

An aerial photograph of a city skyline at sunset. The sky is a mix of orange, yellow, and blue. In the foreground, several tall, modern skyscrapers are visible, some with glass facades reflecting the light. A river or canal winds through the city. The overall scene is hazy and atmospheric.

# Отражение сделок РЕПО с плавающими ставками в отчете EQM06

# Содержание

1. Общие характеристики продукта плавающие ставки
2. Особенности расчета суммы второй части сделок:
  - в зависимости от контрагента (с ЦК / без ЦК)
  - в зависимости от индикатора
3. Другие особенности сделок РЕПО с плавающими ставками
4. Отражение сделок в отчете EQM06

## Примеры в отчетах:

1. РЕПО с ЦК. Срок 7 дней. Индикатор **Ключевая ставка Банка России (RREFKEYR)**
2. Междилерское РЕПО-М. Срок 7 дней. Индикатор **Ключевая ставка Банка России (RREFKEYR)**
  
3. РЕПО с ЦК. Срок 7 дней. Индикатор **RUSFAR (ON)**.
  - 3.1. Особенности для кодов расчета Y1 и Y2.
4. Междилерское РЕПО-М. Срок 7 дней. Индикатор **RUSFAR (ON)**.
  - 4.1. Особенности для кодов расчета S01, S02, РЕПО с открытой датой
  
5. РЕПО с ЦК. Срок 14 дней. Индикатор **RUSFAR 1W**.
6. Междилерское РЕПО-М. Срок 14 дней. Индикатор **RUSFAR 1W**.

# Общие характеристики продукта плавающие ставки



	Режимы торгов	
	Безадресные (с ЦК)	Адресные (с ЦК и без ЦК)
Тех. реализация	Новые режимы	Новое метчинговое поле (индикатор)
Ставка РЕПО	спред + индикатор	
Индикаторы	RUSFAR (ON) RUSFARCNY (ON)	- RUSFAR (ON, 1W, 2W, 1M, 3M) - RUSFARCNY (ON) - Ключевая ставка Банка России - RUONIA
Валюта	RUB, CNY Валюта режима и валюта индикатора должны совпадать	
Сроки	1W, 2W, 1M, 2M, 3M, 6M, 9M, 1Y	- до 1 года для РЕПО с КСУ - до 3 мес. для РЕПО с ЦК - до 3 лет для РЕПО-М

## Ограничения

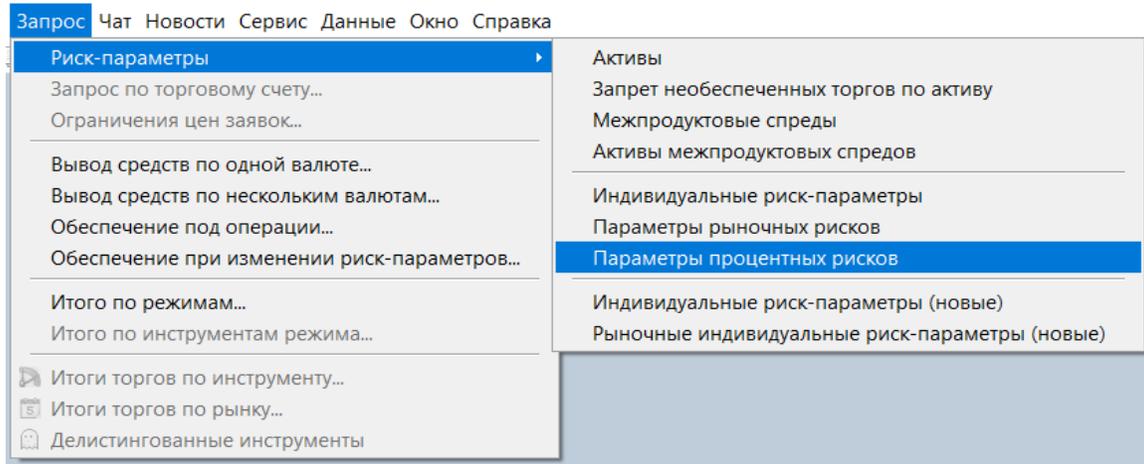
Для Участников клиринга категории «В» возможность заключения сделок РЕПО с плавающей ставкой недоступна.

# Особенности расчета суммы второй части в зависимости от контрагента (с ЦК / без ЦК)

В дату заключения **сумма второй части** сделки РЕПО определяется:

- Для **Междилерского РЕПО** – исходя из значения индикатора, действующего в дату заключения сделки. В процессе жизни сделки сумма второй части пересчитывается:
  - известная составляющая – по уже определенным значениям индикатора,
  - прогнозная составляющая – по **последнему известному** значению индикатора.
- Для **РЕПО с ЦК** (вкл. КСУ) – исходя из **риск-параметра** индикатора, рассчитанного на **дату второй части**. В процессе жизни сделки сумма второй части пересчитывается:
  - известная составляющая – по уже определенным значениям индикатора,
  - прогнозная составляющая – по значениям из **Параметров процентных рисков** на **дату исполнения второй части**.

Просмотр таблицы «Параметры процентных рисков» в торговом терминале:



Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RREFKEYR	20.09.2023	13,00
RREFKEYR	21.09.2023	13,00
RREFKEYR	22.09.2023	13,01
RREFKEYR	23.09.2023	13,02
RREFKEYR	24.09.2023	13,03
RREFKEYR	25.09.2023	13,04
RREFKEYR	26.09.2023	13,05
RREFKEYR	27.09.2023	13,06
RREFKEYR	28.09.2023	13,07

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RUSFAR	21.09.2023	12,47
RUSFAR	22.09.2023	12,47
RUSFAR	23.09.2023	12,50
RUSFAR	24.09.2023	12,53
RUSFAR	25.09.2023	12,56
RUSFAR	26.09.2023	12,60
RUSFAR	27.09.2023	12,63
RUSFAR	28.09.2023	12,67
RUSFAR	29.09.2023	12,70
RUSFAR	30.09.2023	12,72

# Особенности расчета суммы второй части в зависимости от индикатора

Для индикаторов «**овернайт**», а также с Ключевой ставки Банка России:

$$\text{Сумма 2й части РЕПО} = \text{Сумма 1й части} \cdot \left( 1 + \sum_{i=T_1+1}^{T_2} \frac{r_i + \text{спред}}{N_i \cdot 100} \right)$$

$r_i$  – значение индикатора (в процентах годовых)

**спред** – величина спреда к плавающей ставке (в процентах годовых)

$T_1$  – дата исполнения первой части сделки РЕПО

$T_2$  – дата исполнения второй части сделки РЕПО

$N_i$  – число дней в календарном году

Для индикаторов, **отличных от индикаторов «овернайт»** RUSFAR (1W, 2W, 1M, 3M)

$$\text{Сумма 2й части РЕПО} = \text{Сумма 1й части} \cdot \left( 1 + \sum_{i=1}^K \frac{r_i + \text{спред}}{100} \left( \frac{T_{i365}}{365} + \frac{T_{i366}}{366} \right) \right)$$

$r_i$  – значение индикатора (в процентах годовых)

**спред** – величина спреда к плавающей ставке (в процентах годовых)

$T_{i365}$  – число дней в  $i$ -м процентном периоде, приходящимся на календарный год, состоящий из 365 дней

$T_{i366}$  – число дней в  $i$ -м процентном периоде, приходящимся на календарный год, состоящий из 366 дней

$K_i$  – количество процентных периодов исходя из конвенции, применяемой к индикатору

## Другие особенности сделок РЕПО с плавающими ставками

Применяется значение индикатора, действующее в текущий день

Для плавающих ставок в сделках междилерского РЕПО **недоступны внутридневные сделки** и во всех типах РЕПО сделки сроком «овернайт».

В случае если сумма индикатора и спреда меньше или равна нулю, то ставка РЕПО с **КСУ** принимается равной **0.01%**.  
Для РЕПО с ЦК и РЕПО-М таких ограничений нет, ставка может быть отрицательной.

Если в текущем дне расчет значения индикатора не производится, его значение принимается равным последнему известному значению.

*RUSFAR не рассчитывается: в последний торговый день года, в нерабочие торговые дни, в рабочие субботы и воскресенья*

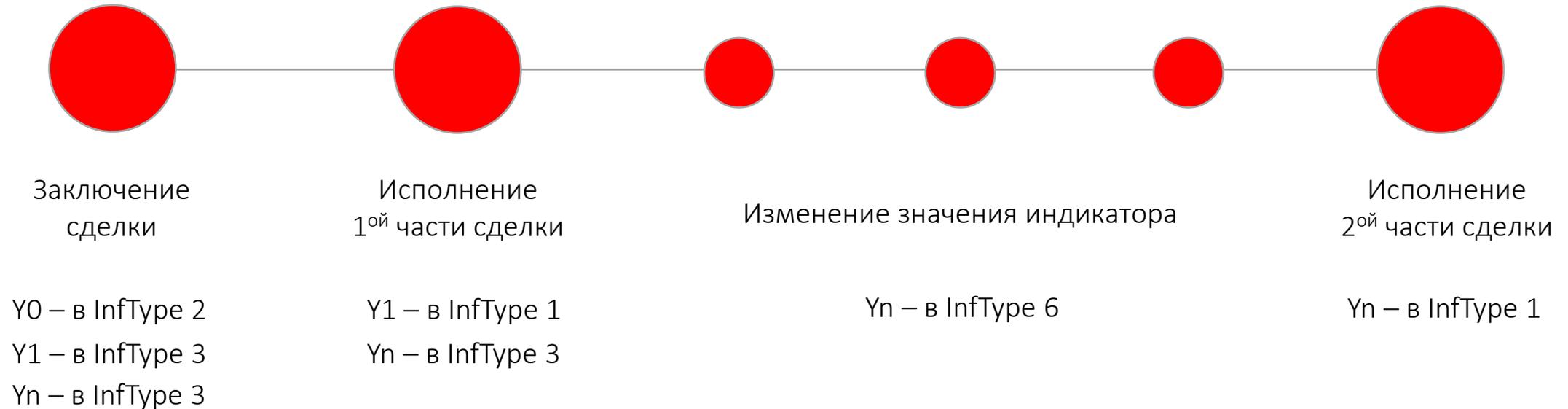
Установлено строгое соответствие валюты индикатора и валюты режима торгов сделки РЕПО

Для плавающих ставок доступны стандартные инструменты как для фиксированных ставок:

- Отказ от сделки РЕПО;
- Досрочное исполнение РЕПО;
- Айсберг заявки.

# Отражение сделок в EQM06

В отчете EQM06 сделка отражается в следующие дни:



Если значение индикатора по сравнению с предыдущим отчетным днем не изменилось, то в отчете за текущий день сделка не отразится.

Значения поля Тип информации, InfType:

- 1 – Исполненные сделки предыдущих дней
- 2 – Исполненные сделки текущего дня
- 3 – Сделки, подлежащие исполнению
- 6 – Сделки, подлежащие исполнению, с измененными параметрами

**ПРИМЕРЫ В ОТЧЕТАХ**

# Пример 1. РЕПО с ЦК. Срок 7 дней. Индикатор Ключевая ставка Банка России (RREFKEYR)

## Условия

Сумма РЕПО: 6 449 940,00руб.;

Срок: 7 дней, 20.09 (заключение, ч. 1.) – 27.09 (ч.2.);

Спред: 0,2%;

Индикатор: RREFKEYR

## Особенности:

- При использовании индикатора Ключевая ставка Банка России проценты рассчитываются с учетом ежедневного изменения **индикатора + спред**;
- Значение индикатора для **Ключевой ставки БР** применяется **за текущий** Расчетный день;
- При РЕПО с ЦК для расчета прогнозной части процентов используется значение Ключевой ставки БР с учетом процентного риска на дату исполнения 2-ой части.

Дни недели	20 СР	21 ЧТ	22 ПТ	23 СБ	24 ВС	25 ПН	26 ВТ	27 СР
Часть сделки РЕПО	<b>Ч. 1</b> EQM06					<b>EQM06</b>		<b>Ч. 2</b> EQM06
Значение RUSFAR, <b>действующее</b> в этот день, для начисления <b>известной</b> части процентов, %	13,0*	13,0	13,0	→		17,0	17,0	17,0
День применения значения для Ключевой ставки Банка России для начисления процентов		↓	↓	↓	↓	↓	↓	↓
При РЕПО с ЦК для расчета <b>прогнозной</b> части процентов используется значение RREFKEYR с учетом <b>процентного риска</b> на дату исполнения 2-ой части.	13,06	13,05	13,02	13,01	13,01	13,01	13,00	x

\* - указывается в EQM06 за дату заключения индикативно, в начислении процентов не участвует.

# Пример 1. РЕПО с ЦК. Срок 7 дней. Индикатор Ключевая ставка Банка России

День	1 (Y0)	2	3	4 (сб)	5 (вс)	6	7	8 (Y5)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	22.09.2023	23.09.2023	24.09.2023	25.09.2023	26.09.2023	27.09.2023
Применяемое значение RREFKEYR	13,00%	13,00%	13,00%	13,00%	13,00%	17,00%	17,00%	17,00%
Значение RREFKEYR для расчета прогнозной части процентов	13,06%	13,05%	13,02%	13,01%	13,01%	13,01%	13,00%	x

## Расчет суммы РЕПО к возврату

День 1, 20.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:	прогнозная часть:		
6 449 940,00	0,20%	-	x	13,20%	0	-	-	6 449 940,00	6 466 342,29
		x	13,06%	13,26%	7	16 402,29	x		

День 2, 21.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:	прогнозная часть:		
6 449 940,00	0,20%	13,00%	x	13,20%	1	2 332,58	2 332,58	6 452 272,58	6 466 321,08
		x	13,05%	13,25%	6	14 048,50	x		

## Основные данные в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06)

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
День 1. 20.09. Заключение сделки, исполнение 1-ой части															
	2	4373738230	1	B	Y0	30000	214,998	6 449 940,00	6 449 940,00	RREFKEYR	13,00%	0,20%	20.09.2023	13,20%	FLOATING
	3	4373738230	2	S	Y5	30000	215,545	6 466 342,29	6 466 342,29	RREFKEYR	13,00%	0,20%	27.09.2023	13,20%	FLOATING
День 2. 21.09. – значение индикатора не изменилось, сделки в отчете нет.															

# Пример 1. РЕПО с ЦК. Срок 7 дней. Индикатор Ключевая ставка Банка России

День Дата	1 (Y0) 20.09.2023	2 21.09.2023	3 22.09.2023	4 (сб) 23.09.2023	5 (вс) 24.09.2023	6 25.09.2023	7 26.09.2023	8 (Y5) 27.09.2023
Применяемое значение RREFKEYR	13,00%	13,00%	13,00%	13,00%	13,00%	17,00%	17,00%	17,00%
Значение RREFKEYR для расчета прогнозной части процентов	13,06%	13,05%	13,02%	13,01%	13,01%	13,01%	13,00%	x

## Расчет суммы РЕПО к возврату

День 3, 22.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:	прогнозная часть:		
6 449 940,00	0,20%	13,00%	x	13,20%	1	2 332,58	6 454 605,16	6 466 285,74	
		13,00%		13,20%	1	2 332,58			
		x	13,02%	13,22%	5	11 680,58			x

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RREFKEYR	22.09.2023	13,00
RREFKEYR	23.09.2023	13,00
RREFKEYR	24.09.2023	13,00
RREFKEYR	25.09.2023	13,00
RREFKEYR	26.09.2023	13,01
RREFKEYR	27.09.2023	13,02
RREFKEYR	28.09.2023	13,03
RREFKEYR	29.09.2023	13,04
RREFKEYR	30.09.2023	13,05
RREFKEYR	01.10.2023	13,06

День 6, 25.09, (после выходных)

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:	прогнозная часть:		
6 449 940,00	0,20%	13,00%	x	13,20%	4	9 330,32	6 462 309,75	6 466 978,44	
		17,00%	x	17,20%	1	3 039,42			
			13,01%	13,21%	2	4 668,70			x

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RREFKEYR	25.09.2023	13,00
RREFKEYR	26.09.2023	13,00
RREFKEYR	27.09.2023	13,01
RREFKEYR	28.09.2023	13,02
RREFKEYR	29.09.2023	13,03
RREFKEYR	30.09.2023	13,04
RREFKEYR	01.10.2023	13,05
RREFKEYR	02.10.2023	13,07

## Основные данные в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06)

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
День 3, 22.09 – значение индикатора не изменилось, сделки в отчете нет. День 6. 25.09. Изменение значения индикатора.															
	6	4373738230	2	S	Y5	30000	215,545	6 466 978,44	6 466 978,44	RREFKEYR	17,00%	0,20%	27.09.2023	17,20%	FLOATING

# Пример 1. РЕПО с ЦК. Срок 7 дней. Индикатор Ключевая ставка Банка России

День	1 (Y0)	2	3	4 (сб)	5 (вс)	6	7	8 (Y5)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	22.09.2023	23.09.2023	24.09.2023	25.09.2023	26.09.2023	27.09.2023
Применяемое значение RREFKEYR	13,00%	13,00%	13,00%	13,00%	13,00%	17,00%	17,00%	17,00%
Значение RREFKEYR для расчета прогнозной части процентов	13,06%	13,05%	13,02%	13,01%	13,01%	13,01%	13,00%	x

## Расчет суммы РЕПО к возврату

День 7, 26.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
6 449 940,00	0,20%	13,00%	x	13,20%	1	известная часть: 2 332,58 2 332,58 4 665,16 6 078,85	6 465 349,17	6 467 681,75
		13,00%	x	13,20%	1			
		13,00%	x	13,20%	2			
		17,00%	x	17,20%	2			
		x	13,00%	13,20%	1	прогнозная часть: 2 332,58	x	

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RREFKEYR	26.09.2023	13,00
RREFKEYR	27.09.2023	13,00
RREFKEYR	28.09.2023	13,01
RREFKEYR	29.09.2023	13,02
RREFKEYR	30.09.2023	13,03
RREFKEYR	01.10.2023	13,04
RREFKEYR	02.10.2023	13,05
RREFKEYR	03.10.2023	13,07

День 8, 27.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
6 449 940,00	0,20%	13,00%	x	13,20%	4	известная часть: 9 330,32 9 118,27	6 468 388,60	6 468 388,60
		17,00%	x	17,20%	3			

## Основные данные в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06)

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
День 7, 26.09 – значение индикатора не изменилось, сделки в отчете нет. День 8. 27.09. Исполнение второй части															
	1	4373738230	2	S	Y5	30000	215,613	6 468 388,60	6 468 388,60	RREFKEYR	17,00%	0,20%	27.09.2023	17,20%	FLOATING

## Пример 2. Междилерское РЕПО-М. Срок 7 дней. Индикатор Ключевая ставка Банка России (RREFKEYR)

### Условия

Сумма РЕПО: 1 061 560,00 руб.;

Срок: 7 дней, 20.09 (заключение, ч. 1.) – 27.09 (ч.2.);

Спред: 0,2%;

Индикатор: RREFKEYR

### Особенности:

- При использовании индикатора Ключевая ставка Банка России проценты рассчитываются с учетом ежедневного изменения **индикатора + спред**;
- Значение индикатора для **Ключевой ставки БР** применяется **за текущий** Расчетный день.

Дни недели	20 СР	21 ЧТ	22 ПТ	23 СБ	24 ВС	25 ПН	26 ВТ	27 СР
Часть сделки РЕПО	Ч. 1 							Ч. 2 
Значение индикатора (%)	13,0*	13,0	13,0			17,0	17,0	17,0
Применение Ключевой ставки Банка России для расчета процентов		↓	↓	↓	↓	↓	↓	↓

\* - указывается в EQM06 за дату заключения индикативно, в начислении процентов не участвует.

## Пример 2. Междилерское РЕПО-М. Срок 7 дней. Индикатор Ключевая ставка Банка России

День	1 (Y0)	2	3	4 (сб)	5 (вс)	6	7	8 (Y5)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	22.09.2023	23.09.2023	24.09.2023	25.09.2023	26.09.2023	27.09.2023
Применяемое значение RREFKEYR	13,00%	13,00%	13,00%	13,00%	13,00%	17,00%	17,00%	17,00%

### Расчет суммы РЕПО к возврату

День 1 20.09	Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
			без рисков	с учетом риска			известная часть:			
1 061 560,00	0,20%		13,00%	х	13,20%	0	известная часть:	-	<b>1 061 560,00</b>	<b>1 064 247,35</b>
			13,00%	х	13,20%	7	прогнозная часть:	2 687,35		

День 2 21.09	Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
			без рисков	с учетом риска			известная часть:			
1 061 560,00	0,20%		13,00%	х	13,20%	1	известная часть:	383,91	<b>1 061 943,91</b>	<b>1 064 247,35</b>
			13,00%	х	13,20%	6	прогнозная часть:	2303,44		

### Основные данные в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06)

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	х	х
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
День 1. 20.09. Заключение сделки, исполнение 1-ой части															
	2	4373750914	1	B	Rb	4000	265,39	1 061 560	1 061 560	RREFKEYR	13,00%	0,20%	20.09.2023	13,20%	FLOATING
	3	4373750914	2	S	Rb	4000	266,0618	1 064 247,2	1 064 247,35	RREFKEYR	13,00%	0,20%	27.09.2023	13,20%	FLOATING

## Пример 2. Междилерское РЕПО-М. Срок 7 дней. Индикатор Ключевая ставка Банка России

День	1 (Y0)	2	3	4 (сб)	5 (вс)	6	7	8 (Y5)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	22.09.2023	23.09.2023	24.09.2023	25.09.2023	26.09.2023	27.09.2023
Применяемое значение RREFKEYR	13,00%	13,00%	13,00%	13,00%	13,00%	17,00%	17,00%	17,00%

### Расчет суммы РЕПО к возврату

День 3  
22.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:	прогнозная часть:		
1 061 560,00	0,20%	13,00%	x	13,20%	1	383,91	383,91	1 062 327,81	1 064 247,35
		13,00%		13,20%	1				
		13,00%	x	13,20%	5	1 919,53	x		

День 6  
25.09

(после  
выходных)

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:	прогнозная часть:		
1 061 560,00	0,20%	13,00%	x	13,20%	4	1 535,63	500,24	1 063 595,87	1 064 596,35
		17,00%	x	17,20%	1				
		17,00%	x	17,20%	2	1 000,48	x		

### Основные данные в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06)

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
День 6. 25.09. Изменение значения индикатора.															
	6	4373750914	2	S	Rb	4000	266,1491	1 064 596,4	1 064 596,35	RREFKEYR	17,00%	0,20%	27.09.2023	17,20%	FLOATING

## Пример 2. Междилерское РЕПО-М. Срок 7 дней. Индикатор Ключевая ставка Банка России

День	1 (Y0)	2	3	4 (сб)	5 (вс)	6	7	8 (Y5)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	22.09.2023	23.09.2023	24.09.2023	25.09.2023	26.09.2023	27.09.2023
Применяемое значение RREFKEYR	13,00%	13,00%	13,00%	13,00%	13,00%	17,00%	17,00%	17,00%

### Расчет суммы РЕПО к возврату

День 7, 26.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:	прогнозная часть:		
1 061 560,00	0,20%	13,00%	x	13,20%	1	383,91	1 064 096,11	1 064 596,35	
		13,00%	x	13,20%	1	383,91			
		13,00%	x	13,20%	2	767,81			
		17,00%	x	17,20%	2	1 000,48			
		13,00%	x	13,20%	1	500,24	x		

День 8, 27.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:			
1 061 560,00	0,20%	13,00%	x	13,20%	4	1 535,63	1 064 596,35	1 064 596,35	
		17,00%	x	17,20%	3	1 500,73			

### Основные данные в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06)

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
День 7, 26.09 – значение индикатора не изменилось, сделки в отчете нет. День 8. 27.09. Исполнение второй части															
	4	4373750914	2	S	Rb	4000	266,1491	1 064 596,4	1 064 596,35	RREFKEYR	17,00%	0,20%	27.09.2023	17,20%	FLOATING

# Пример 3. РЕПО с ЦК адресное 7 дней RUSFAR Overnight

## Условия

Сумма РЕПО: 8 599 920,00 руб.;

Срок: 7 дней, 20.09 (заключение, ч. 1.) – 27.09 (ч.2.);

Спред: 0,2%;

Индикатор: RUSFAR (ON)

## Особенности

- В день заключения сделки сумма обязательств по второй части определяется исходя из прогнозного значения RUSFAR(ON) с учетом процентного риска на дату исполнения второй части.
- При ежедневном расчете процентов (и пересчете суммы обязательств) для известной части применяются значения RUSFAR(ON) рассчитанные (опубликованные) в предыдущий Расчетный день, действующие в отчетный день, для прогнозной части применяются значения RUSFAR(ON) с учетом процентного риска на дату исполнения второй части.
- Проценты начисляются, начиная с Y1 (в Y0 не начисляются)
- При использовании индикаторов «овернайт» проценты рассчитываются с учетом ежедневного изменения индикатора + спред

Дни недели	20.09, СР	21.09, ЧТ	22.09, ПТ	СБ	ВС	25.09, ПН	26.09, ВТ	27.09, СР
Часть сделки РЕПО	ч. 1	EQM06	EQM06	EQM06		EQM06	EQM06	ч. 2
Значение RUSFAR, <b>действующее</b> в этот день, используется для начисления <b>известной</b> части процентов (публикуется на moex.com ~12:30 предыдущего дня)	12,59*	12,40	12,47			12,45	12,33	12,42
День применения значения RUSFAR для начисления процентов								
Значение RUSFAR с учетом <b>процентного риска</b> , определенное на дату исполнения 2-ой части, для расчета <b>прогнозной</b> части процентов.	12,63	12,63	12,51			12,36	12,42	x

\* - указывается в EQM06 за дату заключения индикативно, в начислении процентов не участвует.

- RUSFAR в Терминале ("Значение индикатора, %" в таблицах "Индикаторы", "Сделки", "Сделки для исполнения") и в EQM06 ("BenchmarkRate").

Указывается значение, опубликованное в предыдущий расчетный день и действующее в отчетный день. В примере используются условные значения.

Индикатор	Описание индикатора	Значение индикатора, %	Дата вступления в силу значения индикатора	Значение индикатора на следующий календарный день, %	Код расчетов	Валюта расчетов	Актив
RUSFAR	RUSFAR овернайт	12,4	21.09.2023		Y1	руб.	RUSFAR

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RUSFAR	21.09.2023	12,47
RUSFAR	22.09.2023	12,47
RUSFAR	23.09.2023	12,50
RUSFAR	24.09.2023	12,53
RUSFAR	25.09.2023	12,56
RUSFAR	26.09.2023	12,60
RUSFAR	27.09.2023	12,63
RUSFAR	28.09.2023	12,67
RUSFAR	29.09.2023	12,70
RUSFAR	30.09.2023	12,72

Тип	Дата сделки	Дата исполнения	Режим	Инструмент	К/П	Сумма / Сумма РЕПО	Сумма к исполнению	Сумма возврата РЕПО	Лотов к исполнению	Цена	Цена на дату исполнения	Лоты	Цена на дату заключения	Код расчетов	Срок	Ставка / Спред, %	Плавающая ставка	Индикатор	Значение индикатора
АЦК2	20.09.2023	27.09.2023	РЕПО с ЦК адресное	Сбербанк	П	8 599 920,00	8 602 888,74	8 621 026,32	4 000	215,072	215,526	4 000	214,998	Y5	7	0,200	Плавающая	RUSFAR овернайт	12,4

# Пример 3. РЕПО с ЦК адресное 7 дней RUSFAR Overnight

День	1 (Y0)	2	3	4 (сб)	5 (вс)	6	7	8 (Y5)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	22.09.2023	23.09.2023	24.09.2023	25.09.2023	26.09.2023	27.09.2023
Действующее значение RUSFAR	12,59%	12,40%	12,47%	12,45%	12,45%	12,45%	12,33%	12,42%
Значение RUSFAR для расчета прогнозной части процентов	12,63	12,63	12,51	12,51	12,51	12,36	12,42	x

## Расчет суммы РЕПО к возврату

День 1, 20.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
8 599 920,00	0,20%	-	x	-	0	<i>известная часть:</i> -	8 599 920,00	8 621 080,52
		x	12,63%	12,83%	7	<i>прогнозная часть:</i> 21 160,52		

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RUSFAR	21.09.2023	12,47
RUSFAR	22.09.2023	12,47
RUSFAR	23.09.2023	12,50
RUSFAR	24.09.2023	12,53
RUSFAR	25.09.2023	12,56
RUSFAR	26.09.2023	12,60
RUSFAR	27.09.2023	12,63
RUSFAR	28.09.2023	12,67
RUSFAR	29.09.2023	12,70
RUSFAR	30.09.2023	12,72

День 2, 21.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
8 599 920,00	0,20%	12,40%	x	12,60%	1	<i>известная часть:</i> 2 968,74	8 602 888,74	8 621 026,32
		x	12,63%	12,83%	6	<i>прогнозная часть:</i> 18 137,58		

## Основные данные в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06)

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
<b>День 1. 20.09. Заключение сделки, исполнение 1-ой части</b>															
	2	4373719873	1	B	Y0	40000	214,998	8 599 920,00	8 599 920,00	RUSFAR	12,59%	0,20%	20.09.2023	12,79%	FLOATING
	3	4373719873	2	S	Y5	40000	215,527	8 621 080,52	8 621 080,52	RUSFAR	12,59%	0,20%	27.09.2023	12,79%	FLOATING
<b>День 2. 21.09. Изменение значения индикатора.</b>															
	6	4373719873	2	S	Y5	40000	215,527	8 621 026,32	8 621 026,32	RUSFAR	12,40%	0,20%	27.09.2023	12,60%	FLOATING

# Пример 3. РЕПО с ЦК адресное 7 дней RUSFAR Overnight

День	1 (Y0)	2	3	4 (сб)	5 (вс)	6	7	8 (Y5)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	22.09.2023	23.09.2023	24.09.2023	25.09.2023	26.09.2023	27.09.2023
Действующее значение RUSFAR	12,59%	12,40%	12,47%	12,45%	12,45%	12,45%	12,33%	12,42%
Значение RUSFAR для расчета прогнозной части процентов	12,63	12,63	12,51	12,51	12,51	12,36	12,42	x

День 3, 22.09

Расчет суммы РЕПО к возврату

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
8 599 920,00	0,20%	12,40%	x	12,60%	1	известная часть: 2 968,74 2 985,23	8 605 873,97	8 620 847,26
		12,47%		12,67%	1			
		x	12,51%	12,71%	5	прогнозная часть: 14 973,29	x	

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RUSFAR	22.09.2023	12,45
RUSFAR	23.09.2023	12,45
RUSFAR	24.09.2023	12,45
RUSFAR	25.09.2023	12,45
RUSFAR	26.09.2023	12,47
RUSFAR	27.09.2023	12,51
RUSFAR	28.09.2023	12,55
RUSFAR	29.09.2023	12,59

День 6, 25.09 (после выходных)

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
8 599 920,00	0,20%	12,40%	x	12,60%	1	известная часть: 2 968,74 2 985,23 8 941,56	8 614 815,53	8 620 734,16
		12,47%	x	12,67%	1			
		12,45%	x	12,65%	3			
		x	12,36%	12,56%	2	прогнозная часть: 5 918,63	x	

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RUSFAR	25.09.2023	12,33
RUSFAR	26.09.2023	12,33
RUSFAR	27.09.2023	12,36
RUSFAR	28.09.2023	12,40
RUSFAR	29.09.2023	12,44
RUSFAR	30.09.2023	12,49
RUSFAR	01.10.2023	12,53
RUSFAR	02.10.2023	12,58
RUSFAR	03.10.2023	12,61
RUSFAR	04.10.2023	12,64
RUSFAR	05.10.2023	12,67

Основные данные в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06)

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
День 3. 22.09. Изменение значения индикатора.															
	6	4373719873	2	S	Y5	40000	215,527	8 620 847,26	8 620 847,26	RUSFAR	12,47%	0,20%	27.09.2023	12,67%	FLOATING
День 6. 25.09. Изменение значения индикатора.															
	6	4373719873	2	S	Y5	40000	215,527	8 620 734,16	8 620 734,16	RUSFAR	12,45%	0,20%	27.09.2023	12,65%	FLOATING

# Пример 3. РЕПО с ЦК адресное 7 дней RUSFAR Overnight

День	1 (Y0)	2	3	4 (сб)	5 (вс)	6	7	8 (Y5)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	22.09.2023	23.09.2023	24.09.2023	25.09.2023	26.09.2023	27.09.2023
Действующее значение RUSFAR	12,59%	12,40%	12,47%	12,45%	12,45%	12,45%	12,33%	12,42%
Значение RUSFAR для расчета прогнозной части процентов	12,63	12,63	12,51	12,51	12,51	12,36	12,42	x

День 7, 26.09

Расчет суммы РЕПО к возврату

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
8 599 920,00	0,20%	12,40%	X	12,60%	1	известная часть: 2 968,74 2 985,23 8 941,56 2 952,25	<b>8 617 767,78</b>	<b>8 620 741,23</b>
		12,47%	X	12,67%	1			
		12,45%	X	12,65%	3			
		12,33%	X	12,53%	1			
		x	12,42%	12,62%	1	прогнозная часть: 2 973,45		

День 8, 27.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
8 599 920,00	0,20%	12,40%		12,60%	1	известная часть: 2 968,74 2 985,23 8 941,56 2 952,25 2 973,45	<b>8 620 741,23</b>	<b>8 620 741,23</b>
		12,47%		12,67%	1			
		12,45%		12,65%	3			
		12,33%		12,53%	1			
		12,42%		12,62%	1			

Основные данные в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06)

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
День 7. 26.09. Изменение значения индикатора.															
	6	4373719873	2	S	Y5	40000	215,519	8 620 741,23	8 620 741,23	RUSFAR	12,33%	0,20%	27.09.2023	12,53%	FLOATING
День 8. 27.09. Исполнение второй части															
	1	4373719873	2	S	Y5	40000	215,527	8 620 741,23	8 620 741,23	RUSFAR	12,42%	0,20%	27.09.2023	12,62%	FLOATING

## Пример 3.1. Особенности для кодов расчетов Y1 и Y2.

### Условия

Сумма РЕПО	Срок	Спред	Индикатор
2 526 470,00	7 дней	0,2%	RUSFAR (ON)

### Особенность:

Когда дата исполнения 1 части сделки **не совпадает** с датой заключения сделки, то на дату заключения ставка индикатора берется равной риск параметру на дату исполнения второй части сделки

### Расчет суммы РЕПО к возврату

Код расчетов: Y1 28.09 (заключение, ч. 1.), 29.09 (исполнение ч. 1) – 06.10 (исполнение ч.2.);

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска				
2 526 470,00	0,20%		12,66%	12,86%	7	<i>известная часть:</i> 6 231,04	<b>2 532 701,04</b>

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RUSFAR	28.09.2023	12,48
RUSFAR	29.09.2023	12,48
RUSFAR	30.09.2023	12,50
RUSFAR	01.10.2023	12,53
RUSFAR	02.10.2023	12,55
RUSFAR	03.10.2023	12,58
RUSFAR	04.10.2023	12,61
RUSFAR	05.10.2023	12,64
RUSFAR	06.10.2023	12,66

Код расчетов: Y2 28.09 (заключение, ч. 1.), 02.10 (исполнение ч. 1) – 09.10 (исполнение ч.2.);

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска				
2 526 470,00	0,20%	-	12,71%	12,91%	7	<i>известная часть:</i> 6 255,26	<b>2 532 725,26</b>

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RUSFAR	28.09.2023	12,48
RUSFAR	29.09.2023	12,48
RUSFAR	30.09.2023	12,50
RUSFAR	01.10.2023	12,53
RUSFAR	02.10.2023	12,55
RUSFAR	03.10.2023	12,58
RUSFAR	04.10.2023	12,61
RUSFAR	05.10.2023	12,64
RUSFAR	06.10.2023	12,66
RUSFAR	07.10.2023	12,68
RUSFAR	08.10.2023	12,70
RUSFAR	09.10.2023	12,71
RUSFAR	10.10.2023	12,72
RUSFAR	11.10.2023	12,73

# Пример 4. Междилерское РЕПО-М 7 дней RUSFAR Overnight

## Условия

Сумма РЕПО: 5 307 800,00 руб.;

Срок: 7 дней, 20.09 (заключение, ч. 1.) – 27.09 (ч.2.);

Спред: 0,2%;

Индикатор: RUSFAR (ON)

## Особенности

- При использовании индикаторов «овернайт» проценты рассчитываются с учетом ежедневного изменения индикатора + спред
- При расчете процентов применяются значения RUSFAR(ON) рассчитанные (опубликованные) в предыдущий Расчетный день

Дни недели	20.09, СР	21.09, ЧТ	22.09, ПТ	СБ	ВС	25.09, ПН	26.09, ВТ	27.09, СР
Часть сделки РЕПО	ч. 1							ч. 2
Значение RUSFAR, <b>действующее</b> в этот день, для начисления <b>известной</b> части процентов, % (публикуется на moex.com ~12:30 предыдущего дня)	12,59*	12,40	12,47			12,45	12,33	12,42
День применения значения RUSFAR для начисления процентов								

\* - указывается в EQM06 за дату заключения индикативно, в начислении процентов не участвует.

RUSFAR в Терминале ("Значение индикатора, %" в таблицах "Индикаторы", "Сделки", "Сделки для исполнения") и в EQM06 ("BenchmarkRate").

Указывается значение, опубликованное в предыдущий расчетный день и действующее в отчетный день.

В примере используются условные значения.

Индикатор	Описание индикатора	Значение индикатора, %	Дата вступления в силу значения индикатора	Значение индикатора на следующий календарный день, %	Код расчетов	Валюта расчетов	Актив
RUSFAR	RUSFAR овернайт	12,4	21.09.2023		Y1	руб.	RUSFAR

Тип	Дата сделки	Дата исполнения	Режим	Инструмент	К/П	Сумма / Сумма РЕПО	Сумма к исполнению	Сумма возврата РЕПО	Лоты к исполнению	Цена	Цена на дату исполнения	Лоты	Цена на дату заключения	Код расчетов	Срок	Ставка / Спред, %	Плавающая ставка	Индикатор	Значение индикатора
P2	20.09.2023	27.09.2023	РЕПО-М	Сбербанк	П	5 307 800,00	5 309 659,91	5 320 819,38	20 000	265,4830	266,0410	20 000	265,3900	Rb	7	0,2000	Плавающая	RUSFAR овернайт	12,59

## Пример 4. Междилерское РЕПО-М 7 дней RUSFAR Overnight

День	1 (Y0)	2	3	4 (сб)	5 (вс)	6	7	8 (Y5)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	22.09.2023	23.09.2023	24.09.2023	25.09.2023	26.09.2023	27.09.2023
Применяемое значение RUSFAR	12,59%	12,40%	12,47%	12,45%	12,45%	12,45%	12,33%	12,42%

### Расчет суммы РЕПО к возврату

День 1  
20.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
5 307 800,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	0	<i>известная часть:</i> -	<b>5 309 659,91</b>	<b>5 320 819,38</b>
		12,59%	x	12,79%	7	<i>прогнозная часть:</i> 13 019,38	x	

День 2  
21.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
5 307 800,00	0,20%	12,40%	x	12,60%	1	<i>известная часть:</i> 1 832,28	<b>5 309 632,28</b>	<b>5 320 625,97</b>
		12,40%	x	12,60%	6	<i>прогнозная часть:</i> 10 993,69	x	

### Основные данные в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06)

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
<b>День 1. 20.09. Заключение сделки, исполнение 1-ой части</b>															
	2	4373757497	1	B	Rb	20000	265,39	5 307 800,00	5 307 800,00	RUSFAR	12,59%	0,20%	20.09.2023	12,79%	FLOATING
	3	4373757497	2	S	Rb	20000	215,527	5 320 820,00	<b>5 320 819,38</b>	RUSFAR	12,59%	0,20%	27.09.2023	12,79%	FLOATING
<b>День 2. 21.09. Изменение значения индикатора.</b>															
	6	4373757497	2	S	Rb	20000	266,0313	5 320 626,00	<b>5 320 625,97</b>	RUSFAR	12,40%	0,20%	27.09.2023	12,60%	FLOATING

# Пример 4. Междилерское РЕПО-М 7 дней RUSFAR Overnight

День	1 (Y0)	2	3	4 (сб)	5 (вс)	6	7	8 (Y5)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	22.09.2023	23.09.2023	24.09.2023	25.09.2023	26.09.2023	27.09.2023
Применяемое значение RUSFAR	12,59%	12,40%	12,47%	12,45%	12,45%	12,45%	12,33%	12,42%

## Расчет суммы РЕПО к возврату

День 3  
22.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
5 307 800,00	0,20%	12,40%	x	12,60%	1	<i>известная часть:</i> 1 832,28 1 842,46	<b>5 311 474,74</b>	<b>5 320 687,05</b>
		12,47%	x	12,67%	1			
		12,47%	x	12,67%	5	<i>прогнозная часть:</i> 9 212,30	x	

День 6  
25.09  
(после  
выходных)

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
5 307 800,00	0,20%	12,40%	x	12,60%	1	<i>известная часть:</i> 1 832,28 1 842,46	<b>5 316 993,40</b>	<b>5 320 672,51</b>
		12,47%	x	12,67%	1			
		12,45%	x	12,65%	<b>3</b>	5 518,66	x	
		12,45%	x	12,65%	2	<i>прогнозная часть:</i> 3 679,11		

## Основные данные в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06)

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
<b>День 3. 22.09. Изменение значения индикатора.</b>															
	6	4373757497	2	S	Rb	20000	266,0344	5 320 687,05	5 320 687,05	RUSFAR	12,47%	0,20%	27.09.2023	12,67%	FLOATING
<b>День 6. 25.09. Изменение значения индикатора.</b>															
	6	4373757497	2	S	Rb	20000	266,0336	5 320 672,51	5 320 672,51	RUSFAR	12,45%	0,20%	27.09.2023	12,65%	FLOATING

# Пример 4. Междилерское РЕПО-М 7 дней RUSFAR Overnight

День	1 (Y0)	2	3	4 (сб)	5 (вс)	6	7	8 (Y5)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	22.09.2023	23.09.2023	24.09.2023	25.09.2023	26.09.2023	27.09.2023
Применяемое значение RUSFAR	12,59%	12,40%	12,47%	12,45%	12,45%	12,45%	12,33%	12,42%

## Расчет суммы РЕПО к возврату

День 7  
26.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
5 307 800,00	0,20%	12,40%	x	12,60%	1	известная часть: 1 832,28 1 842,46 5 518,66 1 822,10	5 318 815,50	5 320 637,61
		12,47%	x	12,67%	1			
		12,45%	x	12,65%	3			
		12,33%	x	12,53%	1			
		12,33%	x	12,53%	1	прогнозная часть: 1 822,10	x	

День 8  
27.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
5 307 800,00	0,20%	12,40%	x	12,60%	1	известная часть: 1 832,28 1 842,46 5 518,66 1 822,10	5 320 650,69	5 320 650,69
		12,47%	x	12,67%	1			
		12,45%	x	12,65%	3			
		12,33%	x	12,53%	1			
		12,42%	x	12,62%	1	1 835,19		

## Основные данные в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг (EQM06)

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
День 7. 26.09. Изменение значения индикатора.															
	6	4373757497	2	S	Rb	20000	266,0319	5 320 637,61	5 320 637,61	RUSFAR	12,33%	0,20%	27.09.2023	12,53%	FLOATING
День 8. 27.09. Исполнение второй части															
	1	4373757497	2	S	Rb	20000	266,0325	5 320 650,00	5 320 650,69	RUSFAR	12,42%	0,20%	27.09.2023	12,62%	FLOATING

## 4.1. Особенности для кодов расчетов S0, S01, S02

### Условия

Режим	Сумма РЕПО	Срок	Ставка	Индикатор
РЕПО-М	3 992 023,65	7	Плавающая	RUSFAR овернайт

### Особенность

Сумма процентов не зависит от кода расчетов

### Код расчетов S0

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков			известная часть:		
3 992 023,65	0,20%	12,45%	12,65%	7	9 684,76	<b>4 001 708,41</b>	

### Код расчетов S01

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков			известная часть:		
3 992 023,65	0,20%	12,45%	12,65%	7	9 684,76	<b>4 001 708,41</b>	

### Код расчетов S02

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков			известная часть:		
3 992 023,65	0,20%	12,45%	12,65%	7	9 684,76	<b>4 001 708,41</b>	

## 4.2. Особенности для кодов расчета S01, S02, РЕПО с открытой датой

### Условия

Сумма РЕПО: 3 992 023,65 руб.;

Срок: 360 дней;

Спред: 0,2%;

Индикатор: RUSFAR (ON)

РЕПО с открытой датой

### Особенность

При РЕПО с **открытой датой** необходимо учитывать количество дней в текущем и следующем году, принимая во внимание, что для високосного года за базу расчета процентов принимается 366 дней.

### Код расчетов S01

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Дни с базой 365	Дни с базой 366	Сумма процентов	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков					
3 992 023,65	0,20%	12,45%	12,65%	93	267	<i>известная часть:</i> 497 064,01	<b>4 489 087,66</b>

### Код расчетов S02

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Дни с базой 365	Дни с базой 366	Сумма процентов	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков					
3 992 023,65	0,20%	12,45%	12,65%	90	270	<i>известная часть:</i> 497 052,66	<b>4 489 076,31</b>

# Пример 5. РЕПО с ЦК. Срок 14 дней. Индикатор RUSFAR 1W

## Условия

Сумма РЕПО: 6 449 940,00 руб.;

Срок: 7 дней, 20.09 (заключение, ч. 1.) – 04.10 (ч.2.);

Спред: 0,2%;

Индикатор: RUSFAR 1W

## Особенности:

Значение индикатора для расчета процентов осуществляется в соответствии со сроком расчета индикатора. Для расчета суммы второй части берутся значения риска-параметра на дату начала **каждого** временного отрезка.

Например, в сделке с RUSFAR 1W сроком на 14 дней значение индикатора изменяется только **2 раза**, независимо от того, что сам индикатор рассчитывается ежедневно.

Другой пример: в сделке с RUSFAR 1W сроком на 1 год значение индикатора изменяется **52 раза**, хотя индикатор рассчитывается в течение всего года.

Дни недели	20, СР	21, ЧТ	22, ПТ	23, СБ	24, ВС	25, ПН	26, ВТ	27, СР	28, ЧТ	29, ПТ	30, СБ	1, ВС	2, ПН	3, ВТ	4, СР
Часть сделки РЕПО	Ч. 1														Ч. 2
Значение RUSFAR, <b>действующее</b> в этот день, используется для начисления <b>известной</b> части процентов (публикуется на moex.com ~12:30 предыдущего дня)	EQM06 12,65*	EQM06 12,59							EQM06 12,72						EQM06
День применения значения RUSFAR для начисления процентов															
Применение RUSFAR 1W для расчета процентов	12,59								12,92						

\* - указывается в EQM06 за дату заключения индикативно, в начислении процентов не участвует.

- RUSFAR в Терминале ("Значение индикатора, %" в таблицах "Индикаторы", "Сделки", "Сделки для исполнения") и в EQM06 ("BenchmarkRate").

Указывается значение, опубликованное в предыдущий расчетный день и действующее в отчетный день. В примере используются условные значения.

Тип	Дата сделки	Дата исполнения	Режим	Инструмент	К/П	Сумма / Сумма РЕПО	Сумма к исполнению	Сумма возврата РЕПО	Лотов к исполнению	Цена	Цена на дату исполнения	Лоты	Цена на дату заключения	Код расчетов	Срок	Ставка / Спред, %	Плавающая ставка	Индикатор	Значение индикатора
АЦК1	20.09.2023	20.09.2023	РЕПО с ЦК адресное	Сбербанк	К	6 449 940,00	6 449 940,00	6 481 990,02	3 000	214,998	216,066	3 000	214,998	Y0		0,200	Плавающая	RUSFAR 1 неделя	
АЦК2	20.09.2023	04.10.2023	РЕПО с ЦК адресное	Сбербанк	П	6 449 940,00	6 452 210,73	6 481 990,02	3 000	215,074	216,066	3 000	214,998	Y10	14	0,200	Плавающая	RUSFAR 1 неделя	12,65

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RUSFAR1W	20.09.2023	12,59
RUSFAR1W	21.09.2023	12,59
RUSFAR1W	22.09.2023	12,65
RUSFAR1W	23.09.2023	12,70
RUSFAR1W	24.09.2023	12,76
RUSFAR1W	25.09.2023	12,81
RUSFAR1W	26.09.2023	12,87
RUSFAR1W	27.09.2023	12,92
RUSFAR1W	28.09.2023	12,92
RUSFAR1W	29.09.2023	12,92
RUSFAR1W	30.09.2023	12,92
RUSFAR1W	01.10.2023	12,92

# Пример 5. РЕПО с ЦК. Срок 14 дней. Индикатор RUSFAR 1W

День	1 (Y0)	2	9	15 (сб)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	28.09.2023	04.10.2023
Действующее значение RUSFAR	12,65%	12,59%	12,72%	12,68%
Значение RUSFAR для расчета прогнозной части процентов	12,92%	12,97%	x	x

## Расчет суммы РЕПО к возврату

День 1  
20.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:	прогнозная часть:	
6 449 940,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	15 820,91	6 481 990,02	
		x	12,92%	13,12%	7	16 229,11		
Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению		
6 449 940,00	0,20%	12,59%	12,79%	0	-	6 449 940,00		

День 2  
21.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:	прогнозная часть:	
6 449 940,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	15 820,91	6 482 051,87	
		x	12,97%	13,17%	7	16 290,96		
Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению		
6 449 940,00	0,20%	12,59%	12,79%	1	2 260,13	6 452 200,13		

## В отчете EQM06

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
<b>День 1. 20.09. Заключение сделки, исполнение 1-ой части</b>															
	2	4373728055	1	B	Y0	30000	216,066	6 449 940,00	6 449 940,00	RUSFAR1W	12,65%	0,20%	20.09.2023	12,85%	FLOATING
	3	4373728055	2	S	Y10	30000	216,066	6 481 990,02	6 481 990,02	RUSFAR1W	12,65%	0,20%	04.10.2023	12,85%	FLOATING
<b>День 2. 21.09. Изменение значения индикатора.</b>															
	6	4373728055	2	S	Y10	30000	216,066	6 482 051,87	6 482 051,87	RUSFAR1W	12,59%	0,20%	04.10.2023	12,79%	FLOATING

# Пример 5. РЕПО с ЦК. Срок 14 дней. Индикатор RUSFAR 1W

День	1 (Y0)	2	9	15 (сб)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	28.09.2023	04.10.2023
Действующее значение RUSFAR	12,65%	12,59%	12,72%	12,68%
Значение RUSFAR для расчета прогнозной части процентов	12,92%	12,97%	x	x

## Расчет суммы РЕПО к возврату

День 3  
22.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:	прогнозная часть:	
6 449 940,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	15 820,91	16 216,74	<b>6 481 977,65</b>
		x	12,91%	13,11%	7			

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
6 449 940,00	0,20%	12,59%	12,79%	2	4 520,26	<b>6 454 460,26</b>

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RUSFAR1W	22.09.2023	12,64
RUSFAR1W	23.09.2023	12,64
RUSFAR1W	24.09.2023	12,64
RUSFAR1W	25.09.2023	12,64
RUSFAR1W	26.09.2023	12,73
RUSFAR1W	27.09.2023	12,82
RUSFAR1W	28.09.2023	12,91
RUSFAR1W	29.09.2023	13,00
RUSFAR1W	30.09.2023	13,00
RUSFAR1W	01.10.2023	13,00
RUSFAR1W	02.10.2023	13,00
RUSFAR1W	03.10.2023	13,01
RUSFAR1W	04.10.2023	13,01

День 6  
25.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:	прогнозная часть:	
6 449 940,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	15 820,91	15 820,91	<b>6 481 581,82</b>
		x	12,59%	12,79%	7			

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
6 449 940,00	0,20%	12,59%	12,79%	5	11 300,65	<b>6 461 240,65</b>

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RUSFAR1W	25.09.2023	12,47
RUSFAR1W	26.09.2023	12,47
RUSFAR1W	27.09.2023	12,53
RUSFAR1W	28.09.2023	12,59
RUSFAR1W	29.09.2023	12,65
RUSFAR1W	30.09.2023	12,71
RUSFAR1W	01.10.2023	12,77
RUSFAR1W	02.10.2023	12,83

Так как пересмотра значения индикатора не происходит, в EQM06 сделка не отражается

# Пример 5. РЕПО с ЦК. Срок 14 дней. Индикатор RUSFAR 1W

День	1 (Y0)	2	9	15 (сб)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	28.09.2023	04.10.2023
Действующее значение RUSFAR	12,65%	12,59%	12,72%	12,68%
Значение RUSFAR для расчета прогнозной части процентов	12,92%	12,97%	x	x

## Расчет суммы РЕПО к возврату

День 7  
26.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:	прогнозная часть:	
6 449 940,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	15 820,91	15 895,13	<b>6 481 656,03</b>
		x	12,65%			12,85%		

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RUSFAR1W	26.09.2023	12,60
RUSFAR1W	27.09.2023	12,60
RUSFAR1W	28.09.2023	12,65
RUSFAR1W	29.09.2023	12,70
RUSFAR1W	30.09.2023	12,75
RUSFAR1W	01.10.2023	12,80
RUSFAR1W	02.10.2023	12,85
RUSFAR1W	03.10.2023	12,90

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
6 449 940,00	0,20%	12,59%	12,79%	6	13 560,78	<b>6 463 500,78</b>

День 8  
27.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:		
6 449 940,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	15 820,91	15 981,71	<b>6 481 742,62</b>
		12,72%	x			12,92%		

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
6 449 940,00	0,20%	12,59%	12,79%	7	15 820,91	<b>6 465 760,91</b>

Так как пересмотра значения индикатора не происходит, в EQM06 сделка не отражается

# Пример 5. РЕПО с ЦК. Срок 14 дней. Индикатор RUSFAR 1W

День	1 (Y0)	2	9	15 (сб)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	28.09.2023	04.10.2023
Действующее значение RUSFAR	12,65%	12,59%	12,72%	12,68%
Значение RUSFAR для расчета прогнозной части процентов	12,92%	12,97%	x	x

## Расчет суммы РЕПО к возврату

День 9  
28.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска				
6 449 940,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	известная часть: 15 820,91	6 481 742,62
		12,72%	x	12,92%	7		

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
6 449 940,00	0,20%	12,59%	12,79%	7	15 820,91	6 468 044,01
	0,20%	12,72%	12,92%	1	2 283,10	

День 15  
04.10

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска				
6 449 940,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	известная часть: 15 820,91	6 481 742,62
		x	12,72%	12,92%	7		

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
6 449 940,00	0,20%	12,59%	12,79%	7	15 820,91	6 481 742,62
	0,20%	12,72%	12,92%	7	15 932,24	

## В отчете EQM06

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
День 9. 28.09. Изменение значения индикатора.															
	6	4373728055	2	S	Y10	30000	216,066	6 481 742,62	6 481 742,62	RUSFAR1W	12,72%	0,20%	04.10.2023	12,92%	FLOATING
День 15. 04.10. Изменение значения индикатора.															
	1	4373728055	2	S	Y10	30000	216,066	6 481 742,62	6 481 742,62	RUSFAR1W	12,68%	0,20%	04.10.2023	12,88%	FLOATING

# Пример 6. Междилерское РЕПО-М. Срок 14 дней. Индикатор RUSFAR 1W.

## Условия

Сумма РЕПО: 3 980 850,00 руб.;

Срок: 7 дней, 20.09 (заключение, ч. 1.) – 04.10 (ч. 2.);

Спред: 0,2%;

Индикатор: RUSFAR 1W

## Особенности:

Значение индикатора для расчета процентов осуществляется в соответствии со сроком расчета индикатора. Например, в сделке с RUSFAR 1W сроком на 14 дней, значение индикатора применяется два раза (для первой недели и для второй недели), независимо от того, что сам индикатор рассчитывается ежедневно.

Дни недели	20, СР	21, ЧТ	22, ПТ	23, СБ	24, ВС	25, ПН	26, ВТ	27, СР	28, ЧТ	29, ПТ	30, СБ	1, ВС	2, ПН	3, ВТ	4, СР
Часть сделки РЕПО	Ч. 1														Ч. 2
Значение RUSFAR, <b>действующее</b> в этот день, используется для начисления <b>известной</b> части процентов (публикуется на moex.com ~12:30 предыдущего дня)	EQM06 12,65*	EQM06 12,59							EQM06 12,72						EQM06
День применения значения RUSFAR для начисления процентов		↓	↓	↓	↓	↓	↓	↓	↓	↓	↓	↓	↓	↓	↓

\* - указывается в EQM06 за дату заключения индикативно, в начислении процентов не участвует.

- RUSFAR в Терминале ("Значение индикатора, %" в таблицах "Индикаторы", "Сделки", "Сделки для исполнения") и в EQM06 ("BenchmarkRate").  
Указывается значение, опубликованное в предыдущий расчетный день и действующее в отчетный день. В примере используются условные значения.

Индикатор	Описание индикатора	Значение индикатора, %	Дата вступления в силу значения индикатора	Значение индикатора на следующий календарный день, %	Код расчетов	Валюта расчетов	Актив
RUSFAR1W	RUSFAR 1 неделя	12,65	20.09.2023	12,68	Y1W	руб.	RUSFAR1W

Тип	Дата сделки	Дата исполнения	Режим	Инструмент	К/П	Сумма / Сумма РЕПО	Сумма к исполнению	Сумма возврата РЕПО	Лоты к исполнению	Цена	Цена на дату исполнения	Лоты	Цена на дату заключения	Код расчетов	Срок	Ставка / Спред, %	Плавающая ставка	Индикатор	Значение индикатора
P2	20.09.2023	04.10.2023	РЕПО-М	Сбербанк	П	3 980 850,00	3 982 251,48	4 000 470,68	15 000	265,4834	266,6980	15 000	265,3900	Rb	14	0,2000	Плавающая	RUSFAR 1 неделя	12,65

# Пример 6. Междилерское РЕПО-М. Срок 14 дней. Индикатор RUSFAR 1W.

День	1 (Y0)	2	9	15
Дата	20.09.2023	21.09.2023	28.09.2023	24.10.2023
Применяемое значение RUSFAR	12,65%	12,59%	12,72%	12,68%

## Расчет суммы РЕПО к возврату

День 1  
20.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:		
3 980 850,00	0,20%	12,65%	x	12,85%	7	9 810,34		4 000 470,68
		12,65%	x	12,85%	7	прогнозная часть:	9 810,34	

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
3 980 850,00	0,20%	12,59%	12,79%	0	-	3 980 850,00

День 2  
21.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска			известная часть:		
3 980 850,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	9 764,53		4 000 379,07
		12,59%	x	12,79%	7	прогнозная часть:	9 764,53	

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
3 980 850,00	0,20%	12,59%	12,79%	1	1 394,93	3 982 244,93

## В отчете EQM06

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
День 1. 20.09. Заключение сделки, исполнение 1-ой части															
	2	4373758402	1	B	Rb	15000	265,39	3 980 850,00	3 980 850,00	RUSFAR1W	12,65%	0,20%	20.09.2023	12,85%	FLOATING
	3	4373758402	2	S	Rb	15000	266,698	4 000 470,68	4 000 470,68	RUSFAR1W	12,65%	0,20%	04.10.2023	12,85%	FLOATING
День 2. 21.09. Изменение значения индикатора.															
	6	4373758402	2	S	Rb	15000	266,6919	4 000 378,5	4 000 379,07	RUSFAR1W	12,59%	0,20%	04.10.2023	12,79%	FLOATING

## Пример 6. Междилерское РЕПО-М. Срок 14 дней. Индикатор RUSFAR 1W.

День	1 (Y0)	2	9	15
Дата	20.09.2023	21.09.2023	28.09.2023	04.10.2023
Применяемое значение RUSFAR	12,65%	12,59%	12,72%	12,68%

### Расчет суммы РЕПО к возврату

День 3  
22.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
3 980 850,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	<i>известная часть:</i>	9 764,53	<b>4 000 447,78</b>
		12,68%	x	12,88%	7	<i>прогнозная часть:</i>	9 833,24	

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
3 980 850,00	0,20%	12,59%	12,79%	2	2 789,87	<b>3 983 639,87</b>

День 6  
25.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
3 980 850,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	<i>известная часть:</i>	9 764,53	<b>4 000 417,24</b>
		12,64%	x	12,84%	7	<i>прогнозная часть:</i>	9 802,71	

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
3 980 850,00	0,20%	12,59%	12,79%	5	6 974,67	<b>3 987 824,67</b>

Так как пересмотра значения индикатора не происходит, в EQM06 сделка не отражается

## Пример 6. Междилерское РЕПО-М. Срок 14 дней. Индикатор RUSFAR 1W.

День	1 (Y0)	2	9	15
Дата	20.09.2023	21.09.2023	28.09.2023	04.10.2023
Применяемое значение RUSFAR	12,65%	12,59%	12,72%	12,68%

### Расчет суммы РЕПО к возврату

День 7  
26.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
3 980 850,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	<i>известная часть:</i>	9 764,53	<b>4 000 287,45</b>
		12,47%	x	12,67%	7	<i>прогнозная часть:</i>	9 672,92	

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
3 980 850,00	0,20%	12,59%	12,79%	6	8 369,60	<b>3 989 219,60</b>

День 8  
27.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов		Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска					
3 980 850,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	<i>известная часть:</i>	9 764,53	<b>4 000 386,70</b>
		12,60%	x	12,80%	7	<i>прогнозная часть:</i>	9 772,17	

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
3 980 850,00	0,20%	12,59%	12,79%	7	9 764,53	<b>3 990 614,53</b>

Так как пересмотра значения индикатора не происходит, в EQM06 сделка не отражается

## Пример 6. Междилерское РЕПО-М. Срок 14 дней. Индикатор RUSFAR 1W.

День	1 (Y0)	2	9	15 (сб)
Дата	20.09.2023	21.09.2023	28.09.2023	04.10.2023
Применяемое значение RUSFAR	12,65%	12,59%	12,72%	12,68%

### Расчет суммы РЕПО к возврату

День 9  
28.09

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска				
3 980 850,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	известная часть: 9 764,53	<b>4 000 478,32</b>
		12,72%	x	12,92%	7	9 863,78	

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
3 980 850,00	0,20%	12,59%	12,79%	7	9 764,53	<b>3 992 023,65</b>
	0,20%	12,72%	12,92%	1	1 409,11	

День 15  
04.10

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор		Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма РЕПО к возврату
		без рисков	с учетом риска				
3 980 850,00	0,20%	12,59%	x	12,79%	7	известная часть: 9 764,53	<b>4 000 478,32</b>
		12,72%	x	12,92%	7	9 863,78	

Сумма РЕПО	Спред	Индикатор	Ставка для расчета процентов	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Сумма к исполнению
3 980 850,00	0,20%	12,59%	12,79%	7	9 764,53	<b>4 000 478,32</b>
	0,20%	12,72%	12,92%	7	9 863,78	

### В отчете EQM06

EQM06 (для печати)	Тип информации	Номер сделки...	Часть сделки...	Направленность	Код расчетов	Кол-во	Цена	Объем сделки..., в валюте расчетов	Обязательство/ требование по денежным средствам	Индикатор	Размер инд. ставки	Ставка РЕПО/ процентная ставка/спред	Дата исполнения	x	x
EQM06 в XML	InfType	TradeNo	RepoPart	BuySell	SettleCode	Quantity	Price	Value	Amount	Benchmark	Benchmark Rate	RepoRate	DueDate	CurRepoRate	RateType
День 9. 28.09. Изменение значения индикатора.															
	6	4373758402	2	S	Rb	15000	266,6986	4 000 479	4 000 478,32	RUSFAR1W	12,72%	0,20%	04.10.2023	12,92%	FLOATING
День 15. 04.10. Исполнение второй части.															
	1	4373758402	2	S	Rb	15000	266,698	4 000 478,32	4 000 478,32	RUSFAR1W	12,68%	0,20%	04.10.2023	12,88%	FLOATING

# СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ



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

[ps@moex.com](mailto: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.