

Заключение сделок РЕПО с Банком России с плавающими ставками

1. Сделки РЕПО с Банком России по плавающей ставке заключаются на организованных торгах в новом Режиме торгов «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка». Техническое название режима (борда) в торговой системе фондового рынка «РЕПО с ЦБ РФ: Аукц.плав.ставки», код режима – FFCB. Валюта сделок – рубли РФ.
2. Текущее значение ставки РЕПО рассчитывается как (текущее значение бенчмарка) + (Спред по сделке).
 - 2.1. Бенчмарк – Ключевая ставка Банка России;
 - 2.2. Значение Спреда определяется и фиксируется на аукционе при заключении сделки.
3. Параметры аукциона, его расписание, список допущенных бумаг и их дисконты определяет Банк России. В том числе, минимальное значение Спреда для заявок участников. Подробная информация размещается на сайте Банка России: http://www.cbr.ru/hd_base/
4. Участники в окне ввода заявок указывают значение Спреда (вместо значения ставки!!!).

Окно ввода заявки РЕПО с клирингом НКЦ:

Ввод адресной заявки РЕПО ? X

Купить Продать [Заполнить последней](#)

Режим: РЕПО с ЦБ РФ: Аукц.плав.▼	Партнер: ЦБ РФ▼
Инструмент: ОФЗ 26220▼	Код расчетов: S01▼ ?
Номинал: 1 000 руб., Валюта расч.: руб.	Дата расчетов: 18.06.2020
Первая часть сделки РЕПО	Вторая часть сделки РЕПО
Сумма РЕПО: 100 000 000,00▼	Срок РЕПО: 365▼
Лотов: 1▼	Спред %: 0,1500▼
Размер лота: 1	Бенчмарк: 5,5% (Ключевая ставка БР) Дата расчетов: 18.06.2021
Дисконт, %	Расчетная цена: 105,6340
Начальный: 0,0000▼	В полях "Сумма РЕПО", "Лотов" и "Начальный дисконт" указываются два любых параметра из трех
Нижний предел: -0,5000▼	
Верхний предел: 0,5000▼	

Фирма: Даниленко▼

Торговый счет: S01+00000F00▼ Клиринговый расчетный код: 40146

Клиент: ▼ Поручение: ▼

Возмещение, %: ▼ Ссылка: ▼

Комиссия и Единый Лимит под заявку ?

Комиссия, руб.: ЕЛ под заявку: ЕЛ с учетом заявки:

Ввести заявку Закреть

Окно ввода заявки РЕПО с клирингом НРД:

Ввод адресной заявки РЕПО с корзиной

Купить Продать [Заполнить последней](#)

Режим: РЕПО с ЦБ РФ: Аукц.плав. Партнер: ЦБ РФ

Инструмент: *КорзинаЦБ Код расчетов: DVP3 ?

Номинал: 1 руб., Валюта расч.: руб. Дата расчетов: 18.06.2020

Первая часть сделки РЕПО Вторая часть сделки РЕПО

Сумма РЕПО: 100 000 000,00 Срок РЕПО: 365

Дополнительный идентификатор: Спред %: 0,2200

Бенчмарк: 5,5% (Ключевая ставка БР)
Дата расчетов: 18.06.2021

Фирма: Даниленко

Торговый счет: REPONSD00000 Клиринговый расчетный код: MC9043200NSD

Клиент: Поручение:

Ссылка:

Комиссия и Единый Лимит под заявку ?

Комиссия за торги, руб.: ЕЛ под заявку: ЕЛ с учетом заявки:

5. Аукцион проходит в закрытой форме – участники не видят информацию о заявках и котировках других участников. После ввода встречных заявок Банком России заключаются сделки, которые отображаются в таблицах торгового терминала.

2 - Отправленные адресные заявки													
Заявка №	Время заявк.	Статус	Режим	Код режима	Бенчмарк	Инструмент	Валюта	К/П	Код расчетов	Ставка РЕПО, %	Сумма РЕПО	Срок РЕПО	Партнер
18 997 882 812	12:12:33	+	РЕПО с ЦБ РФ: Аукц.плав.ставки	FFCB	Ключевая ставка БР	ОФЗ 26220	руб.	П	S01	0,1500	100 000 000,00	365	ЦБ РФ
18 997 891 559	12:15:56	+	РЕПО с ЦБ РФ: Аукц.плав.ставки	FFCB	Ключевая ставка БР	*КорзинаЦБ	руб.	П	DVP3	0,2200	100 000 000,00	365	ЦБ РФ

2 - Сделки													
Сделка №	Время	Режим	Код режу	Бенчмарк	Инструмент	Валюта	К/П	Код расчетов	Ставка РЕПО, %	Сумма РЕПО	Срок РЕПО	Остаток стоимости в	Партнер
4 090 009 874	12:45:40	РЕПО с ЦБ РФ: Аукц.плав.ставки	FFCB	Ключевая ставка БР	ОФЗ 26220	руб.	П	S01	0,1500	100 000 000,00	365	105 641 668,16	ЦБ РФ
4 090 009 879	12:45:45	РЕПО с ЦБ РФ: Аукц.плав.ставки	FFCB	Ключевая ставка БР	*КорзинаЦБ	руб.	П	DVP3	0,2200	100 000 000,00	365	105 711 564,94	ЦБ РФ

6. Для расчета суммы возврата по сделке РЕПО используется текущее значение ставки РЕПО (спред+Ключевая ставка). Проценты по сделке начисляются ежедневно с даты исполнения первой части (**включительно**) до даты исполнения второй части репо (**не включая эту дату**) исходя из актуальных значений Ключевой ставки, Суммы РЕПО и базы дней в году (365 или 366 дней) на соответствующие даты.
7. В случае выплаты купонного дохода или амортизации по облигации внутри срока сделки РЕПО, текущая Сумма РЕПО уменьшится на сумму выплаты.
8. В торговых отчетах SEM02 (заявки) и SEM03 (сделки) добавляется 2 новых поля: RateType – для РЕПО с фиксированной ставкой значение «FIX», с плавающей ставкой «FLOATING»; Benchmark – код бенчмарка для РЕПО с плавающей ставкой («RREFKEYR» для Ключевой ставки БР). Значение Спреда заполняется в существующем поле RepoRate. В случае изменения Ключевой ставки БР внутри срока РЕПО, информация о скорректированных параметрах сделки (бенчмарк, ставка РЕПО,

сумма возврата) будут отображаться в клиринговом отчете EQM06 в дату вступления в силу нового значения ставки.

Ссылка на форматы торговых отчетов: <https://fs.moex.com/files/9856>

Ссылка на форматы клиринговых отчетов: <https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/020416>