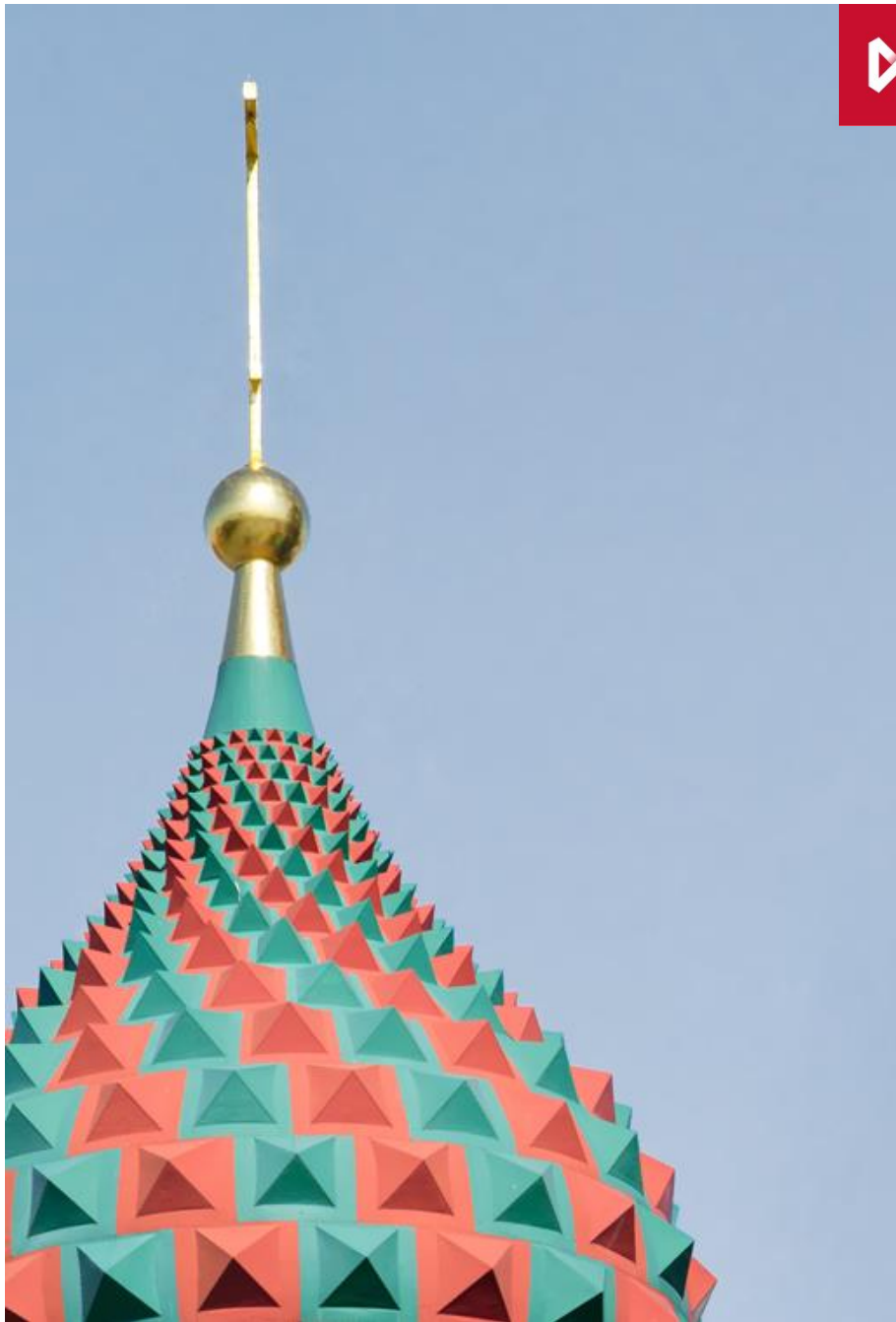




МОСКОВСКАЯ
БИРЖА



БИРЖЕВОЕ РЕПО
С БАНКОМ РОССИИ
С СЕРВИСАМИ НРД

БИРЖЕВЫЕ СЕРВИСЫ ПО СДЕЛКАМ РЕПО С БАНКОМ РОССИИ С КОРЗИНОЙ ЦЕННЫХ БУМАГ

Совместный проект Московской биржи, Банка России и НКО ЗАО НРД по предоставлению биржевых сервисов по сделкам РЕПО с БР с корзиной бумаг

Корзина ценных бумаг РЕПО с Банком России – ценные бумаги, включенные в Ломбардный список Банка России и принимаемые в обеспечение по сделкам прямого РЕПО

Тенденция – увеличения сроков Прямого РЕПО с Банком России

Решение – РЕПО с корзиной бумаг: для поддержания ликвидности реализована возможность замены бумаг в течение срока сделки

Внебиржевое РЕПО

Подача заявки
Bloomberg
+
Замена обеспечения,
маркировка
Луч/SWIFT



Биржевое РЕПО

MICEX Trade SE

- **Биржевые** правила и технологии при подаче заявок и заключении сделок, статус биржевой сделки
- **Единый терминал:** получение информации о сделках, бумагах в обеспечении, их маркирование, замена обеспечения, исполнение компенсационных взносов

СХЕМА РАБОТЫ

Проведение операций

РЕПО с Банком России на ФБ с корзиной ценных бумаг и с СУО НРД

Клиринг и Система управления обеспечением (СУО) НРД для всех сделок

РЕПО с ЦБР с корзиной (МБ, СПВБ, ОТС) с использованием Биржевого терминала

- Новый инструмент **«Корзина ЦБ»**, доп. идентификаторы и новые типы расчетов по РЕПО с ЦБР в Торговой Системе
- Подача заявки на заключение сделки РЕПО с корзиной ценных бумаг с Банком России
- Регистрация сделок на ФБ
- Передача информации о сделках в клиринг НРД
- Подача поручения на замену обеспечения по сделкам РЕПО с корзиной
- Динамический возврат бумаги из РЕПО с ЦБР на торги
- Отображение информации об обеспечении по всем сделкам РЕПО с корзиной с ЦБ
- Подбор бумаг в обеспечение по сделкам РЕПО с корзиной с Банком России осуществляется только из списка маркированных участником бумаг
- Единое маржирование в НРД по всем сделкам РЕПО с корзиной с Банком России, заключенным как через Биржу, так и на внебиржевом рынке



Особенности системы управления обеспечением

- Автоматический подбор обеспечения на основе набора промаркированных заемщиком счетов депо (разделов), ценных бумаг, дополнительных идентификаторов по сделке
- Подбор обеспечения из числа бумаг с минимальными дисконтами
- Оценка обеспеченности производится по пулу сделок
- Ежедневная переоценка обеспечения
- Генерация и автоматическое исполнение компенсационных взносов
- Замена обеспечения в сделке по желанию заемщика
- Автоматическая замена обеспечения перед корпоративными действиями



УСЛОВИЯ ЗАКЛЮЧЕНИЯ СДЕЛОК

- Подача заявок и заключение сделок РЕПО через Биржевой Терминал
- Новые **коды расчетов** по первой части: DVP1, DVP3
- Заключение сделок в виде аукциона и торгов фиксированной ставкой. Существующие **режимы** - РЕПО с ЦБ РФ: Аукцион РЕПО, РЕПО с ЦБ РФ: фикс. Ставка.
- **Инструмент:** Корзина РЕПО Банка России
- Возможность задать доп. идентификатор, приоритет подбора обеспечения
- **Сроки РЕПО:** 1, 7, 90 дней и 12 месяцев (определяется ЦБР)
- **Дисконты:** однодневные дисконты Банка России
- **Клиринг** в НРД - многосторонний неттинг
- Три клиринговых сеанса: 12.00, 16.00, 19.40
- СУО НРД: автоматический подбор обеспечения, переоценка обязательств, замена обеспечения
- Частичное исполнение обязательств по первой части сделки РЕПО
- Перенос даты исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО
- Ролловер (перенос неисполненных обязательств)



ДОПОЛНИТЕЛЬНЫЕ ИДЕНТИФИКАТОРЫ

- **Дополнительный идентификатор Корзины РЕПО** – код, соответствующий перечню ценных бумаг, входящих в Корзину РЕПО, которые НКО ЗАО НРД вправе использовать при Подборе ценных бумаг для исполнения обязательств Кредитной организации по Сделке, включая исполнения маржинальных требований и замену обеспечения.
- Список бумаг, входящих в дополнительный идентификатор, отображается в Биржевом терминале в Таблице «Состав корзины бумаг» и «Дополнительные идентификаторы».
- Участник вправе выбрать дополнительный идентификатор при подаче заявки, либо указать код отдельной ценной бумаги (ISIN). При выборе доп. идентификатора обеспечение будет подобрано в соответствии с выбранным типом. При выборе конкретного ISINa указанные бумаги будут подобраны в первую очередь.

1	GCOLLATERAL весь Ломбардный список Банка России
2	GCSHARES акции из Ломбардного списка
3	GCFOREIGN иностранные ценные бумаги из Ломбардного списка
4	GCNOSHARES весь Ломбардный список, кроме акций
5	GCBONDS весь Ломбардный список, кроме акций и иностранных ценных бумаг

ПРЕИМУЩЕСТВА БИРЖЕВОГО РЕПО

Участники через биржевые терминалы получают следующую информацию:



Сеть Московской биржи обеспечивает качественное соединение и бесперебойность работы сервиса по сравнению с Интернет-соединением



ДОГОВОРНЫЕ ОТНОШЕНИЯ



Дополнительное соглашение к Договору
на терминал MicexTradeSE (при
использовании данного терминала)

Участник

- Договор счета депо
- Договор банковского счета
- Договор об обмене электронными документами
- Договор о клиринговом обслуживании
- Договор об оказании услуг по управлению обеспечением

Генеральное соглашение



* Банк России устанавливает:

- Лимиты
- Ограничения на ценные бумаги аффилированных эмитентов
- Допустимый уровень переоценки



ИСПОЛЬЗУЕМЫЕ СЧЕТА

Следующие счета могут быть использованы при проведении расчетов по 1-м частям сделок РЕПО:

Для получения денежных средств Участником:

- торговый банковский счет, открытый под клиринг НРД (30411)

Для подбора ценных бумаг в обеспечение:

- счета депо собственника, предварительно промаркированные участником

Следующие счета могут быть использованы при проведении расчетов по 2-м частям сделок РЕПО:

Для возврата денежных средств Банку России:

- торговый банковский счет НРД (30411)

Для возврата ценных бумаг из обеспечения Заемщику:

- торговый счет депо, открытый под клиринг НРД (при необходимости – любой другой счет участника)



ОСТАТКИ БУМАГ НА РАЗДЕЛАХ

Бумаги, подобранные в обеспечение, отображаются в таблицах:

1 - НРД: Бумаги в обеспечении - 16:22:13

Код инструмента	Инструмент	Количество	Цена переоценки	НКД	Дисконт, %	Цена с учетом дисконта, руб	Оценка
XS0088543193	MINFIN RF 12.75 24/06/28	19	55 888,1185	12,0361	2,00%	54 770,36	1 040 636,77

1 - 50815928 - НРД: Бумаги в обеспечении под сделкой - 16:15:56

Код инструмента	Инструмент	Количество	Цена переоценки	НКД	Дисконт, %	Цена с учетом дисконта, руб	Оценка	Статус сделки
XS0088543193	MINFIN RF 12.75 24/06/...	19	55 888,1185	12,0361	2,00%	54 770,36	1 040 636,77	Рассчитана 1 часть

В терминале отражается стоимость остатков ценных бумаг:

- на всех открытых разделах Участника (с указанием разделов, доступных для маркирования)
- указан статус аффилированности эмитента ценной бумаги с заемщиком

12 - НРД: Остатки бумаг на разделах - 18:11:26

Счет	Раздел	Код НРД (все)	Код НРД (ломб.сп.)	Инструмент	Доступно к маркированию	Количество	Аффилирован	Исключена из подбора	Цена подбора НРД	Стоимость остатка
HS1405150024	000000000000000000	RU000A0DASAO	RU000A0DASAO	МГор39-о6	-	1 000 000			1 028,6200	1 002 904 500,00
HS1405150024	000000000000000000	RU000A0E6TKO	RU000A0E6TKO	МГор44-о6	-	1 000 000			991,3900	966 605 250,00
HS1405150024	000000000000000000	XS0088543193	XS0088543193	MINFIN RF 12.7...	-	1 000 000			55 888,1185	54 770 356 170,22
HS1405150024	000000000000000000	XS0089375249	XS0089375249	МФ-126(XS)	-	1 000 000			46 900,3246	45 962 318 088,38
HS1405150024	36МС00МЕХ00000F00	RU000A0DASAO	RU000A0DASAO	МГор39-о6	+	1 000 000			1 028,6200	1 002 904 500,00
HS1405150024	36МС00МЕХ00000F00	RU000A0E6TKO	RU000A0E6TKO	МГор44-о6	+	1 000 000			991,3900	966 605 250,00
HS1405150024	36МС00МЕХ00000F00	XS0088543193	XS0088543193	MINFIN RF 12.7...	+	1 000 000			55 888,1185	54 770 356 170,22
HS1405150024	36МС00МЕХ00000F00	XS0089375249	XS0089375249	МФ-126(XS)	+	1 000 000			46 900,3246	45 962 318 088,38
TS1405150035	000000000000000000	RU000A0DASAO	RU000A0DASAO	МГор39-о6	+	1 000 000			1 028,6200	1 002 904 500,00
TS1405150035	000000000000000000	RU000A0E6TKO	RU000A0E6TKO	МГор44-о6	+	1 000 000			991,3900	966 605 250,00
TS1405150035	000000000000000000	XS0088543193	XS0088543193	MINFIN RF 12.7...	+	999 998			55 888,1185	54 770 246 629,51
TS1405150035	000000000000000000	XS0089375249	XS0089375249	МФ-126(XS)	+	1 000 000			46 900,3246	45 962 318 088,38



МАРКИРОВАНИЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

Подача поручения на маркировку ценных бумаг:

Заявка на маркировку

Инструмент: Башнефт ао

Количество: [spinner]

Оценочная стоимость: -

Счет ДЕПО: TS140117001B

Раздел счета: 000000000000000000

Торговый счет: [dropdown]

Ген. соглашения: MERR;RCBR

Да Закрыть

- Набор ценных бумаг, доступных для передачи в обеспечение, маркируется участником при помощи заявки через биржевые терминалы (MTSE, CMA)
- Для маркирования ценных бумаг могут использоваться следующие счета/разделы: TS/00, TS/73, S/00, S/73, HS/31, HS/36, HS/3Y
- При маркировке ценные бумаги не блокируются
- Маркирование может осуществляться в любое время

Таблица маркированных бумаг:

NR п/п	Код инструмента	Инструмент	Количество бумаг	Счет депо	Раздел счета депо	Торговый счет	Код генсоглашения	Цена подбора	Дисконт, %	Максимальное количество	Цена с учетом дисконта, руб	Оценка позиции
1	RU000A0E6TK0	МГор44-о6	900 000	TS1405150035	000000000000000000		MERR,RCBR	1 000,8500	2,50%	900 000	975,83	878 245 875,00
2	RU000A0DASAO	МГор39-о6	Не подбирать	TS140117001B	000000000000000000		MERR,RCBR	0,0000	2,50%	0	0,00	0,00
3	XS0088543193	MINFIN RF 12...	Любое	TS1405150035	000000000000000000		MERR,RCBR	61 154,7495	2,00%		59 931,65	59 900 010 559,69

Счет вывода: [dropdown] Раздел счета: [dropdown] Торговый счет: [dropdown]

Вести поручение Очистить анкету... Загрузить... Сохранить... Закрыть



РЕГЛАМЕНТ ЗАКЛЮЧЕНИЯ СДЕЛОК, ПРОВЕДЕНИЕ КЛИРИНГА И РАСЧЕТОВ

№	Этап	Время
1	Завершение приема заявок на аукцион РЕПО (1 день)	11:15
2	Начало первого сеанса клиринга	12:00
3	Завершение приема заявок на аукцион РЕПО (7 дней)	13:15
4	Начало второго сеанса клиринга	16:00
5	Завершение приема заявок по фиксированной ставке (1 день)	17:30
6	Начало третьего сеанса клиринга	19:40



ЗАКЛЮЧЕНИЕ СДЕЛКИ

Подача заявок на заключение сделок через Биржевые Терминалы (терминалы MTSE, СМА, QUIK). При подаче заявки обеспеченность не проверяется



Заключение сделки в Торговой системе ФБ ММВБ при вводе встречной заявки Банком России



Реестр сделок передается в НРД, НРД проводит подбор обеспечения и расчеты, информация о результатах подбора обеспечения доступна в Биржевых терминалах и API НРД



Перевод денежных средств и бумаг по итогам клиринга в НРД

Типы расчетов:

- **DVP1** – расчеты проводятся сразу после получения реестра сделок. НРД подбирает обеспечение, и при отсутствии или недостаточности ценных бумаг, подлежащих передаче по первой части сделки РЕПО, расчеты и подбор бумаг осуществляется каждые 30 минут.
- **DVP3** – расчеты проводятся в рамках каждого клирингового сеанса. Подбор обеспечения осуществляется непосредственно перед ближайшим клиринговым сеансом (в котором будет исполняться первая часть) из числа промаркированных Заемщиком бумаг, с учетом ограничений и дисконтов.



ЗАКЛЮЧЕНИЕ СДЕЛКИ

Информация по заключенной сделке РЕПО с корзиной отображается в общей таблице «Сделки» в торговой системе

Сделка №	Время	Заявка №	Партнер	Режим	Инструмен	К/П	Цена	Лоты	Объем	Торговый счет	Код расче	Срок РЕПО	Ставка РЕПО, %	Сумма РЕПО	Начальный дисконт, %	Цена выкупа	Стоимость выкупа РЕПО
2 295 902 821	17:11:48	1 268 440 690	ЦБ РФ	РЕПО с ЦБ РФ: А...	ОФЗ 25071	П/К	6,0000	746 993	88 399 151,62	L01-00000F00	Y0	1	6,0000	99 999 952,91	50,0000	23,3604	100 016 391,26
2 295 902 821	17:11:48	1 268 440 794	ЦБ РФ	РЕПО с ЦБ РФ: А...	ОФЗ 25071	К/П	6,0000	746 993	88 399 151,62	L01-00000F00	Y0	1	6,0000	99 999 952,91	50,0000	23,3604	100 016 391,26
2 295 902 856	17:12:34	1 268 440 806	ЦБ РФ	РЕПО с ЦБ РФ: А...	Корзина...	П/К	0	0	70 000 000,00	X01-00000000	DVP3	1	5,7000	70 000 000,00	0	0	70 010 931,50
2 295 902 856	17:12:34	1 268 440 832	ЦБ РФ	РЕПО с ЦБ РФ: А...	Корзина...	К/П	0	0	70 000 000,00	X01-00000000	DVP3	1	5,7000	70 000 000,00	0	0	70 010 931,50
2 295 902 915	17:12:57	1 268 440 879	ЦБ РФ	РЕПО с ЦБ РФ: А...	Корзина...	П/К	0	0	90 000 000,00	X01-00000000	DVP3	1	6,0000	90 000 000,00	0	0	90 014 794,50
2 295 902 915	17:12:57	1 268 440 911	ЦБ РФ	РЕПО с ЦБ РФ: А...	Корзина...	К/П	0	0	90 000 000,00	X01-00000000	DVP3	1	6,0000	90 000 000,00	0	0	90 014 794,50

Информация с учетом результатов клиринга, включая возможное частичное исполнение сделки, отображается в таблице «НРД: Сделки в клиринге»

Номер сделки	Дата сде	Номер заявки	Площадка	Дата расчета перв	Дата выхода из обес	Начальный объем	Объем, исполненный НРД	Сумма возврата	Ставка	Сумма обязательств	Сумма обеспечения	Статус сдел
7494184	31.03.2014	44 054 765	МОЕХ	31.03.2014	07.04.2014	100 000 000 000,00	11 005 011 767,69	11 018 730 344,00	6,50000	11 008 931 360,92	10 904 154 966,62	Рассчитана ...
7494279	31.03.2014	44 031 423	МОЕХ	31.03.2014	01.04.2014	10 000 000 000,00			8,00000			Не нарезано
7495049	31.03.2014	44 029 325	МОЕХ	31.03.2014	01.04.2014	9 299 999 999,00			8,00000			Не нарезано
7495153	31.03.2014	44 027 277	МОЕХ	31.03.2014	07.04.2014	100 000 000,00	100 000 000,00	100 153 424,66	8,00000	100 043 835,62	100 097 979,98	Рассчитана ...
7844831	01.04.2014	44 480 535	МОЕХ	01.04.2014	02.04.2014	10 000 000 000,00			8,00000			Не нарезано
7845488	01.04.2014	44 479 563	МОЕХ	01.04.2014	08.04.2014	200 000 000,00			7,50000			Не нарезано
7845490	01.04.2014	44 481 646	МОЕХ	01.04.2014	08.04.2014	3 000 000 000,00	3 000 000 000,00	3 004 027 397,26	7,00000	3 000 575 342,47	2 964 783 939,81	Рассчитана ...



СХЕМА ПРОВЕДЕНИЯ РАСЧЕТОВ ПО ПЕРВОЙ ЧАСТИ



1. Заемщик направляет заявку на участие в аукционе или в режиме «фикс. Ставка» через биржевые терминалы
2. Банк России акцептует заявку и отправляет на ФБ ММВБ подтверждение
3. Происходит заключение сделки
4. ФБ ММВБ формирует реестр сделок и направляет его в НРД
5. НРД подбирает ценные бумаги в обеспечение, возможен частичный подбор
6. НРД сообщает отчетом о результатах подбора бумаг Банку России и Заемщику
7. НРД проводит клиринг
8. НРД осуществляет перевод денег и ценных бумаг по итогам клиринга и регистрирует обязательства по 2-м частям сделок
9. НРД направляет отчеты о завершении расчетов, об обязательствах и их обеспеченности Банку России и Заемщику
10. ФБ ММВБ отправляет торговые отчеты по итогам торгов Участнику и Банку России



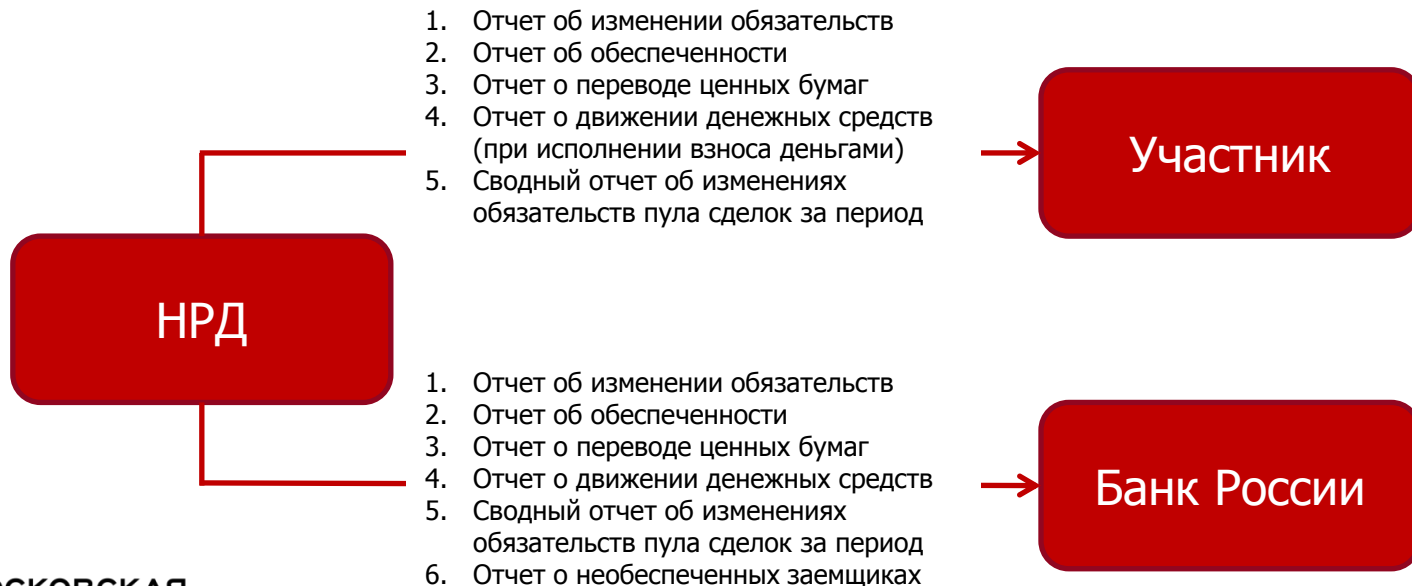
ЧАСТИЧНОЕ ИСПОЛНЕНИЕ ПЕРВОЙ ЧАСТИ РЕПО С БАНКОМ РОССИИ

Если бумаг, промаркированных Заемщиком, недостаточно для исполнения первой части, то возможно частичное исполнение первой части сделки:

- В ближайший клиринговый сеанс обязательство исполняется в объеме пропорциональном подобранному обеспечению (хотя бы 1 ценная бумага)
- При появлении ценных бумаг оставшаяся часть обязательства исполняется в следующих клиринговых сеансах
- На момент завершения последнего клирингового сеанса обязательство считается исполненным на сумму, пропорциональную объему подобранного обеспечения. На оставшуюся сумму Банком России начисляется штраф
- Если в обеспечение не удалось подобрать ни одной бумаги – обязательство считается невыполненным.

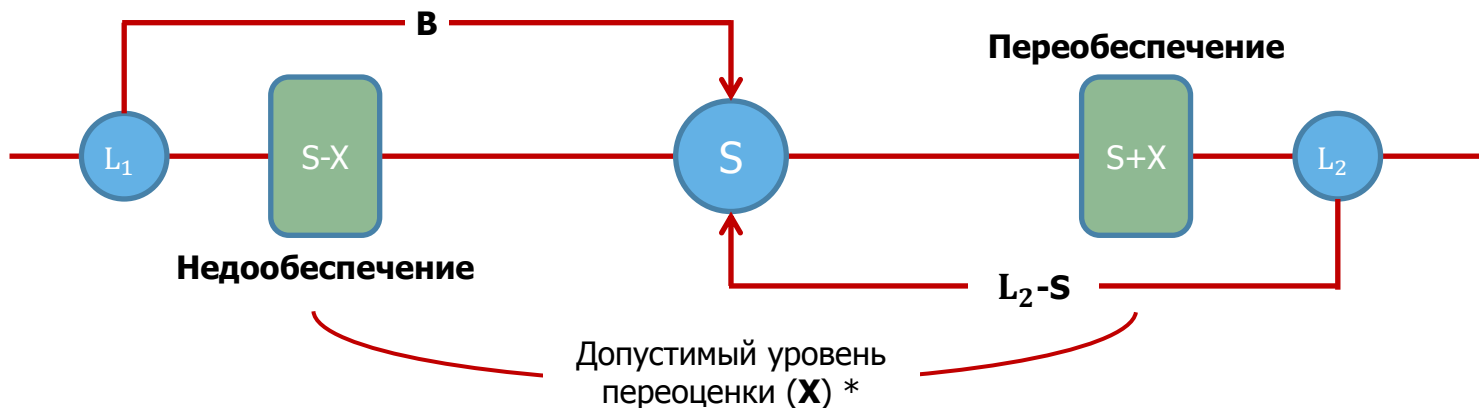
ПРОЦЕДУРА ПЕРЕОЦЕНКИ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ И ОБЕСПЕЧЕНИЯ (MARK-TO-MARKET)

- Переоценка стоимости обеспечения происходит ежедневно в 10:30 (по вчерашним ценам) с учетом дисконтов, установленных Банком России
- Переоценка происходит на основании рыночной цены Z, при отсутствии – индикативной цены НФА
- Переоценка проводится по всему портфелю обязательств
- По результатам переоценки происходит маржирование и уплата компенсационных взносов



МАРЖИРОВАНИЕ

- Проверка обеспеченности проводится по пулу всех сделок
- Компенсационный взнос (**B**) выставляется при превышении отклонения размера обязательств (**S**) и текущей стоимости обеспечения с учетом дисконтов (L_1) пороговой величины (**X**)
- Компенсационный взнос рассчитывается таким образом, чтобы текущая стоимость обеспечения с учетом дисконтов сравнялась с размером обязательств
- Если текущая стоимость обеспечения с учетом дисконтов (L_2) превышает размер обязательств (**S**) более чем на значение пороговой величины (**X**), ценные бумаги в размере $L_2 - S$ автоматически выводятся из обеспечения



* Допустимый уровень переоценки (**X**) устанавливается Банком России

АВТОМАТИЧЕСКОЕ ИСПОЛНЕНИЕ КОМПЕНСАЦИОННОГО ВЗНОСА

Компенсационный взнос исполняется в первую очередь бумагами. При **наличии достаточного объема** промаркированных **ценных бумаг** для исполнения компенсационного взноса НРД автоматически переводит их на счет Банка России. Переобеспеченность устраняется аналогично: на торговый счет Заемщика переводятся ценные бумаги.



АВТОМАТИЧЕСКОЕ ИСПОЛНЕНИЕ КОМПЕНСАЦИОННОГО ВЗНОСА

ВЕЧЕРНИЙ СЕАНС

В случае **отсутствия** необходимого объема промаркированных **ценных бумаг** у Заемщика до конца вечернего клирингового сеанса, **но наличия денежных средств** на торговом счете Заемщика производится частичное исполнение обязательств по 2-й части (перевод денежных средств) в вечернем клиринговом сеансе.



ПЕРЕНОС ОБЯЗАТЕЛЬСТВ (ROLLOVER)

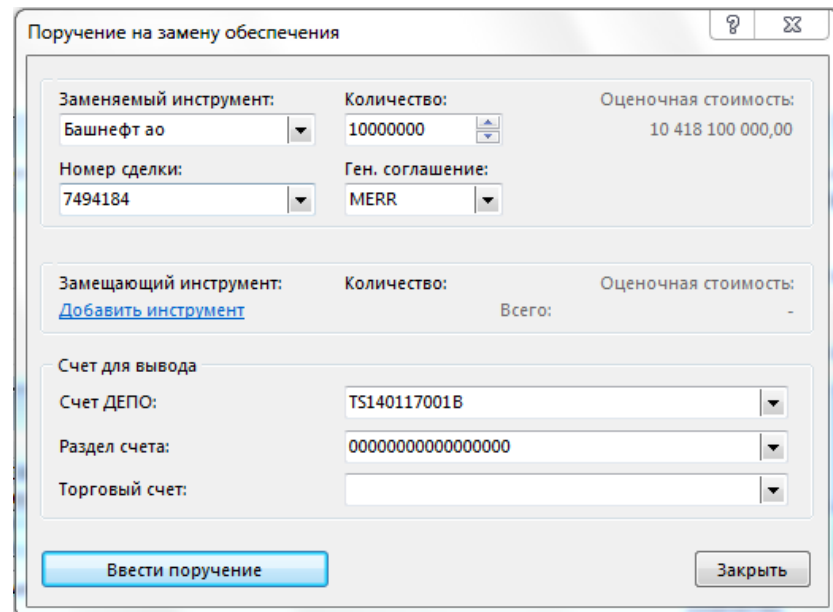
При отсутствии денежных средств для исполнения обязательств Участника по второй части сделки РЕПО:

- Расчеты по исполнению обязательств по 2-й части сделки с текущей датой исполнения исключаются из третьей клиринговой сессии
- НРД проверяет возможность проведения ролловера:
 - ✓ При наличии обеспечения на счетах участника НРД производит автоматический перенос обязательств участника на следующий день
 - ✓ Ролловер одной сделки может проводиться не более трех раз последовательно
 - ✓ По законодательству максимальный срок РЕПО - 1 год, поэтому ролловер не может быть применен к сделкам длиной 365, 364, 363 дня соответственно
 - ✓ НРД осуществляет расчеты по ролловеру сразу после вечернего клирингового сеанса
- Если обеспечения недостаточно, то объявляется дефолт участника

ЗАМЕНА ОБЕСПЕЧЕНИЯ

Проводится:

- Заемщиком:
 - по желанию (плата не взимается, количество не ограничено) как по **биржевым**, так и по **внебиржевым** сделкам
- НРД (автоматически):
 - перед корпоративными действиями
 - при исключении бумаги из списка РЕПО
 - при дефолте эмитента



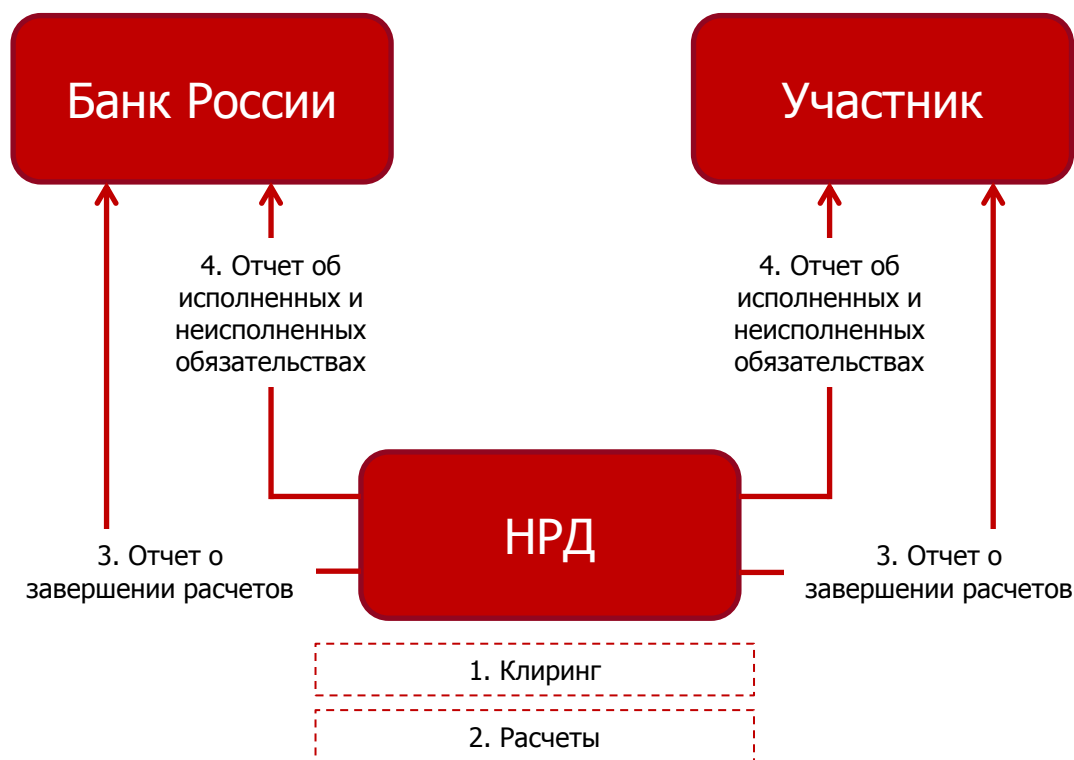
Поручение на замену обеспечения

Заменяемый инструмент:	Количество:	Оценочная стоимость:
Башнефт ао	10000000	10 418 100 000,00
Номер сделки:	Ген. соглашение:	
7494184	MERR	
Замещающий инструмент:	Количество:	Оценочная стоимость:
Добавить инструмент	Всего:	-
Счет для вывода		
Счет ДЕПО:	TS140117001B	
Раздел счета:	000000000000000000	
Торговый счет:		

Ввести поручение Закрыть

Замена будет произведена только при наличии достаточного объема промаркированных бумаг

СХЕМА ПРОВЕДЕНИЯ РАСЧЕТОВ ПО ВТОРОЙ ЧАСТИ



1. НРД проводит клиринг, учитывая обязательства по исполняемым первым и вторым частям РЕПО
2. НРД осуществляет перевод денег и ценных бумаг по итогам клиринга
3. НРД направляет отчеты о завершении расчетов Банку России и Участнику
4. НРД направляет Банку России и Участнику отчеты об исполненных и неисполненных обязательствах

ВРЕМЕННОЙ РЕГЛАМЕНТ ПОЛУЧЕНИЯ ОТЧЕТОВ ОТ НРД И ФБ ММВБ*

Этап	Время
От НРД:	
Переоценка обязательств (Mark-to-Market)	10:30
MS118, MS018, MS101, MS218	10:35
Первый клиринговый сеанс	12:00
MS101	12:05
MS007, MS009, MS018, MS118, MS194, MS102, МТ900/910, MS218	12:10
Второй клиринговый сеанс	16:00
MS101	16:05
MS007, MS009, MS018, MS118, MS194, MS102, МТ900/910	16:10
Третий клиринговый сеанс	19:40
MS101	19:45
MS007, MS009, MS018, MS118, MS194, MS102, МТ900/910	19:50
Закрытие операционного дня	21:30
MS118, MS218	21:30
От ФБ ММВБ:	
SEM02, SEM03	20:00

MS101 (MT546) – Отчет об исполнении депозитарного поручения (блокировка)

MS009 (MT575) – Подтверждение осуществления расчетов на условия ППП по сделкам

MS007 (MT537) – Неисполненные обязательства по сделкам

MS018 (MT558) – Отчет о регистрации обязательств по сделке

MS118 (MT569) – Отчет о составе обязательств и обеспеченности

MS194 (MT545/MT547) – Отчет о расчете первой/второй части сделки

MS102 (MT546/MT544) – Отчет об исполнении сводного депозитарного поручения

MT900/MT910 – дебетовое/кредитовое авизо об исполнении сводного платежного поручения

MS218 – Сводный отчет об изменениях обязательств пула после переоценки, за периоды между переоценкой, сеансами и за весь день

SEM02 – Выписка из реестра заявок на фондовом рынке

SEM03 – Информация по совершенным сделкам на фондовом рынке



КОРПОРАТИВНЫЕ ДЕЙСТВИЯ

- При поступлении доходов по ценным бумагам (дивиденды, купоны, погашения), переданным в обеспечение, они зачисляются на счет Банка России, а затем возвращаются первоначальному владельцу ценных бумаг при обеспеченности пула
- Поступления ценных бумаг обрабатываются так же, как и любая другая переобеспеченность. Если бумаги не входят в Список РЕПО, то они переводятся на счет Заемщика

ДЕФОЛТ

- Дефолт по обеспечению – отсутствие в 19:40 в день выставления компенсационного взноса достаточного количества промаркированных ценных бумаг или денежных средств на счетах Заемщика
- Дефолт по расчетам – отсутствие в 19:40 денежных средств, необходимых для исполнения обязательств Заемщика по второй части сделки РЕПО, и отсутствие возможности для ролловера
- О дефолте специальным отчетом уведомляются и Участник, и Кредитор
- Кредитор может подать одностороннее поручение в НРД на изменение статуса обязательств (исключение части сделок из клиринга)

РАСКРЫТИЕ ИНФОРМАЦИИ

Настоящая презентация была подготовлена и выпущена Открытым акционерным обществом «Московская Биржа ММВБ-РТС» (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.



КОНТАКТНАЯ ИНФОРМАЦИЯ

Сергей Титов

Начальник Управления продаж
+7 (495) 363-3232, доб. 26129
Sergey.Titov@moex.com

Евгения Глимчер

Руководитель направления
Управление продаж
+7 (495) 363-3232, доб. 26126
Evgeniya.Glimcher@moex.com

Яна Морякова

Руководитель направления
Управление продаж
+7 (495) 363-3232, доб. 26125
Yana.Moryakova@moex.com

Наиля Юнусова

Ведущий специалист
Отдела анализа и развития бизнеса
+7 (495) 363-3232, доб. 26128
Nailia.Yunysova@moex.com