



НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
РАСЧЕТНЫЙ  
ДЕПОЗИТАРИЙ  
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

**РЕПОЗИТАРИЙ НКО АО НРД:  
ПРИЧИНЫ И ЦЕЛИ СОЗДАНИЯ.  
ФУНКЦИОНАЛ, УЧАСТНИКИ И  
ИНСТРУМЕНТЫ.**

# ПРИЧИНЫ СОЗДАНИЯ

В 2009 году на саммите Большой двадцатки (G20) в Питтсбурге, США, было принято решение, что сведения о внебиржевых сделках с производными финансовыми инструментами должны предоставляться в **торговые репозитории**.

Принятие такого решения было обусловлено, в том числе, следующими факторами:

- Финансовым кризисом 2008 года, банкротством ряда финансовых организаций.
- Усложнением сделок с ПФИ и увеличением числа участников рынка деривативов.
- Отсутствием прозрачности на внебиржевом рынке деривативов и, как следствие, невозможности оценки рисков.

Законодательство о предоставлении сведений в торговые репозитории разработано (или разрабатывается) во всех странах Большой двадцатки, в том числе в США (Dodd-Frank Act) и Европейском Союзе (EMIR).

В России законодательство, обязывающее участников рынка направлять данные в репозитарий, принято в 2012 году и обновлялось в 2014 – 2016 годах:

- **Глава 3.2 «Репозитарий»** Федерального закона «О рынке ценных бумаг».
- **Указание Банка России №4104-У от 16.08.2016 г.\***



## ФЗ «О РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ»

### Федеральный закон № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» Глава 3.2 «Репозитарий»:

Репозитарной деятельностью признается осуществляемая на основании **лицензии** Банка России деятельность по оказанию услуг по **сбору, фиксации, обработке и хранению информации о заключенных не на организованных торгах договорах репо, договорах, являющихся производными финансовыми инструментами, договорах иного вида**, предусмотренных нормативными актами Банка России, а также по ведению реестра указанных договоров.

#### Статус репозитария:

Может быть получен биржей, клиринговой организацией\*, центральным депозитарием, расчетным депозитарием, не имеющий статуса центрального депозитария.

#### Какие типы сделок (договоров) подлежат регистрации?

Сделки РЕПО, сделки с производными финансовыми инструментами и иные виды сделок, определенные в законодательстве. Репозитарий НРД осуществляет регистрацию всех предусмотренных законодательством сделок, заключенных как на условиях генеральных соглашений, так и вне их рамок.

## УКАЗАНИЕ БАНКА РОССИИ 4104-У

### Указание Банка России № 4104-У от 30.04.2014:

- Определяет порядок по предоставлению информации в Репозитарий.
- Устанавливает сроки по предоставлению информации.
- Устанавливает структуру Реестра договоров.

### Обязанность по предоставлению информации в репозитарий

Представлять в репозитарий информацию обязаны **следующие юридические лица, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации:**

- кредитные организации,
- брокеры,
- дилеры,
- управляющие,
- депозитарии,
- регистраторы,
- негосударственные пенсионные фонды,
- управляющие компании инвестиционного фонда, паевого инвестиционного фонда и негосударственного пенсионного фонда,
- акционерные инвестиционные фонды,
- организаторы торговли,
- клиринговые организации,
- страховые организации.

## УКАЗАНИЕ БАНКА РОССИИ 4104-У

### Предоставление информации в репозитарий нефинансовыми организациями

В соответствии с Указанием Банка России от 16.08.2016 № 4104-У **юридические лица, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации и являющиеся сторонами по договорам, определенных законодательством, с 01.11.2016** обязаны предоставлять информацию о каждом из таких договоров, если второй стороной такого договора является юридическое лицо, не указанное в пункте 2 Указания Банка России, при выполнении любого из следующих условий:

- если сумма обязательств из такого договора на дату заключения в рублях или эквиваленте в иностранной валюте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, превышает 1 миллиард рублей;
- если сумма обязательств из совокупности таких договоров на конец каждого из трех месяцев подряд (далее - расчетный период) составляет не менее 10 миллиардов рублей или эквивалента в иностранной валюте, рассчитанного по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России на дату расчета (далее - пороговое значение);
- если такие договоры заключены с первого числа месяца, следующего за расчетным периодом, в рамках которого были достигнуты пороговые значения.

# СРОКИ ПО ПРЕДОСТАВЛЕНИЮ ОТЧЕТНОСТИ И КЛЮЧЕВЫЕ ДАТЫ



\* В соответствии с Указанием Банка России от 16.08.2016 № 4104-У

# ТИПЫ УЧАСТНИКОВ РЕПОЗИТАРНЫХ ОПЕРАЦИЙ



# КАТЕГОРИИ УЧАСТНИКОВ И СОВМЕЩЕНИЕ ИХ ФУНКЦИЙ

**Функции клиента и Информирующего лица** могут быть совмещены при условии, что клиент заключил с НРД Договор ЭДО.

Таким образом, клиент может являться Информирующим лицом по части собственных сделок и одновременно передать отчетность по другой части сделок другому Информирующему лицу, которым может быть его контрагент или третья сторона.

**Обязательные условия** для выполнения функций Информирующего лица:

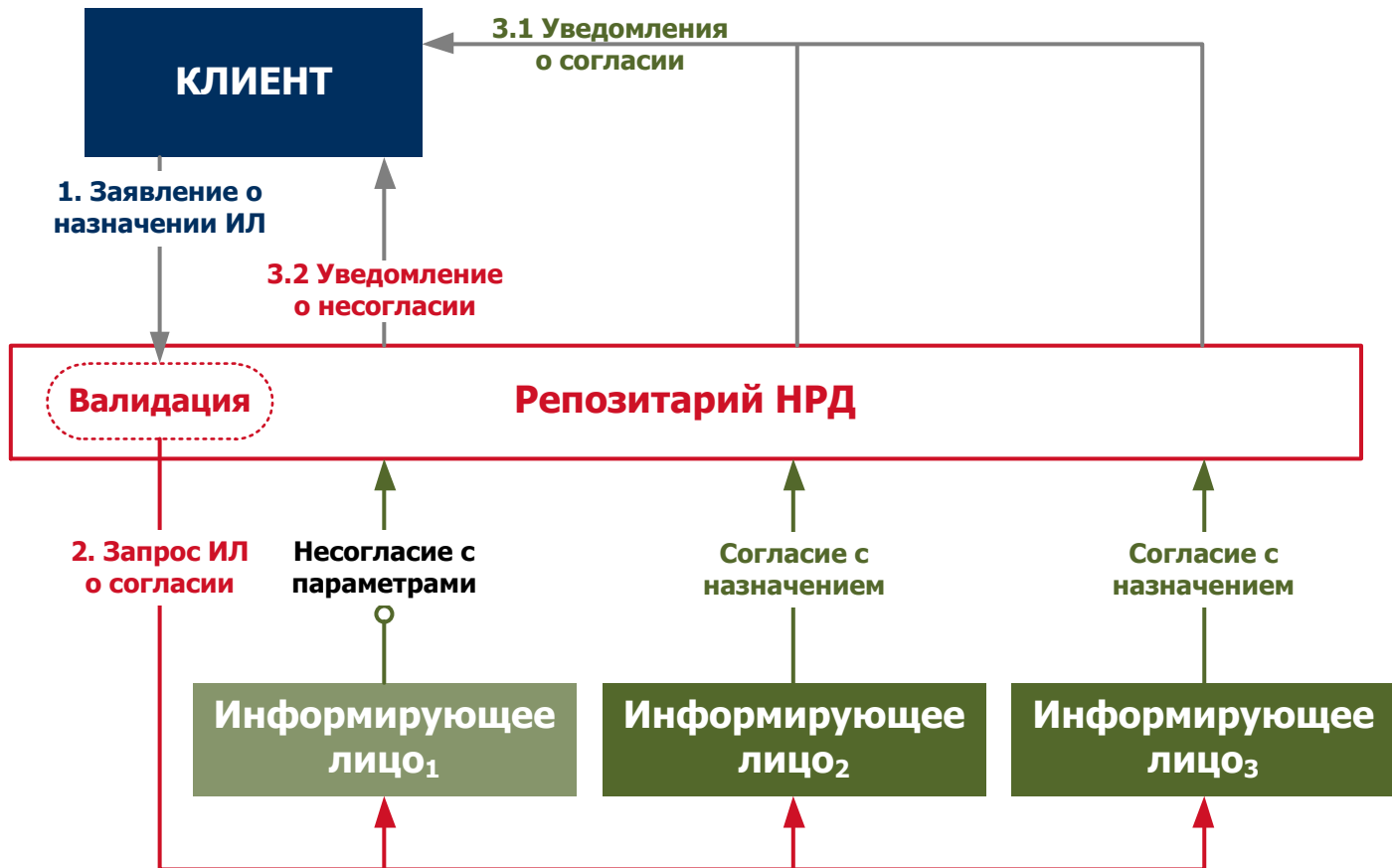
- Участник является юридическим лицом.
- Заключил с НРД Договор ЭДО.
- Получил LEI.

Подробная информация о назначении Информирующих лиц размещена в [\*\*Инструкции по заполнению форм СМ016 и СМ017 на сайте НРД.\*\*](#)



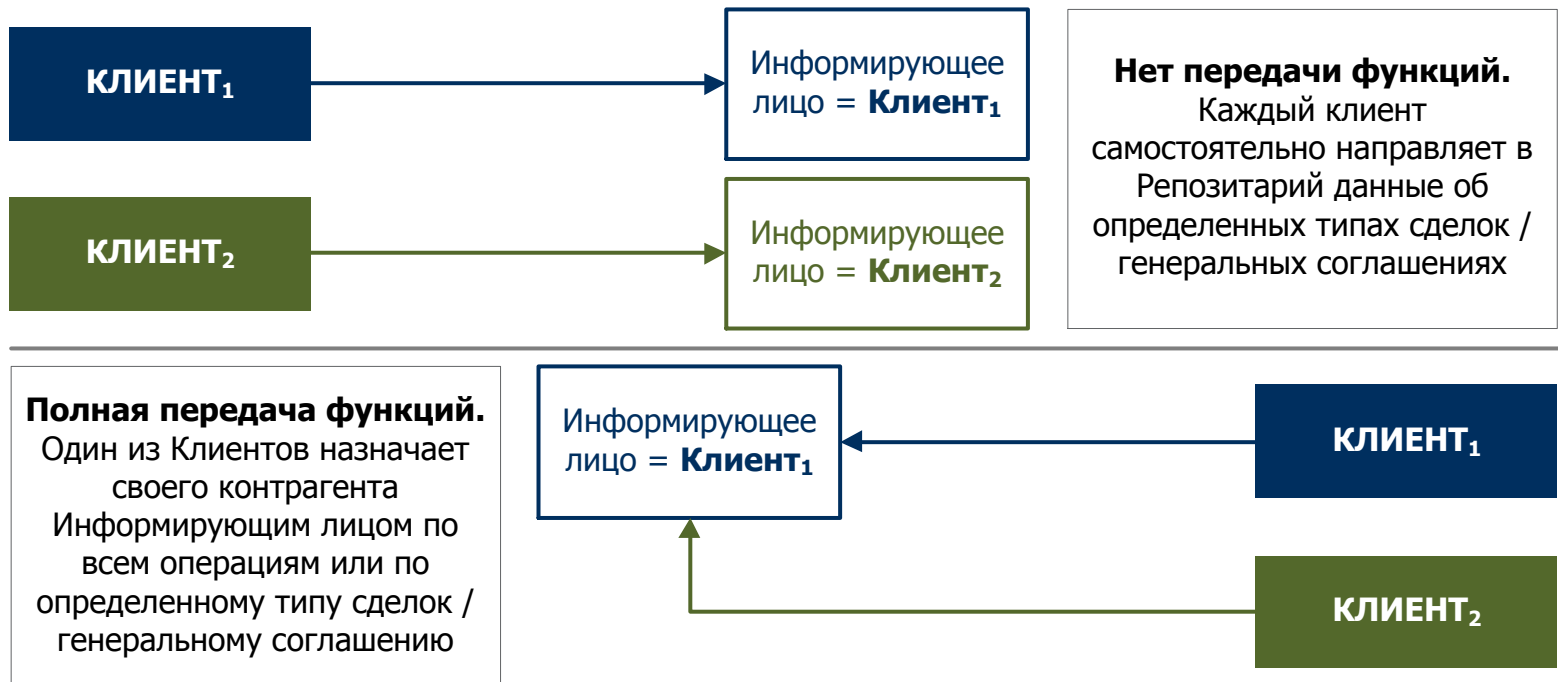
# НАЗНАЧЕНИЕ ИНФОРМИРУЮЩИХ ЛИЦ

Клиент может назначить одно или нескольких Информирующих лиц одним Заявлением, при этом отказ одного Информирующего лица не повлияет на назначение других лиц если последние подтвердят свое назначение:



# ВАРИАНТЫ РАЗДЕЛЕНИЯ ФУНКЦИЙ

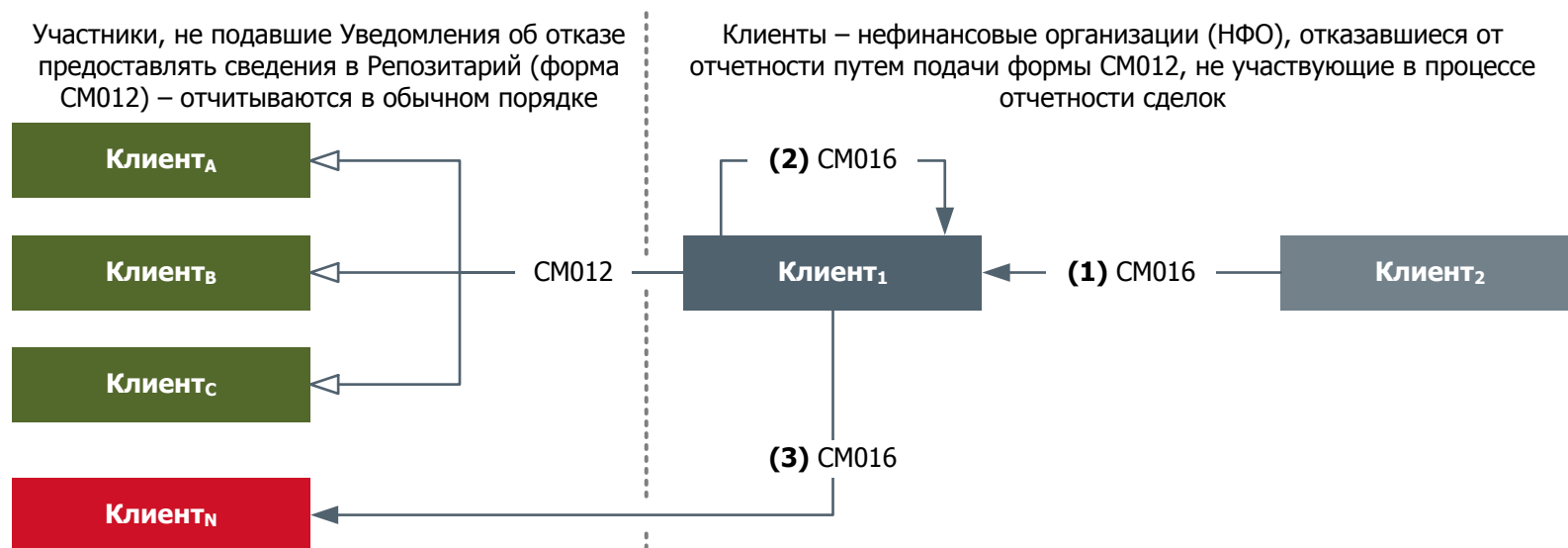
При подаче Заявления по форме СМ016 клиент вправе назначить одно или нескольких Информирующих лиц – и одновременно самостоятельно выполнять функции Информирующего лица по определенным типам сделок или в рамках конкретных генеральных соглашений:



## ФУНКЦИОНАЛ РЕПОЗИТАРИЯ (V)

# ДЛЯ НЕФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ

Для нефинансовых организаций, отказавшихся от отчетности (предоставивших форму СМ012), но которым необходимо отчитать сделки в соответствии с законодательством, доступны следующие варианты по взаимодействию с участниками в Репозитории НРД:



Клиенту, отказавшемуся от отчетности, но которому необходимо отчитать собственные сделки, доступны следующие варианты:

- (1) он может быть назначен Информирующим лицом – контрагентом по сделке (Клиентом<sub>2</sub>);
- (2) он может сам стать Информирующим лицом\*. Дополнительных действий Клиента<sub>2</sub> для отчетности не требуется;
- (3) третье лицо (Клиент<sub>N</sub>), имеющее договор ЭДО с НРД, может быть назначено Информирующим лицом.

В любом из вариантов (1) – (3) клиенту, отказавшемуся от отчетности, не потребуется менять порядок отчетности, если клиент не назначил себя Информирующим лицом по другим сделкам.

## КЛЮЧЕВЫЕ ПРИНЦИПЫ ТАРИФИКАЦИИ

Плательщик за услуги Репозитария по регистрации и учету данных – **Информирующее лицо.**

Клиенты могут выбирать между одним «посделочным» тарифным планом и 5 тарифными планами с фиксированной платой.

Определение ставок за регистрацию сообщений происходит по принципу «слайдинга»: по общему количеству зарегистрированных сообщений по итогам календарного месяца.

Отчетность о справедливой стоимости и маржевых суммах (формы СМ092/СМ094) оплачивается по отдельной ставке.

Введена специальная тарификация для регистрации bulk-отчетов по формам СМ08х.

Подробная информация о Тарифных планах Репозитария, образцы расчетных документов и ответы на часто задаваемые вопросы размещены на сайте НРД в разделе [«Репозитарий\Оплата услуг. Вопросы и ответы»](#).



## ВЫСТАВЛЕНИЕ И ПОЛУЧЕНИЕ СЧЕТОВ

Общие порядок оплаты услуг определен в **Правилах оказания репозитарных услуг (раздел 2.6)**

Периодичность выставления счетов – ежемесячно, не позднее 5 рабочего дня месяца, следующего за расчетным.

Счета за услуги Репозитария должны быть оплачены не последнего числа месяца, следующего за расчетным.

Счет выставляется **на отправителя сообщения – Информирующее лицо**, либо на получателя услуги (например, при заказе выписки или сопутствующих услуг).

При регистрации сообщения в Репозитарии Информирующее лицо платит **только за свое сообщение** – отсутствует двойная тарификация.

Смена тарифного плана осуществляется путем подачи в Репозитарий заявления по стандартной форме. Новый тарифный план вступит в силу с начала следующего месяца.

# ТИПЫ СДЕЛОК ПРИНИМАЕМЫХ РЕПОЗИТАРИЕМ

Доступные для регистрации типы сделок					
Сделки с ПФИ				РЕПО	ИНЫЕ
Форварды	Опционы	Свопы	Свопционы		
Валюта	●	●	●		
Проценты	●	●	●	●	
Товары	●	●	●	●	
Облигации	●	●	●	●	●
Акции	●	●	●	●	●
Кредиты			●	●	
Иные активы					●

# РЕГИСТРАЦИЯ ДАННЫХ В РЕПОЗИТАРИИ (I)

## СПОСОБЫ РЕГИСТРАЦИИ

### Односторонняя регистрация

**Описание:**

Анкета поступает только от одного из участников. Сверка / подтверждение не требуется.

**Применяется:** для генеральных соглашений и договоров, bulk-отчетов (форм СМ08х).

### Встречная регистрация

**Описание:**

Репозитарий получает две Анкеты договоров и сверяет содержащиеся в них данные перед регистрацией сведений о договоре в Реестре.

**Применяется:** Только для договоров.

### Последовательная / Комбинированная регистрация

**Описание:**

Анкета, полученная от одного из участников пересылается второй стороне для подтверждения.

**Применяется:** для генеральных соглашений и договоров (на усмотрение клиента).

## ОСНОВНЫЕ ЭТАПЫ

### ПРОВЕРКА (ВАЛИДАЦИЯ)

Выполняется Репозитарием при получении Анкеты генерального соглашения и/или анкеты Договора от Информирующего лица (Клиента). Репозитарий проверяет правильность и полноту заполнения полей перед переходом к следующему этапу: сверке и/или регистрации.

### СВЕРКА

Осуществляется когда два Информирующих лица участвуют в процессе регистрации данных. Репозитарий сверяет между собой поля двух Анкет. Успешная сверка означает, что сведения о генеральном соглашении / договоре будут зарегистрированы в Реестре договоров Репозитария.

### РЕГИСТРАЦИЯ

Информация о генеральном соглашении или договоре включается в Реестр договоров. Участники получают от Репозитария уведомление об успешной регистрации.



## РЕГИСТРАЦИЯ ДАННЫХ В РЕПОЗИТАРИИ (III)

# ИСПОЛЬЗОВАНИЕ LEI И UTI

В соответствии с законодательством и Правилами оказания репозитарных услуг:

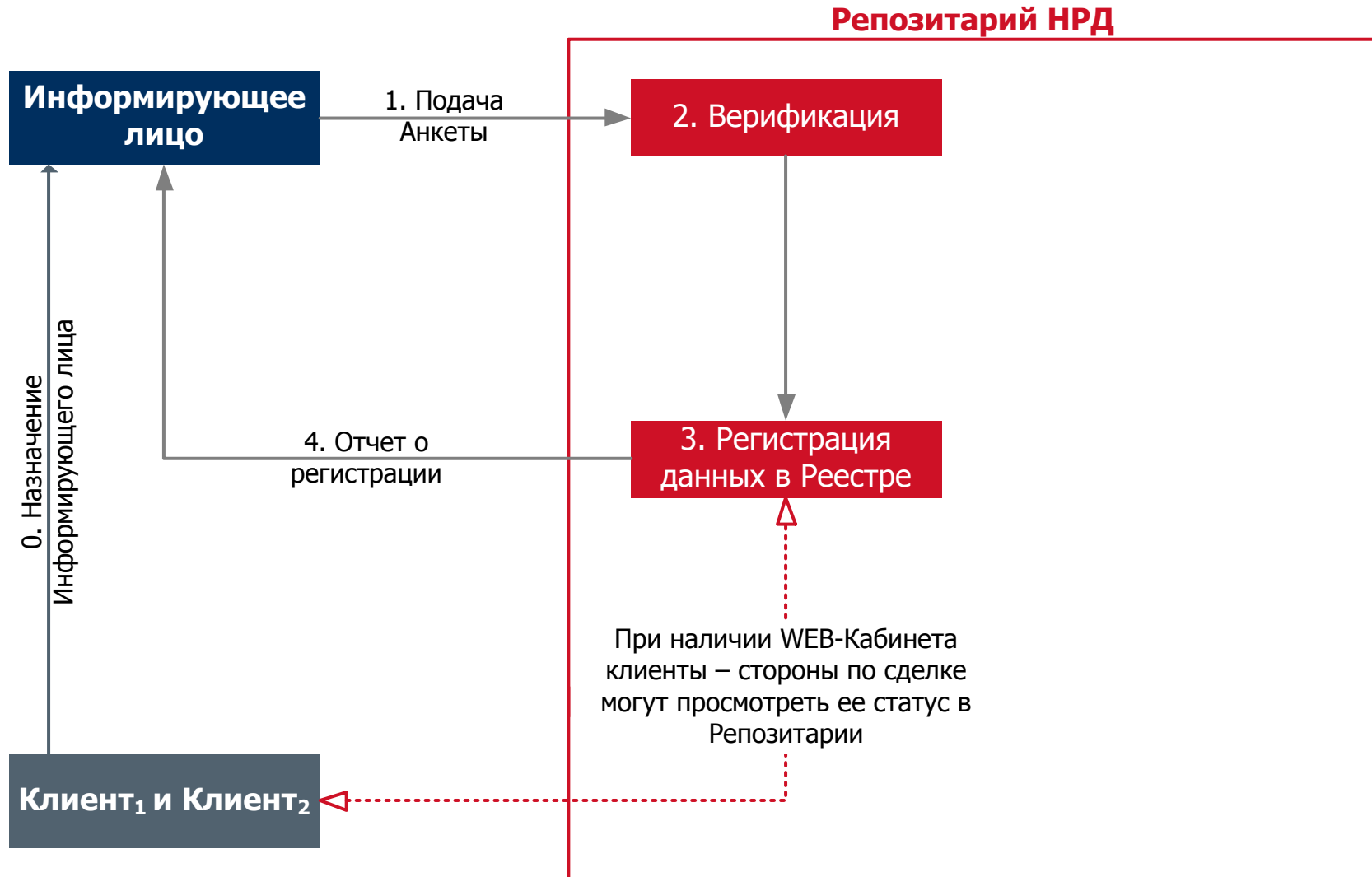
- Юридические лица – клиенты Репозитария (Информирующие лица) должны получить международный код идентификации юридических лиц (Legal Entity Identifier, LEI).
- Сообщения о сделках и генеральных соглашениях, заключенных после 01.07.2016, поступающие в Репозитарий, должны иметь уникальный код идентификации договора (Unique Transaction Identifier, UTI).

LEI может быть присвоен в любом Локальном операционном подразделении (LOU), в том числе и в НРД.

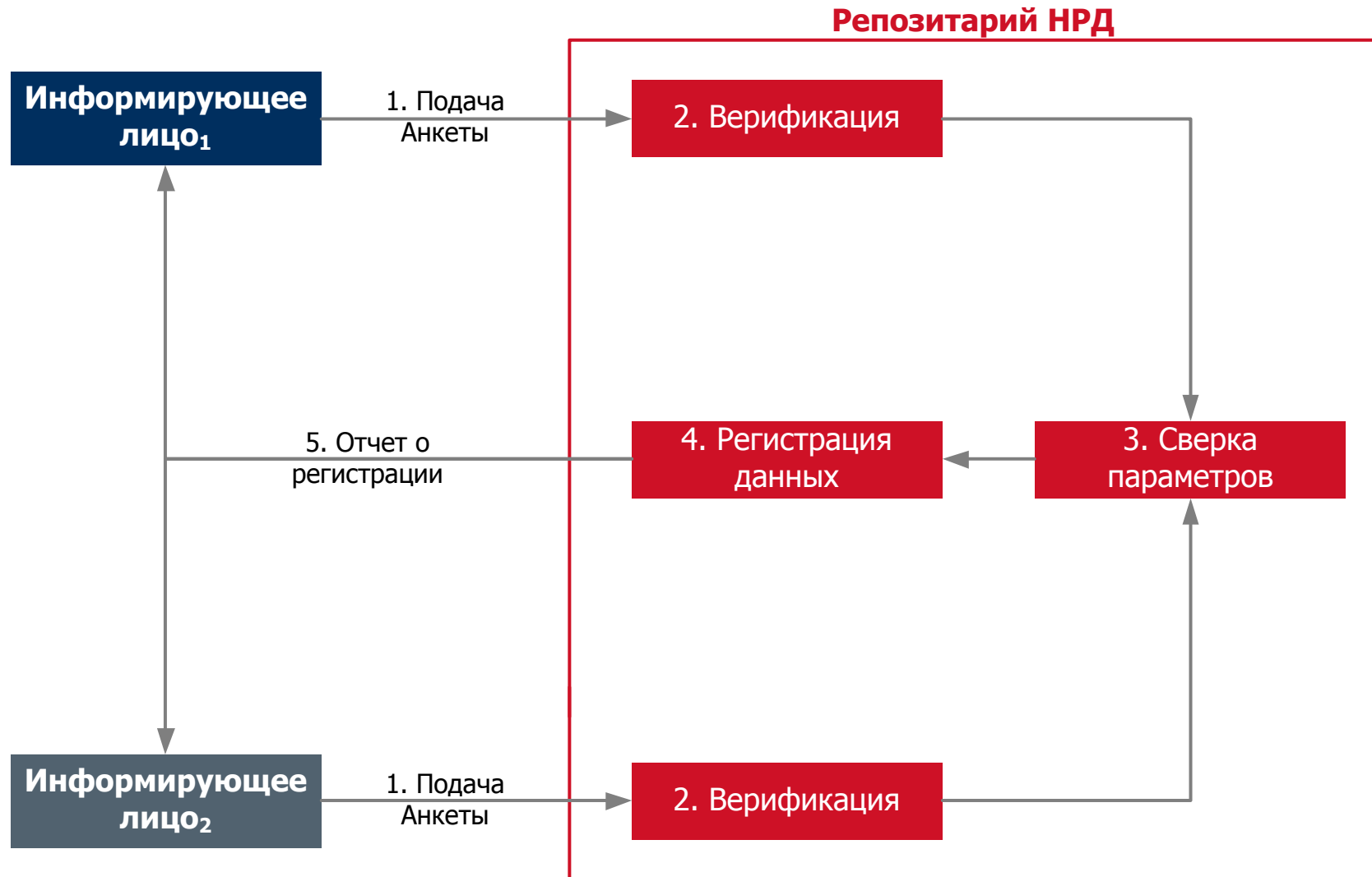
UTI присваивается договору формирующим лицом, которым может быть сторона по сделке, Информирующее или третье лицо. Также участники Репозитария могут воспользоваться сервисом НРД по генерации данного кода, при этом формирующим лицом будет являться Информирующее лицо (клиент).

НРД выступает формирующим лицом только в качестве Информирующего лица по сделкам РЕПО с Банком России и Федеральным казначейством с СУО.

# ОДНОСТОРОННЯЯ РЕГИСТРАЦИЯ

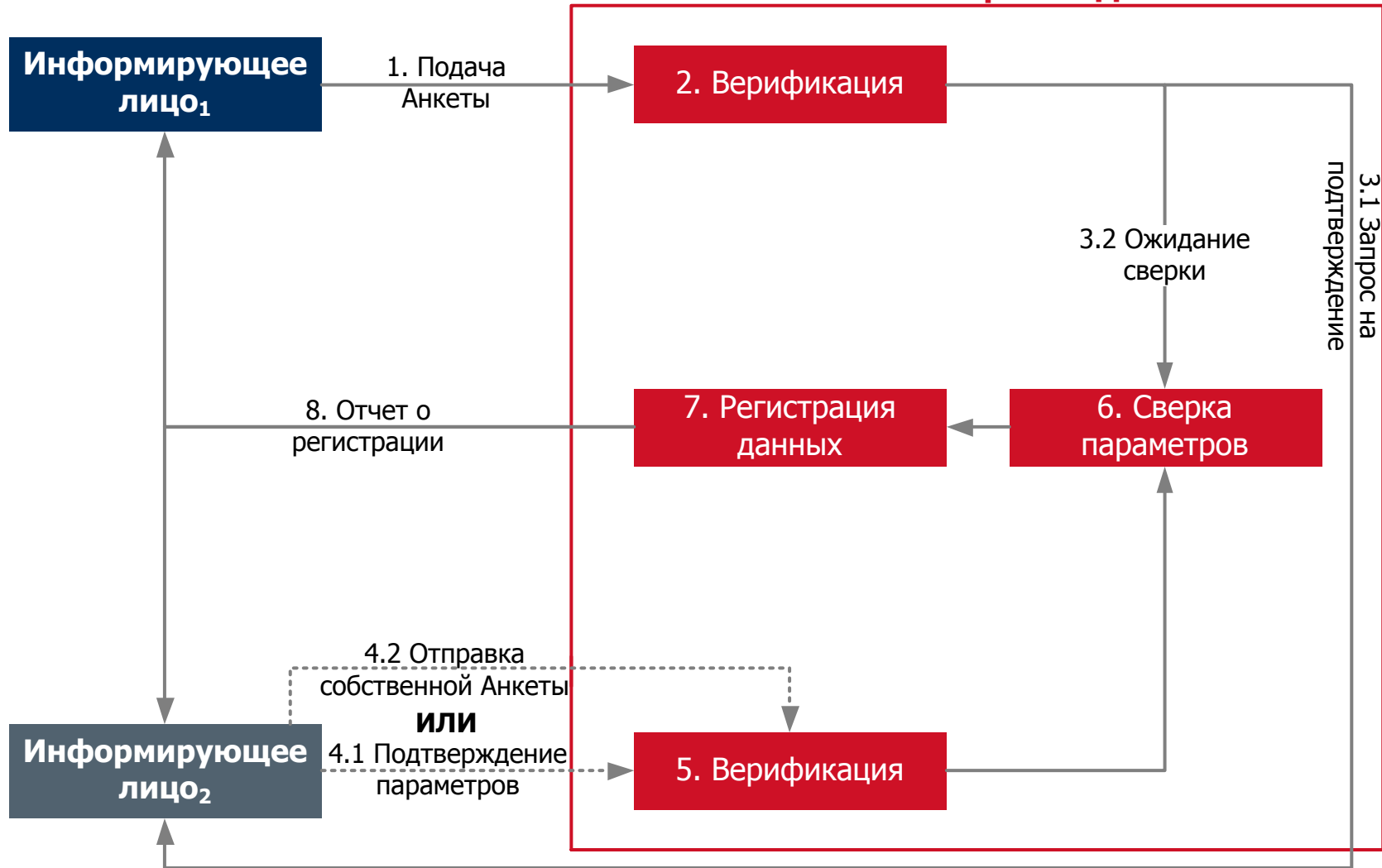


# РЕГИСТРАЦИЯ ДАННЫХ В РЕПОЗИТАРИИ (V) ВСТРЕЧНАЯ РЕГИСТРАЦИЯ



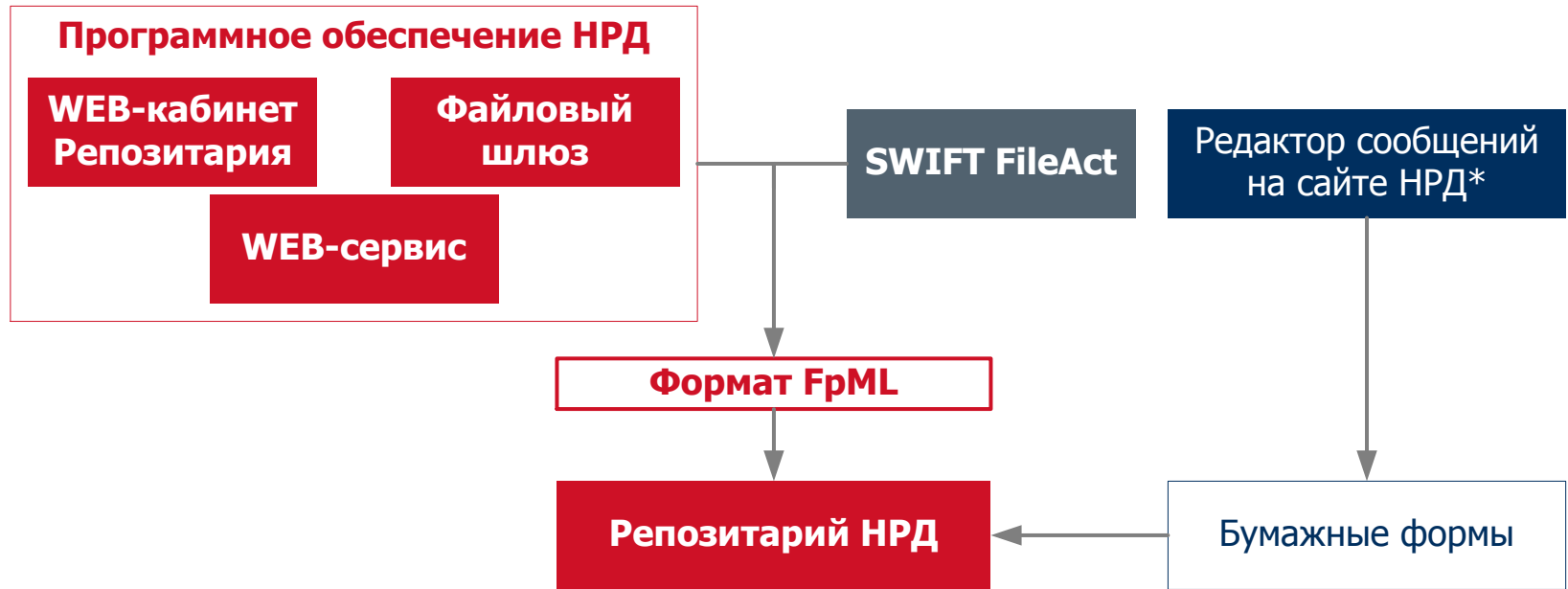
# КОМБИНИРОВАННАЯ РЕГИСТРАЦИЯ

Репозиторий НРД



# ВЗАИМОДЕЙСТВИЕ С РЕПОЗИТАРИЕМ

## КАНАЛЫ СВЯЗИ



Плата за использование программного обеспечения НРД и редактор сообщений **не взимается.**

Информация о WEB-кабинете Репозитория и Файловом шлюзе доступна на сайте НРД в разделе «[Программное обеспечение](#)».

\* Редактор сообщений позволяет импортировать и экспортировать xml-файлы.

# Контакты и полезные ссылки

## Репозитарий:

E-mail: [repository@nsd.ru](mailto:repository@nsd.ru)

<https://www.nsd.ru/ru/services/repository/> - официальный сайт.

<http://repository.nsd.ru> – информация о форматах сообщений, дополнительные сервисы.

## Департамент клиентского обслуживания:

Tel.: +7 (495) 956-27-90/91/92/93; (495) 956-09-40;

(495) 745-81-45; (495) 234-48-65

E-mail: [dc@nsd.ru](mailto:dc@nsd.ru)

## Адрес:

105066, Москва, ул. Спартаковская, 12

**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;
  - 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.

