

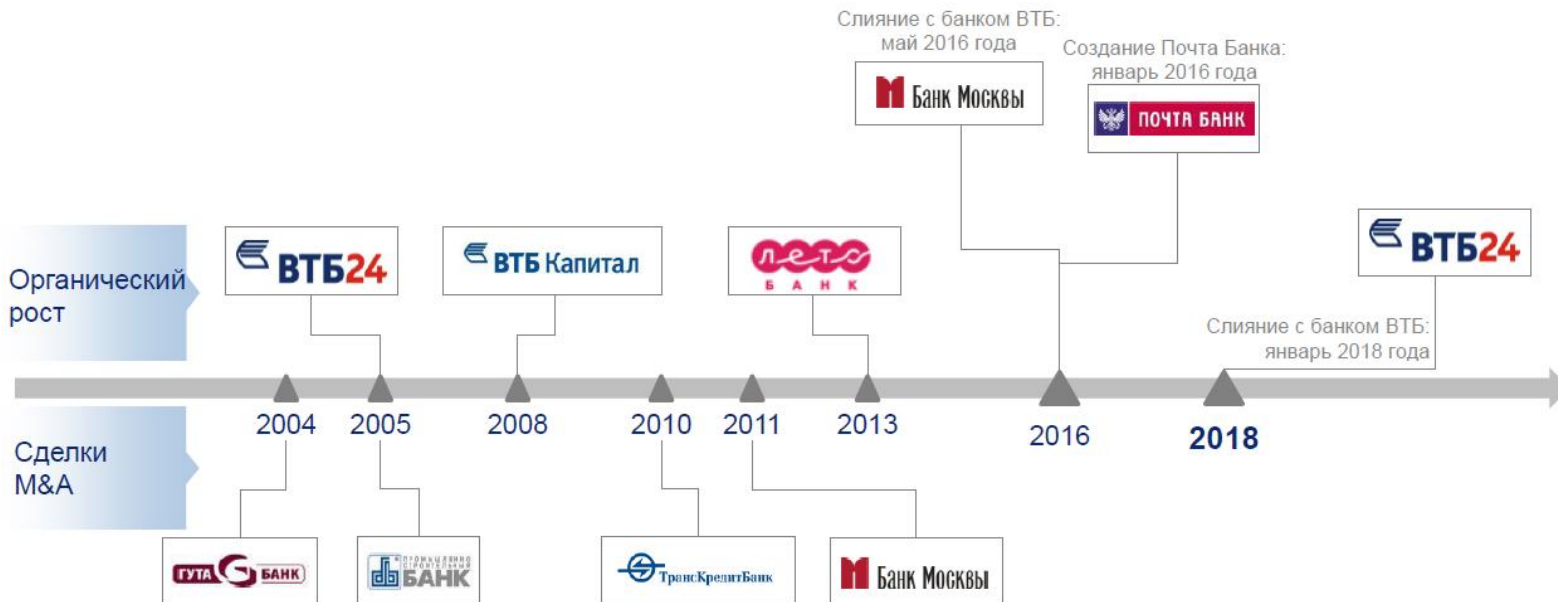
*Доступ на Фондовый и Валютный рынок
Московской Биржи. Сервисы, услуги и
дополнительные возможности для
посредников и инвесторов.*

Москва, 2017



ООО ВТБ Капитал Брокер: Ключевая информация

- ООО ВТБ Капитал Брокер учрежден в 2008 году*
- ООО ВТБ Капитал Брокер – компания Группы ВТБ*
- Группа ВТБ – ведущая международная финансовая группа российского происхождения**
- История Группы ВТБ – история успешного развития за счет органического роста и приобретений на рынке M&A**



* <http://www.vtbcapital-broker.ru/>

** <http://www.vtb.ru/>

Продукты и услуги



Эмитенты | УК | Страховые компании | НПФ | Банки

- Размещение и привлечение рублевой и валютной ликвидности
- Валютная конверсия, FX
- Однодневные облигации
- Депозитарные услуги

Доступные рынки: биржевой и внебиржевой



*DMA (direct market access) – прямое электронное подключение к торговым системам

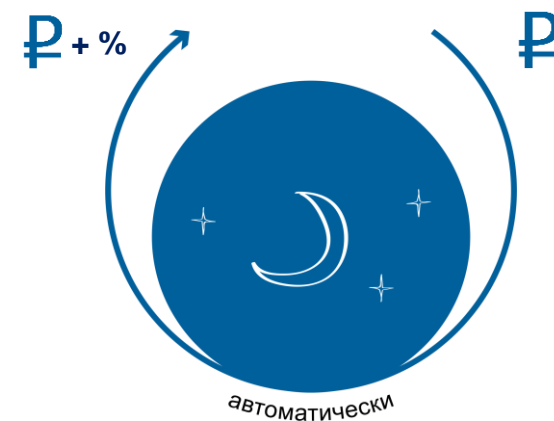
**ОТС (over trade counter) – внебиржевые сделки

Размещение денежных средств

Ценные бумаги

РЕПО

Овернайт*



* Выплата вознаграждения Клиенту за временное использование его денежных средств в соответствии с абз. 3 пункта 3 Ст. 3 Федерального закона 39-ФЗ

Торговое консультирование



Первичное размещение: покупка долговых ценных бумаг



Справедливо заметить, что через Группу ВТБ проходит 2/3 размещений на Российском DCM* рынке

Рубли 63,217 млрд. - доля ВТБ Капитал 61%**

Доллары 15,103 млрд. - доля ВТБ Капитал 76%**

* DCM (debt capital market) – рынок долгового капитала

** Данные Bloomberg

Снижение затрат на конверсионные операции



- Возможность видеть текущий рыночный курс без звонка в банк
- Экономия: разница между ценами покупки и продажи (спрэд) – менее 1 копейки
- Хеджирование валютных рисков
- Частичное обеспечение: для совершения сделки достаточно иметь на счете лишь часть необходимой суммы
- Можно заключать сделку по текущему курсу или выставлять заявку по приемлемому курсу, и она исполняется автоматически, если цена достигнет данного уровня
- Заключение сделок с 10:00 до 23:50

Однодневные облигации Банка ВТБ (1)

МБК

- необходимо оформление генерального соглашения
- необходимо пройти комплаенс-процедуры
- необходимо наличие специальных терминалов
- высокий уровень минимального торгового лота
- возврат 4-5 рейсом

ДЕПОЗИТНЫЕ СЕРТИФИКАТЫ

- только документарная форма выпуска
- отсутствие биржевой торговли
- отсутствие электронных расчетов

ОБЛИГАЦИИ (включая ОБР)

- негибкий режим расчетов, отсутствие возможности гарантированного получения средств к конкретному часу в течение дня
- более длинный срок вложения без возможности изъять средства в любой момент, кроме вторичного рынка
- процентный риск на более длинном сроке вложения

РЕПО

- необходимость получения лимита от ВТБ
- Необходимо проведение переговоров по дисконтам

Однодневные облигации Банка ВТБ (2)

Ориентир ставки

коридор между депозитной ставкой Банка России и ставкой МБК

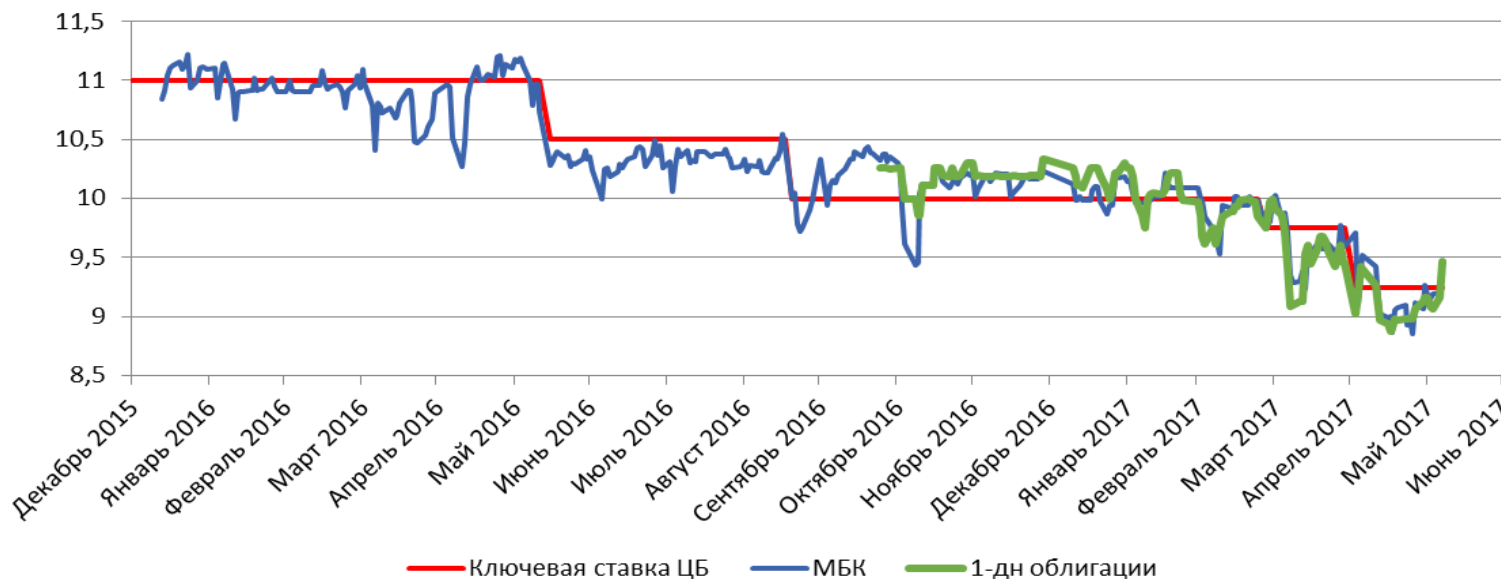
Индикатив

фиксированная депозитная ставка овернайт Банка России + 0,25%

Премия к ставке Банка России – для обеспечения интереса к однодневным облигациям как инструменту ежедневного инвестирования рублевых остатков

Ставка – ниже уровня МБК, т.к. инструмент рассчитан на спрос со стороны банков после закрытия рынка МБК и прочих профучастников ближе к закрытию биржевой сессии

Ставки денежного рынка, % годовых*



* Данные Bloomberg

Однодневные облигации Банка ВТБ (З)

Облигации размещаются ежедневно в день T0

T-1 Публикация информации о дате и порядке размещения и серии размещаемых облигаций

T0 10:00 Публикация информации о цене (ставке) размещения

16:00* Открытие книги заявок - доступ участникам торгов для ввода заявок в режиме торгов «Размещение - Адресные заявки»

16:30-16.45* Окончание приема заявок
ВТБ удовлетворяет заявки в системе торгов с кодом расчетов В0 (заключение сделок без поставки покупателями денежных средств на счет)

до 19:00 Покупатели оплачивают облигации путем подачи отчетов на исполнение сделок
Поставка облигаций Покупателям

T+1 12:00 Погашение облигаций
Владелец получает денежные средства на счет в НРД

Период размещения 16:00-16:45* – для сохранения у покупателя возможности размещения в Банке России в случае неудовлетворения их заявки

Погашение в 12:00 – для обеспечения покупателям возможности участия в торгах и использования средств для стандартных банковских платежей

* Более ранний график размещения может устанавливаться для отдельных дней (пятница, предпраздничные дни и пр.)

Лицензии ООО ВТБ Капитал Брокер



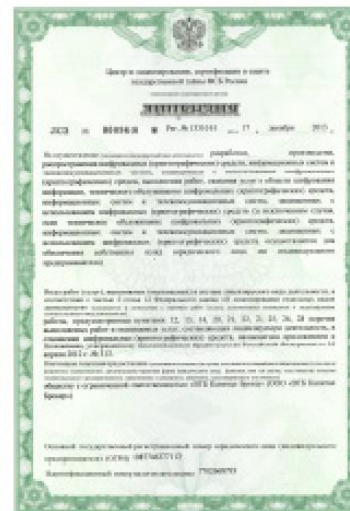
Лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг от ФСФР

на брокерскую деятельность № 177-12014-100000 от 10 февраля 2009 г. Без ограничения срока действия.
на дилерскую деятельность № 177-12021-010000 от 10 февраля 2009 г. Без ограничения срока действия.
на депозитарную деятельность № 177-12027-000100 от 10 февраля 2009 г. Без ограничения срока действия



Лицензии удостоверяющего центра

лицензия № 15559 Н от 11 ноября 2016 г. выдана Центром по лицензированию, сертификации и защите государственной тайны ФСБ России



ЭДО: электронный документооборот



Кабинет клиента:

- поручения на перевод / вывод денежных средств
- поручения на зачисление / списание ценных бумаг
- поручения на внесение изменений в условия обслуживания (анкетные данные / реквизитов)
- поручения в свободной форме
(запрос отчетов за любой период, поручения на участие в офертах)



Предоставление Клиентских отчетов
в удобном формате



- Фондовый рынок
- Валютный рынок
- Срочный рынок
- Международные рынки
- Еврооблигации

9:30

Дисклеймер

Настоящий документ подготовлен ООО ВТБ Капитал Брокер, носит исключительно информационный характер и предназначен только для лиц, являющихся допустимыми получателями. Представленная в настоящем документе информация, описание услуг, продуктов или условий договоров представлены в краткой форме. Предполагается, что краткие описания не являются полными описаниями или представляют собой точные описания полных версий услуг, продуктов или договоров. Дополнительная информация и сопроводительная документация предоставляются по запросу. Представленная в настоящем документе информация не является частью проспекта ценных бумаг, обязательством по размещению ценных бумаг, предложением по финансированию, опционом на заключение договора, офертой или приглашением делать оферты на покупку или продажу каких-либо ценных бумаг или иных финансовых инструментов. При оценке любых инвестиционных продуктов или стратегий, вы должны самостоятельно (с привлечением собственных налоговых, бухгалтерских, финансовых и/или юридических консультантов) определить приемлемость любых финансовых инструментов или сделок до принятия инвестиционного решения. Настоящий документ не должен рассматриваться получателями в качестве замены проведения ими самостоятельного анализа, поскольку настоящий документ не связан с конкретными инвестиционными целями, финансовым положением или определенными нуждами какого-либо конкретного получателя. Настоящий документ (или какая-либо его часть) не является налоговым, юридическим, бухгалтерским, финансовым или инвестиционным советом и не должен интерпретироваться как таковой.

Инвестору следует учитывать, что стоимость любых инвестиций может увеличиваться и уменьшаться в результате изменений на рынке, и инвестор может потерять первоначально инвестированную сумму. Результаты инвестирования в прошлом не гарантируют доходов в будущем. Определенные сделки, в том числе с фьючерсными контрактами, опционами и прочими производными инструментами связаны с повышенной степенью риска и не могут быть одинаково приемлемы для всех инвесторов. Ряд лиц – как физических, так и юридических – может быть ограничен в праве совершения сделок на рынках ценных бумаг. Инвесторам следует проводить собственную юридическую экспертизу до принятия инвестиционного решения. Важно отметить, что ценные бумаги и финансовые инструменты, деноминированные в иностранной валюте, американские депозитарные расписки и прочие инвестиционные инструменты зависят от валютных курсов, колебания которых могут негативно отразиться на стоимости инвестиций. Стоимость инвестиций может как увеличиваться, так и уменьшаться, поэтому инвесторам не может быть гарантировано возвращение инвестированных средств в полном объеме.

Группа ВТБ может находиться в деловых отношениях или стремиться к установлению таковых с компаниями, упомянутыми в настоящем документе. Инвесторы должны осознавать возможность конфликта интересов, который может повлиять на объективность настоящего документа, поскольку компании Группы ВТБ и/или их собственники, руководители, менеджеры и сотрудники (включая, кроме прочих, лиц, участвовавших в подготовке и публикации настоящего документа) могут владеть ценными бумагами или финансовыми инструментами, упоминаемыми в настоящем документе, иметь по ним открытые позиции или совершать с ними сделки; могут осуществлять инвестиции в отношении любого из упоминаемых в настоящем документе эмитентов; могут участвовать в операциях с ценными бумагами в форме, не согласующейся с информацией в настоящем документе в отношении ценных бумаг или финансовых инструментов, упомянутых в настоящем документе; могут продавать их клиентам или покупать их у клиентов, выступая в роли принципала; действовать в качестве руководителя, агента по размещению, консультанта или кредитора; проводить маркетинговые мероприятия; выступать в качестве организатора или соорганизатора последнего по времени публичного размещения в отношении любых инвестиций или эмитентов таких ценных бумаг или финансовых инструментов, упомянутых в настоящем документе; предоставлять или предлагать инвестиционно-банковские или иные услуги любой из компаний, упомянутых в настоящем документе.

Настоящий документ предназначен исключительно для лиц, считающихся профессиональными инвесторами, и не предназначен для распространения, прямо или косвенно, любой другой категории лиц, в том числе розничным инвесторам.

НАСТОЯЩИЙ ДОКУМЕНТ НЕ РАСКРЫВАЕТ ВСЕ ПОТЕНЦИАЛЬНЫЕ РИСКИ И ИНЫЕ АСПЕКТЫ, СВЯЗАННЫЕ С ИНВЕСТИРОВАНИЕМ В КОНКРЕТНЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ/ТРАНЗАКЦИИ. ДО ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ТРАНЗАКЦИЙ ПОТЕНЦИАЛЬНЫЕ ИНВЕСТОРЫ ДОЛЖНЫ УБЕДИТЬСЯ В ПОЛНОМ ПОНИМАНИИ УСЛОВИЙ ТАКИХ ИНВЕСТИЦИЙ/ТРАНЗАКЦИЙ И ЛЮБЫХ РИСКОВ, СВЯЗАННЫХ С НИМИ.

Настоящий документ не может быть использован с целью создания финансовых инструментов или продуктов. Настоящий документ носит исключительно справочный характер и не представляет собой имеющее обязательную силу обязательство или соглашение оказывать услуги или предоставлять финансирование на указанных в них условиях или на аналогичных условиях или любое иное обязательство оказывать услуги или предоставлять финансирование любого рода и не могут быть использованы в качестве заверения о том, что какая-либо определенная сделка непременно могла быть или может быть осуществлена по указанной цене или на указанных условиях.

Несмотря на всю тщательность подготовки настоящего документа, никто из руководителей, менеджеров, сотрудников, агентов или консультантов любой компании Группы ВТБ не дает каких-либо гарантий или заверений, выраженных или подразумеваемых, и не принимает на себя какой-либо ответственности в отношении надежности, точности или полноты информации, содержащейся в настоящем документе.

ООО ВТБ Капитал Брокер не принимает на себя какой-либо ответственности за любые убытки (прямые или косвенные, предвиденные и непредвиденные), возникающие в связи с использованием настоящего документа или содержащейся в нем информации. ООО ВТБ Капитал Брокер не берет на себя обязательств по обновлению информации в настоящем документе. Вся информация, дана по состоянию на дату выпуска настоящего документа и может быть изменена без предварительного уведомления. Деятельность ООО ВТБ Капитал Брокер предоставляет услуги исключительно на территории Российской Федерации на основании соответствующих лицензий профессионального участника рынка ценных бумаг: на осуществление брокерской деятельности № 177-12014-100000, на осуществление дилерской деятельности № 177-12021-010000, на осуществление депозитарной деятельности №177-12027-000100, выданные Федеральной службой по финансовым рынкам 10 февраля 2009 года. Настоящий документ защищен авторскими правами, никакая его часть не может быть воспроизведена, распространена, опубликована полностью или частично для любой цели или передана третьим лицам без предварительного письменного разрешения ООО ВТБ Капитал Брокер.
© ООО ВТБ Капитал Брокер, 2017 г. Все права защищены.

Контакты

Юрий Набатчиков
Инвестиционный консультант
ООО ВТБ Капитал Брокер
Тел.: +7 (495) 380-02-72 доб. 65337
Моб.: +7 (903) 546-31-41
e-mail: Yury.nabatchikov@vtbcapital-broker.com

Дмитрий Федотов
Менеджер
ООО ВТБ Капитал Брокер
Тел.: +7 (495) 380-02-72 доб. 65338
Моб.: +7 (903) 513-55-00
e-mail: Dmitry.fedotov@vtbcapital-broker.com

www.vtbcapital-broker.ru