

ПОСТ-ТРЕЙД ОБСЛУЖИВАНИЕ ДЕПОЗИТОВ ГОСУДАРСТВЕННЫХ КРЕДИТОРОВ



ПРЕДЛОЖЕНИЕ ГРУППЫ МБ



Цель

Применение цифровых технологий в процессах государственного управления и, в частности, цифровизация процесса размещения денежных средств государственных органов



Предложение

Обеспечение полной автоматизации процесса размещения средств Государственного кредитора за счет:

- 1 проведения аукционов в системе отбора заявок М-депозиты Московской биржи
- 2 автоматических расчетов по депозитам
- 3 пост-трейд обслуживания сделок



Преимущества

Повышение удобства и надежности расчетов при размещении денежных средств

ПРЕИМУЩЕСТВА ДЛЯ ГОСУДАРСТВЕННОГО КРЕДИТОРА

Сейчас



Будет

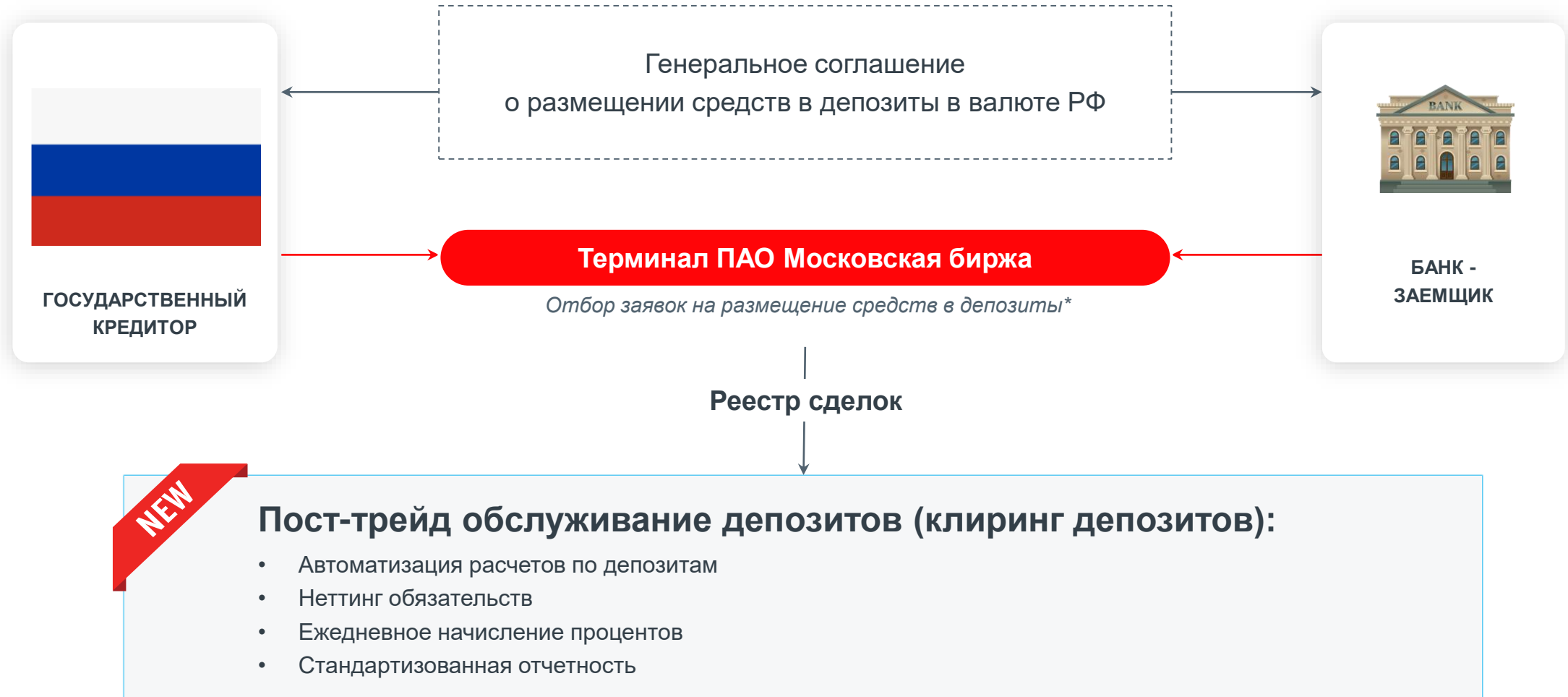
ОТБОР ЗАЯВОК + РУЧНЫЕ РАСЧЕТЫ

- Госкредитор самостоятельно отслеживает даты размещения и возврата депозита
- Госкредитор самостоятельно осуществляет расчеты с банками, подготавливая платёжные поручения по заранее согласованным реквизитам для каждого банка
- Госкредитор сверяет процентные ставки по депозитам и ежедневно начисляет проценты
- Перед возвратом сверяются начисленные проценты, суммы к возврату, реквизиты для перечисления средств

АУКЦИОН + КЛИРИНГ ДЕПОЗИТОВ

- + Подкрепление / Пополнение средств для перечисления в депозит производится на торговый банковский счет Госкредитора, открытый в НРД
- + НРД автоматически распределяет средства по счетам заёмщиков согласно реестру сделок, полученному от системы отбора заявок МОЕХ
- + В течение срока депозита НРД осуществляет ежедневный расчет начисленных процентов как по фиксированной ставке, так и по плавающей ставке
- + НРД предоставляет независимые отчёты сторонам по сделке

ВЗАИМОДЕЙСТВИЕ СТОРОН



ДОГОВОРНЫЕ ОТНОШЕНИЯ УЧАСТНИКОВ С НРД



ОСОБЕННОСТИ ОПЕРАЦИЙ

- Подача заявок и заключение сделок через терминал М-депозиты
- Сроки депозитов устанавливаются Госкредитором
- Начисление процентов по фиксированной или плавающей ставке
- Расчеты проходят по торговым банковским счетам в НРД
- Способы расчетов по сделкам DVP-2 с неттингом по денежным средствам
- Расчеты во всех клиринговых сеансах:

10:00, 12:00, 13:00, 14:00, 15:00, 16:00, 18:00, 18:45, 19:40

РАСЧЕТЫ ПРИ РАЗМЕЩЕНИИ ДЕПОЗИТА



1. Госкредитор направляет на Московскую биржу параметры аукциона
2. Заемщик направляет заявку на участие в аукционе через терминал М-депозиты
3. Госкредитор акцептует заявку и отправляет подтверждение. Заключение сделки.
4. Московская биржа формирует реестр сделок и направляет его в НРД
5. НРД регистрирует обязательства по депозитной сделке и проводит клиринговые сеансы
6. НРД осуществляет переводы денежных средств и направляет отчеты о завершении расчетов. При недостаточности денежных средств для проведения клиринга и расчетов направляется отчет MS007 о неисполненных обязательствах

РАСЧЕТЫ ПРИ ВОЗВРАТЕ ДЕПОЗИТА



1. В течение срока депозитной сделки НРД направляет Госкредитору и Заемщику Отчет об обязательствах участника, включая информацию о начислении процентов.
2. В дату возврат НРД проводит клиринг, включая обязательства как по возврату депозита, так и новые обязательства по размещению
3. НРД осуществляет переводы денежных средств и направляет отчеты о завершении расчетов. При недостаточности денежных средств для проведения клиринга и расчетов направляется отчет MS007 о неисполненных обязательствах
4. В случае неисполнения обязательств по возврату депозита (дефолт) НРД прекращает учет обязательств по депозитной сделке и направляет отчет MS318

ТАРИФИКАЦИЯ ОПЕРАЦИЙ

- Организатор аукционов – Госкредитор не платит за проведение аукционов по депозитам
- Госкредитор оплачивает фиксированную плату за обслуживание в НРД в размере 100 рублей в месяц
- Банки-заемщики оплачивают комиссию за аукционы в МБ
- Банки-заемщики оплачивают комиссию за клиринг в НРД

Комиссия	Тариф
Комиссия Московской биржи за депозитные аукционы	0,0001% от суммы депозита в день
Комиссия НРД за обслуживание депозитов	0,00005% от суммы депозита в день

Формула для тарифа НРД

$$0,00005\% * P * N$$

P – Сумма депозита в рублях, N – Срок депозита в днях

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.