



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
РАСЧЕТНЫЙ
ДЕПОЗИТАРИЙ
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Санкт-Петербург. Декабрь 2015

XIII Российский облигационный конгресс

СИСТЕМА УПРАВЛЕНИЯ ОБЕСПЕЧЕНИЕМ НКО ЗАО НРД



Система управления обеспечением



РЕПО с корзиной **Банка России** и **Федерального казначейства**

- Доля сделок с корзиной в общем объеме сделок РЕПО Банка России 40%
- Количество договоров СУО – 216 шт. (подключены все системообразующие банки)
- Доля ФК в общем обороте сделок в СУО превысила 50%

Ежемесячный объем сделок в 2015, трлн. руб.



Количество сделок в СУО



Система управления обеспечением

Новые **доработки** и ближайшие нововведения

Востребованность услуг агента по управлению обеспечением *



* Результаты опроса Банка России, октябрь 2015

Планы на 2015-2016

- **Прямое РЕПО Банка России в долл. США** – техническая готовность сервисов НРД.
- **Доработки механизма замены** – реализована возможность замены обеспечения с указанием замещающих ценных бумаг: новое поручение 18/У (ноябрь 2015)
- **Новый клиринговый сеанс НРД в 14:00** с использованием торговых банковских счетов в НРД (декабрь 2015)
- **Новые алгоритмы клиринга** – оптимизация алгоритмов клиринга с использованием современных математических методов, позволяющих увеличить процент рассчитанных сделок (IV кв 2016)
- **Универсальная анкета маркирования** – одновременная работа с разными группами сделок (не происходит затирание одной группы сделок, при подаче поручения на другую): с Банком России, с Федеральным казначейством и др. (2016)
- **Универсальный подбор ценных бумаг** – автоматизация подбора активов в Гарантийные фонды, ИКО и др., а также в целях исполнения обязательств по сделкам.
- **Система управления отчетами** - гибкая настройка набора предоставляемой отчетности (2016)

Система управления обеспечением

Участие НРД в развитии проекта РЕПО с КСУ

Клиринговый сертификат участия (КСУ) совместный проект группы Московская Биржа по созданию однородного универсального обеспечения – новой ценной бумаги КСУ.

Участники сохраняют право собственности на активы, вносимые в пул (право на получение доходов и право голоса), а владельцы КСУ получают дополнительную защиту благодаря невозможности наложения ареста на активы в имущественном пуле.

Роль НРД в реализации и функционировании нового продукта:

Учет и хранение

- хранение базовых активов на субсчетах (регрессионная шкала учитывает остатки на счетах депо)
- хранение КСУ и глобальных сертификатов КСУ

Подбор обеспечения

- первоначальный подбор активов в имущественный пул для выпуска КСУ
- подбор КСУ в корзину РЕПО с Банком России

Система управления обеспечением

Развитие РЕПО с Федеральным казначейством

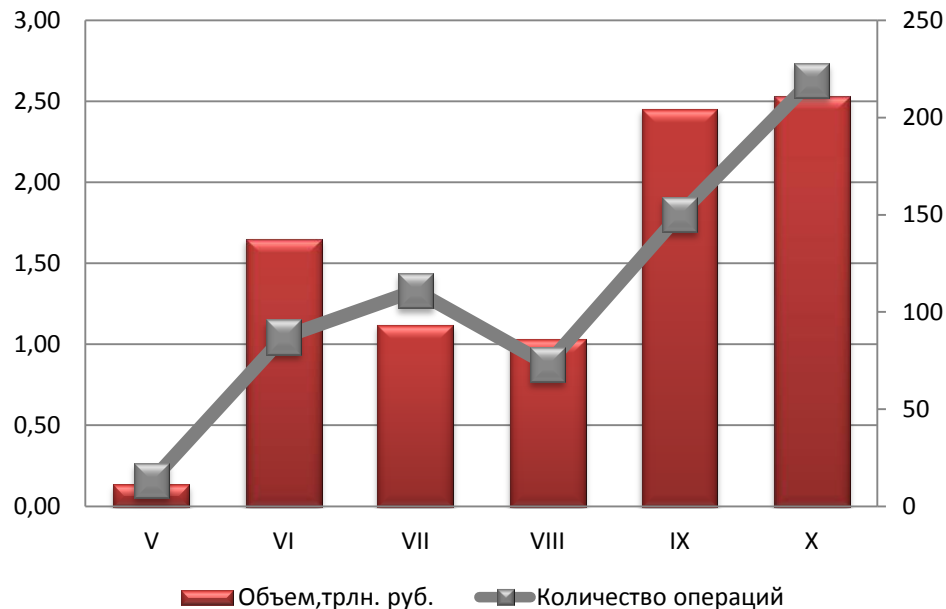


Начало операций с мая 2015

Особенности

- Срок – 1 день, до 6 дней (с декабря 2015)
- Обеспечение - корзина ОФЗ
- Компенсационные взносы только в бумагах
- Отдельный пул маржирования
- Расчеты только DVP-3
- Частичное исполнение сделок и ролловер обязательств не предусмотрены
- Кредитор не подбирает бумаги в обеспечение с предстоящими корп. действиями

Объем и количество операций



Система управления обеспечением

Планы развития платформы на 2016 – 2017




Система управления обеспечением

Разработка Web кабинета для автономной работы с СУО

В планах развития на 2016-2017г. НРД планирует реализовать **новый канал** для взаимодействия с участниками рынка, который не потребует дополнительных расходов на установку и обеспечит замену ПО «ЛУЧ».

- Web-кабинет будет содержать всю необходимую информацию о состоянии обеспечения, расчетов и статусах Репозитария.
- Удобство маркирования и замены обеспечения для всех групп сделок.

 **НАЦИОНАЛЬНЫЙ РАСЧЕТНЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ**
группа компаний ВЭБ

[Контакты](#) [Ru/En](#) [О программе](#)
+7 (495) 234-48-27
многоканальный телефон

Блоттер Новый договор Списание ГС Новая вкладка

Контрагент: ALF456 Альфа-Банк
Организация/подразделение: АКБК123 АК-БАРС БАНК

Открытое РЕПО Фиксированное РЕПО
Тип сделки: Прямое РЕПО

Генеральное соглашение: ALAB12
Номер договора: 123-56AC

Словия сделки 1 часть

Дата заключения: 28.09.2015
Дата расчета 1 части: 28.09.2015
Сумма 1 части: 10000000 RUB
Способ расчетов: DVP-3
Тип ставки: Фиксированная Плавающая
Ставка РЕПО, %: 10

Условия сделки 2 часть

Дата фиксации 2 части: 28.09.2016
Дата расчета 2 части: 28.09.2016
Сумма 2 части: 10083333.34 RUB
Способ расчетов: DVP-3
Метод расчета процентов: 365/366

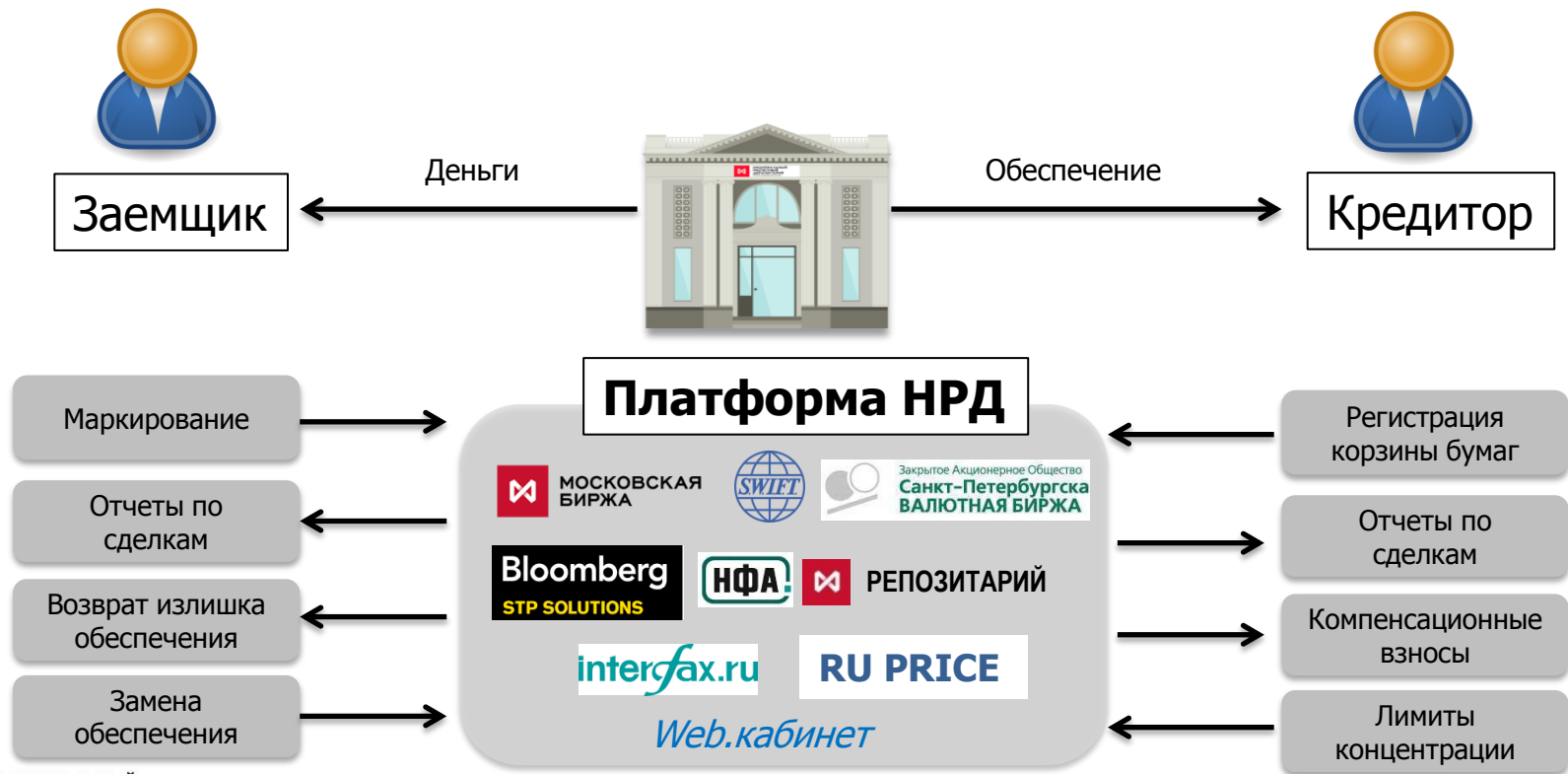
Обеспечение Параметры СУО Дополнительные параметры Реквизиты организации Реквизиты контрагента (необязательно)

Без автоматического маркирования: Нет
С режимом обеспечения: Да
Возврат доходов: 1-Возврат по стандартным ст

Порог переоценки, %: 10
Возможность досрочного исполнения: Ни одна из сторон

Система управления обеспечением

Открытая **архитектура** позволит работать с множеством систем



Контакты

Сергей Голубец

Руководитель направления Управления развития клиентских отношений

Телефон: +7 (495) 782-97-95

Email: Golubets@nsd.ru

Андрей Васильев

Руководитель направления по развитию СУО и трехсторонних сервисов

Телефон: +7 (495) 234-48-27, ext. 4845

Email: vasilev.aa@nsd.ru, triparty@nsd.ru

Алина Акчурина

Управляющий директор по развитию СУО и трехсторонних сервисов

Телефон: +7 (495) 234-48-27, ext. 4995

Email: akchurina@nsd.ru, triparty@nsd.ru

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 (б) 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 (б) 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.