



ОПЦИЯ «EVERGREEN»  
В РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ

# ОПЦИЯ «EVERGREEN» В РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ

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

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

По умолчанию значение параметра = 1.

\* Отчет на закрытие сделки РЕПО с открытой датой

## Пример EVERGREEN 30дн.



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

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

Ввод адресной заявки РЕПО с ЦК

<b>Режим:</b>	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	<b>Партнер:</b>	██████████
<b>Инструмент:</b>	КСУ обл.	<b>Код расчетов:</b>	Y0
<b>Валюта расч.:</b>	руб.	Дата расчетов: 22.10.2024	
<b>Первая часть сделки РЕПО</b>		<b>Вторая часть сделки РЕПО</b>	
Сумма РЕПО:	14 500 000,00	Макс. срок РЕПО:	90
<input checked="" type="checkbox"/> РЕПО с открытой датой		Период до исполнения:	30
Лотов:	14 500	Индикатор:	RUSFAR
Размер лота: 1 000		Значение: 18,78% (RUSFAR овернайт)	
Бумага: 14 500 000		Дата расчетов: 20.01.2025	
<b>Риск-параметры</b>			
Расчетная цена:	1,000	Спред %:	0,500
Дисконт, %:		Сумма возврата: 15 248 869,59 руб.	
По умолчанию:	0,000		
Расч.цена с учетом дисконта:	1,000		
<b>Фирма:</b> ██████████			
Торговый счет:	S00+000002B9	Клиринговый расчетный код:	10161
Клиент:		Поручение:	
Ссылка:			
<b>Комиссия и Единый Лимит под заявку</b>			
Комиссия, руб.:	49,79	ЕЛ под заявку:	52 490,00
ЕЛ с учетом заявки:		15 868 390 047,91	
<b>Ввести заявку</b>		<b>Закрыть</b>	

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

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

1 - Отправленные адресные заявки

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

3 - Сделки

Тип	Режим	Инструмент	К/П	Цена	Цена выкупа	Ставка / Спред, %	Лоты	Объем	Торговый счет	Код расчетов	Сумма / Сумма РЕПО	Стоимость выкупа РЕПО	Репо с "Открытой датой"	Плавающая ставка	Период до исполнения второй части РЕПО	Срок
АЦК	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	К/П	0,500	1,052	0,500	14 500	14 500 000,00	S01+00000F00	Y0	14 500 000,00	15 254 381,83	Да	Плавающая	30	90
АЦК1	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	К	1,000	1,052	0,500	14 500	14 500 000,00	S01+00000F00	Y0	14 500 000,00	15 254 381,83	Да	Плавающая	30	90
АЦК2	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	П	1,052	1,052	0,500	14 500	15 254 381,83	S01+00000F00	YOD90	14 500 000,00	15 254 381,83	Да	Плавающая	30	90

\* 1 - Сделки для исполнения

Дата сделки	Дата исполнения	Режим	Инструмент	К/П	Сумма / Сумма РЕПО	Лоты	Код расчетов	Срок	Период до исполнения второй части РЕПО	Ставка / Спред, %	Плавающая ставка
22.10.2024	20.01.2025	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	П	14 500 000,00	14 500	YOD90	90	30	0,500	Плавающая

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

**Ввод адресной заявки РЕПО**

Режим:	РЕПО-М	Партнер:	Группа партнеров
Инструмент:	Мосбиржа	Код расчетов:	S0
Валюта расч.:	руб.	Дата расчетов: 31.10.2024	
Первая часть сделки РЕПО		Вторая часть сделки РЕПО	
Сумма РЕПО:	100 000 000,00	Макс. срок РЕПО:	90
Лотов:	1	<input checked="" type="checkbox"/> РЕПО с открытой датой	Период до исполнения: 30
Индикатор: RUSFAR Значение: 20,46% (RUSFAR овернайт) Дата расчетов: 29.01.2025			
Дисконт, %		Спред, %	
Начальный:	10,0000	Нижний предел:	0,3000
Верхний предел:		Расчетная цена: 197,4900 В полях "Сумма РЕПО", "Лотов" и "Начальный дисконт" указываются два любых параметра из трех	
Фирма:		Торговый счет: S00+4190AC53 Клиринговый расчетный код: 11849	
Клиент:		Поручение:	
Возмещение,%:		Ссылка:	
Комиссия и Единый Лимит под заявку ? Комиссия, руб.: 156,00 ЕЛ под заявку: 0,00 ЕЛ с учетом заявки: 244 031 888 759,23			
<b>Ввести заявку</b>		<b>Закрыть</b>	

**Ввод запроса RFQ для РЕПО**

Режим:	РЕПО-М	Партнер:	Группа партнеров
Инструмент:	Мосбиржа	Код расчетов:	S0
Валюта расч.:	руб.	Дата расчетов: 31.10.2024	
Адресат		<input type="checkbox"/> Расширенный режим Все <input checked="" type="checkbox"/> Список партнеров: <input type="button"/>	
Первая часть сделки РЕПО		Вторая часть сделки РЕПО	
Сумма:	100 000 000,00	Макс. срок РЕПО:	90
Лотов:	1	<input checked="" type="checkbox"/> РЕПО с открытой датой	Период до исполнения: 30
Индикатор: RUSFAR Значение: 20,46% (RUSFAR овернайт) Дата расчетов: 29.01.2025			
Дисконт, %		Спред, %	
Начальный:	10,0000	Нижний предел:	0,5000
Верхний предел:		Возмещение,%: 10,00	
Торговый счет: S00+4190AC53 Клиринговый расчетный код: 11849		Клиент: Поручение:	
<b>Ввести RFQ</b>			
<b>Закрыть</b>			

**Ввод запроса RFQ для РЕПО с ЦК**

Режим:	РЕПО с ЦК адресное	Партнер:	Группа партнеров
Инструмент:	Мосбиржа	Код расчетов:	Y0
Валюта расч.:	руб.	Дата расчетов: 31.10.2024	
Адресат		<input checked="" type="checkbox"/> Расширенный режим Все <input checked="" type="checkbox"/> Список партнеров: <input type="button"/>	
Первая часть сделки РЕПО		Вторая часть сделки РЕПО	
Сумма:	100 000 000,00	Макс. срок РЕПО:	120
Лотов:	10	<input checked="" type="checkbox"/> РЕПО с открытой датой	Период до исполнения: 35
Индикатор: RUSFAR Значение: 20,46% (RUSFAR овернайт) Дата расчетов: 28.02.2025			
Риск-параметры		Спред, %	
Расчетная цена:	193,788	Спред, %:	0,300
Дисконт, %: По умолчанию:	13,000	Возмещение,%: 10,00	
Расчетена с учетом диконта: 168,596			
Торговый счет: S00+4190AC53 Клиринговый расчетный код: 11849		Клиент: Поручение:	
<b>Ввести RFQ</b>			
<b>Закрыть</b>			

**2 - Отправленные запросы RFQ**

Котировка №	Время завершения сбора заявок	Время	Статус	Инструмент	Режим	Код расчетов	К/П	Объем	Срок РЕПО	Период до исполнения второй части РЕПО	РЕПО с открытой датой	Ставка/ спред, %	Плавающая ставка	Индикатор	Значение индикатора, %	Заявки только на полный объем
14 942	12:48:19	12:38:18	Акт	Мосбиржа	РЕПО с ЦК адресное	Y0	К/П	100 000 000,00	120	35	да	0,300	Плавающая	RUSFAR овернайт	20,46 Да	
14 943	12:41:15	12:41:15	Акт	Мосбиржа	РЕПО-М	S0	K	100 000 000,00	90	30	да	0,5000	Плавающая	RUSFAR овернайт	20,46 Да	

**1 - Отправленные адресные заявки**

Режим	Инструмент	К/П	Цена	Лоты	Остаток лотов	Сумма / Сумма РЕПО	Код расчетов	Стоимость выкупа РЕПО	Срок	Период до исполнения второй части РЕПО	Репо с открытой датой	Ставка / Спред, %	Значение индикатора, %
РЕПО-М	МосБиржа	П	177,7408	562 617	562 617	100 000 000,00	S0	105 109 424,66	90	30	да	0,3000	20,46

# ИСПОЛНЕНИЕ СДЕЛОК РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ С ОПЦИЕЙ «EVERGREEN»

Ввести отчет на досрочное исполнение...

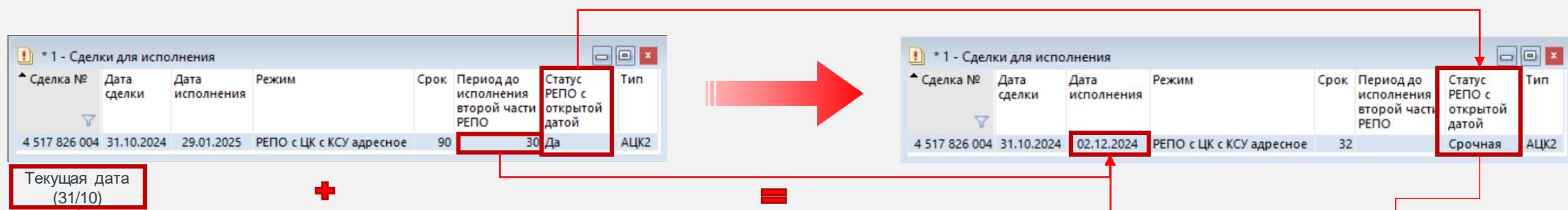
\*

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

Ввести отчет на исполнение сделки Подтверждения...

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

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



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

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

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

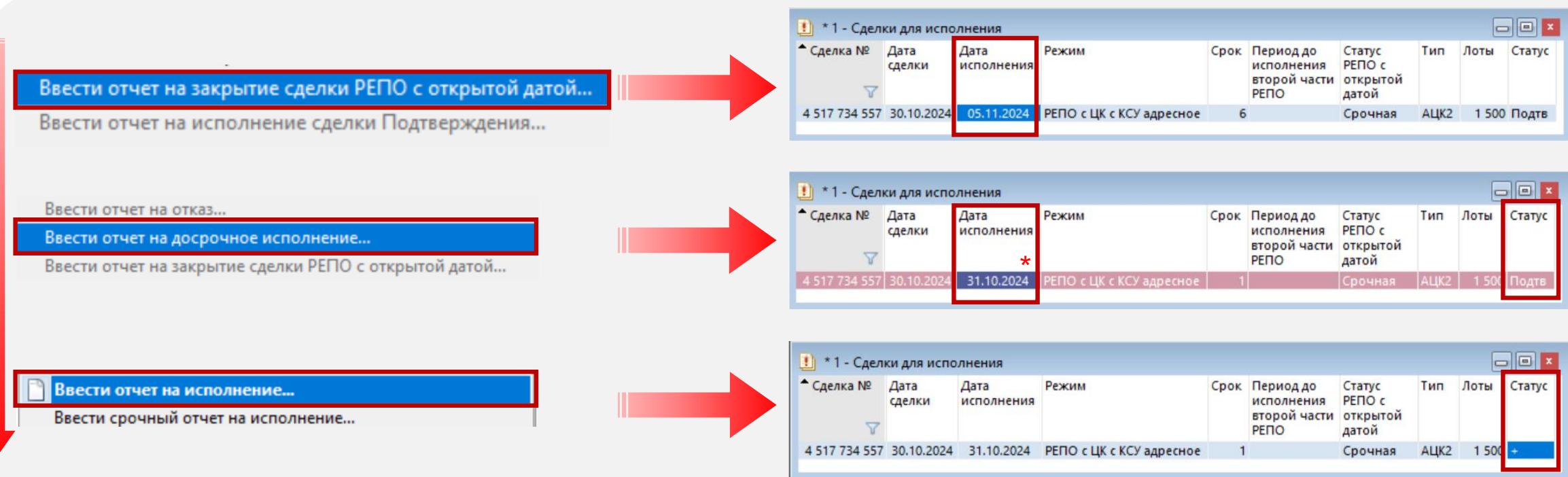
Если срок «EverGreen» (Период до исполнения 2-й части РЕПО) меньше или равен оставшемуся сроку до максимально возможного срока сделки, то сделка автоматически становится срочной к исполнению.

# ИСПОЛНЕНИЕ СДЕЛОК РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ С ОПЦИЕЙ «EVERGREEN»

Так же в сделках РЕПО с открытой датой с опцией «EverGreen» доступны стандартные инструменты исполнения сделки:

- В дату заключения сделки, после подачи отчета на закрытие сделки РЕПО с ЦК с открытой датой (слайд №5), со следующего расчетного дня можно подать поручение на досрочное исполнение приблизив дату второй части в текущую дату и при необходимости исполнить отчетом на исполнение.

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



\* В примере 31/10/2024 - текущая дата

# ОСОБЕННОСТИ ТАРИФИКАЦИИ РЕПО С ОТКРЫТОЙ ДАТОЙ С ОПЦИЕЙ «EVERGREEN»

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

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

## Пример EVERGREEN 30дн.

В дату заключения сделки РЕПО  
торговая и клиринговая  
комиссия взимается отдельно



Ежедневное списание  
клиринговой комиссии =  
(торговая + клиринговая)



Поручение на закрытие  
сделки РЕПО с открытой  
датой с опцией EverGreen



Списание комиссии за весь  
период EverGreen (30

EVERGREEN <=30

Максимально возможный  
срок РЕПО / Дата  
исполнения 2й ч. РЕПО

\* Стандартная тарификация РЕПО с открытой датой осуществляется ежедневно:

- в дату заключения сделки – отдельно торговая и клиринговая составляющие;
- со следующего расчетного дня после даты исполнения первой части РЕПО – только клиринговая составляющая в сумме клиринговая + торговая.

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

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

## SEM02

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

## SEM03

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

## SEM02RQ

BoardId	BoardName	BuySell	SecShortName	RateType	Benchmark	QuoteRate	QuoteValue	QuotePeriod	EvergreenPeriod	SettleCode
PSGC	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	B	КСУ обл.	FLOATING	RUSFAR1M	0,3	111000000	140	77	Y0
PSGC	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	B	КСУ обл.	FIX		27	79000000	360	161	Y0
PSRP	РЕПО с ЦК адресное	B	МосБиржа	FLOATING	RUSFAR	0,3	100000000	120	35	Y0
PSRP	РЕПО с ЦК адресное	B	МосБиржа	FLOATING	RUSFAR	0,3	150000000	120	35	Y0
RPMO	РЕПО-М	S	МосБиржа	FIX		23	50000000	90	30	S0
RPMO	РЕПО-М	S	МосБиржа	FIX		23	50000000	90	30	S0

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

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

Комиссия за период до исполнения 2й части сделок РЕПО с открытой датой «EverGreen» включается в отчет **EQM13, EQM15 (FeeType: 351)** и отдельно отражается в отчете **EQM06** и **EQM151**.

## EQM06 (в дату заключения сделки)

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

Отдельно торговая отдельно  
клиринговая комиссия

Период до исполнения 2й части  
сделок РЕПО с открытой датой

## EQM151 (в дату заключения сделки)

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

Отдельно торговая отдельно  
клиринговая комиссия

Суммарная комиссия  
нарастающим итогом

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

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

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

# 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 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. Доступ к настоящему документу предназначен только для заинтересованных лиц на том основании, что: (A) 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 (B) 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 (a) 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 (a) 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.