

**ПРОЕКТ «РЕПО С ОТКРЫТОЙ
ДАТОЙ»**

Москва, 2023



ОБЩИЕ ХАРАКТЕРИСТИКИ ПРОДУКТА РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ

	РЕПО с открытой датой
Режимы	Адресные РЕПО с ЦК, РЕПО с КСУ и РЕПО-М
Инструменты	Все допущенные к режимам инструменты
Срок	Выбор признака « открытая дата », Максимально возможный срок – 365 дней
Код расчетов второй части	Для РЕПО с ЦК, РЕПО с КСУ – YOD , РЕПО-М без изменений
Валюта	Все доступные валюты
Маржирование	Для целей расчета Единого лимита сделки РЕПО учитывается со сроком 2 дня
Сделки с плавающей ставкой	Да
Исполнение	По требованию одной из сторон или при достижении максимально возможного срока (365 дней)
Отказ от исполнения	Да
Тарификация	<u>Ежедневно (по расчетным дням) начисляется и списывается комиссия:</u> <ul style="list-style-type: none">• в дату заключения сделки – отдельно торговая и клиринговая составляющие,• со следующего расчетного дня после даты исполнения первой части РЕПО – только клиринговая составляющая* в сумме клиринговая + торговая
Конвенция	Перенос даты надлежащего исполнения на предыдущий расчетный день в случае изменения расчетного календаря
Ограничения	<ol style="list-style-type: none">1. Возможность заключения сделок с открытой датой будет недоступна:<ul style="list-style-type: none">• для Участников клиринга категории «В»;• при заключении Депозитов с ЦК;2. При проведении процедуры портабилити от Участника клиринга категории «О», «Б» или «Б2» к Участнику клиринга категории «В» Базовый Участник клиринга должен самостоятельно выставить отчет/поручение на завершение сделки

* - в торговые дни, являющиеся выходными по законодательству РФ, происходит начисление этой комиссии, списание происходит в первый после выходных расчетный день; см. примеры на слайде №10.

ОСОБЕННОСТИ СДЕЛОК РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ

Поручение на закрытие можно подавать начиная с даты заключения сделки РЕПО с открытой датой;

Сделка РЕПО с открытой датой становится срочной к исполнению **на следующий расчетный день** при подаче поручения на завершение в течение основной торговой сессии (**06:50-19:00**). Подробнее см. слайд №4;

Для выпусков ценных бумаг, по которым имеются сведения о дате предстоящей оферты, **допустимый срок РЕПО с открытой датой ограничивается до наступления даты оферты;**

При появлении информации о **корпоративном действии несовместимым с расчетами по отдельному инструменту** запрещается заключать сделки РЕПО с открытой датой с таким инструментом, для уже заключенных сделок изменяется максимально возможный срок сделки на последнюю дату в которой возможен расчет с конкретным инструментом;

Сделка РЕПО с ЦК с открытой датой автоматически становится срочной к исполнению **при ликвидационном неттинге, дефолт-менеджменте участника либо при смене категории Участника клиринга на категорию «В»;**

Компенсационные взносы по сделкам РЕПО-М с открытой датой формируются и исполняются **стандартным образом**. В случае неисполнения компенсационного взноса сделка РЕПО-М с открытой датой становится срочной к исполнению;

Если в течение срока сделки РЕПО с открытой датой происходит выплата дохода по ценной бумаге, то она **будет передана стандартным механизмом** для ЦК или уменьшением второй части сделки для РЕПО-М;

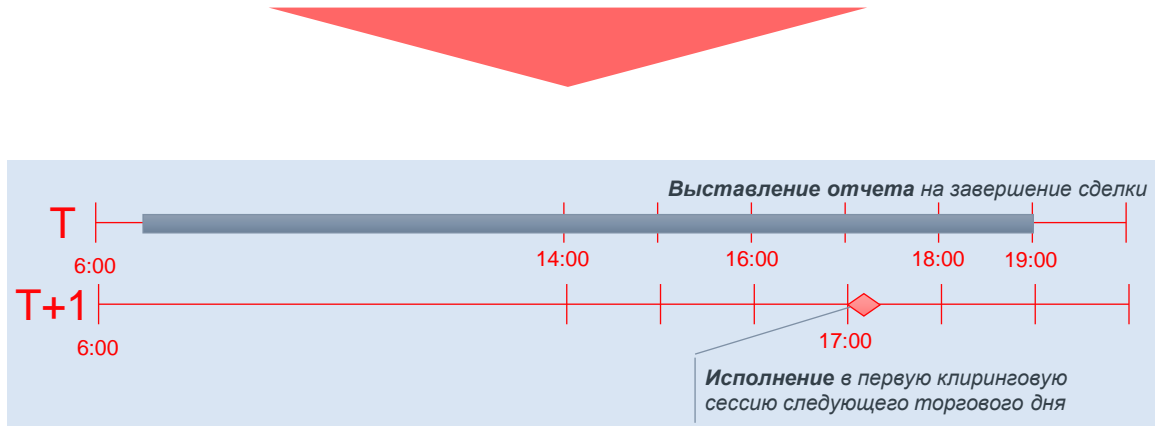
Заключение сделок РЕПО-М с Торгово-клиринговых счетов T0 **не допускается;**

В терминале MTSE в таб. «Сделки для исполнения» сделки РЕПО с открытой датой отражаются со сроком **«не позднее чем».**

ПОРЯДОК ВЫСТАВЛЕНИЯ ОТЧЕТОВ НА ИСПОЛНЕНИЕ И ВЫПОЛНЕНИЯ РАСЧЕТОВ

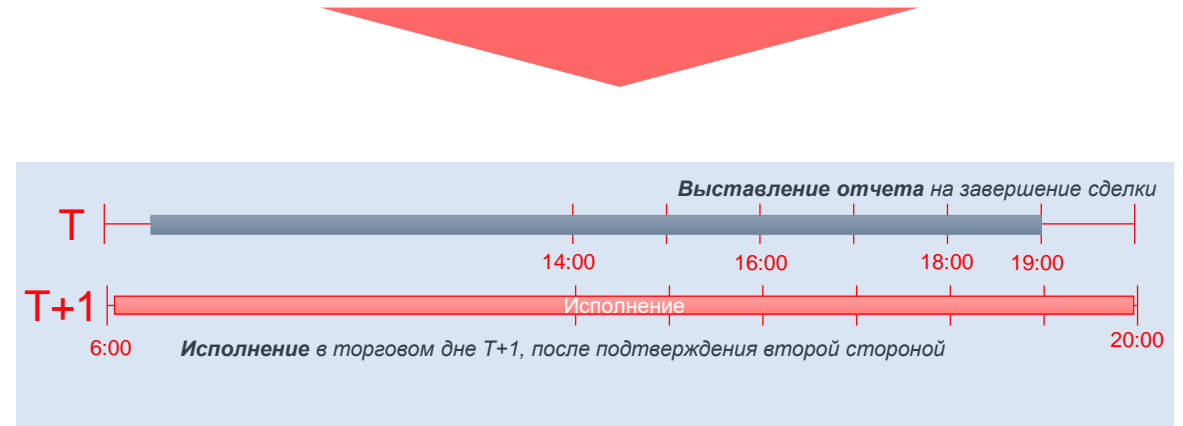
РЕПО С ЦК, РЕПО С КСУ

Выставление поручения на завершение РЕПО с открытой датой возможно в период времени (06:50-19:00) с исполнением в первую клиринговую сессию следующего торгового дня.



РЕПО-М

Выставление поручения на завершение РЕПО с открытой датой возможно в период времени (06:50-19:00), сделка становится срочной к исполнению на следующий торговый день.



ИЗМЕНЕНИЯ В КЛИРИНГОВЫХ ОТЧЕТАХ В СВЯЗИ С РЕАЛИЗАЦИЕЙ ПРОЕКТА «РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ»

1. Текущие клиринговые отчеты, затрагиваемые изменениями:

EQM06 (Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг – включая EQM06P/06R, EQM6C, EQM6D, EQM63)

EQM23 (Отчет об обязательствах по сделкам T+)

2. Новый клиринговый отчет:

EQM151 (Отчет о комиссионном вознаграждении по сделкам РЕПО с открытой датой)

ИЗМЕНЕНИЯ В ВЫПИСКЕ ИЗ РЕЕСТРА СДЕЛОК, ПРИНЯТЫХ В КЛИРИНГ (EQM06/06P/06R, EQM6C, EQM6D, EQM63)

XML-файл

НОДА	АТРИБУТ	ОПИСАНИЕ	ОБЯЗАТЕЛЬ-НОСТЬ	ТИП
SETTLEDATE		Блок данных по дате расчетов		
	SettleDate	Фактическая дата расчетов / Дата исполнения / Максимально допустимый срок исполнения второй части сделки РЕПО с открытой датой	Да	Date
RECORDS		Блок данных по сделке/ заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений/ депозитному договору/ кредитному договору		
	DueDate	Дата исполнения / Максимально допустимый срок исполнения второй части сделки РЕПО с открытой датой	Да	Date
	OpenRepo	Признак сделки РЕПО с открытой датой: «Y» - да.	Нет	Character

Бумажная форма

Дата исполнения*: 31.05.2024

№ п/п	Номер сделки/ заявки/ депозитного договора/ кредитного договора	Часть сделки/ заявки/ депозитного договора/ кредитного договора	Дата заключения	Направленность	Код расчетов	Срок сделки РЕПО/ кредитного договора	Цена	Кол-во	Объем сделки/ заявки/ депозитного договора/ кредитного договора, в валюте расчетов	Комиссия за организацию торгов	Комиссия за клиринг	НКД на дату исполнения	Сумма купонного дохода и компенсационных взносов по ДС	Сумма компенсационных взносов по ЦБ	Обязательство/ требование по денежным средствам	Сумма процентов по кредитному договору, в валюте расчетов	...	Номер отчета на исполн./ поручения на отказ	Время исполнения	Время расчетов	Изменение срока исполнения обязательства по сделке	РЕПО с открытой датой
РЕПО с ЦК адресное AFKS "Система ао" - Цена для данной бумаги указывается в валюте расчетов																						
1	123456789	2	01.06.2023	S	YOD		15.4827	15,800	241,217.37	0.00	0.00	0.00			241,217.37		...				Нет	Да
РЕПО с ЦК адресное FEES "Россети" - Цена для данной бумаги указывается в валюте расчетов																						
2	123456790	2	01.06.2023	S	YOD		0.105111	2,340,000	245,960.16	0.00	0.00	0.00			245,960.16		...				Нет	Да

* - для сделок РЕПО с открытой датой до определения даты исполнения второй части сделки указывается Максимально допустимый срок исполнения второй части сделки

ИЗМЕНЕНИЯ В ОТЧЕТЕ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬСТВАХ ПО СДЕЛКАМ T+ (EQM23)

Бумажная форма

Дата исполнения*:

Идентификатор валюты расчетов/ драгоценного металла:

Тип обязательства	Обязательство**	Требование**

Раздел для учета ценных бумаг в Обеспечении:

Торгово-клиринговый счет:

Код ценной бумаги	Наименование ценной бумаги	Тип обязательства	Обязательство**	Требование**

* – для сделок РЕПО с открытой датой до определения даты исполнения второй части сделки указывается Максимально допустимый срок исполнения второй части сделки

** – Могут содержать требования/обязательства по сделкам РЕПО с открытой датой

НОВЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ОТЧЕТ EQM151

(ОТЧЕТ О КОМИССИОННОМ ВОЗНАГРАЖДЕНИИ ПО СДЕЛКАМ РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ)

Бумажная форма

Блок 1 - информация о ключевых параметрах заключенной сделки

Блок 2 - информация о комиссионном вознаграждении*

№ п/п	Номер сделки	Часть сделки	Направление	Дата торгов	Валюта расчетов	Код ценной бумаги	Наименование ценной бумаги	Сумма начисленного комиссионного вознаграждения, руб.**	Кол-во дней	Дата исполнения обязательств по уплате комиссии	Сумма комиссионных вознаграждений по сделке нарастающим итогом, руб.
[RecNo]	[TradeNo]	[RepoPart]	[BuySell]	[TradeDate]	[CurrencyId]	[SecurityId]	[SecShortName]	[OpenRepoComm]	[CommDays]	[SettleDate]	[TotalComm]

Формируется ежедневно, если есть *неисполненные* сделки РЕПО с открытой датой.

* - сумма начисленной комиссии, количество дней, за которые была начислена комиссия (например, в пятницу – за три дня), дата списания комиссии и сумма всех комиссий по сделке нарастающим итогом (справочно).

** - в отчете за день заключения сделки (Дату торгов) сумма начисленного комиссионного вознаграждения равна сумме комиссионного вознаграждения за организацию торгов и за клиринг (ExchComm + ClrComm в EQM06)

КЛИРИНГОВЫЕ ОТЧЕТЫ, В КОТОРЫХ БУДЕТ ОТРАЖАТЬСЯ СПИСАНИЕ КОМИССИИ ПО СДЕЛКАМ РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ

1. Текущие клиринговые отчеты:

EQM13

(Отчет об итоговых нетто-обязательствах/нетто-требованиях)

- отображается* в дату исполнения обязательств по уплате (списанию) комиссий

EQM15

(Отчет об обязательствах Участника по комиссионному вознаграждению)

ССХ99_EQ

(Отчет о движении денежных средств)

- отображается в дни начисления и дни списания

2. Новый клиринговый отчет:

EQM 151

(Отчет о комиссионном вознаграждении по сделкам РЕПО с открытой датой)

ПРИЛОЖЕНИЕ 1: ПРИМЕР ОТРАЖЕНИЯ НАЧИСЛЕНИЯ И СПИСАНИЯ КОМИССИИ ПО СДЕЛКАМ РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ (1/4)

Пример 1. Сделка заключена в середине недели

чт	пт	сб	вс	пн	вт	ср	чт	пт	сб	вс	...
	х 3							х 3			


Пример 2. Сделка заключена перед неторговыми днями


пт	сб	вс	пн	вт	ср	чт	пт	сб	вс	пн	...
х 3							х 3				

Пример 3. Сделка заключена в торговые выходные (не расчетные) дни

31.12	1.01	2.01	3.01	4.01	5.01	6.01	7.01	8.01	9.01	10.01	...
									х 6		

 Комиссия за торги и комиссия за клиринг

 Комиссия за клиринг: начисление и списание в расчетные дни.

 Комиссия за клиринг: начисление в торговые дни

- Комиссия за торги и комиссия за клиринг:
- начисление и списание в день заключения сделки.
 - Отражаются в разрезе сделок в отчетах:
 - EQM06 как **ExchComm** и **ClrComm**
 - EQM151 как **OpenRepoComm**

- Комиссия за клиринг отражается:
- EQM151 - в разрезе сделок ежедневно как **OpenRepoComm**.
 - EQM15 - в виде нетто по всем сделкам в даты начисления и списания.
 - EQM13 в составе комиссий фондового рынка в даты списания.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1: ПРИМЕР ОТРАЖЕНИЯ НАЧИСЛЕНИЯ И СПИСАНИЯ КОМИССИИ ПО СДЕЛКАМ РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ (2/4)

Пример 3:

3.01	4.01	5.01	6.01	7.01	8.01	9.01
						x 6

EQM15 – Отчет о комиссионных вознаграждениях

за 3.01 Комиссионное вознаграждение за организацию торгов

Вид Комиссионного вознаграждения	Описание	Дата начала периода начисления	Дата окончания периода начисления	Сумма комиссионного вознаграждения*, руб.	Номер счета/ расчетный код	Номер счета обеспечения	Дата исполнения обязательств
49	Фондовый рынок. Оборотная часть комиссионного вознаграждения за организацию торгов. (Расчетный код)	03.01.2023	03.01.2023	150,00	11111	30420810231000211111	03.01.2023
			Всего:	150,00			

Комиссия за клиринг

Вид Комиссионного вознаграждения	Описание	Дата начала периода начисления	Дата окончания периода начисления	Сумма комиссионного вознаграждения*, руб.	в т.ч. НДС, руб.	Номер счета/ расчетный код	Номер счета обеспечения	Дата исполнения обязательств
43	Фондовый рынок. Оборотная часть комиссионного вознаграждения за клиринговое обслуживание. (Расчетный код)	03.01.2023	03.01.2023	380,00		11111	30420810231000211111	03.01.2023
			Всего:	380,00				

EQM151 - Отчет о комиссионном вознаграждении по сделкам РЕПО с открытой датой

за 3.01

№ п/п	Номер сделки	Часть сделки	Направленность	Дата торгов	Валюта расчетов	Код ценной бумаги	Наименование ценной бумаги	Сумма начисленного комиссионного вознаграждения*, руб.	Кол-во дней	Дата исполнения обязательств по уплате комиссии	Сумма комиссионных вознаграждений по сделке нарастающим итогом*, руб.
1	987654321	1	К	03.01.2023	RUB	SU26221RMFS0	ОФЗ 26221	530,00		03.01.2023	530,00

* - Значения комиссионных вознаграждений рассчитаны на основе ставок тарифного плана «REPO_0», действующих в течение маркетингового периода (по 31 декабря 2023 г.), сумма сделки 100 000 000 руб.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1: ПРИМЕР ОТРАЖЕНИЯ НАЧИСЛЕНИЯ И СПИСАНИЯ КОМИССИИ ПО СДЕЛКАМ РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ (3/4)

Пример 3:

3.01	4.01	5.01	6.01	7.01	8.01	9.01
						x 6

EQM15 – Отчет о комиссионных вознаграждениях

за 4.01

Комиссия за клиринг

Вид Комиссионного вознаграждения	Описание	Дата начала периода начисления	Дата окончания периода начисления	Сумма комиссионного вознаграждения*, руб.	в т.ч. НДС, руб.	Номер счета/ расчетный код	Номер счета обеспечения	Дата исполнения обязательств
308	Фондовый рынок. Сумма клиринговой комиссии по сделкам РЕПО с открытой датой. (Расчетный код)	04.01.2023	04.01.2023	530,00		11111	30420810231000211111	09.01.2023
			Всего:	530,00				

за 5.01

Комиссия за клиринг

Вид Комиссионного вознаграждения	Описание	Дата начала периода начисления	Дата окончания периода начисления	Сумма комиссионного вознаграждения*, руб.	в т.ч. НДС, руб.	Номер счета/ расчетный код	Номер счета обеспечения	Дата исполнения обязательств
308	Фондовый рынок. Сумма клиринговой комиссии по сделкам РЕПО с открытой датой. (Расчетный код)	05.01.2023	05.01.2023	530,00		11111	30420810231000211111	09.01.2023
			Всего:	530,00				

за 6.01

Комиссия за клиринг

Вид Комиссионного вознаграждения	Описание	Дата начала периода начисления	Дата окончания периода начисления	Сумма комиссионного вознаграждения*, руб.	в т.ч. НДС, руб.	Номер счета/ расчетный код	Номер счета обеспечения	Дата исполнения обязательств
308	Фондовый рынок. Сумма клиринговой комиссии по сделкам РЕПО с открытой датой. (Расчетный код)	06.01.2023	06.01.2023	1 590,00		11111	30420810231000211111	09.01.2023
			Всего:	1 590,00				

за 9.01

Комиссия за клиринг

Вид Комиссионного вознаграждения	Описание	Дата начала периода начисления	Дата окончания периода начисления	Сумма комиссионного вознаграждения*, руб.	в т.ч. НДС, руб.	Номер счета/ расчетный код	Номер счета обеспечения	Дата исполнения обязательств
308	Фондовый рынок. Сумма клиринговой комиссии по сделкам РЕПО с открытой датой. (Расчетный код)	04.01.2023	04.01.2023	530,00		11111	30420810231000211111	09.01.2023
308	Фондовый рынок. Сумма клиринговой комиссии по сделкам РЕПО с открытой датой. (Расчетный код)	05.01.2023	05.01.2023	530,00		11111	30420810231000211111	09.01.2023
308	Фондовый рынок. Сумма клиринговой комиссии по сделкам РЕПО с открытой датой. (Расчетный код)	06.01.2023	06.01.2023	1 590,00		11111	30420810231000211111	09.01.2023
308	Фондовый рынок. Сумма клиринговой комиссии по сделкам РЕПО с открытой датой. (Расчетный код)	09.01.2023	09.01.2023	530,00		11111	30420810231000211111	09.01.2023
			Всего:	3 180,00				

* - Значения комиссионных вознаграждений рассчитаны на основе ставок тарифного плана «REPO_0», действующих в течение маркетингового периода (по 31 декабря 2023 г.), сумма сделки 100 000 000 руб.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1: ПРИМЕР ОТРАЖЕНИЯ НАЧИСЛЕНИЯ И СПИСАНИЯ КОМИССИИ ПО СДЕЛКАМ РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ (4/4)

Пример 3:

3.01	4.01	5.01	6.01	7.01	8.01	9.01
						x 6

EQM151 - Отчет о комиссионном вознаграждении по сделкам РЕПО с открытой датой

за 4.01

№ п/п	Номер сделки	Часть сделки	Направленность	Дата торгов	Валюта расчетов	Код ценной бумаги	Наименование ценной бумаги	Сумма начисленного комиссионного вознаграждения*, руб.	Кол-во дней	Дата исполнения обязательств по уплате комиссии	Сумма комиссионных вознаграждений по сделке нарастающим итогом*, руб.
1	987654321	2	П	03.01.2023	RUB	SU26221RMFS0	ОФЗ 26221	530,00	1	09.01.2023	1 060,00

за 5.01

№ п/п	Номер сделки	Часть сделки	Направленность	Дата торгов	Валюта расчетов	Код ценной бумаги	Наименование ценной бумаги	Сумма начисленного комиссионного вознаграждения*, руб.	Кол-во дней	Дата исполнения обязательств по уплате комиссии	Сумма комиссионных вознаграждений по сделке нарастающим итогом*, руб.
1	987654321	2	П	03.01.2023	RUB	SU26221RMFS0	ОФЗ 26221	530,00	1	09.01.2023	1 590,00

за 6.01

№ п/п	Номер сделки	Часть сделки	Направленность	Дата торгов	Валюта расчетов	Код ценной бумаги	Наименование ценной бумаги	Сумма начисленного комиссионного вознаграждения*, руб.	Кол-во дней	Дата исполнения обязательств по уплате комиссии	Сумма комиссионных вознаграждений по сделке нарастающим итогом*, руб.
1	987654321	2	П	03.01.2023	RUB	SU26221RMFS0	ОФЗ 26221	1 590,00	3	09.01.2023	3 180,00

за 9.01

№ п/п	Номер сделки	Часть сделки	Направленность	Дата торгов	Валюта расчетов	Код ценной бумаги	Наименование ценной бумаги	Сумма начисленного комиссионного вознаграждения*, руб.	Кол-во дней	Дата исполнения обязательств по уплате комиссии	Сумма комиссионных вознаграждений по сделке нарастающим итогом*, руб.
1	987654321	2	П	03.01.2023	RUB	SU26221RMFS0	ОФЗ 26221	530,00	1	09.01.2023	3 710,00

* - Значения комиссионных вознаграждений рассчитаны на основе ставок тарифного плана «REPO_0», действующих в течение маркетингового периода (по 31 декабря 2023 г.), сумма сделки 100 000 000 руб.

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ

По вопросам: Управление продвижения и информационной
поддержки клиринговых услуг НКО НКЦ (АО)

ps@moex.com

Настоящая презентация была подготовлена и выпущена Публичным 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 является 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, прямо или косвенно связанной с использованием этого документа или иным образом возникшей из него. Данная брошюра содержит прогнозные заявления. Все включенные в настоящую брошюру 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 брошюры, и мы точно отрицаем наличие любых обязательств по обновлению или пересмотру прогнозных заявлений в настоящей брошюре в связи с изменениями наших ожиданий, или перемен в условиях или обстоятельствах, на которых основаны эти прогнозные заявления.