

# RUSFAR CNY - РОССИЙСКИЙ ИНДИКАТОР ПРОЦЕНТНЫХ СТАВОК НА ЮАНИ





### Russian Secured Funding Average Rate

➤ **Риски контрагента не влияют на цену**

Все сделки заключаются через Центрального контрагента, что нивелирует влияние качества конечного контрагента на цену

➤ **Отсутствие специфики ценной бумаги**

В отличие от РЕПО с отдельным выпуском, по РЕПО с КСУ не бывает дефицита ценной бумаги, который влияет на ставку

➤ **Транспарентность**

Все сделки заключаются в анонимных режимах («стаканах»), доступных всем участникам

➤ **Единый денежный рынок**

Участниками данного рынка являются не только проф. участники и банки, но и корпорации нефинансового сектора, размещающие депозиты с Центральным контрагентом

➤ **«Торгуемость»**

Позицию по данной ставке возможно закрыть как в стаканах РЕПО с КСУ (любой проф. участник рынка, банк, или нефинансовая корпорация), так и с помощью фьючерса или другого процентного дериватива на RUSFAR

## Принципы расчета

- Период расчета **10:00-12:30 МСК**
- Расчет базируется на сделках и заявках, поданных в **безадресном режиме РЕПО с КСУ сроком ON с расчетами в китайских юанях**
- Для расчета используется только информация о сделках, если объем заключенных сделок в период расчета **не менее 200 миллионов CNY**
- Ликвидность в «КСУ облигации» с расчетами в юанях поддерживают **12 маркет-мейкеров**
- Средние спрэды в период котирования составляют **0.01% - 0.10%**

### Ликвидность базового рынка\*

(К) Объем котировки	Цена	(П) Объем котировки
5 910	3,3500000	
8 000	3,4000000	
5 000	3,4600000	
1 800	3,4900000	
10 000	3,5200000	
4 140	3,5300000	
5 910	3,5700000	
5 910	3,6300000	
8 000	3,7000000	
800	3,7500000	
	↓ 3,7600000	12 309
	3,7700000	1 831
	3,7800000	8 200
	3,7900000	6 800
	3,8000000	500
	3,9200000	1 800
	3,9500000	3 600
	3,9800000	1 034
	3,9900000	2 000
	4,0000000	2 500

\*Данные 10.04.2023 в 10:15

## Прозрачность расчета

Расчетные параметры раскрываются на сайте Московской Биржи:

- Количество сделок
- Общий объем сделок
- Средний объем сделки
- Максимальная и минимальная ставки
- Удельный вес сделок и заявок

<https://www.moex.com/ru/index/RUSFARCNY>

Значение 07.04.2023 12:30:00		Изменение к закрытию,%	
	3,92		5,09%
Открытие	3,92	Предыдущее закрытие	3,73
Максимальное	3,92	Макс. за год	7,28
Минимальное	3,92	Мин. за год	-1,95
Объем торгов, руб	5 401 443 615	Изм. с начала месяца, %	23,27%
Капитализация, руб	-	Изм. с начала года, %	-46,15%
Валюта	CNY	Делитель	-

### ОСНОВНЫЕ ПАРАМЕТРЫ

Код индекса	RUSFARCNY
Код Bloomberg	
Код Reuters	
Код ISIN	
Тип индикатора	Индикатор стоимости обеспеченных денег
Время расчета (Московское время)	12:30:00
Периодичность расчета Индекса	Ежедневно



МЕТОДИКА РАСЧЕТА



РАСЧЕТНЫЕ ПАРАМЕТРЫ

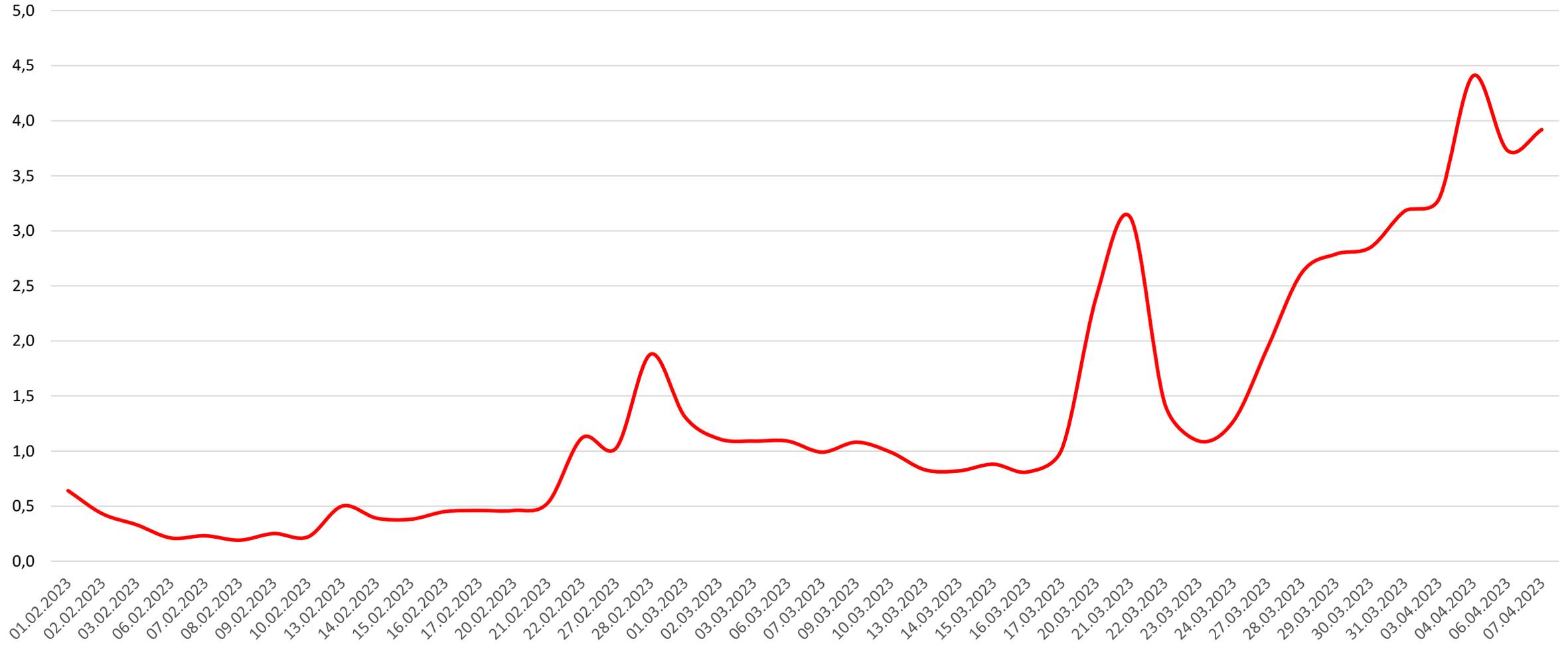
Дата:

2023.04



ГГГГ.ММ

# RUSFAR CNY – график процентных ставок



# 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 offer 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;
  - способностью 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.