

An aerial photograph of a city skyline at sunrise. The sky is a mix of orange, yellow, and blue. In the foreground, a large red shape partially obscures the view. The city features several prominent skyscrapers, including a cluster of tall, dark buildings on the left side. A river or canal is visible on the far left, and a bridge spans across it. The overall scene is hazy and atmospheric.

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 – 360 дней |
| Исполнение | По требованию одной из сторон или при достижении максимально возможного срока (360 дней) |
| Отказ от исполнения | Да |
| Возможность заключения сделок с плавающей ставкой | Да |
| Маржирование | Для целей расчета Единого лимита сделки РЕПО учитывается со сроком 2 дня |
| 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 |

ОСОБЕННОСТИ СДЕЛОК РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ

- 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 Т0 **не допускается**;
- В терминале MTSE в таб. «Сделки для исполнения» сделки РЕПО с открытой датой отражаются со сроком **«не позднее чем»**;
- Конвенция - перенос даты надлежащего исполнения на предыдущий расчетный день в случае изменения расчетного календаря

КОГДА СДЕЛКИ С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ МОГУТ БЫТЬ МЕНЬШЕ 360 ДНЕЙ ИЛИ БЫТЬ ИСПОЛНЕННЫ ДОСРОЧНО

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

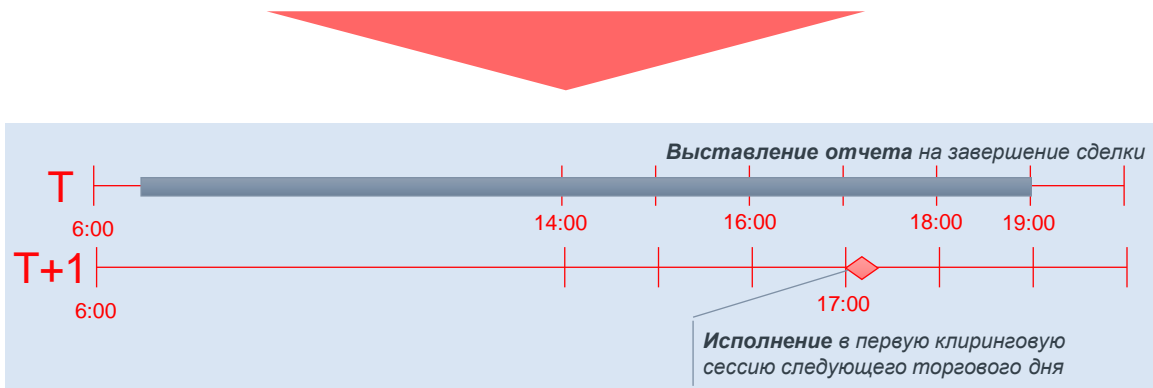
ПОРЯДОК ВЫСТАВЛЕНИЯ ОТЧЕТОВ НА ИСПОЛНЕНИЕ И ВЫПОЛНЕНИЯ РАСЧЕТОВ

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

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.



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

Форма заявки – фиксированная ставка

Вторая часть сделки РЕПО

Срок РЕПО:

РЕПО с открытой датой

Индикатор:

Дата расчетов: 16.09.2024

Форма заявки – плавающая ставка

Вторая часть сделки РЕПО

Срок РЕПО:

РЕПО с открытой датой

Индикатор:

Значение: 12,47% (RUSFAR овернайт)
Дата расчетов: 16.09.2024

Спред %:

Таблица «Сделки к исполнению»

| 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 | YOD |
| 4 357 979 311 | 442 427 + | | АЦК1 | Головин | 04.07.2023 | 04.07.2023 | РЕПО с ЦК адресное | МосБиржа | К | 103 754,00 | | 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 | | 103,768 | 103 768,21 | 100 | 365 | 103 768,21 | Фиксированная | Да | YOD |
| 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 | 555 076,03 | Фиксированная | Да | YOD |
| 4 358 097 867 | 442 427 | Подтв | P1 | 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 №16.

ОПЦИЯ EVERGREEN В РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ 2.0

Базовая конфигурация

В базовом варианте РЕПО с открытой датой максимально возможный срок 360 дней с возможностью подачи поручения на закрытие в любой торговый день начиная с даты заключения с исполнением в ближайший следующий расчетный день по инструменту с учетом расчетного календаря валюты расчетов и бумаги.

Предлагаемая опция

В базовую конфигурацию добавить возможность устанавливать срок в днях, по истечении которого сделка станет срочной к исполнению при подаче поручения на закрытие. По умолчанию значение срока = 1.

Пример EVERGREEN_30

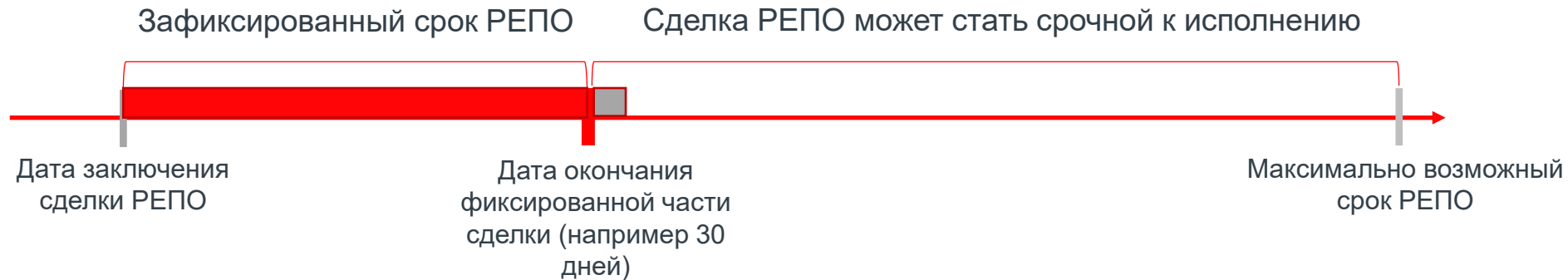


ОПЦИЯ «ФИКСАЦИЯ СРОКА» В РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ 2.0

Предлагаемая конфигурация

Добавить возможность устанавливать мораторий на исполнение на определенный срок с даты заключения. Для этого дополнить существующую конструкцию новым метчинговым полем с указанием количества дней ранее истечения которых сделка РЕПО не может стать срочной к исполнению, т.е. фиксация срока сделки РЕПО

Пример



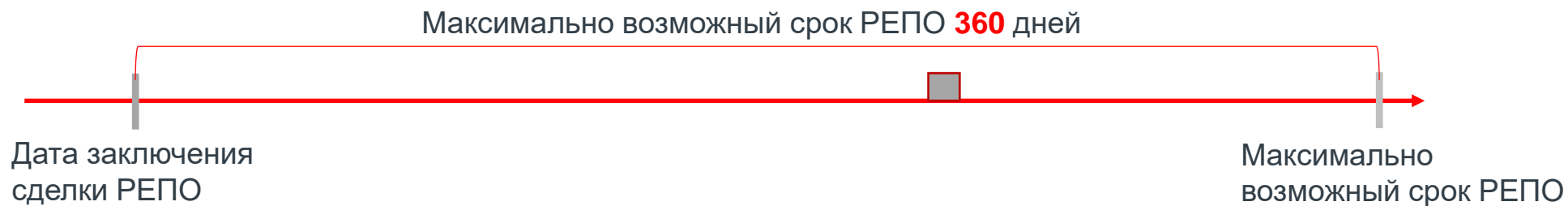
Предлагаемый подход: Подача поручений на закрытие доступна в любой торговый день, но при указании даты «фиксации срока» и подаче поручения на закрытие РЕПО в период зафиксированного срока РЕПО сделка станет срочной к исполнению в дату = фиксированный срок + 1 с учетом расчетного календаря валюты расчетов и бумаги. В последующий период аналогично базовой конфигурации.

ВОЗМОЖНОСТЬ ОГРАНИЧЕНИЯ СРОКА В РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ

Базовая конфигурация

В базовом варианте РЕПО с открытой датой максимально возможный срок **360**.

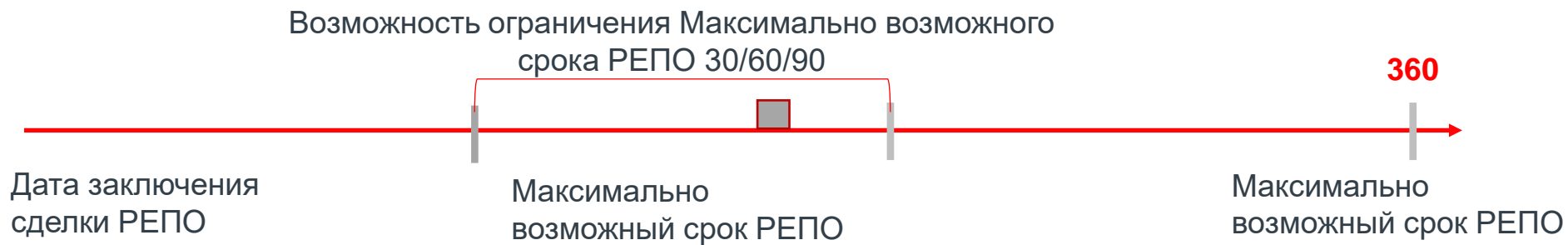
Пример



Предлагаемая конфигурация

- Добавить опцию ограничения срока РЕПО с открытой датой до 30, 60, 90 дней;

Пример



ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ СДЕЛОК

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

1. Текущие отчеты, затрагиваемые изменениями:

SEM02 (Выписка из реестра заявок)

SEM03 (Выписка из реестра сделок с ценными бумагами)

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)

ДОПОЛНЕНИЯ В ТОРГОВЫЕ ОТЧЁТЫ

XML-файл

| НОДА | АТТРИБУТ | ОПИСАНИЕ | ОБЯЗАТЕЛЬ-НОСТЬ | ТИП |
|---------|------------|---|-----------------|-----------|
| RECORDS | | Блок данных по сделке/ заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений/ депозитному договору/ кредитному договору | | |
| | IsOpenRepo | Признак сделки РЕПО с открытой датой: «Y» - сделка РЕПО с открытой датой | Нет | Character |

Выписка из реестра заявок (SEM02)

Режим торгов: РЕПО с ЦК адресное Дата регистрации заявки: 05. 09. 2023

| N | Номер заявки | Направление | Ценная бумага | Клиринговая организация | Кол-во | Объем | Номер торг.-клирингового счета | Код расчетов | Тип ставки | Код индикативной ставки | Ставка РЕПО | Сумма РЕПО, включая НКД | Начальное значение дисконта, % | Признак РЕПО с открытой датой | Срок РЕПО |
|---|--------------|-------------|------------------------|-------------------------|--------|--------------|--------------------------------|--------------|------------|-------------------------|-------------|-------------------------|--------------------------------|-------------------------------|-----------|
| 8 | 38551503336 | S | SU29014RMFS6 ОФЗ 29014 | НКЦ | 10,000 | 9,347,806.00 | S01+00000F00 | Y0/YOD | FLOATING | RUSFAR | 0.2000 | 9,512,706.00 | 6.0000 | Y | |

Выписка из реестра сделок (SEM03)

| № п/п | Номер сделки | Время | Вид сделки | Цена | Количество | Объем (юань) | Контрагент (код Участника торгов-Контрагента) | Код расчетов | Комиссионное вознаграждение | Номер заявки | НКД (юань) | Тип ставки | Код индикативной ставки | Ставка РЕПО | Сумма РЕПО, включая НКД (юань) | Признак РЕПО с открытой датой |
|--|--------------|----------|------------|---------|------------|--------------|---|--------------|-----------------------------|--------------|------------|------------|-------------------------|-------------|--------------------------------|-------------------------------|
| Дата исполнения: 30.08.2024 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| SU29014RMFS6 ОФЗ-ПК 29014 25/03/26 Номинальная стоимость: 1,000.00 руб. непогашенная часть основного долга: 1,000.00 руб. Цена для данной бумаги указывается в % | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Номер торгового-клирингового счета: S01+00000F00 Клиринговая организация: НКЦ | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7 | 8251573818 | 18:00:00 | B | 93.4781 | 10,000 | 9,347,806.00 | MC088880000 О НКО НКЦ (АО) ИНН: 7750004023 | Y0/YOD | 7.71 | 38551503336 | 164,900.00 | FLOATING | RUSFAR | 0.2000 | 9,512,706.00 | Y |
| Итого по: SU29014RMFS6 | | | | | 10,000 | | | | 7.71 | | | | | | | |

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 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. 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 |
| | | | | | | х 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



Департамент Денежного рынка ПАО Московская Биржа
repo@moex.com



Управление продвижения и информационной поддержки
клиринговых услуг НКО НКЦ (АО)
ps@moex.com