

# ЗАЙМЫ ЦЕННЫХ БУМАГ У ФЕДЕРАЛЬНОГО КАЗНАЧЕЙСТВА

# ЗАЙМЫ ЦЕННЫХ БУМАГ У ФЕДЕРАЛЬНОГО КАЗНАЧЕЙСТВА

## Привлечение займа



Банк

Бумаги

Клиринг, СУО и расчёты в НРД



Федеральное казначейство

## Возврат займа



Банк

Бумаги +% в рублях

Клиринг, СУО и расчёты в НРД



Федеральное казначейство

## Подача заявок:

- Терминал MOEX Trade TI

## Инструменты:

- Корзина ОФЗ и еврооблигаций Минфина (GCFEDBNDL)
- Корзина ипотечных облигаций ДОМ.РФ (GCMBSL)

## Тип заявок:

- Адресные заявки

## Технически возможные сроки займов:

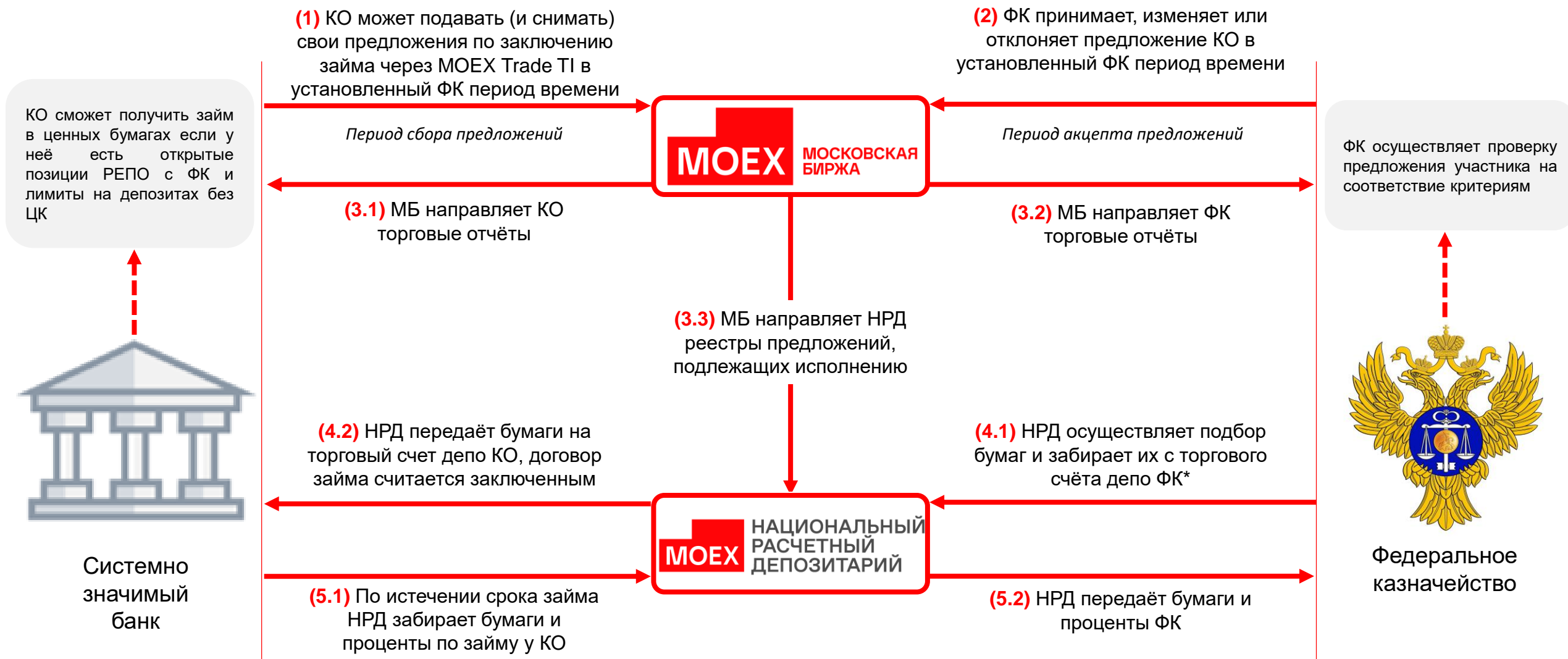
- От 1 до 380 дней (с учётом срока РЕПО на которые были размещены ценные бумаги)\*

## Возможные режимы:

- BREK - "Займы бумаг ФК - ЕКС"
- BRFB - "Займы бумаг ФК - ФБ"

- Заключение сделок займа с ценными бумагами с ФК возможно **только** с кодом расчётов DVP3
- Сделка займа может быть заключена только в **пределах срока** РЕПО и **того же объёма бумаг**, который **уже был передан** кредитной организацией в ФК в качестве обеспечения по сделкам РЕПО\*
- Проценты ежедневно начисляются на **актуальную** сумму займа (с учётом рыночных колебаний цены занятых бумаг)
- Принимать участие в займах ценных бумаг могут **только** системно значимые кредитные организации
- Выдача займа ценными бумагами происходит в **рамках действующего свободного лимита** ФК на необеспеченные операции (по депозитам)
- Подавать заявки могут только те представители кредитных организаций, на которых были предоставлены доверенности в ФК

# Технология займа ценных бумаг



\* НРД подбирает бумаги для займа из открытых сделок РЕПО по той же корзине, под которую заключается займ, причём дата второй части открытой сделки РЕПО должна наступить позже даты возврата заключаемого займа. Если сумма подобранных бумаг меньше суммы предложений, то сделка займа будет заключена исходя из объема подобранных бумаг

# ФОРМА ВВОДА ЗАЯВКИ ДЛЯ ЗАЙМОВ В ТЕРМИНАЛЕ

Заявка

- Заявка внесистемная
- Заявка внесистемная полученная
- Списки партнеров для RFQ
- RFQ
- Заявки исполнения
- Заявка на возврат депозита
- Ограничение денежных позиций
- Послать сообщение...
- Вести пакет... Ctrl+F2
- Сохранить в пакет заявок... Shift+Ctrl+F2

Ввод внесистемной заявки займа

Привлечь Разместить [Заполнить последней](#)

Правила торгов: Займы бумаг ФК - ЕКС Контрагент: ФК

Инструмент: GCFEDBNDL Код расчетов: DVP3

Лот: 1 000 нвб. Дата расчетов: 09.12.2024

Первая часть сделки займа Вторая часть сделки займа

Сумма займа: 20 000 000,00 Срок займа: 43

Ставка, %: 0,7500

Дата возврата: 21.01.2025

Код плат. рекв.: MC00025BRFK1 Расчетный код: MC00025BRFK1

Клиент: Поручение:

Блокировать обеспечение

Комментарий: Ссылка:

Ввести заявку Закрыть

## Заполняемые поля в форме заявки

Правила торгов		Инструмент	
▲ Режим	Код режима	▲ Инструмент	Код инструмента
Займы бумаг ФК - ЕКС	BREK	GCFEDBNDL	GCFEDBNDL
Займы бумаг ФК - ФБ	BRFB	GCMBL	GCMBL

Поля «Контрагент» и «Код расчетов» заполняются **автоматически** значениями «ФК» и «DVP3» соответственно

Поле «Сумма займа» заполняется в рублях, выпуски занимаемых ценных бумаг определяются в системе НРД

# НОВЫЕ ТОРГОВЫЕ ОТЧЁТЫ

FBR01

Выписка из Реестра  
отправленных Предложений

FBR02

Выписка из Реестра  
полученных Предложений

FBR03

Выписка из Реестра  
Предложений по заключению договоров  
Займа ценных бумаг

# ОСОБЕННОСТИ ОТРАЖЕНИЯ ПРЕДЛОЖЕНИЙ В ТЕРМИНАЛЕ

2 - Отправленные внесистемные заявки

Заявка №	Время	Статус	Контрагент	Инструмент	Правила торгов	Операция	Сумма займа	Срок займа	Ставка займа, %	Код платежных реквизитов	Сумма возврата	Код инструмента	Код правил торгов
28	10:06:04	+	ФК	GCFEDBNDL	Займы бумаг ФК - ЕКС	П	1 000 000,00	4	1,1000	MC09537BRFK1	1 000 100,00	GCFEDBNDL	BREK
64	13:25:56	+	ФК	GCFEDBNDL	Займы бумаг ФК - ЕКС	П	1 000 000,00	90	1,0001	MC09537BRFK1	1 002 500,00	GCFEDBNDL	BREK

2 - Сделки

Сделка №	Время	Заявка №	Контрагент	Инструмент	Правила торгов	Операция	Сумма займа	Срок займа	Ставка займа, %	Код платежных реквизитов	Сумма возврата	Код инструмента	Код правил торгов
23	10:08:10	28	ФК	GCFEDBNDL	Займы бумаг ФК - ЕКС	П	1 000 000,00	4	1,1000	MC09537BRFK1	1 000 100,00	GCFEDBNDL	BREK
42	13:26:44	64	ФК	GCFEDBNDL	Займы бумаг ФК - ЕКС	П	1 000 000,00	90	1,0001	MC09537BRFK1	1 002 500,00	GCFEDBNDL	BREK

## ТОРГОВАЯ И КЛИРИНГОВАЯ КОМИССИЯ ЗА ЗАЙМЫ

План	Ставка тарифа, % в день*	Ставка тарифа, % годовых
REPO_0	0,000453%	0,165%
REPO_150	0,000362%	0,132%
REPO_500	0,000310%	0,113%
REPO_6500	0,000271%	0,099%
REPO_16250	0,000232%	0,085%
REPO_32500	0,000206%	0,075%

\*Подробнее о расчёте комиссии за клиринг в НРД на [сайте](#) (пункты 11 и 12)

# НОРМАТИВНЫЕ ДОКУМЕНТЫ

1. [Постановление](#) Правительства Российской Федерации от 4 сентября 2013 г. № 777 «О порядке осуществления операций по управлению остатками средств на едином счете федерального бюджета и едином казначейском счете в части покупки (продажи) ценных бумаг не на организованных торгах по договорам репо, заключения договоров займа ценных бумаг и открытия счетов для осуществления таких операций»
2. [Тарифы](#) и порядок оплаты клиринговых услуг небанковской кредитной организации акционерного общества «Национальный Расчетный Депозитарий»

# ЗАЯВЛЕНИЕ ОБ ОГРАНИЧЕНИИ ОТВЕТСТВЕННОСТИ

- Настоящая презентация была подготовлена и выпущена Публичным акционерным обществом «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее – «Компания»). Если нет какой-либо оговорки об ином, то Компания считается источником всей информации, изложенной в настоящем документе. Данная информация предоставляется по состоянию на дату настоящего документа и может быть изменена без какого-либо уведомления.
- 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 144А 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 (b) секторов с высоким уровнем конкуренции, в которых Компания и ее дочерние общества осуществляют свою деятельность;
  - изменения в (а) отечественном и международном законодательстве и налоговом регулировании и (b) государственных программах, относящихся к финансовым рынкам и рынкам ценных бумаг;
  - ростом уровня конкуренции со стороны новых игроков на рынке России;
  - способность успевать за быстрыми изменениями в научно-технической среде, включая способность использовать расширенные функциональные возможности, которые популярны среди клиентов Компании и ее дочерних обществ;
  - способность сохранять преемственность процесса внедрения новых конкурентных продуктов и услуг, равно как и поддержка конкурентоспособности;
  - способность привлекать новых клиентов на отечественный рынок и в зарубежных юрисдикциях;
  - способность увеличивать предложение продукции в зарубежных юрисдикциях.

Прогнозные заявления делаются только на дату настоящей 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.