



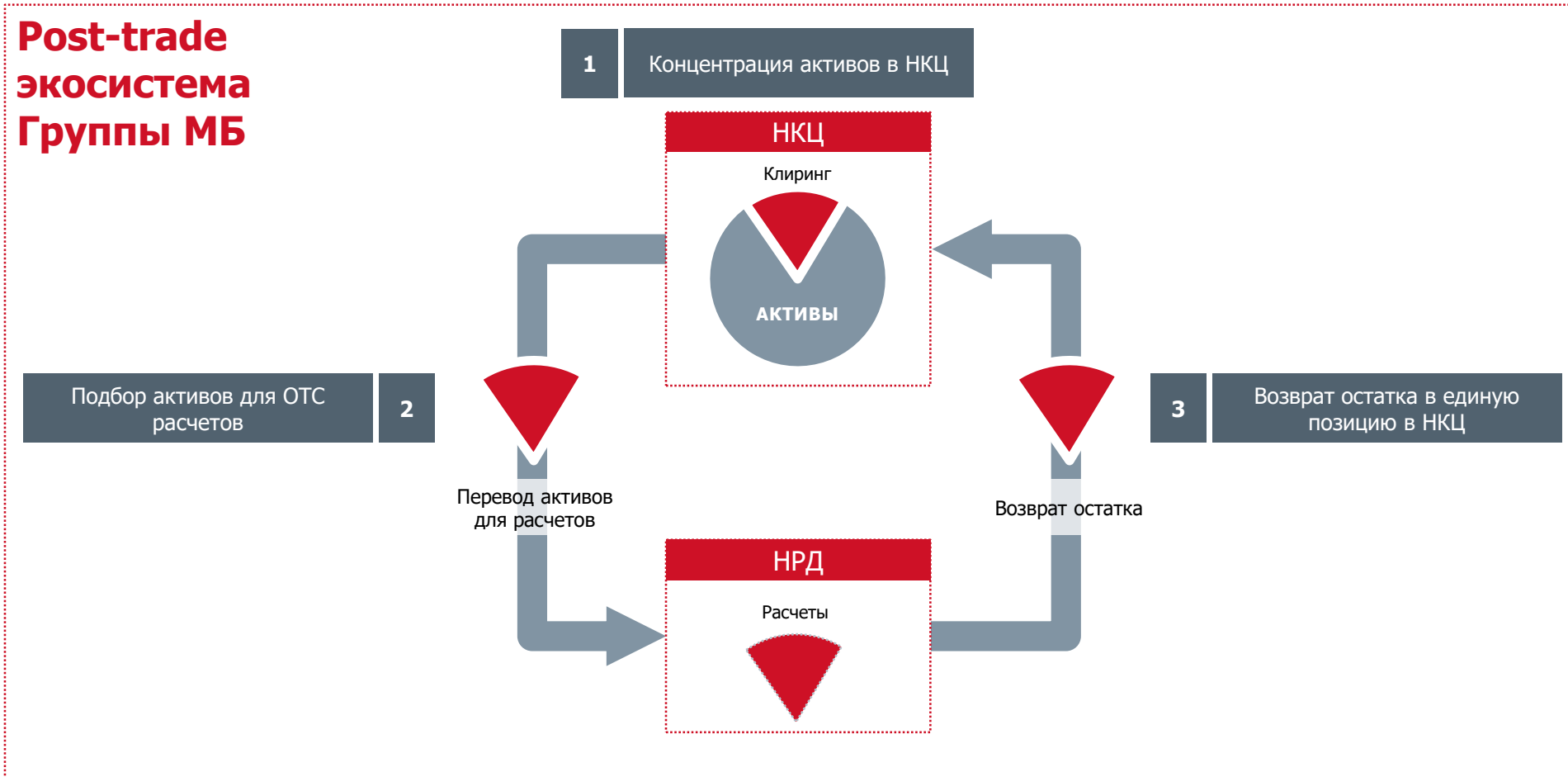
НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
РАСЧЕТНЫЙ  
ДЕПОЗИТАРИЙ  
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

17.12.2018

**ЕДИНЫЙ СЧЕТ.  
УПРАВЛЕНИЕ ЛИКВИДНОСТЬЮ.**

# ЕДИНЫЙ СЧЕТ

## Post-trade экосистема Группы МБ



# ПРЕИМУЩЕСТВА ДЛЯ КЛИЕНТОВ

Высокая скорость перевода активов и оптимизация внутренних процессов

Отсутствие необходимости подавать отдельные поручения для перевода денежных средств между торговыми счетами

Снижение риска неисполнения обязательств по сделкам за счет расширения пула доступной ликвидности

Сервис по автоматическому перераспределению денежных средств дополняет функционал подбора ценных бумаг

Отсутствие дополнительной тарификации за предоставляемые услуги

# ВИДЫ АВТОМАТИЧЕСКИХ ПЕРЕВОДОВ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ

Сервис	Направление	Как считается сумма денежных средств	Когда происходит перевод	Как активировать	Тариф
Управление ликвидностью	НРД -> НКЦ	<ul style="list-style-type: none"> <li>Остаток по счету</li> <li>Остаток за минусом плановых поставок</li> <li>Сумма сделки для DVP-1</li> <li>Сумма компенсационного взноса</li> </ul>	После клирингового сеанса или после расчетов по сделкам в режиме DVP-1 или после исполнения денежного компенсационного взноса	Предоставить в НРД поручение 18/ROUT «Переводы из клиринга НРД в клиринг НКЦ»	Взимается стандартная плата НРД за внутренний перевод между банковскими счетами
Управление ликвидностью	НКЦ -> НРД	<ul style="list-style-type: none"> <li>Сумма сделки для DVP-1</li> <li>Сумма средств для сеанса на gross основе</li> <li>Сумма средств для сеанса на нетто основе</li> <li>Сумма полученных доходов по ценным бумагам в обеспечении</li> <li>Сумма средств для денежного компенсационного взноса</li> </ul>	Перед клиринговым сеансом или перед расчетами по сделкам в режиме DVP-1 или перед исполнением денежного компенсационного взноса	Предоставить в НРД поручение 18/RINN «Переводы из клиринга НКЦ в клиринг НРД»  <i>Действия в НКЦ описаны ниже.</i>	Взимается стандартная плата НРД за внутренний перевод между банковскими счетами

## ДЕЙСТВИЯ УЧАСТНИКА В НКЦ

- Для использования технологии «**Единый счет с НРД**» Участнику клиринга НКЦ необходимо выполнить следующие действия:

  - ❖ **присвоить** Расчетному коду **признак «Единый счет с НРД»**, подав *Запрос на изменение параметров Расчетного кода*;
  - ❖ **зарегистрировать** в качестве Счета для возврата **торговый банковский счет**, открытый в НРД;
- Данные действия Участника клиринга НКЦ подтверждают **полномочия НРД** на:

  - ❖ подачу в НКЦ Запроса на получение денежных средств по такому Расчетному коду;
  - ❖ **возврат Обеспечения** в денежных средствах в соответствии с Запросом на получение денежных средств, полученным от НРД.
- Для **прекращения указанных полномочий НРД** Участник клиринга НКЦ **обязан предоставить** в НКЦ *Запрос на изменение параметров Расчетного кода*, который содержит указание **снять признак «Единый счет с НРД»**.

# СЕРВИС «УПРАВЛЕНИЕ ЛИКВИДНОСТЬЮ»

**УПРАВЛЕНИЕ ЛИКВИДНОСТЬЮ** позволяет автоматизировать перераспределение денежных средств между клиринговыми пулами НРД и НКЦ.

Доступны переводы в рублях (**RUB**) и долларах США (**USD**).

## ДЛЯ КОГО ПРЕДНАЗНАЧЕН СЕРВИС

- Участники клиринга НРД и НКЦ
- Наличие торговых банковских счетов в НРД и расчетных кодов в НКЦ
- Осуществление в НРД сделок РЕПО или DVP
- Подключение в НРД через Web-кабинет СУО

The screenshot shows the 'Web-кабинет СУО' interface. At the top is a red header with the text 'Web-кабинет СУО'. Below it is a dark grey navigation bar with tabs: 'Рабочая панель', 'Операции', 'Информация', 'Справочники', and 'Настройки'. The main content area has a breadcrumb 'Web-кабинет > Управление ликвидностью' and a title 'Управление ликвидностью'. There are two tabs: 'Переводы из клиринга НКЦ в клиринг НРД' and 'Переводы из клиринга НРД в клиринг НКЦ'. Below the tabs is a 'Фильтр' section with a plus icon. A table with four columns is visible: 'Счет списания', 'Счет зачисления', 'Расчетный код в клиринге НКЦ', and 'Расписание'. The first two columns have dropdown menus with 'Выберите значение' and an ellipsis. The third column has an empty text input field. The fourth column has a dropdown menu with a plus icon. There are also document icons and a close button (x) on the right side of the table.

# КАК ИСПОЛЬЗОВАТЬ СЕРВИС

## ВАРИАНТ 1

### **Концентрация ликвидности в одной клиринговой организации – НКЦ**

Сервис позволяет автоматически переводить денежные средства с торговых банковских счетов для клиринга НРД:

- на торговые банковские счета для клиринга НКЦ – 30411
- на расчетные коды НКЦ через клиринговый банковский счет НКЦ – 30414

## ВАРИАНТ 2

### **Подбор денежных средств для исполнения сделок в клиринге НРД**

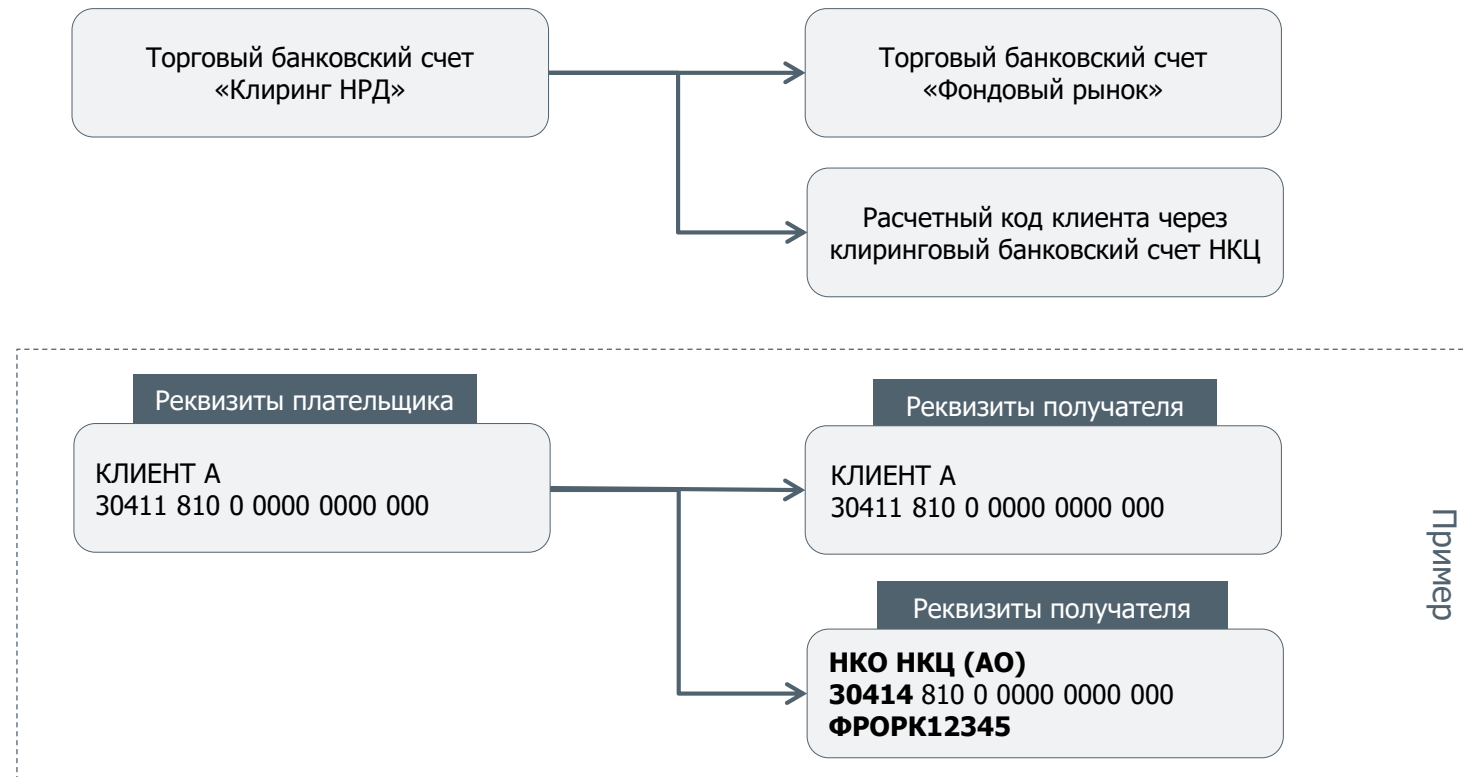
Система осуществляет подсчет суммы денежных средств, необходимых для исполнения сделок в клиринге НРД, и автоматически осуществляет перевод денежных средств на торговые банковские счета для клиринга НРД:

- с торговых банковских счетов для клиринга НКЦ – 30411
- с расчетных кодов НКЦ через клиринговый банковский счет НКЦ – 30414

# КОНЦЕНТРАЦИЯ ЛИКВИДНОСТИ В НКЦ

Денежные средства автоматически возвращаются из НРД в НКЦ:

- Для DVP-1 после исполнения сделки в сумме, равной сумме сделки (или менее)
- Для DVP-2,3 после окончания сеанса в сумме, равной свободному остатку на счете

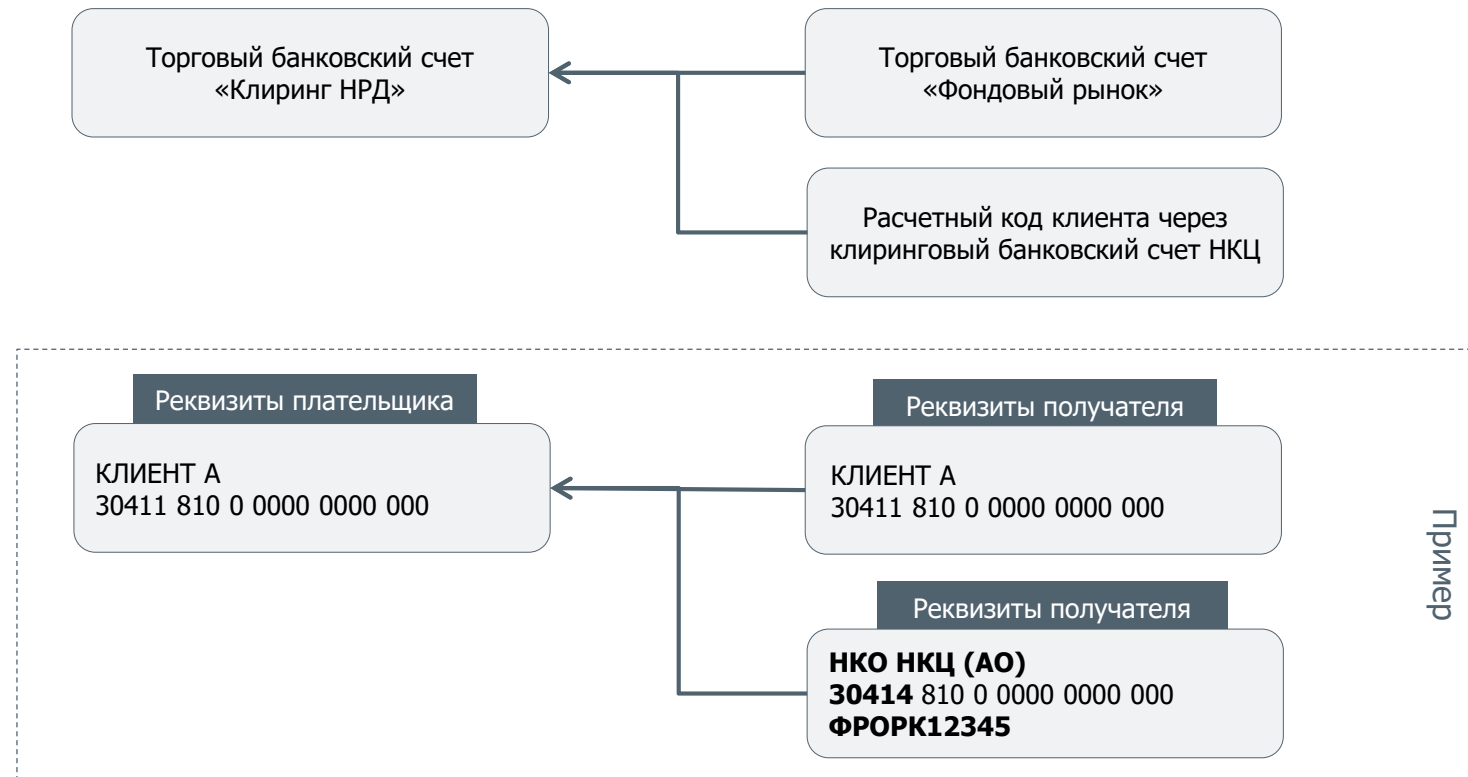


## Дополнительные опции:

- Возврат средств после сеанса за вычетом сумм, необходимых для исполнения открытых сделок РЕПО и DVP (дата расчетов сегодня или ранее). Опция не доступна для DVP-1.
- Возврат средств после исполнения компенсационных взносов в деньгах

# ПОДБОР ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ В КЛИРИНГ НРД

Система СУО НРД рассчитывает и подбирает необходимую сумму денежных средств для исполнения сделок DVP или РЕПО согласно правилам, установленным клиентом.

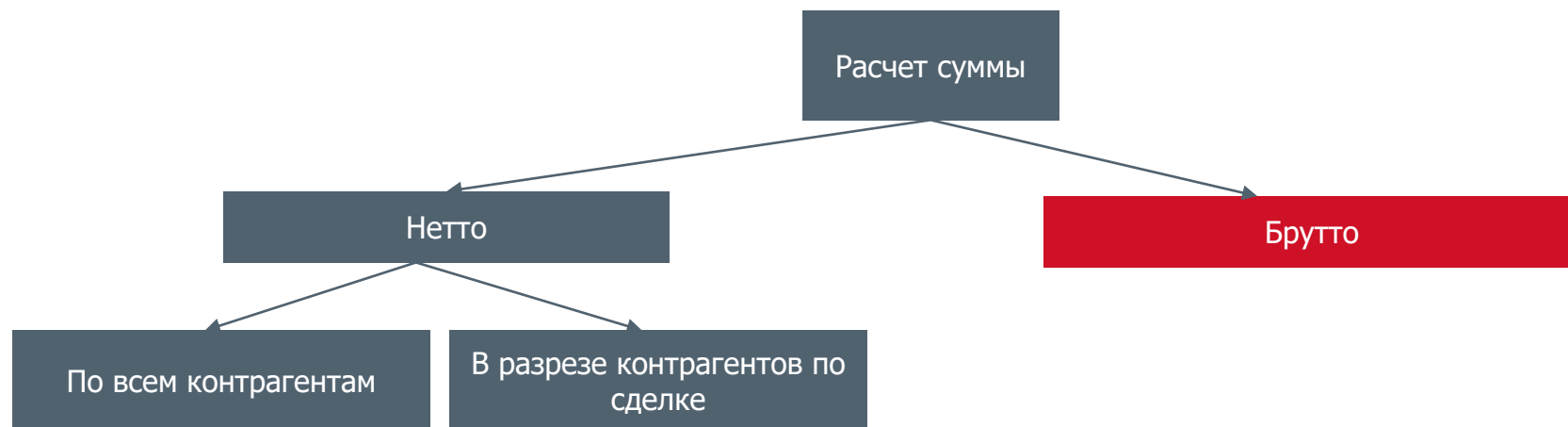


## Дополнительные опции:

- Неттинг по контрагенту при расчете суммы для подбора
- Частичный подбор, если средств на расчетном коде клиента недостаточно для исполнения запроса НРД на полную сумму.



# РАСЧЕТ СУММЫ ПОДБОРА В НРД



Расчет нетто-суммы осуществляется, если клиент дополнительно выбрал типы операций, по которым возникают денежные требования, например:

Продажи по сделкам DVP

Продажи по сделкам РЕПО

Поступление дохода по ценным бумагам в обеспечении

Расчет брутто-суммы осуществляется, если клиент выбрал исключительно типы операций с денежными обязательствами, например:

Только покупки по сделкам DVP

Только покупки по сделкам РЕПО

Только передача дохода по ценным бумагам в обеспечении

Исполнение Компенсационных взносов

# ОПРЕДЕЛЕНИЕ ДЕНЕЖНЫХ СЧЕТОВ

Условия для автоматических переводов денежных средств определяются клиентом посредством Web-кабинета СУО и других каналов с использованием 2х типов операций: 18/ROUT (из НРД в НКЦ) и 18/RINN (из НКЦ в НРД)

СЧЕТ СПИСАНИЯ	СЧЕТ ЗАЧИСЛЕНИЯ	РАСЧЕТНЫЙ КОД	РАСПИСАНИЕ	УСЛОВИЯ ПЕРЕВОДА
<b>30411810.....2</b> (НРД)  <b>ОТКУДА ПОДБИРАТЬ</b>	<b>30411810.....1</b> (НКЦ)  <b>КУДА ПОДБИРАТЬ</b>	12345	<ul style="list-style-type: none"> <li>Первый сеанс</li> <li>Последний сеанс</li> <li>Промежуточные сеансы</li> <li>Вне сеанса</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>1 часть РЕПО, продажа</li> <li>1 часть РЕПО, покупка</li> <li>2 часть РЕПО, продажа</li> <li>2 часть РЕПО, покупка</li> <li>Исполнение комп. взносов</li> <li>Поступление дохода ц/б</li> <li>Выплата дохода по ц/б</li> <li>Продажа бумаг</li> <li>Покупка бумаг</li> </ul>
				<ul style="list-style-type: none"> <li>Неттинг по контрагенту</li> <li>Частичный подбор</li> </ul>

## Управление ликвидностью

Счет списания	Счет зачисления	Расчетный код в клиринге НКЦ	Расписание	Условия перевода
<input type="text" value="Выберите значение"/>	<input type="text" value="Выберите значение"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

# КОНТРОЛЬ ОПЕРАЦИЙ



Формируемые по результатам работы постоянной инструкции проводки можно посмотреть в WEB-кабинете СУО



## Монитор исполнения переводов

### Управление ликвидностью

Переводы из клиринга НКЦ в клиринг НРД    Переводы из клиринга НРД в клиринг НКЦ    Результаты переводов

Фильтр +

Дата	Направление перевода	Счет списания	Расчетный код списания в клиринге НКЦ	Счет зачисления	Расчетный код зачисления в клиринге НКЦ	Номер платежного документа	Номер поручения маркирования	Сумма	Валюта
Переводы денежных средств отсутствуют									
1 из 1  10 									

# ДОПОЛНИТЕЛЬНАЯ ИНФОРМАЦИЯ

1. При предоставлении в НРД поручений 18/RINN и 18/ROUT каждое новое поручение дополняет ранее предоставленное.
2. Для отмены поручений 18/RINN и 18/ROUT требуется для каждой пары счетов оставить пустыми полями «расписание» и «условия перевода».
3. Опция «Передавать в НКЦ доступный остаток за вычетом плановых поставок на сегодня» используется только в рамках клиринговых сеансов.

**СПАСИБО  
ЗА ВНИМАНИЕ!**



**НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
РАСЧЕТНЫЙ  
ДЕПОЗИТАРИЙ**  
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

# ПРАВОВАЯ ОГОВОРКА

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