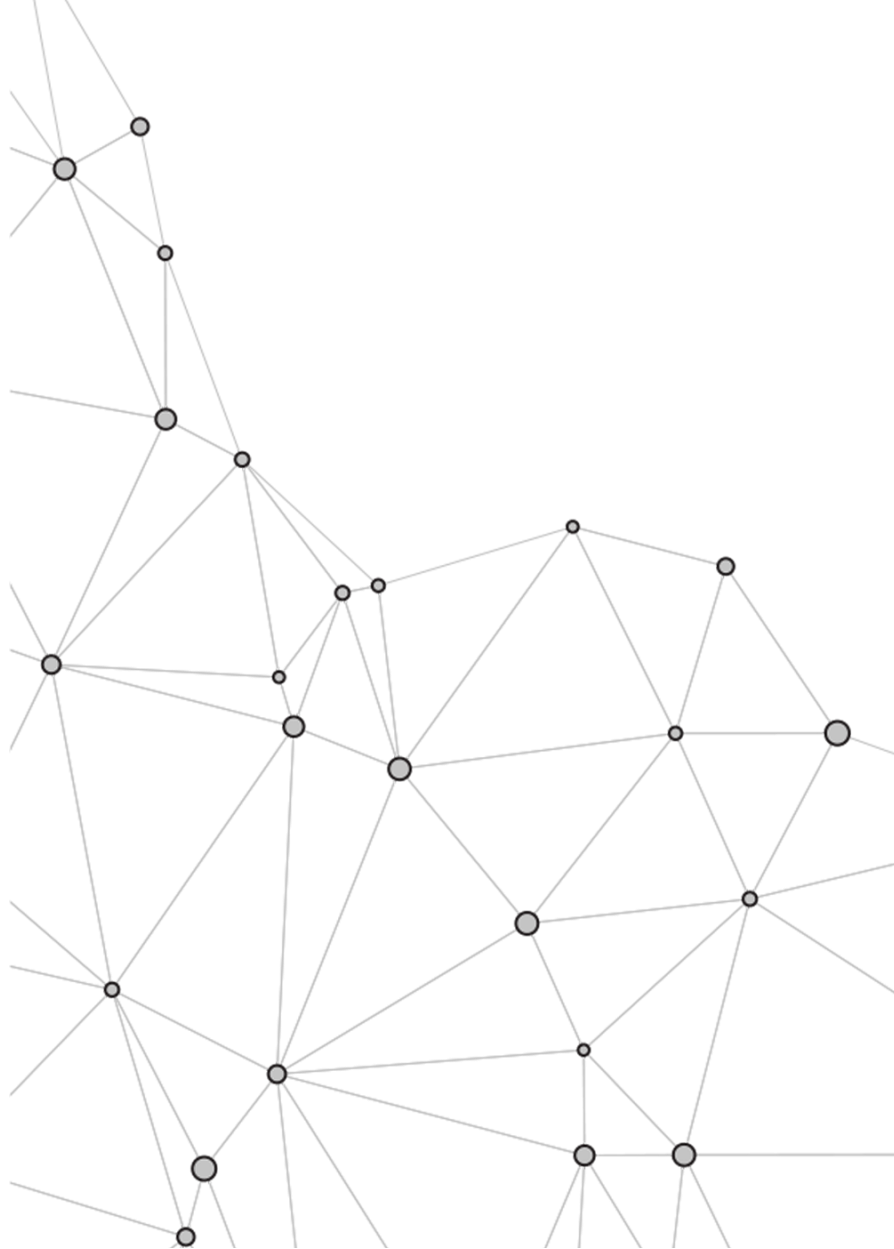




МОСКОВСКАЯ
БИРЖА



**Изменение правила определения
даты возврата РЕПО с ЦК**

**Изменение идентификаторов кодов
расчетов РЕПО с ЦК**

Изменение конвенции сроков в РЕПО с ЦК в безадресных режимах 1 и 3 мес.

На данный момент в РЕПО с ЦК используется конвенция Modify following для стандартных сроков 1 и 3 мес., которая предполагает возможность фактического срока сделки более 30 и 90 дней соответственно.

Учитывая требование нормативных актов, регулирующих расчет ПКЛ и расчет собственных средств для профессиональных участников (N 548-П и N 4402-У) требования по обязательствам более 30 дней для ПКЛ и 90 дней для расчета собственных средств не учитываются.

В соответствии с вышеизложенным, изменяется конвенция Modify following на Previous 30day и Previous 90day с учетом которой сделки РЕПО с ЦК заключенные в стандартизированных сроках 1 и 3 мес. никогда не будут превышать 30 и 90 календарных дня соответственно.

Исключение торговых-нерабочих дней из сделок РЕПО с ЦК для безадресных режимов

Нежелательное попадание второй части сделок РЕПО с ЦК на торговые-нерабочие дни;

Отклонение стандартизированного срока от фактического в сделке РЕПО с ЦК.

Изменение идентификаторов кодов расчетов РЕПО с КСУ в безадресных режимах*

As is	To be
Y0 / Y1	Y0 / Y1 D

Изменение идентификаторов кодов расчетов РЕПО с ЦК с отдельными выпусками в безадресных режимах

As is	To be
Y0 / Y1	Y0 / Y1 Dt
Y0/Y1W	Y0 / Y1 Wt
Y0/Y1M	Y0 / Y1 Mt
Y0/Y3M	Y0 / Y3 Mt

* Остальные идентификаторы кодов расчетов в РЕПО с КСУ остаются неизменными

Изменение правила определения даты возврата РЕПО с КСУ в безадресном режиме.

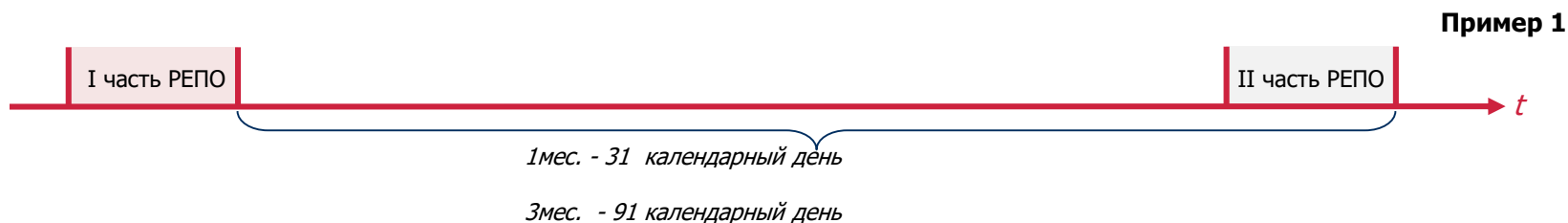
Вторая часть сделки РЕПО с КСУ в безадресных режимах не может приходиться на **торговые-нерабочие дни**. Если исходя из стандартизированного срока исполнения обязательств вторая часть сделки РЕПО приходится на **торговый-нерабочий день**, то надлежащая дата исполнения переносится на **следующий торговый-рабочий день**.

Ограничение срока сделки РЕПО с ЦК с отдельными выпусками, РЕПО с КСУ в безадресных режимах 1 и 3 мес.

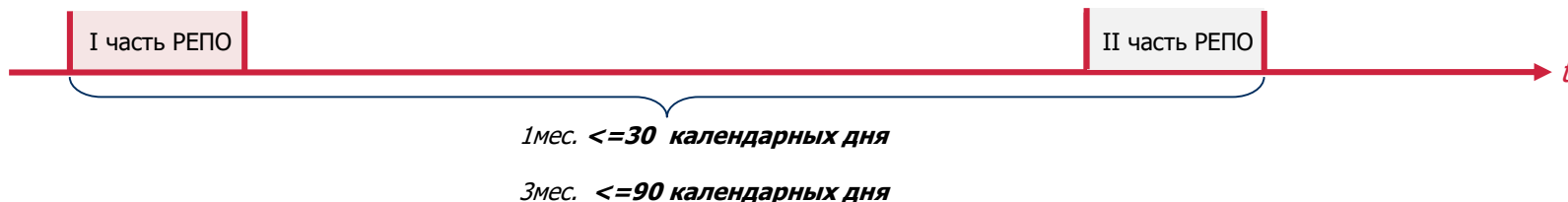
Исполнение обязательств в безадресных режимах РЕПО с ЦК с отдельными выпусками, РЕПО с КСУ в сроках 1 и 3 мес. по второй части сделки РЕПО **не может превышать 30 и 90 календарных дней соответственно**.

Правило определения второй части сделки РЕПО в других сроках в безадресных режимах не изменяется.

AS IS



TO BE



Пример 2

Срок РЕПО с ЦК с КСУ	Первая часть → Вторая часть
0/N	30/12 → 09/01 03/01 → 09/01, 06/01 → 09/01, 08/01 → 09/01
1W	27/12 → 09/01, 30/12 → 09/01, 03/01 → 10/01 06/01 → 13/01, 08/01 → 15/01
2W	20,23,24,25,26/12 → 09/01 03/01 → 17/01 06/01 → 20/01 08/01 → 22/01

	Пн	Вт	Ср	Чт	Пт	Сб	Вс
Декабрь 2019							1
	2	3	4	5	6	7	8
	9	10	11	12	13	14	15
	16	17	18	19	20	21	22
	23	24	25	26	27	28	29
30	31						

	Пн	Вт	Ср	Чт	Пт	Сб	Вс
Январь 2020			1	2	3*	4	5
	6*	7	8*	9	10	11	12
	13	14	15	16	17	18	19
	20	21	22	23	24	25	26
	27	28	29	30	31		

* Торговые-нерабочие дни