

ФОРМАТЫ ОТЧЕТНЫХ ФОРМ В
РАМКАХ ПРОВЕДЕНИЯ
ОПЕРАЦИЙ РЕПО С
ГЛОБАЛЬНЫМ КРЕДИТОРОМ С
КОРЗИНОЙ ЦЕННЫХ БУМАГ

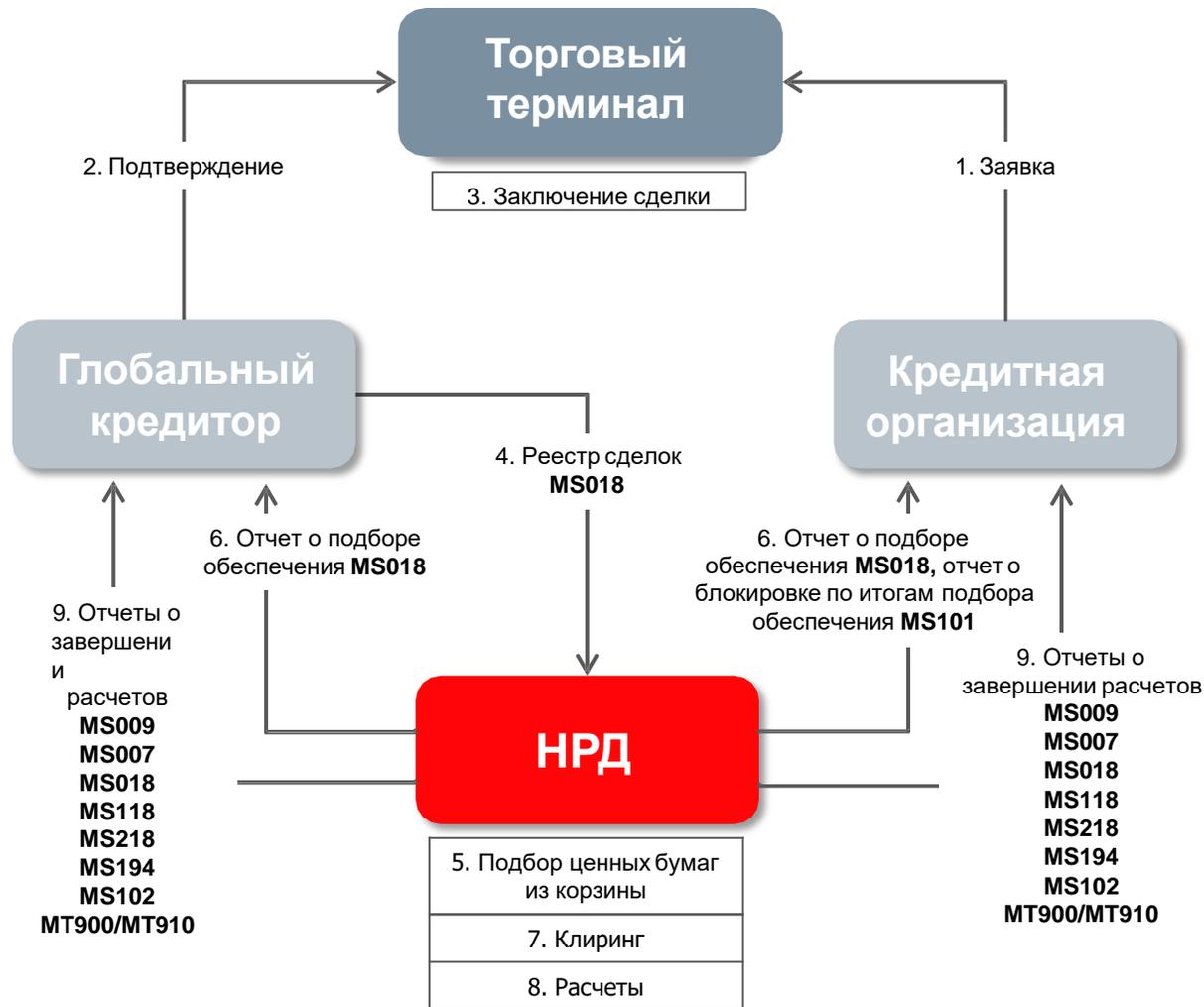


СХЕМА ПРОВЕДЕНИЯ РАСЧЕТОВ ПО ПЕРВОЙ ЧАСТИ РЕПО



1. Заемщик направляет заявку на участие в аукционе через торговый терминал биржи (систему отбора заявок)
2. Глобальный кредитор акцептует заявку и отправляет подтверждение в торговый терминал биржи (систему отбора заявок)
3. Происходит заключение сделки
4. Глобальный кредитор формирует реестр сделок и направляет его в НРД
5. НРД подбирает ценные бумаги в обеспечение, возможен частичный подбор
6. НРД сообщает отчетом о результатах подбора бумаг Глобальному кредитору и Заемщику
7. НРД проводит клиринг
8. НРД осуществляет перевод денег и ценных бумаг по итогам клиринга и регистрирует обязательства по 2-м частям сделок
9. НРД направляет отчеты о завершении расчетов, об обязательствах и их обеспечении Глобальному кредитору и Заемщику

ОТЧЕТЫ В РАМКАХ ПЕРВОЙ ЧАСТИ РЕПО



6. Отчеты о подборе обеспечения:

- MS018 (MT558) – Отчет о регистрации обязательств по сделке
- MS101 (MT546) – Отчет об исполнении депозитарного поручения (блокировка)

9. Отчеты о завершении отчетов:

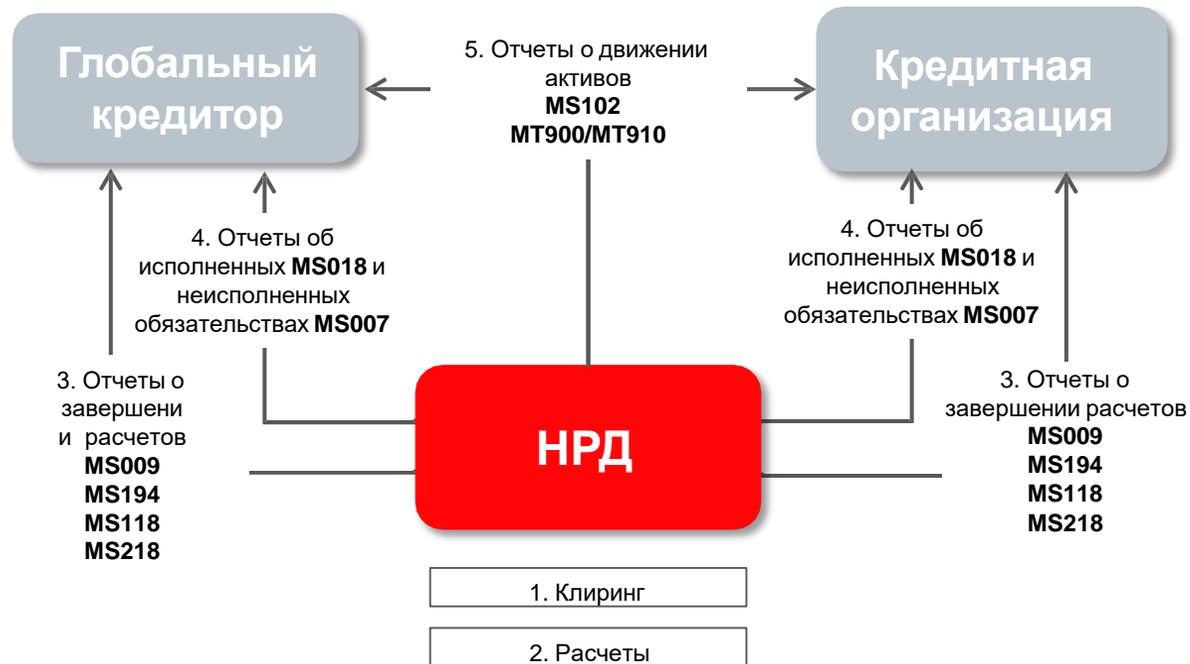
- MS009 (MT575) – Подтверждение осуществления расчетов на условия ППП по сделкам
- MS007 (MT537) – Неисполненные обязательства по сделкам
- MS018 (MT558) – Отчет о регистрации обязательств по сделке
- MS118 (MT569) – Отчет о составе обязательств и обеспеченности
- MS218 – Сводный отчет об изменениях обязательств пула
- MS194 (MT545/MT547) – Отчет о расчете первой/второй части сделки
- MS102 (MT546/MT544) – Отчет об исполнении сводного депозитарного поручения
- MT900/MT910 – дебетовое/кредитовое авизо об исполнении сводного платежного поручения

СХЕМА ПРОВЕДЕНИЯ РАСЧЕТОВ ПО ВТОРОЙ ЧАСТИ РЕПО



1. НРД проводит клиринг, учитывая обязательства по исполняемым первым и вторым частям РЕПО
2. НРД осуществляет перевод денег и ценных бумаг по итогам клиринга
3. НРД направляет отчеты о завершении расчетов Глобальному кредитору и Заемщику
4. НРД направляет Глобальному кредитору и Заемщику отчеты об исполненных и неисполненных обстоятельствах
5. НРД направляет Глобальному кредитору и Заемщику отчеты о движении активов

ОТЧЕТЫ В РАМКАХ ВТОРОЙ ЧАСТИ РЕПО



3. Отчеты о завершении расчетов:

- MS009 (MT575) – Подтверждение осуществления расчетов на условии ППП
- MS194 (MT545/MT547) – Отчет о расчете первой/второй части
- MS118 (MT569) – Отчет о составе обязательств и обеспеченности
- MS218 – Сводный отчет об изменениях обстоятельств пула

4. Отчеты об исполненных и неисполненных обязательствах:

- MS007 (MT537) – Неисполненные обязательства
- MS018 (MT558) – Отчет о регистрации обязательств по сделке

5. Отчеты о движении денежных средств и ценных бумаг:

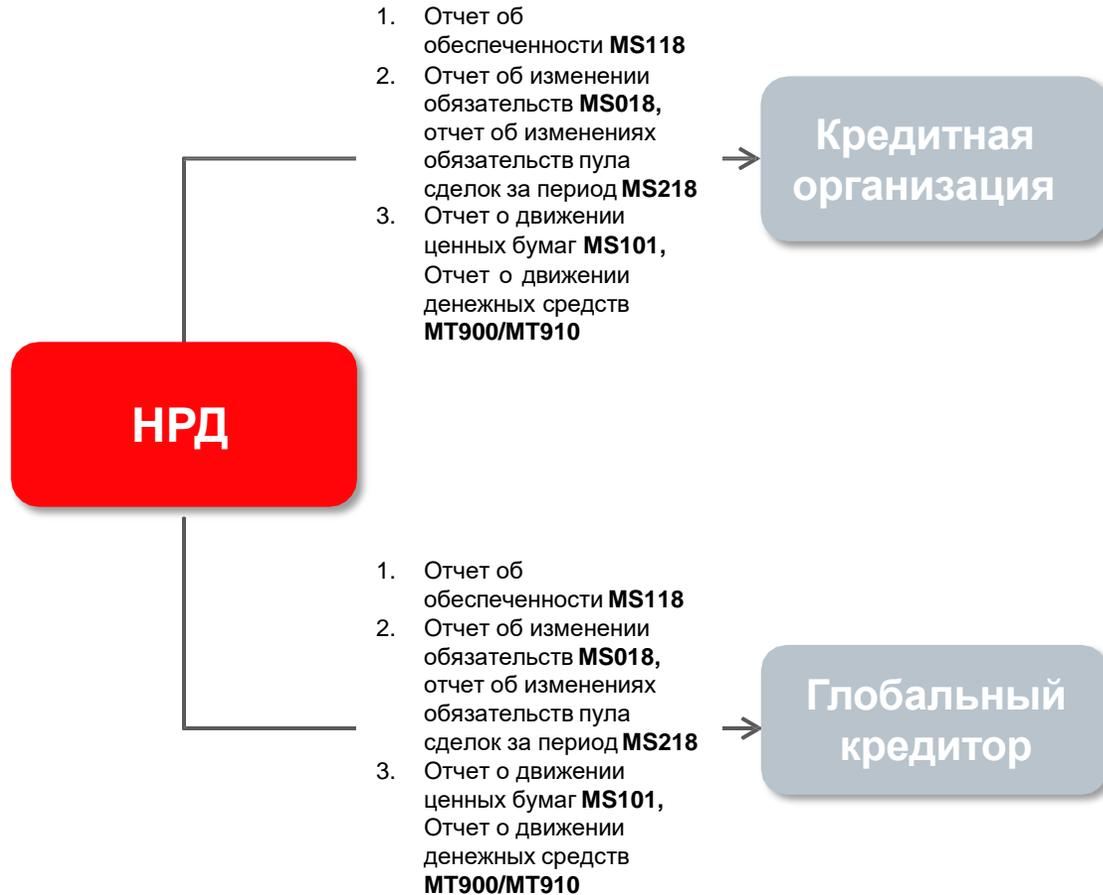
- MS102 (MT546/MT544) – Отчет об исполнении сводного депозитарного поручения
- MT900/MT910 – Дебетовое/кредитовое авизо об исполнении сводного платежного поручения

СХЕМА РАСЧЕТОВ ПРИ ИСПОЛНЕНИИ КОМПЕНСАЦИОННОГО ВЗНОСА



1. НРД проводит переоценку обязательств и обеспечения, определяет необходимость уплаты компенсационного взноса
2. НРД производит подбор бумаг для исполнения обязательств Заемщика или Глобального кредитора по компенсационным взносам
3. НРД создает платежное поручение на перевод ценных бумаг в обеспечение/из обеспечения
4. НРД исполняет компенсационный взнос ценными бумагами, отправляет отчеты о движении бумаг, об изменениях обязательств и их обеспеченности
5. После последнего клирингового сеанса НРД списывает денежные средства с торгового счета Заемщика при неполном исполнении им компенсационного взноса ценными бумагами. НРД отправляет отчеты о движении денежных средств, об изменениях обязательств и их обеспеченности

ОТЧЕТЫ ПРИ ПРОВЕДЕНИИ MARK-TO-MARKET И ИСПОЛНЕНИИ КОМПЕНСАЦИОННОГО ВЗНОСА



1. Отчет об обеспеченности

- MS118 (MT569) – Отчет о составе обязательств и обеспеченности

2. Отчеты об изменении обязательств

- MS018 (MT558) – Отчет об изменении обязательств и/или обеспечения
- MS218 – Сводный отчет об изменениях обязательств пула сделок за период

3. Отчеты о движении активов обязательств или обеспечения

- MS101 (MT546) – Отчет о движении ценных бумаг
- MT900/MT910 – Отчет о движении денежных средств (при выплате компенсационного взноса Заемщиком деньгами)

ВРЕМЕННОЙ РЕГЛАМЕНТ ПОЛУЧЕНИЯ ОТЧЕТОВ

Переоценка обязательств, Mark-to-Market (10.30):

10.35: MS118, MS018, MS218, MS101

Первый клиринговый сеанс (12.00):

12.05: MS101

12.10: MS007, MS009, MS018, MS218, MS118, MS194, MS102, MT900/910

Второй клиринговой сеанс (16.00):

16.05: MS101

16.10: MS007, MS009, MS018, MS218, MS118, MS194, MS102, MT900/910

Третий клиринговый сеанс (19:40):

19.45: MS101

19.50: MS007, MS009, MS018, MS218, MS194, MS102, MT900/910

Заккрытие операционного дня (21:30)

21.30: MS118, MS218

*Представленный временной регламент получения отчетов является ориентировочным

КОНТАКТЫ

УПРАВЛЕНИЕ РАЗВИТИЯ
СУО И ТРЕХСТОРОННИХ
СЕРВИСОВ

Тел. +7 495 234-48-27
доб. 4804, 4451, 4237
Моб. +7 916 584-00-65
E-mail: triparty@nsd.ru

УПРАВЛЕНИЕ
ПРОДАЖ

Моб. +7 985 764-25-79
E-mail: clients@nsd.ru

УПРАВЛЕНИЕ
ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ
С КЛИЕНТАМИ

Тел. +7 495 234-48-27
доб. 5704
E-mail: sales@nsd.ru

ОТДЕЛ ПО РАБОТЕ
С КЛИЕНТАМИ И ВАШ
ПЕРСОНАЛЬНЫЙ
МЕНЕДЖЕР

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

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ

ПРАВОВАЯ ОГОВОРКА

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