



МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

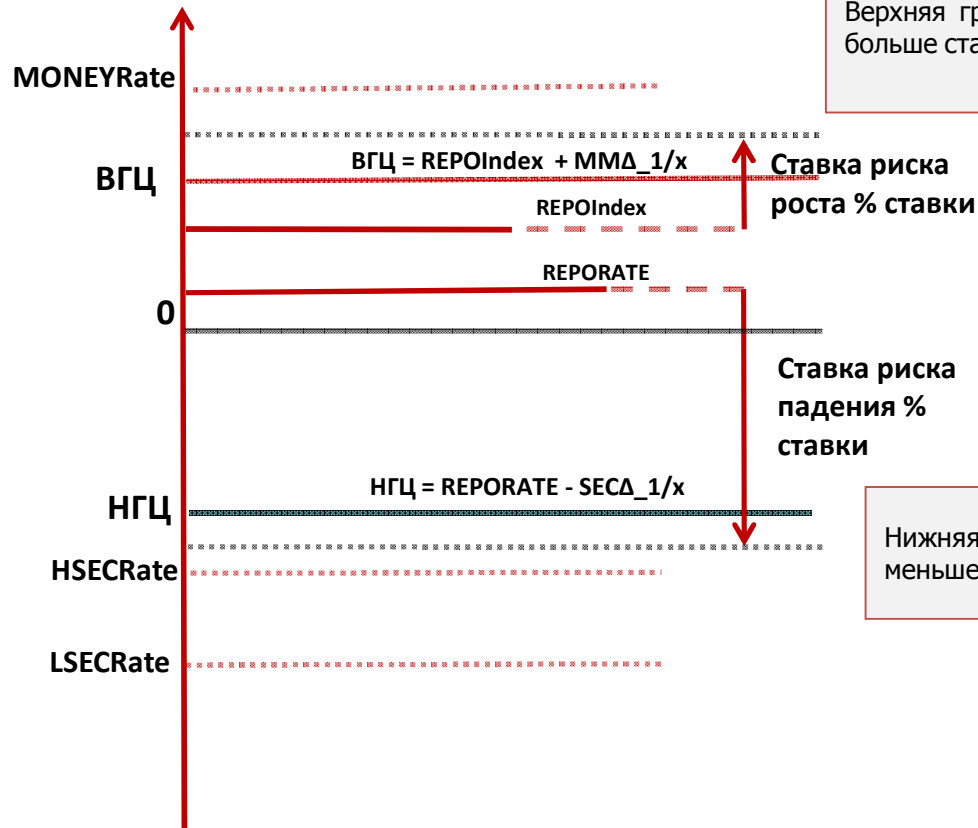


Асимметрия границ ставок РЕПО
(изменение с 20.06.2016 на ФР)

Определение ставок РЕПО с учетом асимметрии (для сроков Y0/Y1 и Y0/Y1W)

Параметры, устанавливаемые Банком НКЦ (АО):

ММД_1 – минимальная ставка роста процентного риска
 SECD_1 – минимальная ставка падения процентного риска
 MONEYRate – ставка переноса по рублям
 HSECRate - верхний ограничительный уровень ставки переноса
 LSECRate – нижний ограничительный уровень ставки переноса



Верхняя граница коридора РЕПО Y0/Y1 (ВГЦ) не может быть больше ставки переноса по рублям (MONEYRate)

REPORATE определяется как минимальное значение из REPOIndex, средневзвешенной цены и цены закрытия

REPOIndex - индикатор РЕПО, рассчитанного по группе бумаг, устанавливается по каждой ценной бумаге.

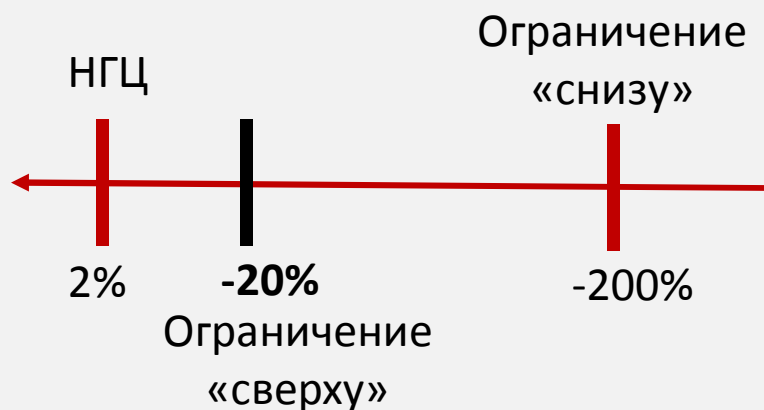
Нижняя граница ценового коридора (НГЦ) не может быть меньше LSECRate



Штрафная ставка переноса обязательств по ценным бумагам

- определяется в **16-00** каждый торговый день
- ограничена «сверху» и «снизу» уровнями **HSECRate*** и **LSECRate*** соответственно
- равна нижней границе Ценового коридора РЕПО Y0/Y1 при условии, что НГЦ **не превышает** верхнего ограничительного уровня

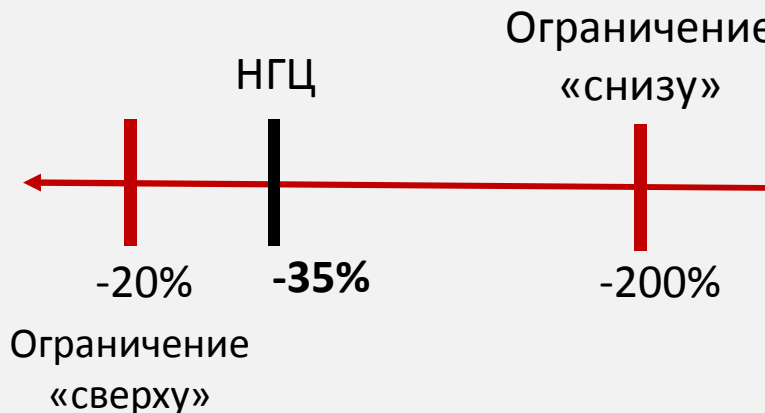
Пример:



Ситуация 1:

нижняя граница цены (НГЦ) +2%
ограничение сверху -20%
штрафная ставка = **-20%**

Пример:



Ситуация 2:

нижняя граница цены (НГЦ) -35%
ограничение сверху -20%
штрафная ставка = **-35%**

* Параметры, устанавливаемые решением НКЦ, могут быть изменены в зависимости от рыночной ситуации



Информирование участников

Информация об изменениях штрафной ставки: оповещения в ТС и на сайте НКЦ, а также <http://nkcbank.ru/fondMarketRates.do>

РЫНОЧНЫЕ РИСКИ НА ДАТУ 27.06.2016

- Рыночные риски на заданную дату
- Динамика рыночных рисков по инструменту

Выберите бумагу

1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 56 >>

ИНСТРУМЕНТ	ДИАПАЗОН	НАЧАЛО ДИАПАЗОНА, ШТ.	КОНЕЦ ДИАПАЗОНА, ШТ.	СТАВКА РИСКА ПАДЕНИЯ ЦЕНЫ, %	СТАВКА РИСКА РОСТА ЦЕНЫ, %	НИЖНЯЯ ГРАНИЦА, РУБ.	РАСЧЕТНАЯ ЦЕНА, РУБ.	ВЕРХНЯЯ ГРАНИЦА, РУБ.	ШТРАФНАЯ СТАВКА ЗА ПЕРЕНОС ПОЗИЦИИ ПО БУМАГАМ, %	ШТРАФНАЯ СТАВКА ЗА ПЕРЕНОС ПОЗИЦИИ ПО ДЕНЬГАМ, %	П/О
ABRD	1	0	2 000	100.00	100.00	0.0000000	81.4057000	162.8114000	-20.00	21.00	
ABRD	2	2 000	2 001	100.00	100.00	0.0000000	81.4057000	162.8114000	-20.00	21.00	
ABRD	3	2 001		100.00	100.00	0.0000000	81.4057000	162.8114000	-20.00	21.00	
AESL	1	0	2 000	100.00	100.00	0.0000000	79.4080000	158.8160000	-20.00	21.00	

Информация о границах процентных рисков: оповещения в ТС и на сайте НКЦ, а также <http://nkcbank.ru/fondPercentRates.do>

ПРОЦЕНТНЫЕ РИСКИ НА ДАТУ 27.06.2016

- Процентные риски на заданную дату
- Динамика процентных рисков по инструменту

Выберите бумагу

1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 112 >>

ИНСТРУМЕНТ	ДАТА РАСЧЕТОВ	ДИАПАЗОН	НАЧАЛО ДИАПАЗОНА, ШТ.	КОНЕЦ ДИАПАЗОНА, ШТ.	НИЖНЯЯ ГРАНИЦА, РУБ.	ВЕРХНЯЯ ГРАНИЦА, РУБ.	РАСЧЕТНАЯ СТАВКА РЕПО, РУБ.	НИЖНЯЯ ГРАНИЦА, %	ВЕРХНЯЯ ГРАНИЦА, %	П/О
ABRD	28.06.2016	1	0	2 000	-0.0210000	0.0570000	0.0236000	-9.43	25.57	
ABRD	28.06.2016	2	2 000	2 001	-0.0210000	0.0570000	0.0236000	-9.43	25.57	
ABRD	28.06.2016	3	2 001		-0.0210000	0.0570000	0.0236000	-9.43	25.57	
ABRD	28.06.2016	4	2 002	2 003	-0.0210000	0.0570000	0.0236000	-9.43	25.57	

