

Расторжение адресной сделки РЕПО с ЦК



Процедура ввода отчета на расторжение сделки

С 25 октября 2021 года реализована возможность расторжения адресных сделок РЕПО с ЦК, РЕПО с КСУ. (Часть II. Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Статья 38.)

- Только в дату заключения сделки
- Под заключенной, но еще не исполненной сделкой РЕПО, понимается сделка РЕПО, по первой части которой не сквитованы поданные УК встречные Отчеты на исполнение (в случае их подачи) или по которой не наступил срок Определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований согласно утвержденного Временного регламента (Приложение 6 Правил клиринга).
- Выставить отчет на расторжение сделки нельзя если:
 1. если УК-сторонами были ранее поданы Отчеты на исполнение первой части сделки РЕПО и они уже сквитованы;
 2. если сделка перешла в статус «Исполнена»:
 - позже 16:00 – по сделке с расчетами в RUB или USD, заключенной до 16:00, по сделке с расчетами в CNY, заключенной с 12:00 до 16:00, по сделке с расчетами в EUR, заключенной с 15:15 до 16:00;
 - позже 19:00 - по сделке с расчетами в RUB или USD, заключенной с 16:00 до 19:00;
 - позже установленного расписанием срока определения итоговых нетто-позиций по валюте расчетов сделки с кодом расчетов Y0/Yn: позже 12:00 для сделок с расчетами в CNY, заключенных до 12:00, позже 15:15 для сделок с расчетами в EUR, заключенных до 15:15;
 3. Отчет на расторжение не прошел проверку на расчетную позицию по деньгам.

Отчет на расторжение проходит проверку расчетной позиции по деньгам. Проверка считается пройденной если значение расчетной позиции по деньгам с учетом Поручения на отказ не становится отрицательным, или, если расчетная позиция по деньгам была отрицательной до момента проверки, то ее значение после проверки не станет меньше, чем было до момента проверки.
 4. Отчет на расторжение не прошел проверку на обеспеченность в момент регистрации в торгово-клиринговой системе .
- Отступное не предусмотрено, комиссия не возвращается.
- После подтверждения отчета на расторжение сторонами сделки РЕПО обязательства по сделке РЕПО считаются прекращенными, исключаются из числа обязательств, допущенных к клирингу, и не подлежат исполнению в Клиринговой системе.

Процедура ввода отчета на расторжение сделки

Отчет на расторжение подается в таблице «Сделки для исполнения»:

9 - Сделки для исполнения

Заявка	Сделка №	Статус	Тип	Г	Дата сделки	Дата исполнения	Сделка РЕПО	Режим	Цена на дату заключения	Отчет партнера	Лоты	Объем	Расчетный код
26 504 721 435	4 193 428 377	Подтв	АЦК1	Г	26.10.2021	26.10.2021	4 193 428 378	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	1 000	1	1 000	1 000 000,00	11849
26 504 721 435	4 193 428 378	Подтв	АЦК2	Г	26.10.2021	26.10.2022	4 193 428 377	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	1 000 164,38	1	1 000	1 000 164,38	11849

Далее необходимо подтвердить ввод отчета:

Ввод отчета на отказ от исполнения сделки

Сделка №: 4 193 428 377
Клиринговая фирма: Берестовой
Партнер: Головин
Режим: РЕПО с ЦК с КСУ адресное
Инструмент: КСУ все
Бумаг к исполнению: 1 000 000
Сумма к исполнению: -1 000 000,00 руб.

Подтверждение

Вы действительно хотите ввести отчет на отказ от исполнения сделки со следующими параметрами?

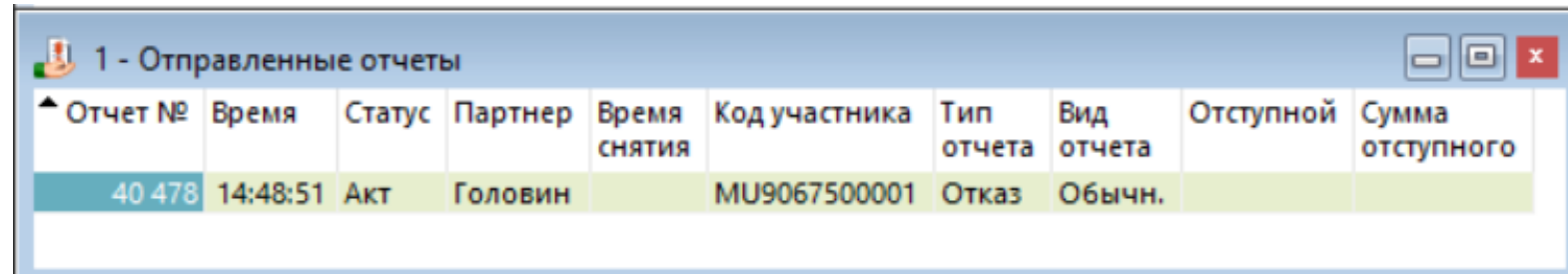
Параметр	Значение
Сделка №	4 193 428 377
К/П	Купля

MOEX Trade SE (тестовая версия)

(654) Заявка на отказ от исполнения №40478 зарегистрирована

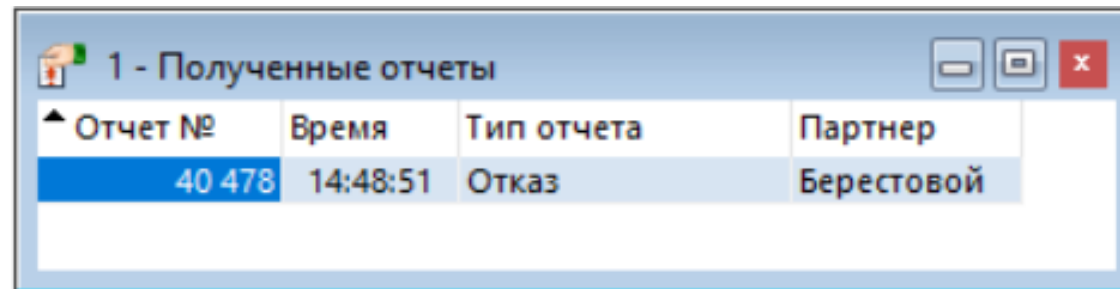
Отображение отчетов

Отчет можно увидеть и при необходимости снять в таблице «Отправленные отчеты»



▲ Отчет №	Время	Статус	Партнер	Время снятия	Код участника	Тип отчета	Вид отчета	Отступной	Сумма отступного
40 478	14:48:51	Акт	Головин		MU9067500001	Отказ	Обычн.		

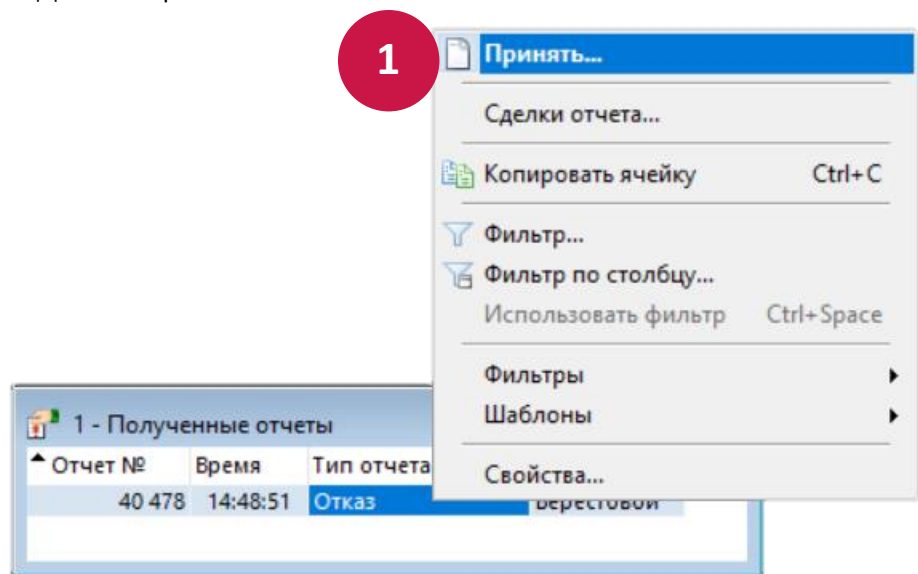
Контрагент по сделке увидит отчет в таблице «Полученные отчеты»



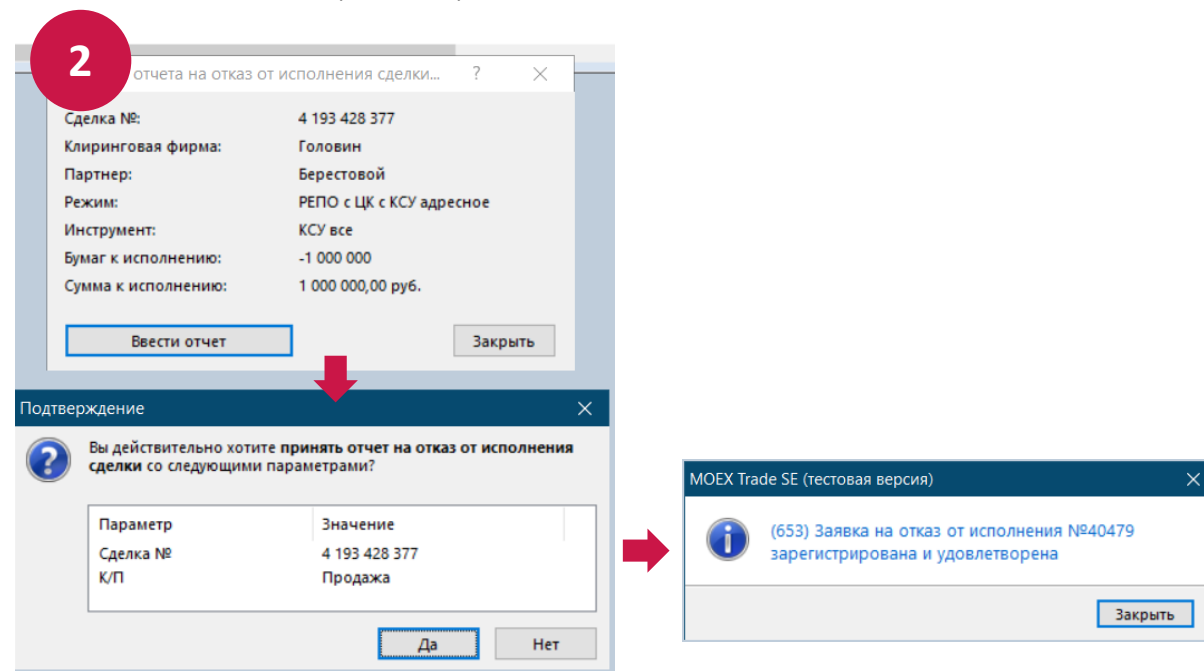
▲ Отчет №	Время	Тип отчета	Партнер
40 478	14:48:51	Отказ	Берестовой

Подтверждение отчета

Отчет подтверждается стандартным образом, или можно подать встречный отчет.



Необходимо подтвердить принятие отчета



В таблице «Сделки для исполнения» с поле «статус» появится «-» (отменена пользователем)

3

Заявка	Сделка №	Статус	Тип	Г	Дата сделки	Дата исполнения	Сделка РЕПО	Режим	Инструмент	К/П	Сумма к исполнению	Лоты к исполнению	Цена на дату заключения	Отчет партнера	Лоты	Объем	Расчетный код	T
26 504 721 435	4 193 428 377	-	АЦК1	Г	26.10.2021	26.10.2021	4 193 428 378	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ все	К	1 000 000,00	1 000	1	40 479	1 000	1 000 000,00	11849	S
26 504 721 435	4 193 428 378	-					4 193 428 377	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ все	П	1 000 164,38	1 000	1		1 000	1 000 164,38	11849	S

Отменена пользователем

Информация о расторгнутых сделках

Расторгнутые сделки отражаются в клиринговом отчете EQM06 в отдельном блоке «Неисполненные и расторгнутые сделки». Торговый отчет SEM03 дополнен полями для маркировки расторгнутых сделок и отражения номеров поручений на расторжение:

- **CancelOrder** - "Номер поручения расторжения сделки";
- **IsCancel** - "Признак расторжения сделки". это поле принимает значение Y для расторгнутых сделок и NULL для всех остальных

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.