



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ**
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА



Москва 2018

**СИСТЕМА УПРАВЛЕНИЯ
ОБЕСПЕЧЕНИЕМ (СУО) НРД:
АВТОПОДБОР ЦЕННЫХ
БУМАГ В КЛИРИНГ НКЦ**

НУЖНО ПЕРЕВЕСТИ ЦЕННЫЕ БУМАГИ В НКЦ? НРД ПОДБЕРЕТ БУМАГИ ПОД РАСЧЕТЫ

Автоперевод для расчетов в НКЦ

- Не хватает бумаг (в т.ч. КСУ) для поставки с 36 раздела



- НРД автоматически подберет недостающее количество с **разрешенных клиентом** счетов

Куда подбирает НРД и сколько это стоит?

на разделы **36**

в имущественные **пулы для выпуска КСУ**

Комиссия **240 руб. за запрос**
независимо от числа подобранных ISINs

Комиссия **взимается с НКЦ**

Комиссия ~75 руб. за перевод каждого ISIN не взимается

Что делает НРД?

- В режиме онлайн исполняет запрос
- Подбирает требуемые для поставки в клиринге НКЦ ценные бумаги с указанных счетов Участника в НРД
- Автоматически переводит подобранные бумаги на указанный счет и раздел/субсчет для клиринга НКЦ

ЧТО ТАКОЕ АВТОПЕРЕВОД ДЛЯ РАСЧЕТОВ В НКЦ

AS IS

- 1** Депонент самостоятельно переводит ценные бумаги в НКЦ со своей внебиржевой позиции

ДОБАВЛЯЕТСЯ

2 Автоперевод для расчетов сделок с ЦК

- НКЦ перед клирингом определяет недостающее количество ценных бумаг и подает поручение НРД на подбор
- НРД обращается к маркированным счетам клиента
- НРД переводит запрошенные ценные бумаги с маркированных разделов на 36 раздел или в имущественный пул
- НКЦ исполняет обязательства клиента по поставке ценных бумаг в клиринговом сеансе

РЕГЛАМЕНТ ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ С ЦК



16:00 / 18:00

Определение Итоговых (предварительных Итоговых) нетто-обязательств по ценным бумагам

**16:00–16:30 /
18:00–18:30***

НКЦ переводит ценные бумаги:

- со связанного Раздела T0;
- с субсчета депо, входящего в состав связанного пульного ТКС.

**16:30 –16:45 /
18:30 – 19:00***

НКЦ обращается к сервису подбора ценных бумаг НРД

НКЦ переводит ценные бумаги:

- со связанного Раздела T0;
- с субсчета депо, входящего в состав связанного пульного ТКС.

**16:45–17:00 /
19:00***

17:00 / 19:00

Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам, определенных на 1-м этапе формирования Единого клирингового пула, в т.ч. заключение сделок РЕПО с Недобросовестным участником

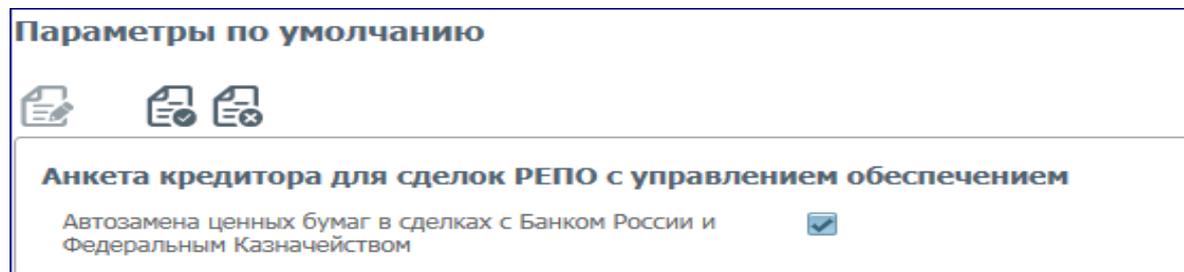
***каждый последующий шаг выполняется в случае недостаточности ценных бумаг на Разделе T+ для исполнения Итогового нетто-обязательства по ценным бумагам по итогам предыдущего шага**

ВОЗМОЖНОСТЬ АВТОМАТИЧЕСКОЙ ЗАМЕНЫ ЦЕННЫХ БУМАГ ИЗ СДЕЛОК С ГЛОБАЛЬНЫМИ КРЕДИТОРАМИ ДЛЯ РАСЧЕТОВ В НКЦ

При запросе НКЦ на ценные бумаги для расчетов их может не оказаться на маркированных счетах. Но нужные бумаги есть в сделках РЕПО с корзиной с Банком России или Казначейством.

Тогда НРД заменит нужные бумаги в сделке РЕПО на другие подходящие и переведет их автоматически в НКЦ для расчетов в клиринге.

Для активации сервиса нужно подать поручение в Веб-кабинете СУО: Меню-Операции-Параметры по умолчанию:



Параметры по умолчанию

Анкета кредитора для сделок РЕПО с управлением обеспечением

Автозамена ценных бумаг в сделках с Банком России и Федеральным Казначейством

Автоперевод для расчетов сделок с ЦК с автозаменой

- НКЦ перед клирингом определяет недостающее количество ценных бумаг и подает поручение НРД на подбор
- НРД обращается к маркированным счетам клиента
- Если на маркированных счетах нужных бумаг не хватает, дополнительно делает автозамену из сделок РЕПО с Банком России или Казначейством
- НРД переводит запрошенные ценные бумаги на 36 раздел или в имущественный пул
- НКЦ исполняет обязательства клиента по поставке ценных бумаг в клиринговом сеансе

ОТЧЕТНОСТЬ НРД КЛИЕНТУ ПО РЕЗУЛЬТАТАМ АВТОПЕРЕВОДА

- Перевод исполняется незамедлительно после получения запроса от НКЦ
- Возможно частичное исполнение запроса
- Результат подбора отражается в клиринговом отчете НРД по форме MS18G, депозитарном отчете MS101, SWIFT MT544, 546

ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ УЧАСТНИКА ДЛЯ ПОЛУЧЕНИЯ УСЛУГИ ПОДБОРА

1. Заключить с НРД договоры:

- об оказании клиринговых услуг
- об оказании услуг по управлению обеспечением

Внимание: если Вы уже заключили данные договоры (напр., для совершения сделок РЕПО с Банком России с корзиной), то дополнительных действий не нужно

2. Подать поручение на маркирование (см. Приложение)

ПРИЛОЖЕНИЕ. ПОДАЧА ПОРУЧЕНИЯ НА МАРКИРОВАНИЕ



ЧТО ТАКОЕ МАРКИРОВАНИЕ ДЛЯ КЛИРИНГА НКЦ

Маркирование для клиринга НКЦ - это **указание** Участником **счетов депо/разделов счетов депо**, а также (опционально) конкретных **ISIN** ценных бумаг и их **количества**, по которым он **поручает** НРД **осуществлять*** перевод на **указанные им в качестве счетов поставки** торговые счета для клиринга НКЦ, а также в имущественные пулы для выпуска КСУ.

Важно: путем **маркирования** Участник **также поручает** НРД **переводить** ценные бумаги при получении **поручения на подбор от НКЦ**.

Перевод ценных бумаг происходит при получении НРД **разовых запросов** на подбор от НКЦ (автоперевод для расчетов в НКЦ)

*В соответствии с Порядком взаимодействия клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением

КАК МАРКИРОВАТЬ ДЛЯ ПОДБОРА В КЛИРИНГ НКЦ

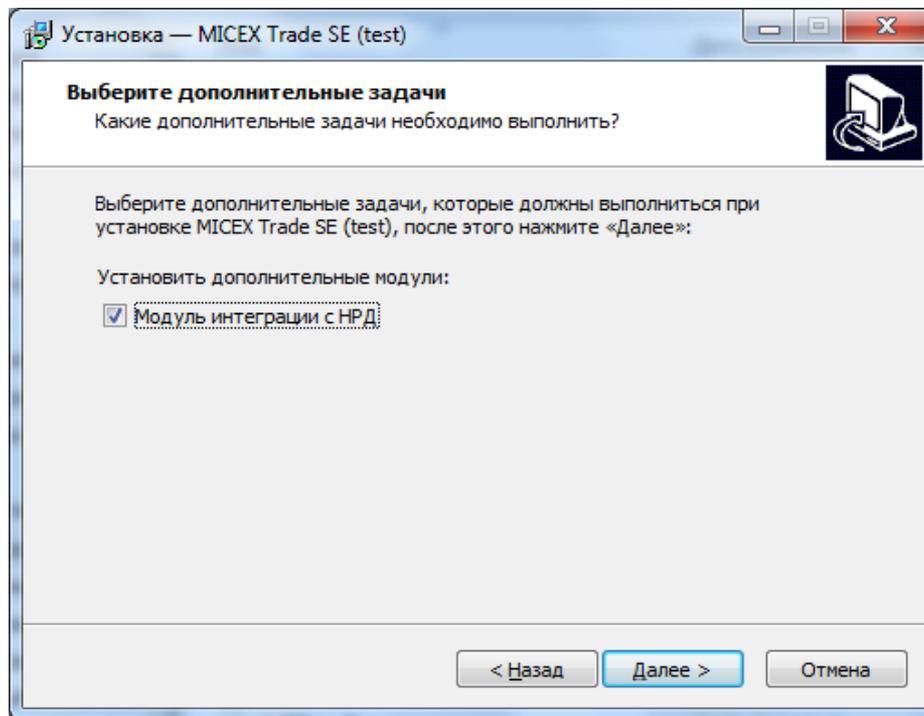
1. Группа сделок «GNCC» или «Подбор в клиринг НКЦ»
2. Подача поручения маркирования в Веб-кабинете СУО:
https://www.nsd.ru/common/img/uploaded/files/Documents/edodocs/rk/forms/krat_suo_ruk_web_cab.pdf раздел Маркирование или в терминале Московской биржи (см.слайды 11-14)
3. Обязательное заполнение субсчета (раздела счета депо), на который будут переводиться подобранные бумаги:
 - 36 или 31 раздел торгового счета депо
 - Субсчет клирингового счета депо НКЦ
4. Типы счетов и разделов, с которых возможен подбор активов
 - Основные счета депо, разделы 00, 70, 73, IN
 - Торговые счета депо НКЦ, разделы 31 и 36
 - Торговые счета депо НРД, разделы 00, 70, 73
5. Типы счетов, с которых возможен подбор активов, должны соответствовать типам счетов депо (субсчетов клирингового счета депо) в клиринге НКЦ. Например, для субсчета владельца допустим подбор только со счетов депо владельца, для субсчета номинального держателя – только со счетов депо номинального держателя.
6. Полезная информация об особенностях подбора (Раздел IV, VI) и правилах заполнения поручений (см. одноименный раздел) содержится на сайте НРД в разделе:

Документы -> **Услуги по управлению обеспечением** -> **Приложение №1 Порядок взаимодействия** клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением

ПОДАЧА ПОРУЧЕНИЯ НА МАРКИРОВАНИЕ В ТЕРМИНАЛЕ ФОНДОВОГО РЫНКА

Для доступа к сервису СУО НРД необходимо обновить Торговый терминал фондового рынка с указанием из программы установки «Модуль интеграции с НРД».

- **Внимание:** при автоматическом обновлении терминала при подключении к торговой системе данный модуль доступен не будет.



ПОДАЧА ПОРУЧЕНИЯ НА МАРКИРОВАНИЕ В ТЕРМИНАЛЕ ФОНДОВОГО РЫНКА (ПРОДОЛЖЕНИЕ)

ВКЛАДКА «НРД» В ТЕРМИНАЛЕ ФОНДОВОГО РЫНКА

Тестовый идентификатор 2 - Управляющий фирмы - MICEX Trade SE (тестовая версия)

Сеанс Вид Действие Таблица Запрос НРД Сервис Данные Окно Справка

0 - Сделки

Сделка №	Время	Тип	Заявка №	Партнер	Лоты	Объем	Объем НКД	Торговый счет
* 11 - НРД: Сделки в клиринге - 17:10:48								
Номер	Дата сделки	Номер заявки	Плоск		Исполненный объем	Объем, исполненный НРД		
1002	25.07.2014	11 485 001 266	МОЕХ			11,00		
1004	25.07.2014	11 485 001 267	МОЕХ			22,00		
54531920	03.07.2014	67 418 367	МОЕХ		1 000 000,00			
54531922	03.07.2014	67 418 369	МОЕХ		2 000 000,00			
55558908	08.07.2014	69 847 226	МОЕХ		8 000 000,00			
55558910	08.07.2014	69 848 292	МОЕХ		9 000 000,00			
55558914	08.07.2014	69 849 560	МОЕХ		10 000 000,00			
56747152	10.07.2014	71 662 243	МОЕХ		3 000 000,00			
64271980	15.07.2014	74 401 153	МОЕХ		3 000 000,00			
69528502	28.07.2014	81 407 741	МОЕХ		3 000 000,00			3 000 000,00
69950001	29.07.2014	81 774 949	МОЕХ		1 300 000,00			

Меню НРД:

- Анкета маркирования...
- Поручение на замену обеспечения...
- Состояние обеспечения
- Бумаги в обеспечении
- Сделки в клиринге
- Бумаги в обеспечении под сделкой
- Состояние поручений
- Корзины ценных бумаг
- Состав корзин ценных бумаг
- Дисконты и параметры обеспечения
- Остатки бумаг на разделах
- Депозитарные счета
- Торговые банковские счета

ПОДАЧА ПОРУЧЕНИЯ НА МАРКИРОВАНИЕ В ТЕРМИНАЛЕ ФОНДОВОГО РЫНКА (ПРОДОЛЖЕНИЕ)

Ввод строк поручения на маркирование: в Торговом терминале фондового рынка необходимо выбрать пункт НРД-> Анкета маркирования -> Добавить

- Группа сделок GNCC
- Поручение на маркирование определяет правила, с каких разделов счетов депо (счета подбора) на какие разделы счетов депо (счета поставки) может производиться подбор
- Порядок строк в анкете определяет, в какой последовательности эти правила подбора будут выполняться
- Можно указать конкретные ценные бумаги и их количества, которые разрешено подбирать
- При указании **количества 0** по конкретным бумагам **СУО не подбирает эти бумаги** с указанного счета/раздела

Заявка на маркировку

Инструмент: < все инструменты >

Количество: [input field]

Стоимость по макс.дисконту: -

Включить в список обеспечения для подбора
 Исключить из списка обеспечения для подбора

Группа сделок: GNCC

Счет депо подбора: HS1512230070

Раздел счета депо подбора: 36MC0128800000F00

Торговый счет подбора: S01+00000F00

Счет депо поставки: HX151102002C

Раздел счета депо поставки: 8SMC0128800000F00

Торговый счет поставки: S01b00000F00

Да Закреть

ПОДАЧА ПОРУЧЕНИЯ НА МАРКИРОВАНИЕ В ТЕРМИНАЛЕ ФОНДОВОГО РЫНКА (ПРОДОЛЖЕНИЕ)

1. Можно изменить строки анкеты, поменяв их местами или исправив любой атрибут, а также добавить строку с выбранными атрибутами
2. При включении в перечень ценных бумаг с промаркированного счета депо / раздела счета депо для всех бумаг данного счета/раздела используется установленный для счета/раздела приоритет (указанный в №п/п)
3. Далее необходимо нажать кнопку «Ввести поручение»

№ п/	Код инструмента	Инструмент	Группа сделок	Количество	Счет депо	Раздел счета депо	Торговля	Правила	Цена подбора	Дисконт
1	MSNG	+МосЭнерго	GNCC	20 000	HS1212115419	36MC0128800000F00		Да	0,8180	45,00%
2	RU000A0JUP14	100 КЖИ, АО ао01	CBR1	Любое	MS100616006A	000000000000000000				0,00%
3			CBR1,GNCC	Любое	HS1212115419	36MC0128800000F00		Да		
4			GNCC	Любое	TS121207032B	000000000000000000		Да		

Счет вывода: [dropdown] Раздел счета: [dropdown] Торговый счет: [dropdown]

Считать указанную в сделке корзину переменной

Ввести поручение Очистить анкету... Загрузить... Сохранить... Заккрыть

КОНТАКТЫ

- **Информацию по сервису** Вы можете получить у Вашего персонального менеджера в Отделе по работе с клиентами в НРД:

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

или

в отделе развития системы управления обеспечением:

Тимашева Светлана

Руководитель направления по развитию СУО и трехсторонних сервисов

Тел.: +7 (495) 234-48-27, ext. 4451

E-mail: timasheva@nsd.ru, triparty@nsd.ru

- **Информацию по вопросам подписания документов** Вы можете получить в отделе заключения и сопровождения договоров с клиентами в **НРД**:

Тел.: +7 (495) 956-27-89



**СПАСИБО
ЗА ВНИМАНИЕ!**



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ**
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

ПРАВОВАЯ ОГОВОРКА

- Настоящая презентация была подготовлена и выпущена НКО ЗАО НРД (далее – «Компания»). Если нет какой-либо оговорки об ином, то Компания считается источником всей информации, изложенной в настоящем документе. Данная информация предоставляется по состоянию на дату настоящего документа и может быть изменена без какого-либо уведомления.
- Данный документ не является, не формирует и не должен рассматриваться в качестве предложения или же приглашения для продажи или участия в подписке, или же, как побуждение к приобретению или же к подписке на какие-либо ценные бумаги, а также этот документ или его часть или же факт его распространения не являются основанием и на них нельзя полагаться в связи с каким-либо предложением, договором, обязательством или же инвестиционным решением, связанными с ним, равно как и он не является рекомендацией относительно ценных бумаг компании.
- Изложенная в данном документе информация не являлась предметом независимой проверки. В нем также не содержится каких-либо заверений или гарантий, сформулированных или подразумеваемых и никто не должен полагаться на достоверность, точность и полноту информации или мнения, изложенного здесь. Никто из Компании или каких-либо ее дочерних обществ или аффилированных лиц или их директоров, сотрудников или работников, консультантов или их представителей не принимает какой-либо ответственности (независимо от того, возникла ли она в результате халатности или чего-то другого), прямо или косвенно связанной с использованием этого документа или иным образом возникшей из него.
- Данная презентация содержит прогнозные заявления. Все включенные в настоящую презентацию заявления, за исключением заявлений об исторических фактах, включая, но, не ограничиваясь, заявлениями, относящимися к нашему финансовому положению, бизнес-стратегии, планам менеджмента и целям по будущим операциям являются прогнозными заявлениями. Эти прогнозные заявления включают в себя известные и неизвестные риски, факторы неопределенности и иные факторы, которые могут стать причиной того, что наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, будут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются под этими прогнозными заявлениями. Данные прогнозные заявления основаны на многочисленных презумпциях относительно нашей нынешней и будущей бизнес-стратегии и среды, в которой мы ожидаем осуществлять свою деятельность в будущем. Важнейшими факторами, которые могут повлиять на наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, которые могут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются этими прогнозными заявлениями являются, помимо иных факторов, следующие:
 - восприятие рыночных услуг, предоставляемых Компанией и ее дочерними обществами;
 - волатильность (а) Российской экономики и рынка ценных бумаг и (b) секторов с высоким уровнем конкуренции, в которых Компания и ее дочерние общества осуществляют свою деятельность;
 - изменения в (а) отечественном и международном законодательстве и налоговом регулировании и (b) государственных программах, относящихся к финансовым рынкам и рынкам ценных бумаг;
 - ростом уровня конкуренции со стороны новых игроков на рынке России;
 - способность успевать за быстрыми изменениями в научно-технической среде, включая способность использовать расширенные функциональные возможности, которые популярны среди клиентов Компании и ее дочерних обществ;
 - способность сохранять преемственность процесса внедрения новых конкурентных продуктов и услуг, равно как и поддержка конкурентоспособности;
 - способность привлекать новых клиентов на отечественный рынок и в зарубежных юрисдикциях;
 - способность увеличивать предложение продукции в зарубежных юрисдикциях.
- Прогнозные заявления делаются только на дату настоящей презентации, и мы точно отрицаем наличие любых обязательств по обновлению или пересмотру прогнозных заявлений в настоящей презентации в связи с изменениями наших ожиданий, или перемен в условиях или обстоятельствах, на которых основаны эти прогнозные заявления.

