

An aerial photograph of a city skyline, likely Moscow, featuring several prominent skyscrapers. A large red rectangular overlay covers the right side of the image, containing the text "РЕПО с открытой датой".

РЕПО с открытой датой

ОБЩИЕ ХАРАКТЕРИСТИКИ ПРОДУКТА РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ

	РЕПО с открытой датой
Режимы	Адресные РЕПО с ЦК, РЕПО с КСУ и РЕПО-М
Валюта	Все доступные валюты
Инструменты	Все допущенные к режимам инструменты
Код расчетов второй части	Для РЕПО с ЦК, РЕПО с КСУ – YOD , РЕПО-М без изменений
Срок	Выбор признака « открытая дата », Максимально возможный срок – 365 дней
Исполнение	По требованию одной из сторон или при достижении максимально возможного срока (365 дней)
Отказ от исполнения	Да
Сделки с плавающей ставкой	Да
Тарификация	<u>Ежедневно (по расчетным дням) начисляется и списывается комиссия:</u> • 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
Маржирование	Для целей расчета Единого лимита сделка РЕПО учитывается со сроком 2 дня
Ограничения	1. Возможность заключения сделок с открытой датой будет недоступна: • 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

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)**;
- ✓ 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 инструментом;
- ✓ Сделка РЕПО с ЦК с открытой датой автоматически становится срочной к исполнению **при ликвидационном неттинге, дефолтменеджменте участника либо при смене категории Участника клиринга на категорию «В»;**
- ✓ Компенсационные взносы по сделкам РЕПО-М с открытой датой формируются и исполняются **стандартно**. 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

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

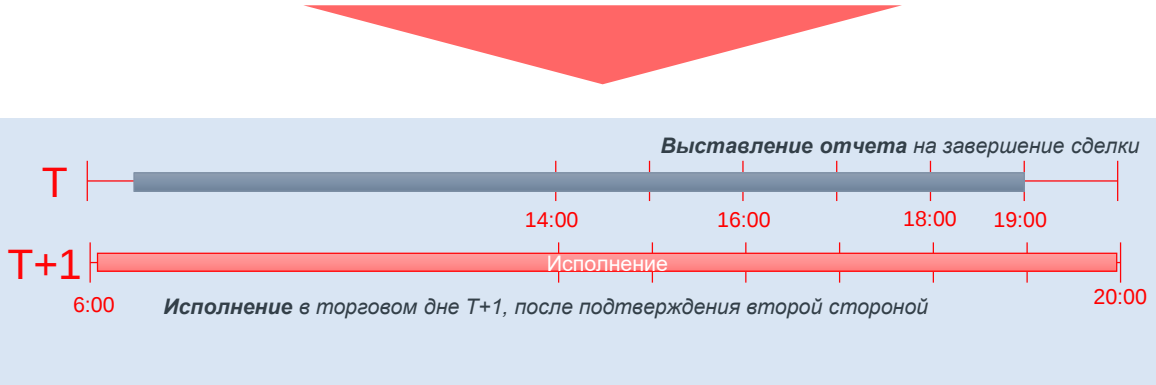
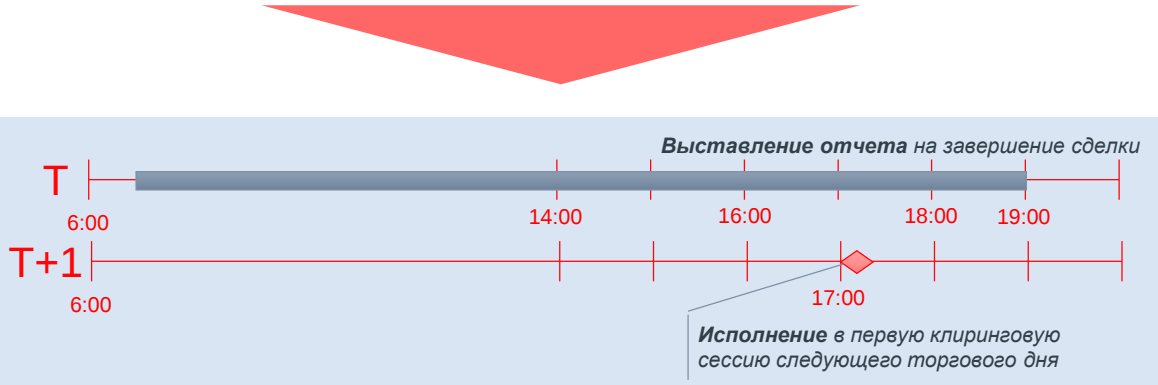
Сделка РЕПО с открытой датой становится срочной к исполнению **на следующий расчетный день** при подаче поручения на завершение в течение основной торговой сессии (06:50-19:00).

РЕПО С ЦК, РЕПО С КСУ

РЕПО-М

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.

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.



НОВЫЙ РЕКВИЗИТ ФОРМЫ ВВОДА ЗАЯВКИ И ОТРАЖЕНИЕ СДЕЛОК В ТАБЛИЦЕ «СДЕЛКИ К ИСПОЛНЕНИЮ»

Форма заявки – фиксированная ставка

Вторая часть сделки РЕПО

Срок РЕПО: 365

☒ РЕПО с открытой датой

Индикатор: Фикс.ставка

Дата расчетов: 03.07.2024

Форма заявки – плавающая ставка

Вторая часть сделки РЕПО

Срок РЕПО: 365

☒ РЕПО с открытой датой

Индикатор: RUSFAR

Значение: 7,44% (RUSFAR овернайт)
Дата расчетов: 03.07.2024

Спред %: 2,000

Таблица «Сделки к исполнению»

* 7 - Сделки для исполнения

Сделка №	Отчет на закрытие сделки РЕПО с "Открытой датой"	Статус	Тип	Партнер	Дата сделки	Дата исполнения	Режим	Инструмент	К/П	Сумма к исполнению	Лотов к исполнению	Цена	Объем	Лоты	Срок	Стоимость выкупа РЕПО с открытой датой	Плавающая ставка	Статус РЕПО с открытой датой	Код расчетов
4 344 369 844		Подтв	ЦК2		13.03.2023	13.03.2024	РЕПО с ЦК с КСУ 1 год	КСУ все	К	1 030 958,90	1 000	1,031	1 030 958,90	1 000	366	0,00	Фиксированная	Нет	Y12M
4 356 043 934		Подтв	АЦК2	Головин	20.06.2023	19.06.2024	РЕПО с ЦК адресное	МосБиржа	П	105 413,78	100	105,414	105 413,78	100	365	105 428,19	Фиксированная	Да	Y0D
4 357 979 311	442 427 +		АЦК1	Головин	04.07.2023	04.07.2023	РЕПО с ЦК адресное	МосБиржа	К	103 754,00	100	103,754	103 754,00	100		0,00	Фиксированная	Да	Y0
4 357 979 312	442 427	Подтв	АЦК2	Головин	04.07.2023	03.07.2024	РЕПО с ЦК адресное	МосБиржа	П	103 768,21	100	103,768	103 768,21	100	365	103 768,21	Фиксированная	Да	Y0D
4 357 979 917	442 427 -		АЦК1	Головин	04.07.2023	04.07.2023	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	П	555 000,00	555	1,000	555 000,00	555		0,00	Фиксированная	Да	Y0
4 357 979 918	442 427 -		АЦК2	Головин	04.07.2023	03.07.2024	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	К	555 076,03	555	1,000	555 076,03	555	365	555 076,03	Фиксированная	Да	Y0D
4 358 097 867	442 427	Подтв	Р1	Головин	04.07.2023	04.07.2023	РЕПО-М	МосБиржа	К	125 710,00	1 000	125,7100	125 710,00	1 000	365	0,00	Фиксированная	Да	S0

ОСОБЕННОСТИ ТАРИФИКАЦИИ СДЕЛОК С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ

Комиссия начисляется и списывается ежедневно (по расчетным дням), при этом:

- 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

До 31 декабря 2023 г. будет действовать маркетинговый период на заключение сделок с открытой датой.

Целевой тариф: +10% к вашему тарифу.

* - в торговые дни, являющиеся выходными по законодательству РФ, происходит начисление этой комиссии, списание происходит в первый после выходных расчетный день; см. примеры на слайде №15.

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	Направ- ленность	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 компенсац ионных 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 обязательств 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		15.4627	15,600	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 Т+ (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	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.
[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. Обратная 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. Обратная 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.

ОПЦИЯ «EVERGREEN» В РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ

В рамках расширения инструментария денежного рынка реализована возможность заключения Участниками сделок РЕПО с открытой датой с опций «EverGreen» – Период до исполнения 2й части сделок РЕПО с открытой датой.

Период до исполнения 2й части сделок РЕПО с открытой датой – количество календарных дней после подачи «поручения на исполнение сделки РЕПО»* с открытой датой, через которое 2-я часть сделки РЕПО становится срочной к исполнению, но не позднее максимально возможного срока, определенного в заявке РЕПО.

По умолчанию значение параметра = 1.

* Отчет на закрытие сделки РЕПО с открытой датой

Пример EVERGREEN 30дн.



** Сделка РЕПО с открытой датой не может стать срочной к исполнению позднее даты максимально возможного срока.

ПОДАЧА ЗАЯВОК И ЗАКЛЮЧЕНИЕ СДЕЛОК РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ С ОПЦИЕЙ «EVERGREEN» (MTSE)

Ввод адресной заявки РЕПО с ЦК

Режим: РЕПО с ЦК с КСУ адресное | Партнер: [выбор] | Инструмент: КСУ обл. | Код расчетов: Y0 | Валюта расч.: руб. | Дата расчетов: 22.10.2024

Первая часть сделки РЕПО: Сумма РЕПО: 14 500 000,00 | Лоты: 14 500

Вторая часть сделки РЕПО: ☒ РЕПО с открытой датой | Период до исполнения: 30 | Индикатор: RUSFAR | Значение: 18,78% (RUSFAR овернайт) | Дата расчетов: 20.01.2025 | Спред, %: 0,500

Риск-параметры: Расчетная цена: 1,000 | Дисконт, %: 0,000 | Расч.цена с учетом дисконта: 1,000

Сумма возврата: 15 248 869,59 руб.

Фирма: [выбор] | Торговый счет: S00+000002B9 | Клиринговый расчетный код: 10161 | Клиент: [выбор] | Поручение: [выбор] | Ссылка: [выбор]

Комиссия и Единый Лимит под заявку: Комиссия, руб.: 49,79 | ЕЛ под заявку: 52 490,00 | ЕЛ с учетом заявки: 15 868 390 047,91

Ввести заявку | Закрыть

Сделка РЕПО с открытой датой с опцией **EverGreen** может быть заключена в адресных режимах РЕПО с ЦК, РЕПО с КСУ, РЕПО-М во всех доступных валютах, включая использование плавающей ставки по выбранному индикатору.

Новый метчинговый параметр - Значение **EVERGREEN** (в календ. днях)

1 - Отправленные адресные заявки

Режим	Репо с "Открытой датой"	Инструмент	К/П	Цена	Лоты	Остаток лотов	Объем	Торговый счет	Сумма / Сумма РЕПО	Код расчетов	Стоимость выкупа РЕПО	Срок	Период до исполнения второй части РЕПО	Ставка / Спред, %	Значение индикатора, %
РЕПО с ЦК с КСУ адресное	Да	КСУ обл.	К/П	0,500	14 500	14 500	14 500 000,00	S00+4190AC53	14 500 000,00	Y0	15 246 751,66	90	30	0,500	18,64

3 - Сделки

Тип	Режим	Инструмент	К/П	Цена	Цена выкупа	Ставка / Спред, %	Лоты	Объем	Торговый счет	Код расчетов	Сумма / Сумма РЕПО	Стоимость выкупа РЕПО	Репо с "Открытой датой"	Плавающая ставка	Период до исполнения второй части РЕПО	Срок
АЦК1	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	К/П	0,500	1,052	0,500	14 500	14 500 000,00	S01+00000F00	Y0	14 500 000,00	15 254 381,83	Да	Плавающая	30	90
АЦК2	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	К	1,000	1,052	0,500	14 500	14 500 000,00	S01+00000F00	Y0	14 500 000,00	15 254 381,83	Да	Плавающая	30	90
АЦК2	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	П	1,052	1,052	0,500	14 500	15 254 381,83	S01+00000F00	Y0D90	14 500 000,00	15 254 381,83	Да	Плавающая	30	90

* 1 - Сделки для исполнения

Дата сделки	Дата исполнения	Режим	Инструмент	К/П	Сумма / Сумма РЕПО	Лоты	Код расчетов	Срок	Период до исполнения второй части РЕПО	Ставка / Спред, %	Плавающая ставка
22.10.2024	20.01.2025	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	П	14 500 000,00	14 500	Y0D90	90	30	0,500	Плавающая

ОПЦИЯ «EVERGREEN» В ФОРМАХ ВВОДА РЕПО-М, RFQ

Ввод адресной заявки РЕПО

Режим: РЕПО-М Партнер: [выбор]

Инструмент: МосБиржа Код расчетов: 50 ?

Валюта расч.: руб. Дата расчетов: 31.10.2024

Первая часть сделки РЕПО Вторая часть сделки РЕПО

Сумма РЕПО: 100 000 000,00 Макс. срок РЕПО: 90

Лотов: 1 ☒ РЕПО с открытой датой

Размер лота: 1 Период до исполнения: 30

Индикатор: RUSFAR

Значение: 20,46% (RUSFAR овернайт)

Дата расчетов: 29.01.2025

Спред, %: 0,3000

Расчетная цена: 197,4900

В полях "Сумма РЕПО", "Лотов" и "Начальный дисконт" указываются два любых параметра из трех

Дисконт, %

Начальный: 10,0000

Нижний предел:

Верхний предел:

Фирма: [выбор]

Клиринговый расчетный код: 11849

Торговый счет: S00+4190AC53

Клиент: [выбор] Поручение: [выбор]

Возмещение, %: Ссылка: [выбор]

Комиссия и Единый Лимит под заявку ?

Комиссия, руб.: 156,00 ЕЛ под заявку: 0,00 ЕЛ с учетом заявки: 244 031 888 759,23

Вести заявку Закрыть

Ввод запроса RFQ для РЕПО

Режим: РЕПО-М Партнер: [выбор]

Инструмент: МосБиржа Код расчетов: 50 ?

Валюта расч.: руб. Дата расчетов: 31.10.2024

Адресат: Все ☒ ☐ Расширенный режим

Список партнеров: [выбор] ☐ Anonymous

☒ Full amount

☐ Время сбора заявок

Не ограничено

Первая часть сделки РЕПО Вторая часть сделки РЕПО

Сумма: 100 000 000,00 Макс. срок РЕПО: 90

Лотов: ☒ РЕПО с открытой датой

Размер лота: 1 Период до исполнения: 30

Индикатор: RUSFAR

Значение: 20,46% (RUSFAR овернайт)

Дата расчетов: 29.01.2025

Спред, %: 0,5000

Возмещение, %: 10,00

Дисконт, %

Начальный: 10,0000

Нижний предел:

Верхний предел:

Торговый счет: S00+4190AC53 Клиринговый расчетный код: 11849

Клиент: [выбор] Поручение: [выбор]

Вести RFQ Закрыть

Ввод запроса RFQ для РЕПО с ЦК

Режим: РЕПО с ЦК адресное Партнер: [выбор]

Инструмент: МосБиржа Код расчетов: Y0 ?

Валюта расч.: руб. Дата расчетов: 31.10.2024

Адресат: Все ☒ ☐ Расширенный режим

Список партнеров: [выбор] ☐ Anonymous

☒ Full amount

☐ Время сбора заявок

10 минут

Первая часть сделки РЕПО Вторая часть сделки РЕПО

Сумма: 100 000 000,00 Макс. срок РЕПО: 120

Лотов: ☒ РЕПО с открытой датой

Размер лота: 10 Период до исполнения: 35

Индикатор: RUSFAR

Значение: 20,46% (RUSFAR овернайт)

Дата расчетов: 28.02.2025

Спред, %: 0,300

Риск-параметры

Расчетная цена: 193,788

Дисконт, %: По умолчанию: 13,000

Расч.цена с учетом дисконта: 168,596

Торговый счет: S00+4190AC53 Клиринговый расчетный код: 11849

Клиент: [выбор] Поручение: [выбор]

Вести RFQ Закрыть

2 - Отправленные запросы RFQ

Котировка №	Время завершения сбора заявок	Время	Статус	Инструмент	Режим	Код расчетов	К/П	Объем	Срок РЕПО	Период до исполнения второй части РЕПО	РЕПО с открытой датой	Ставка/спред, %	Плавающая ставка	Индикатор	Значение индикатора, %	Заявки только на полный объем
14 942	12:48:19	12:38:18	Акт	МосБиржа	РЕПО с ЦК адресное	Y0	К/П	100 000 000,00	120	35	Да	0,300	Плавающая	RUSFAR овернайт	20,46	Да
14 943	12:41:15	12:41:15	Акт	МосБиржа	РЕПО-М	50	К	100 000 000,00	90	30	Да	0,5000	Плавающая	RUSFAR овернайт	20,46	Да

1 - Отправленные адресные заявки

Режим	Инструмент	К/П	Цена	Лоты	Остаток лотов	Сумма / Сумма РЕПО	Код расчетов	Стоимость выкупа РЕПО	Срок	Период до исполнения второй части РЕПО	Репо с "Открытой датой"	Ставка / Спред, %	Значение индикатора, %
РЕПО-М	МосБиржа	П	177,7408	562 617	562 617	100 000 000,00	50	105 109 424,66	90	30	Да	0,3000	20,46

ИСПОЛНЕНИЕ СДЕЛОК РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ С ОПЦИЕЙ «EVERGREEN»

Ввести отчет на досрочное исполнение...

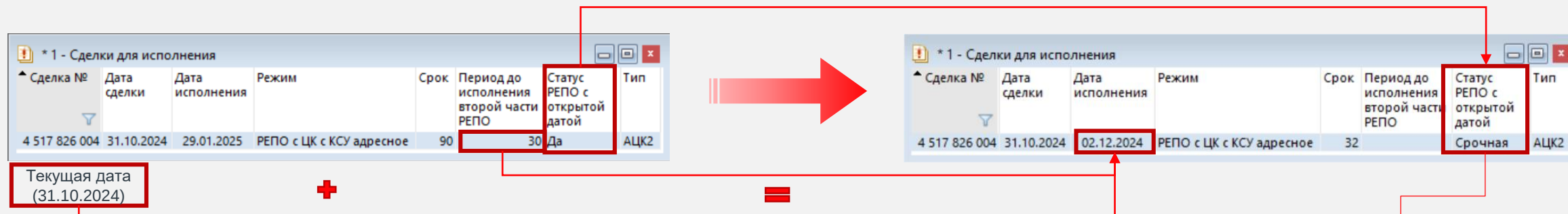
Ввести отчет на закрытие сделки РЕПО с открытой датой...

Ввести отчет на исполнение сделки Подтверждения...

*

- 1) Сделка РЕПО с Открытой датой с опцией «EverGreen» становится срочной к исполнению с помощью Поручения на закрытие (завершение) сделки РЕПО.

* Контекстное меню правой кнопкой мыши по второй части сделки РЕПО в таб. «сделки для исполнения»



- 2) Дата исполнения второй части РЕПО устанавливается на дату* **Текущая дата + «Период до исполнения второй части РЕПО»**

* при попадании на нерасчетный день датой исполнения определяется как следующий ближайший расчетный день

Статус поля «РЕПО с открытой датой» меняет значение с «ДА» на «Срочная»

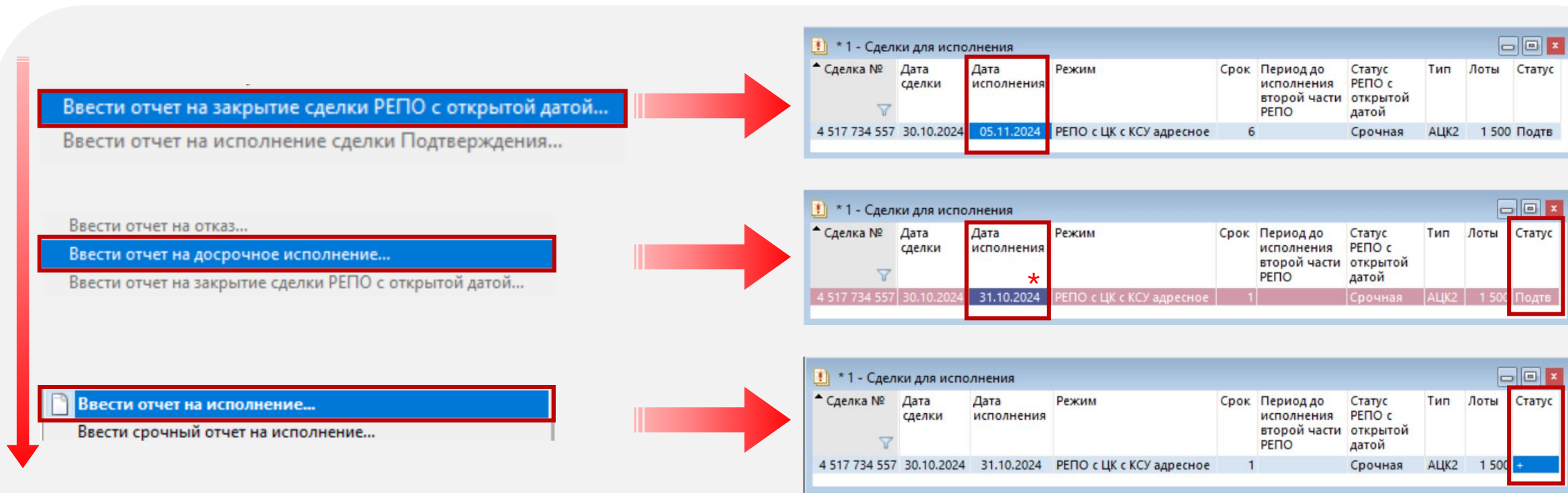
Если срок «EverGreen» (Период до исполнения 2-й части РЕПО) меньше или равен оставшемуся сроку до максимально возможного срока сделки, то сделка автоматически становится срочной к исполнению.

ИСПОЛНЕНИЕ СДЕЛОК РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ С ОПЦИЕЙ «EVERGREEN»

В сделках РЕПО с открытой датой с опцией «EverGreen» доступны стандартные инструменты исполнения сделки:

В дату заключения сделки, после подачи отчета на закрытие сделки РЕПО с ЦК с открытой датой (предыдущий слайд), со следующего расчетного дня можно подать поручение на досрочное исполнение, приблизив дату второй части в текущую дату, и при необходимости исполнить отчетом на исполнение.

Для сделок РЕПО-М отчет на исполнение доступен сразу в дату заключения сделки РЕПО без требования подачи отчета на закрытие сделки РЕПО с открытой датой.



* В примере 31.10.2024 - текущая дата

ОСОБЕННОСТИ ТАРИФИКАЦИИ РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ С ОПЦИЕЙ «EVERGREEN»

К стандартному подходу тарификации* РЕПО с открытой датой добавляется еще одна **комиссия за период до исполнения 2й части сделок РЕПО с открытой датой «EverGreen»**.

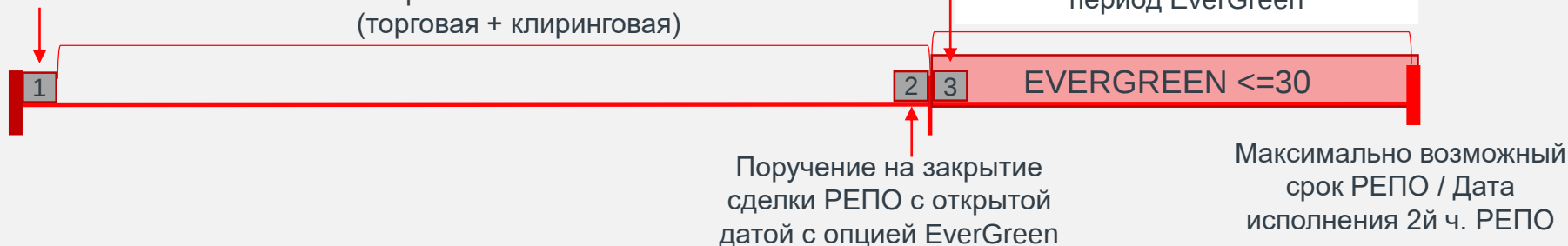
В дату определения сделки РЕПО срочной к исполнению (подача отчета на закрытие или достижение оставшегося срока РЕПО срока «EverGreen») **комиссия взимается за период** со следующего расчетного дня по дату исполнения 2й части.

Пример EVERGREEN 30дн.

В дату заключения сделки РЕПО
торговая и клиринговая
комиссия взимается отдельно

Ежедневное списание
клиринговой комиссии =
(торговая + клиринговая)

Списание комиссии за весь
период EverGreen



* Стандартная тарификация РЕПО с открытой датой осуществляется ежедневно:

- 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.

ИЗМЕНЕНИЯ В ТОРГОВЫХ ОТЧЕТАХ СДЕЛОК РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ С ОПЦИЕЙ «EVERGREEN»

В торговых отчетах **SEM02**, **SEM03**, **SEM02RQ** добавлен новый атрибут «**EvergreenPeriod**» с указанием количества календарных дней определенных участниками при заключении сделки РЕПО с открытой датой.

SEM02

BoardId	BoardName	BuySell	SecurityId	SecShortName	CurrencyId	Quantity	ClearingCenterId	SettleCode	RateType	RepoRate	RepoValue	EvergreenPeriod	IsOpenRepo	AmendTime	Benchmark
PSGC	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	S	RU000A0JW4Z1	КСУ обл.	RUR	1000	HKЦ	Y0/YOD30	FIX	25,882	1000	1	Y		
PSGC	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	S	RU000A0JW4Z1	КСУ обл.	RUR	14500000	HKЦ	Y0/YOD90	FIX	21	14500000	1	Y	14:30:29	
PSGC	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	S	RU000A0JW4Z1	КСУ обл.	RUR	14500000	HKЦ	Y0/YOD90	FIX	21	14500000	24	Y	14:30:33	
PSGC	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	S	RU000A0JW4Z1	КСУ обл.	RUR	14500000	HKЦ	Y0/YOD90	FLOATING	0,5	14500000	30	Y		RUSFAR

SEM03

BoardId	BoardName	SecShortName	ClearingCenterId	RecNo	BuySell	SettleCode	Quantity	CPFirmShortName	RepoValue	EvergreenPeriod	RateType	RepoRate	IsOpenRepo	Benchmark
PSGC	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	HKЦ	1	B	Y0/YOD30	1000	HKO HKЦ (AO)	1000	1	FIX	25,882	Y	
PSGC	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	HKЦ	2	B	Y0/YOD90	14500000	HKO HKЦ (AO)	14500000	30	FLOATING	0,5	Y	RUSFAR

SEM02RQ

BoardId	BoardName	BuySell	SecShortName	RateType	Benchmark	QuoteRate	QuoteValue	QuotePeriod	EvergreenPeriod	SettleCode
PSGC	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	B	КСУ обл.	FLOATING	RUSFAR1M	0,3	111000000	140	77	Y0
PSGC	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	B	КСУ обл.	FIX		27	790000000	360	161	Y0
PSRP	РЕПО с ЦК адресное	B	МосБиржа	FLOATING	RUSFAR	0,3	100000000	120	35	Y0
PSRP	РЕПО с ЦК адресное	B	МосБиржа	FLOATING	RUSFAR	0,3	150000000	120	35	Y0
RPMO	РЕПО-М	S	МосБиржа	FIX		23	500000000	90	30	S0
RPMO	РЕПО-М	S	МосБиржа	FIX		23	500000000	90	30	S0

ИЗМЕНЕНИЯ В КЛИРИНГОВЫХ ОТЧЕТАХ СДЕЛОК РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ С ОПЦИЕЙ «EVERGREEN»

В клиринговых отчетах **EQM06/EQM06P/EQM06R, EQM6C, EQM6D, EQM63** добавлен новый атрибут **«DaysBeforeSettleDate»** («EverGreen» Период до исполнения 2й части сделок РЕПО с открытой датой) с указанием количества календарных дней, определенных участниками при заключении сделки РЕПО.

Комиссия за период до исполнения 2й части сделок РЕПО с открытой датой «EverGreen» – FeeType = 351 «Фондовый рынок. Сумма клиринговой комиссии по сделкам РЕПО с открытой датой за период до исполнения 2-й части» – **включается в отчеты EQM13, EQM15 и отдельно отражается в отчетах EQM06 и EQM151.**

EQM06 (в дату заключения сделки)

ReportDate	SettleDate	BoardId	TradeNo	BuySell	SettleCode	Quantity	Value	ExchComm	ClrComm	RepoRate	RateType	OpenRepo	DaysBeforeSettleDate
16.10.2024	16.10.2024	PSRP	11303014367	S	Y0	11496	9870684,02	9,72	24,62	5	FLOATING	Y	3
16.10.2024	28.10.2024	PSRP	11303014367	B	YOD12	11496	9936027,87	0	0	5	FLOATING	Y	3

Отдельно торговая отдельно
клиринговая комиссия

Период до исполнения 2й части
сделок РЕПО с открытой датой

EQM151 (в дату заключения сделки)

ReportDate	TradeNo	RepoPart	BuySell	TradeDate	CurrencyId	CurrencyName	SecurityId	ISIN	SecShortName	OpenRepoComm	SettleDate	TotalComm
16.10.2024	11303014367	1	S	16.10.2024	RUR	руб.	SU26234RMFS3	RU000A101QE0	ОФЗ 26234	34,34	16.10.2024	34,34

Отдельно торговая отдельно
клиринговая комиссия

Суммарная комиссия
нарастающим итогом

EQM151 (в дату подачи поручения на закрытие сделки РЕПО с открытой датой)

ReportDate	RecNo	TradeNo	RepoPart	BuySell	TradeDate	CurrencyId	CurrencyName	SecShortName	OpenRepoComm	CommDays	SettleDate	TotalComm
17.10.2024	19	11303014367	2	B	16.10.2024	RUR	руб.	ОФЗ 26234	34,34	1	17.10.2024	68,68
17.10.2024	20	11303014367	2	B	16.10.2024	RUR	руб.	ОФЗ 26234	103,02	3	18.10.2024	171,7

Комиссия за отчетную дату и
начисленная комиссия за 3 дня
периода до исполнения 2й части
сделок РЕПО с открытой датой

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ



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

ps@moex.com

ЗАЯВЛЕНИЕ ОБ ОГРАНИЧЕНИИ ОТВЕТСТВЕННОСТИ

- Настоящая презентация была подготовлена и выпущена Публичным акционерным обществом «Московская Биржа ММВБ-ПТС» (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.
- Настоящая презентация либо ее копии не могут быть перемещены или перевезены в Соединенные Штаты Америки или на их зависимые и иные территории или прямо или косвенно распространены в Соединенных Штатах Америки или на их зависимых и иных территориях в соответствии с Положением S Закона США о ценных бумагах 1933 г., с учетом изменений и дополнений (далее - «Закон о ценных бумагах»), за исключением случаев распространения настоящей презентации среди «квалифицированных институциональных покупателей» в значении Правила 144A Закона о ценных бумагах. Любой случай несоблюдения данных ограничений может считаться нарушением законодательства Соединенных Штатов о ценных бумагах. Данная презентация не является офертой или продажей ценных бумаг в Соединенных Штатах. Группа Московской Биржи не зарегистрировала и не намерена регистрировать никакие ценные бумаги в Соединенных Штатах или осуществлять публичное предложение ценных бумаг в Соединенных Штатах.
- Настоящая презентация не представляет собой рекламу или публичное предложение ценных бумаг в какой-либо юрисдикции. Данная презентация не предназначена для публичного распространения в какой-либо юрисдикции. Доступ к настоящему документу предназначен только для заинтересованных лиц на том основании, что: (А) если данные лица являются гражданами Соединенного Королевства либо зарегистрированы в Соединенном Королевстве, то они попадают под действие статей 19 и 49 Приказа 2005 г., изданного на основании Закона «О финансовых услугах и рынках» 2000 г. (Финансовая реклама); или (Б) данные лица находятся за пределами Соединенного Королевства, и в соответствии с действующим законодательством имеют право на получение настоящего документа. Получатели данного документа в юрисдикциях за пределами Соединенного Королевства должны узнать и соблюдать применимые требования законодательства.
- 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.