейства для получения выплат в текущий или в течение предыдущих 4 (четырех) операционных дней, в отношении ценных бумаг, указанных в пункте 35.4.2 Порядка;
      3. в российских рублях и иностранной валюте, зачисленных на Счет Банка России и (или) Федерального казначейства для получения выплат в текущий или в течение предыдущих 5 (пяти) операционных дней, в отношении ценных бумаг, указанных в пункте 35.4.3 Порядка.
   2. Предоставление Банку России и Федеральному казначейству [Отчета о компенсации доходов Кредитора](#_Отчет_о_компенсации_1) по итогам перечисления средств, указанных в пункте 5.1 настоящего Приложения.
   3. Исполнение обязательств по Компенсационным взносам в виде денежных средств.
   4. Формирование для Государственных кредиторов [Отчета о Заемщиках, обязательства которых не обеспечены](#_Отчет_о_Заемщиках,_1).
   5. Перенос Даты второй части Сделки РЕПО (если возможность такого Переноса предусмотрена Генеральным соглашением с Глобальным кредитором).
6. Перед закрытием операционного дня НРД осуществляет:
   1. Расчет Текущей ставки РЕПО по каждой Сделке РЕПО, заключенной с Плавающей Ставкой РЕПО (за исключением Сделок РЕПО, заключенных с Плавающей ставкой РЕПО с использованием Индикативных ставок RUONmDS, RREFKmDS и RREFKEYR).
   2. Формирование итоговых [Отчетов об Обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1) по всем зарегистрированным обязательствам, [Сводных отчетов о регистрации обязательств](#_Сводный_отчет_о_1) за весь день, а также [Отчетов о Заемщиках, обязательства которых не обеспечены](#_Отчет_о_Заемщиках,_1) для Федерального казначейства. Банку России также предоставляется дополнительный отчет, содержащий перечень Заемщиков, обязательства которых не обеспечены, и Компенсационные взносы с которых не были удержаны ввиду недостаточности денежных средств и ценных бумаг.
   3. Формирование в случаях, установленных Порядком, [Отчетов об Обеспеченности](#_Отчет_о_составе_1) за каждый предстоящий нерабочий день.
   4. Определение права изменения Даты второй части в Сделках междилерского РЕПО.

Приложение 5 к Порядку взаимодействия клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением

# Перечень выпусков облигаций с запретом на обращение в периоды между датами составления списков для выплаты купонов и датами выплат

Ниже приводится перечень облигаций, для которых, согласно Решению о выпуске, устанавливается запрет на операции по счетам депо, связанные с их обращением, в периоды между датами составления списков для выплаты купонов и датами выплат.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ISIN | Код НРД | Рег. номер | Наименование | Эмитент |
| RU000A0JNYN1 | RU000A0JNYN1 | RU32048MOS0 | Облигации сорок восьмого выпуска Городского облигационного (внутреннего) займа Москвы | Правительство Москвы в лице Департамента финансов города Москвы |

Приложение 6 к Порядку взаимодействия Клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением

*На бланке организации*

В Небанковскую кредитную организацию акционерное

общество «Национальный расчетный депозитарий»

# УВЕДОМЛЕНИЕ О ДЕФОЛТЕ

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

(полное и/или сокращенное наименование организации в соответствии Уставом)

в связи с \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_,

(описание обстоятельств)

признаваемым в соответствии с Генеральным соглашением об общих условиях заключения договоров РЕПО на рынке ценных бумаг от «\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

№ \_\_\_\_\_\_\_\_ дефолтом \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_,

(полное и/или сокращенное наименование контрагента по Сделке РЕПО в соответствии с Уставом)

просит НКО АО НРД прекратить учет обязательств по следующим заключенным с указанным лицом Сделкам РЕПО:

|  |  |
| --- | --- |
| № п/п | Референс обязательства |
|  |  |
|  |  |
|  |  |

в соответствии с Порядком взаимодействия клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением.

Руководитель (Уполномоченный представитель):

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

(Должность) (подпись) (И.О. Фамилия)

М.П.

«\_\_\_»\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_20\_\_\_г.

Приложение 7 к Порядку взаимодействия Клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением

# Заявление о присоединении

# к договору об оказании услуг по управлению обеспечением

«\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

(*полное наименование Клиента, ОГРН/регистрационный номер*)

в лице \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_, действующего на основании\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_, в соответствии со статьей 428 Гражданского кодекса Российской Федерации полностью и безусловно присоединяется к договору об оказании услуг по управлению обеспечением, условия которого определены Порядком взаимодействия клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением и предусмотренными им Тарифами НРД.

Клиент ознакомлен с условиями оказания услуг и согласен, что Порядок взаимодействия клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением и Тарифы НРД могут быть изменены НКО АО НРД в одностороннем порядке.

Клиент согласен, что в случае недостижения согласия между Сторонами все споры, разногласия, претензии и требования, возникающие из Договора или прямо или косвенно связанные с ним, в том числе касающиеся его заключения, существования, изменения, исполнения, нарушения, расторжения, прекращения и действительности, подлежат разрешению в порядке арбитража (третейского разбирательства), администрируемого Арбитражным центром при Российском союзе промышленников и предпринимателей (РСПП) в соответствии с его правилами, действующими на дату подачи искового заявления. Вынесенное третейским судом решение будет окончательным, обязательным для Сторон и не подлежит оспариванию

1. В случае отсутствия в день, предшествующий дню, за который начисляются проценты, публикации значения ставки RUONIA, в расчет принимается последнее из опубликованных значений ставки RUONIA. [↑](#footnote-ref-1)
2. Термин «Санкции» используется в значении, установленном Условиями. [↑](#footnote-ref-2)
3. Термин «Иностранные ценные бумаги» используется в значении, установленном Порядком взаимодействия Депозитария и Депонентов при реализации Условий осуществления депозитарной деятельности Небанковской кредитной организацией акционерным обществом «Национальный расчетный депозитарий» [↑](#footnote-ref-3)
4. Foreign Accounts Tax Compliance Act, закон США, направленный на предотвращение уклонения налогоплательщиками США от налогобложения в США. [↑](#footnote-ref-4)
5. Название поля дано исключительно в целях информирования Сторон по Сделке РЕПО о предоставлении в соответствии с Порядком технической возможности для подачи поручений с кодом операции 18/54. При этом контроль за соблюдением условий Сделки РЕПО, в том числе за допустимостью изменения Даты второй части Сделки РЕПО, возлагается на Стороны по данной Сделке. [↑](#footnote-ref-5)
6. Наличие ограничений отражено в Анкете ценной бумаги, размещенной на Сайте в разделе «Обслуживаемые ценные бумаги». [↑](#footnote-ref-6)
7. Блок отображается только при наличии информации [↑](#footnote-ref-7)
8. Блок отображается только при наличии информации [↑](#footnote-ref-8)
9. Если поле пустое, то в печатной форме не отображается [↑](#footnote-ref-9)
10. Блок отображается только при наличии информации [↑](#footnote-ref-10)
11. Блок отображается только при наличии информации [↑](#footnote-ref-11)