

УТВЕРЖДЕНЫ

Правлением ПАО Московская Биржа
09 августа 2019 года, Протокол № 45

Председатель Правления
ПАО Московская Биржа



Ю.О. Денисов

ПРАВИЛА использования Системы торгов ПАО Московская Биржа при проведении отборов заявок кредитных организаций на заключение договоров репо с Федеральным казначейством

1. Термины и определения

1.1. В целях настоящих Правил применяются следующие термины и определения:

- 1.1.1. *Договор репо* - договор, заключенный Федеральным казначейством (далее – Казначейство) и Участником, в соответствии с которым Казначейство размещает средства у Участника при осуществлении операций по управлению остатками средств на едином счете федерального бюджета в части покупки (продажи) ценных бумаг по договорам репо, в установленной сумме и в установленный срок, в порядке и на условиях, определяемых в соответствии с нормативными правовыми актами, актами Казначейства, регулирующими порядок осуществления операций по управлению остатками средств на едином счете федерального бюджета в части покупки (продажи) ценных бумаг по договорам репо, настоящими Правилами и Генеральным соглашением (как определено ниже);
- 1.1.2. *Генеральное соглашение* - генеральное соглашение о покупке (продаже) ценных бумаг по договорам репо, заключенное между Участником и Казначейством (территориальным органом Казначейства) в соответствии с нормативными правовыми актами и актами Казначейства, регулирующими порядок осуществления операций по управлению остатками средств на едином счете федерального бюджета в части покупки (продажи) ценных бумаг по договорам репо;
- 1.1.3. *Участник* - кредитная организация - резидент Российской Федерации, допущенная Биржей к участию в совершении операций при проведении отборов заявок кредитных организаций на заключение договоров репо с Федеральным казначейством в соответствии с Регламентом допуска;

- 1.1.4. *Идентификатор Участника* - уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Участнику для получения технического доступа к Системе торгов Биржи;
- 1.1.5. *ПТК Биржи* - совокупность программно-технических средств Биржи, используемых для обслуживания Участников и Казначейства;
- 1.1.6. *Система торгов Биржи* - подсистема ПТК Биржи – Система информационного обеспечения отбора заявок, предназначенная для регистрации в порядке, предусмотренном настоящими Правилами Заявок Участников с целью определения условий заключаемых по итогам отбора заявок Договоров репо между Казначейством и Участниками, подготовки отчетных и иных документов, а также выполнения иных действий, предусмотренных настоящими Правилами;
- 1.1.7. *Заявка* - заявка на заключение Договора репо, подаваемая Участником в Систему торгов Биржи согласно настоящим Правилам;
- 1.1.8. *Биржа* - Публичное акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС»;
- 1.1.9. *Регламент допуска* - Регламент допуска к участию в операциях на Денежном рынке ПАО Московская Биржа, утвержденный уполномоченным органом Биржи;
- 1.1.10 *Маклер* - сотрудник Биржи, надлежащим образом уполномоченный Биржей для организации работ по обеспечению проведения отборов заявок кредитных организаций и заключения Договоров репо, а также выполнения иных действий, предусмотренных настоящими Правилами;
- 1.1.11 *Правила ЭДО* - Правила электронного документооборота, утвержденные уполномоченным органом Биржи;
- 1.1.12 *Клиринговая организация* - Небанковская кредитная организация акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий».

1.2. Термины и определения, применяемые в целях настоящих Правил (за исключением терминов и определений, указанных в п. 1.1 настоящих Правил), используются в том смысле, в каком они понимаются в нормативных правовых актах Российской Федерации, актах Казначейства, регулирующих порядок осуществления операций по управлению остатками средств на едином счете федерального бюджета в части покупки (продажи) ценных бумаг по договорам репо, Правилах ЭДО и Регламенте допуска.

2. Общие положения

2.1. Настоящие Правила разработаны в соответствии с нормативными правовыми актами Российской Федерации и актами Казначейства, регулиющими порядок осуществления операций по управлению остатками средств на едином счете федерального бюджета в части покупки (продажи) ценных бумаг по договорам репо, и устанавливают порядок использования Системы торгов Биржи при проведении отборов

Заявок кредитных организаций на заключение договоров репо с Федеральным казначейством.

2.2. На основании предоставленной Казначейством информации, содержащей условия проведения отбора Заявок, Биржа формирует коды инструментов в соответствии с Приложением №1 к настоящим Правилам.

2.3. Максимальное количество Заявок, которое может подавать Участник в ходе одного отбора Заявок, устанавливается Казначейством при определении условий проведения отбора Заявок.

Сведения о зарегистрированных в Системе торгов Биржи Заявках Участников, а также о заключённых Договорах репо, содержатся в формируемых в электронной форме Реестре заявок и Реестре Договоров репо, соответственно.

2.4. Заявка, подаваемая Участником в Систему торгов Биржи в соответствии с настоящими Правилами, представляет собой электронное сообщение, подписанное аналогом собственноручной подписи Участника (далее – АСП Участника) и содержащее реквизиты, предусмотренные Приложением №5 к настоящим Правилам. Заявка Участника признается документом, являющимся предложением Участника заключить Договор репо на условиях, содержащихся в Заявке.

АСП Участника признается Торговый идентификатор Участника (далее – Торговый идентификатор), позволяющий однозначно идентифицировать Участника, подавшего в Систему торгов Биржи Заявку (документ, подтверждающий снятие Заявки), и достоверно установить, что Заявка (документ, подтверждающий снятие Заявки) исходит от Участника, которому присвоен данный Торговый идентификатор.

Заявка (документ, подтверждающий снятие Заявки), подаваемая Участником в Систему торгов Биржи в соответствии с настоящими Правилами, признается электронным документом, равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному собственноручной подписью Участника.

Порядок присвоения Идентификаторов Участников / Торговых Идентификаторов определен в Регламенте допуска.

2.5. Подача Участником Заявки в Систему торгов Биржи означает безусловное согласие Участника заключить с Казначейством в установленном настоящими Правилами и Генеральным соглашением порядке соответствующий Договор репо на условиях, содержащихся в данной Заявке Участника.

2.6. Заявка Участника может быть удовлетворена частично в порядке, предусмотренном настоящими Правилами.

2.7. По результатам регистрации в Системе торгов Биржи Заявок Участников, а также определения перечня заключённых Договоров репо Биржа осуществляет подготовку отчетных документов, предусмотренных настоящими Правилами. Формы отчетных документов определены в Приложениях №№2-3 к настоящим Правилам.

Отчетные документы предоставляются Участнику в виде электронных документов в соответствии с Правилами ЭДО (категории и форматы электронных документов определены в Приложении №4 к настоящим Правилам).

2.8. Биржа осуществляет ведение Реестра заявок за каждый день проведения Казначейством отбора Заявок, в котором отражаются все Заявки Участников, зарегистрированные в Системе торгов Биржи за день. Реестр заявок формируется в

электронной форме и содержит реквизиты, предусмотренные в Приложении №2 к настоящим Правилам.

Биржа осуществляет ведение Реестра Договоров репо за каждый день проведения Казначейством отбора Заявок, по итогам которого были заключены Договоры репо. В этом реестре отражаются все Договоры репо, заключённые по итогам всех отборов Заявок, проведенных Казначейством за день. Реестр Договоров репо формируется в электронной форме и содержит реквизиты, предусмотренные в Приложении №3 к настоящим Правилам.

2.9. Участник вправе на основании письменного запроса получить копии электронных документов на бумажном носителе.

3. Допуск к использованию Системы торгов Биржи

3.1. Для обеспечения возможности использования Системы торгов Биржи для участия в отборе Заявок кредитная организация – резидент Российской Федерации обязана заключить с Федеральным казначейством Генеральное соглашение и осуществить другие действия в соответствии с Регламентом допуска.

3.2. После выполнения Участником требований, предусмотренных п. 3.1 настоящего Раздела, Биржа осуществляет ввод данных об Участнике в базу данных ПТК Биржи. Присвоенные Участнику Торговые идентификаторы Биржа вводит в базу данных ПТК Биржи и автоматически устанавливает им начальные стандартные пароли. В дальнейшем Участник самостоятельно устанавливает себе новые пароли и определяет порядок изменения паролей. Контроль за использованием Торговых идентификаторов и паролей осуществляет Участник. Биржа вправе изменять пароли, соответствующие Торговым идентификаторам Участника, предварительно уведомив об этом Участника.

3.3. Биржа направляет уведомление о присвоенных Участнику Идентификаторе Участника и Торговых идентификаторах в соответствии с Регламентом допуска.

4. Порядок использования Системы торгов Биржи при заключении Договоров репо

4.1. Подача и регистрация Заявок Участника, определение перечня заключаемых Договоров репо, формирование отчётных и иных документов по итогам отбора Заявок производится в порядке, установленном настоящими Правилами.

4.2. Биржа средствами Системы торгов Биржи доводит до сведения Участников, допущенных Казначейством к участию в данном отборе заявок:

- информацию об условиях проводимого отбора заявок, полученную от Казначейства;
- информацию о доступе к отбору заявок, установленную Казначейством в отношении Торговых идентификаторов Участника;
- информацию о величине лимита покупки, в пределах которого Участник вправе подавать Заявки в ходе проводимого отбора заявок (далее - Лимит на заявки), установленных Казначейством в отношении Участника;

4.3. Сумма, указываемая Участником в подаваемой в Систему торгов Биржи Заявке, должна быть кратна размеру Лота (минимально допустимое изменение суммы Договора репо). Размер Лота устанавливается Биржей и равен 1 000 рублей. Процентная ставка или премия к базовой плавающей процентной ставке Договора репо, указываемая

Участником в подаваемой в Систему торгов Биржи Заявке, должна быть кратна размеру Шага ставки (минимально допустимое изменение ставки Договора репо). Размер Шага ставки устанавливается Биржей по согласованию с Казначейством и доводится до сведения Участников.

4.4. В Системе торгов Биржи осуществляется контроль за соответствием условий Заявки Участника ограничениям, установленным Казначейством для соответствующего отбора Заявок. При несоответствии хотя бы одному из условий Заявка Участника в Системе торгов Биржи не регистрируется, в том числе не подлежит регистрации в Системе торгов Биржи Заявка:

- введённая Участником, не включённым в установленный Казначейством перечень Участников, допущенных Казначейством к участию в данном отборе Заявок;
- введённая Участником заявка, подписанная Торговым идентификатором, не включённым в установленный Казначейством перечень Торговых идентификаторов Участников, допущенных Казначейством к участию в данном отборе Заявок;
- введённая Участником, не включённым в установленный Клиринговой организацией перечень Участников, допущенных Клиринговой организацией к клиринговым операциям по договорам репо;
- по итогам регистрации которой с учетом ранее зарегистрированных Заявок данного Участника произойдет превышение установленного Казначейством в отношении данного Участника Лимита на заявки;
- по итогам регистрации которой с учетом ранее зарегистрированных заявок данного Участника с таким же значением процентной ставки Договора репо (или премии к базовой плавающей процентной ставке Договора репо), суммарный объем таких заявок превысит максимальную сумму размещаемых средств, установленную Казначейством для данного отбора Заявок;
- содержащая размер процентной ставки Договора репо / премии к базовой плавающей процентной ставке Договора репо меньше минимального размера процентной ставки Договора репо / минимальной премии к базовой плавающей процентной ставке Договора репо, установленного Казначейством для данного отбора Заявок;
- сумма привлекаемых средств по Договору репо в которой меньше минимальной суммы Заявки Участника, установленной Казначейством для данного отбора Заявок.

4.5. При регистрации Заявки Участника в Системе торгов Биржи фиксируется время ее регистрации.

4.6. Ввод Участниками Заявок прекращается после окончания времени ввода Заявок, установленного Казначейством.

4.7. Участник самостоятельно осуществляет контроль за правильностью введенных им в Систему торгов Биржи Заявок. Для контроля за правильностью введенных в Систему торгов Биржи Заявок Участник имеет возможность получать с помощью средств Системы торгов Биржи информацию о введенных им Заявках.

4.8. Порядок проведения отбора Заявок в открытой и закрытой форме установлен нормативными правовыми актами Российской Федерации и актами Казначейства, регулирующими порядок осуществления операций по управлению остатками средств на

едином счете федерального бюджета в части покупки (продажи) ценных бумаг по договорам репо.

4.9. При использовании Системы торгов Биржи для участия в отборе Заявок Участники имеют доступ:

- для отборов Заявок, проводимых в закрытой форме - только к информации о собственных Заявках;
- для отборов Заявок, проводимых в открытой форме - к информации о собственных Заявках, а также к информации, содержащейся в Заявках, поданных другими Участниками по итогам предварительного периода (на момент окончания предварительного периода) и в период конкуренции (по мере выставления Участниками новых заявок). При этом Участник не имеет доступа к информации об идентификаторах и наименованиях других Участников, выставивших Заявки.

4.10. При проведении Казначейством отбора Заявок в закрытой форме и в предварительном режиме при проведении Казначейством отбора Заявок в открытой форме Система торгов Биржи предоставляет Участнику возможность изменения и снятия введенной им Заявки до установленного Казначейством времени окончания ввода Заявок Участников.

При проведении Казначейством отбора Заявок в открытой форме в режиме конкуренции Система торгов Биржи предоставляет Участнику возможность снятия введенной им ранее Заявки только в случае регистрации вместо нее новой Заявки Участника с теми же параметрами, за исключением процентной ставки Договора репо / премии к базовой плавающей процентной ставке Договора репо, которая может быть изменена только в сторону повышения.

4.11. После получения от Казначейства информации о процентной ставке отсека в Системе торгов Биржи определяется перечень Договоров репо, подлежащих заключению, согласно следующим правилам:

4.11.1. Заявка Участника, зарегистрированная в Системе торгов Биржи и не снятая Участником к моменту окончания времени ввода Заявок Участников (для отбора Заявок в закрытой форме), либо к моменту завершения периода конкуренции (для отбора заявок в открытой форме), подлежит удовлетворению (заключению Договора репо) по указанной в ней процентной ставке Договора репо / премии к базовой плавающей процентной ставке Договора репо:

- в сумме, указанной в Заявке, если указанная в ней процентная ставка Договора репо / премия к базовой плавающей процентной ставке Договора репо превышает процентную ставку отсека;
- в сумме, указанной в Заявке, либо в меньшей сумме, если указанная в ней процентная ставка Договора репо / премия к базовой плавающей процентной ставке Договора репо равна процентной ставке отсека.

4.11.2. Заявки Участника, поданные по процентной ставке отсека, включаются в Реестр Договоров репо с указанием меньшей суммы только в случае, если максимальная сумма размещаемых средств, установленная Казначейством для данного отбора заявок, меньше общей суммы заявок Участников, которые подлежат удовлетворению (заключению Договоров репо) при установлении Казначейством данной процентной ставки отсека.

4.11.3. В случае, предусмотренном в подпункте 4.11.2 настоящего пункта Правил, Заявка Участника, поданная по процентной ставке отсечения, включается в Реестр Договоров репо с указанием меньшей суммы, рассчитанной следующим образом:

а) определяется доля такой Заявки Участника в общей сумме Заявок всех Участников, поданных по процентной ставке отсечения;

б) рассчитывается сумма Договора репо по такой Заявке как произведение доли, определенной в соответствии с подпунктом 4.11.3 а) настоящего пункта Правил, на величину превышения максимального объема размещаемых средств, установленного Казначейством для данного отбора Заявок, над суммой Заявок, удовлетворяемых полностью;

в) если сумма, рассчитанная в соответствии с подпунктом 4.11.3 б) настоящего пункта Правил, равна дробному количеству Лотов, то она округляется в меньшую сторону до ближайшего целого количества Лотов.

4.12. Биржа после получения от Казначейства информации о признании отбора Заявок несостоявшимся средствами Системы торгов Биржи сообщает Участникам, допущенным Казначейством к участию в данном отборе Заявок, о признании Казначейством данного отбора Заявок несостоявшимся.

4.13. После определения в Системе торгов Биржи перечня заключенных Договоров репо, Участнику направляется Выписка из реестра Договоров репо (по форме Приложения №3 к настоящим Правилам).

4.14. На основании запроса Участника Биржа предоставляет Участнику Выписку из реестра Заявок (по форме Приложения №2 к настоящим Правилам) по итогам дня.

В Выписке из реестра Заявок отражаются реквизиты поданных данным Участником в Систему торгов Биржи Заявок с указанием, был ли по данной Заявке заключён Договор репо или нет.

5. Исполнение Договоров репо

5.1. По итогам проведения отбора Заявок и заключения Договоров репо Биржа направляет информацию о заключённых Договорах репо в Клиринговую организацию для дальнейшего проведения Клиринговой организацией клиринга и расчетов по этим Договорам репо.

5.2. Исполнение Договоров репо осуществляется в соответствии с Генеральным соглашением, заключенным между Участником и Казначейством в соответствии с требованиями нормативных правовых актов Российской Федерации, актов Казначейства, регулирующих порядок осуществления операций по управлению остатками средств на едином счете федерального бюджета в части покупки (продажи) ценных бумаг по договорам репо, договоров Участников и Казначейства с Клиринговой организацией и документов, регламентирующих деятельность Клиринговой организации.

6. Маклер

6.1. Со стороны Биржи полномочия по обеспечению исполнения настоящих Правил возлагаются на Маклера.

6.2. Маклер имеет право:

а) осуществлять подготовку Системы торгов Биржи;

б) управлять проведением отбора Заявок, а также осуществлять взаимодействие с уполномоченными представителями подразделений Биржи, организаций, уполномоченных Биржей выполнять функции представителей Биржи, Технических центров доступа Участников в Систему торгов Биржи;

в) подписывать отчётные и другие документы по итогам отбора Заявок;

г) делать объявления (сообщения) по вопросам, связанным с порядком проведения отбора Заявок с использованием Системы торгов Биржи;

д) осуществлять другие действия, необходимые для исполнения настоящих Правил и договоров, заключенных в соответствии с настоящими Правилами и Регламентом допуска.

6.3. Маклер обязан:

а) осуществлять своевременную подготовку Системы торгов Биржи;

б) управлять проведением отбора Заявок с использованием Системы торгов Биржи в соответствии с Разделом 4 настоящих Правил;

в) обеспечивать учёт и хранение отчётных документов по итогам отборов Заявок.

7. Порядок приостановления, прекращения и возобновления отборов Заявок

7.1. Биржа вправе принять решение о приостановлении и/или прекращении отборов Заявок, проводимых в соответствии с настоящими Правилами, при возникновении ситуаций, вызывающих невозможность и/или создающих предпосылки к невозможности эксплуатации Системы торгов Биржи и/или препятствующих ее нормальному функционированию в отношении Биржи, Участников или Казначейства (в том числе в случае возникновения обстоятельств непреодолимой силы).

7.2. Под приостановлением отборов Заявок в рамках настоящих Правил понимается приостановка отбора Заявок в ходе его проведения, а также отсрочка начала проводимого отбора Заявок на условиях отбора заявок Казначейства в день отбора Заявок.

7.3. Под прекращением отборов Заявок в рамках настоящих Правил понимается прекращение, перенос или отмена отбора Заявок в ходе его проведения на условиях отбора Заявок Казначейства.

7.4. Обстоятельствами непреодолимой силы являются чрезвычайные и непредотвратимые обстоятельства, не подлежащие разумному контролю, в том числе такие как наводнение, пожар, землетрясение и другие природные явления, а также военные действия, блокада, забастовки, массовые беспорядки, повлекшие нарушения в работе Биржи, запретительные действия властей, акты государственных органов, затрагивающие работу Биржи, разрушения или значительные повреждения занимаемых Биржей помещений.

7.5. В случае принятия решения о приостановке и/или прекращении и/или возобновлении отбора Заявок Биржа обеспечивает соответствующее уведомление Участников средствами Системы торгов Биржи (при наличии такой возможности), а также путем размещения сообщения на сайте Биржи в сети Интернет (при наличии такой возможности) или иными доступными средствами связи.

7.6. После прекращения ситуации, послужившей основанием для приостановки отбора Заявок, отбор Заявок по решению Биржи может быть возобновлен или прекращен.

7.7. Биржа не несёт ответственности за убытки, которые могут возникнуть у Участника в связи с возникновением указанной в настоящем Разделе ситуации и ее последствиями.

8. Ответственность

8.1. За нарушение Участником требований настоящих Правил Участник несет ответственность, предусмотренную законодательством Российской Федерации, настоящим Разделом Правил, Регламентом допуска и Договором об участии в Системе торгов Биржи.

8.2. За нарушение порядка участия в отборах Заявок, проводимых Казначейством с использованием Системы торгов Биржи, а также при совершении Участником действий, которые препятствуют или могут воспрепятствовать нормальному функционированию ПТК Биржи (Системы торгов Биржи), Биржей могут быть применены к Участнику следующие меры:

8.2.1. Приостановление допуска Участника к участию в проводимых Казначейством отборах Заявок;

8.2.2. Прекращение допуска Участника к участию в проводимых Казначейством отборах Заявок.

8.3. Решение о применении к Участнику одной из перечисленных пунктами 8.2.1 и 8.2.2 настоящего Раздела Правил мер принимается Биржей. Уведомление о принятом решении направляется Участнику в порядке, определенном Регламентом допуска.

8.4. Возобновление допуска Участника, допуск которого ранее был приостановлен в соответствии с п. 8.2.1 настоящего Раздела Правил, к участию в проводимых Казначейством отборах Заявок возможно по решению Биржи только после устранения причин, повлекших за собой приостановление допуска такому Участнику.

8.5. Приостановление или прекращение допуска Участника к участию в проводимых Казначейством отборах Заявок в соответствии с п. 8.2 настоящего Раздела Правил лишает Участника возможности участия в отборах Заявок, проводимых Казначейством с использованием Системы торгов Биржи, и заключения по их итогам Договоров репо.

9. Конфиденциальная информация

9.1. Участник не имеет права разглашать информацию, связанную с ходом и итогами проведения Казначейством с использованием Системы торгов Биржи отборов Заявок.

9.2. В случае разглашения Участником информации о ходе и итогах проведения Казначейством с использованием Системы торгов Биржи отборов Заявок к Участнику может применяться один из видов ответственности, предусмотренных в п.8.2 Раздела 8 настоящих Правил.

10. Оповещение Участников (предоставление информации)

В рамках настоящих Правил Биржа осуществляет оповещение Участников в порядке, предусмотренном Регламентом допуска (если иной порядок оповещения (предоставления информации) не предусмотрен в настоящих Правилах).

11. Порядок разрешения споров

11.1. Все гражданско-правовые споры и разногласия, возникающие в связи с осуществлением деятельности на Бирже в соответствии с настоящими Правилами, подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражном суде г. Москвы в соответствии с документами, определяющими его правовой статус и порядок разрешения споров, действующими на момент подачи искового заявления.

11.2. Решения Арбитражного суда г. Москвы являются окончательными и обязательными для сторон. Неисполненное добровольно решение Арбитражного суда г. Москвы подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством иной страны места принудительного исполнения и/или международными соглашениями.

12. Заключительные положения

12.1. Настоящие Правила, а также изменения и дополнения в них утверждаются уполномоченным органом Биржи.

12.2. О вступлении в силу настоящих Правил (изменений и дополнений в них) Участники извещаются путем раскрытия на сайте Биржи в сети Интернет информационного сообщения о дате вступления их в силу и текста документа.

Приложение № 1

**к Правилам использования Системы торгов ПАО
Московская Биржа при проведении отборов
заявок кредитных организаций на заключение
договоров репо с Федеральным казначейством**

Порядок присвоения кодов инструментов

Код инструмента для отбора Заявок: RTR_ X₁_X₂_X₃, где:

X₁ – кодовое обозначение типа процентной ставки Договора репо («FX» - фиксированная, «FL» - плавающая);

X₂ – кодовое обозначение валюты Договора репо («RUB» - рубли РФ);

X₃ – кодовое обозначение условий заключения Договора репо («T» - срочный; «S» - особый).

**Приложение № 2
к Правилам использования Системы торгов
ПАО Московская Биржа при проведении
отборов заявок кредитных организаций на
заключение договоров репо с Федеральным
казначейством**

Выписка из реестра Заявок

Вид: электронный документ

Формат: XML

Наименование: <IDIDIDI>_FRP01_F00_<ДДММГГ>.xml, где <IDIDIDI> - сокращенное значение Идентификатора участника, <ДДММГГ> - дата формирования файла

Структура:

| Название тегов | Название атрибутов | Описание | Обязательно | Тип | Размер | Десятичные знаки |
|-------------------|--------------------|----------------------------------------------------------------------------|-------------|-----------|--------|------------------|
| MICEX_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа. | Да | | | |
| DOC_REQUISITIONS | | Блок информации о файле | Да | | | |
| | DOC_DATE | Дата формирования файла | Да | Date | | |
| | DOC_TIME | Время формирования файла | Да | Time | | |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота | Нет | Character | 1-12 | |
| | DOC_TYPE_ID | Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота | Нет | Character | 1-12 | |
| | SENDER_ID | Идентификатор отправителя | Нет | Character | 1-12 | |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | Нет | Character | 1-30 | |
| | RECEIVER_ID | Идентификатор получателя | Нет | Character | 1-12 | |
| | REMARKS | Текст примечания к файлу | Нет | Character | 1-120 | |
| /DOC_REQUISITIONS | | Завершение блока информации о документе | | | | |
| FRP01 | | Блок данных о Заявках | Да | | | |
| | VER | Ограничения на версию документа FRP01 | Да | Character | 3-12 | |
| FRP01_AUCTIONS | | Данные об отборах Заявок | Да | | | |
| | TRADEDATE | Дата проведения отбора Заявок | Да | Date | | |

| | | | | | | |
|---------------|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|-----------|-------|--|
| | EXCHANGE | Наименование Биржи (ПАО Московская Биржа) | Да | Character | 1-30 | |
| | FIRMID | Идентификатор Участника | Да | Character | 12 | |
| | FIRMNAME | Наименование Участника | Да | Character | 1-120 | |
| | ORGANIZERID | Идентификатор Федерального казначейства | Да | Character | 12 | |
| | ORGANIZERNAME | Наименование Федерального казначейства | Да | Character | 1-120 | |
| FRP01_AUCTION | | Данные об отборе Заявок | Да | | | |
| | BOARDID | Режим проведения операций | Да | Character | 4 | |
| | BOARDNAME | Наименование режима проведения операций | Да | Character | 1-30 | |
| | SECURITYID | Код инструмента | Да | Character | 9-12 | |
| | CURRENCYID | Валюта Договора репо | Да | Character | 3 | |
| | RATE_TYPE | Тип процентной ставки Договора репо: фиксированная «FIXED» или плавающая «FLOATING_*****», где ***** - обозначение кода базовой плавающей процентной ставки размещения средств | Да | Character | 10-17 | |
| | AUCTION_ID | Уникальный идентификатор отбора Заявок | Да | Character | 1-12 | |
| | SETTLEDATE1 | Дата размещения средств | Да | Date | | |
| | SETTLEDATE2 | Дата возврата средств | Да | Date | | |
| | TERM | Срок Договора репо (календарных дней) | Да | Number | 11 | |
| | DEAL_TYPE | Вид Договора репо: значение «S» - обычный, значение «O» - особый | Нет | Character | 1 | |
| | COLLATERAL_TYPE | Код корзины обеспечения | Да | Character | 12 | |
| | KV_TYPE | Возможность компенсационного взноса: значение «Y» - да, значение «N» - нет (по правилам Клиринговой организации) | Нет | Character | 1 | |
| | NETT_TYPE | Возможность взаимозачетов: значение «Y» - да, значение «N» - нет (по правилам Клиринговой организации) | Нет | Character | 1 | |
| | EXCHANGE_TYPE | Возможность замены бумаг: значение «Y» - да, значение «N» - нет (по | Нет | Character | 1 | |

| | | | | | | |
|--------------|--------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|-----------|----|---|
| | | правилам Клиринговой организации) | | | | |
| | PAY_TIME | Время расчетов (клиринговый сеанс). Значения: «1», «2», «3» или «4» (по правилам Клиринговой организации) | Нет | Number | 1 | 0 |
| | PAY_TYPE | Тип расчетов в Клиринговой организации | Да | Character | 4 | |
| FRP01_REC | | Данные о Заявке | Нет | | | |
| | REC_NUMBER | Номер по порядку | Да | Number | 11 | |
| | ORDER_NUMBER | Номер Заявки в Системе торгов Биржи | Да | Number | 11 | |
| | STATUS | Состояние заявки: С – Заявка снята Биржей по завершении периода сбора Заявок, М – Заявка подлежит удовлетворению по итогам отбора заявок, W – Заявка снята Участником | Да | Character | 1 | |
| | RATE | Процентная ставка Договора репо или премия к базовой плавающей процентной ставке Договора репо, % годовых | Да | Number | 20 | 2 |
| | TRADERID | Торговый идентификатор | Да | Character | 12 | |
| | BUYSELL | Вид Заявки: "В"-привлечение денежных средств | Да | Character | 1 | |
| | AMOUNT | Сумма Договора репо (в валюте Договора репо) | Да | Number | 20 | 2 |
| | ENTRYTIME | Время введения заявки в Систему торгов Биржи | Да | Time | | |
| | AMENDTIME | Время снятия заявки из Системы торгов Биржи | Нет | Time | | |
| | EXTREF | Примечание | Нет | Character | 12 | |
| / | | Завершение записи о Заявке | | | | |
| /FRP01_AUC | | Завершение записи об отборе Заявок | | | | |
| TION | | | | | | |
| /FRP01_AUCTI | | Завершение записи об отборах Заявок | | | | |
| ONS | | | | | | |
| /FRP01 | | Завершение записи о Заявках | | | | |
| /MICEX_DOC | | Завершение документа | | | | |

Приложение № 3
к Правилам использования Системы торгов
ПАО Московская Биржа при проведении
отборов заявок кредитных организаций на
заключение договоров репо с Федеральным
казначейством

Выписка из Реестра Договоров репо

Вид: электронный документ

Формат: XML

Наименование: <IDIDIDI>_FRP06_F<NN>_<ДДММГГ>.xml, где <IDIDIDI> - сокращенное значение Идентификатора участника, <NN> - номер файла в течении дня (01, 02 и т.д.), <ДДММГГ> - дата формирования файла

Структура:

| Название тегов | Название атрибутов | Описание | Обязательно | Тип | Размер | Десятичные знаки |
|-------------------|--------------------|----------------------------------------------------------------------------|-------------|-----------|--------|------------------|
| MICEX_DOC | | Корневой элемент (root element) XML документа. | Да | | | |
| DOC_REQUISITIONS | | Блок информации о файле | Да | | | |
| | DOC_DATE | Дата формирования файла | Да | Date | | |
| | DOC_TIME | Время формирования файла | Да | Time | | |
| | DOC_NO | Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота | Нет | Character | 1-12 | |
| | DOC_TYPE_ID | Идентификатор типа документа в системе электронного документооборота | Нет | Character | 1-12 | |
| | SENDER_ID | Идентификатор отправителя | Нет | Character | 1-12 | |
| | SENDER_NAME | Краткое наименование отправителя | Нет | Character | 1-30 | |
| | RECEIVER_ID | Идентификатор получателя | Нет | Character | 1-12 | |
| | REMARKS | Текст примечания к файлу | Нет | Character | 1-120 | |
| /DOC_REQUISITIONS | | Завершение блока информации о документе | | | | |
| FRP06 | | Блок данных о Договорах репо | Да | | | |
| | VER | Ограничения на версию документа FRP06 | Да | Character | 3-12 | |
| FRP06_AUCTION | | Данные об отборе Заявок | Да | | | |
| | TRADEDATE | Дата проведения отбора Заявок | Да | Date | | |

| | | | | |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|-----------|-------|
| EXCHANGE | Наименование Биржи (ПАО Московская Биржа) | Да | Character | 1-30 |
| FIRMID | Идентификатор Участника | Да | Character | 12 |
| FIRMNAME | Наименование Участника | Да | Character | 1-120 |
| ORGANIZERID | Идентификатор Федерального казначейства | Да | Character | 12 |
| ORGANIZERNAME | Наименование Федерального казначейства | Да | Character | 1-120 |
| BOARDID | Режим проведения операций | Да | Character | 4 |
| BOARDNAME | Наименование режима проведения операций | Да | Character | 1-30 |
| SECURITYID | Код инструмента | Да | Character | 9-12 |
| CURRENCYID | Валюта Договора репо | Да | Character | 3 |
| RATE_TYPE | Тип процентной ставки Договора репо: фиксированная «FIXED» или плавающая «FLOATING_*****», где ***** - обозначение кода базовой плавающей процентной ставки размещения средств | Да | Character | 10-17 |
| DISCOUNT_RATE | Фиксированный дисконт для плавающей ставки (при наличии) | Нет | Number | 8,4 |
| AUCTION_ID | Уникальный идентификатор отбора заявок | Да | Character | 1-12 |
| SETTLEDATE1 | Дата размещения средств | Да | Date | |
| SETTLEDATE2 | Дата возврата средств | Да | Date | |
| TERM | Срок Договора репо (календарных дней) | Да | Number | 11 |
| DEAL_TYPE | Вид Договора репо: значение «S» - обычный, значение «O» - особый | Нет | Character | 1 |
| COLLATERAL_TYPE | Код корзины обеспечения | Да | Character | 12 |
| KV_TYPE | Возможность компенсационного взноса: значение «Y» - да, значение «N» - нет (по правилам Клиринговой организации) | Нет | Character | 1 |
| NETT_TYPE | Возможность взаимозачетов: значение «Y» - да, значение «N» - нет (по правилам Клиринговой организации) | Нет | Character | 1 |
| EXCHANGE_TYPE | Возможность замены бумаг: значение «Y» - да, | Нет | Character | 1 |

| | | | | | | |
|-----------|---------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|-----------|----|---|
| | | значение «N» - нет (по правилам Клиринговой организации) | | | | |
| | PAY_TIME | Время расчетов (клиринговый сеанс). Значения: «1», «2», «3» или «4» (по правилам Клиринговой организации) | Нет | Number | 1 | 0 |
| | PAY_TYPE | Тип расчетов в Клиринговой организации | Да | Character | 4 | |
| FRP06_REC | | Данные о Заявке, подлежащей удовлетворению | Нет | | | |
| | REC_NUMBER | Номер по порядку | Да | Number | 11 | |
| | TRADE_NUMBER | Номер записи о заявке в Системе торгов Биржи, подлежащей удовлетворению | Да | Number | 11 | |
| | ORDER_NUMBER | Номер заявки в Системе торгов Биржи | Да | Number | 11 | |
| | RATE | Процентная ставка Договора репо или премия к базовой плавающей процентной ставке Договора репо, % годовых | Да | Number | 20 | 2 |
| | TRADERID | Торговый идентификатор | Да | Character | 12 | |
| | BUYSELL | Вид Заявки: "B"-привлечение денежных средств | Да | Character | 1 | |
| | PART1AMOUNT | Сумма Договора репо (в валюте Договора репо) | Да | Number | 20 | 2 |
| | COMMISSION | Суммарное комиссионное вознаграждения Биржи (в рублях) | Да | Number | 20 | 2 |
| | COMMISSIONTRD | Комиссионное вознаграждение Биржи за торги (в рублях) | Да | Number | 20 | 2 |
| | COMMISSIONITS | Комиссионное вознаграждение Биржи за Интегрированный технологический сервис (в рублях) | Да | Number | 20 | 2 |
| | PERCAMOUNT | Сумма процентов (в валюте Договора репо). Для Договоров репо по плавающей процентной ставке не заполняется | Нет | Number | 20 | 2 |
| | PART2AMOUNT | Сумма возврата (в валюте Договора репо). Для Договоров репо по плавающей процентной ставке не заполняется | Нет | Number | 20 | 2 |
| | EXTREF | Примечание | Нет | Character | 12 | |
| / | | Завершение записи о Договоре репо | | | | |

| | | | | | | |
|--------------------|--|---------------------------------------|--|--|--|--|
| /FRP06_AUC TION | | Завершение записи об отборе Заявок | | | | |
| /FRP06 | | Завершение записи о Договорах репо | | | | |
| /MICEX_DOC | | Завершение документа | | | | |

Приложение № 4
к Правилам использования Системы торгов
ПАО Московская Биржа при проведении
отборов заявок кредитных организаций на
заключение договоров репо с Федеральным
казначейством

Форматы электронных документов

| Название документа | Категория* | Формат файла | Форма электронного документа |
|--------------------------------------|-------------------|---------------------|-------------------------------------|
| 1. Выписка из Реестра Заявок | «В» | XML | Приложение №2 к настоящим Правилам |
| 2. Выписка из Реестра Договоров репо | «В» | XML | Приложение №3 к настоящим Правилам |

* Понятие категории электронного документа определяется в соответствии с Правилами ЭДО.

Приложение № 5
к Правилам использования Системы торгов
ПАО Московская Биржа при проведении
отборов заявок кредитных организаций на
заключение договоров репо с Федеральным
казначейством

Реквизиты Заявки Участника

| № п/п | Название полей | Содержание |
|--------------|----------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. | Идентификатор Участника | Идентификатор Участника в Системе торгов Биржи (однозначно определяет наименование кредитной организации) |
| 2. | Торговый идентификатор (АСП Участника) | Торговый идентификатор в Системе торгов Биржи |
| 3. | Код инструмента | Код инструмента в Системе торгов Биржи |
| 4. | Сумма | Сумма привлечения средств по Договору репо (в валюте отбора Заявок) |
| 5. | Процентная ставка или премия | Заявленная процентная ставка Договора репо или премия к базовой плавающей процентной ставке Договора репо |
| 6. | Дата размещения | Кодовое обозначение в Системе торгов Биржи установленной Казначейством для данного отбора Заявок даты размещения денежных средств по Договору репо |
| 7. | Дата возврата | Кодовое обозначение в Системе торгов Биржи установленной Казначейством для данного отбора Заявок даты возврата Участником Казначейству денежных средств по Договору репо |