

Управляющий _____ А.Ю. Филаретов

Регламент
совершения сделок РЕПО
с Центральным банком Российской Федерации (Банком России)
в фондовой секции ЗАО «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

1. Общие положения.

1.1. Настоящий регламент составлен в соответствии с действующим законодательством Российской Федерации о рынке ценных бумаг, в том числе нормативными правовыми актами ФСФР России, нормативными правовыми актами Банка России, регулирующими совершение Банком России сделок РЕПО, Правилами торговли в фондовой секции ЗАО «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», Правилами осуществления клиринговой деятельности ЗАО «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

1.2. В настоящем регламенте используются термины и определения в соответствии с Приложением 1 к Правилам торговли в фондовой секции ЗАО «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

1.3. В настоящем регламенте дополнительно к терминам и определениям, указанным в п.1.2, используются следующие сокращения:

1.3.1. СПВБ – ЗАО «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

1.3.2. Правила торговли – Правила торговли в фондовой секции ЗАО «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», утверждённые уполномоченным органом СПВБ.

1.3.3. Регламент – настоящий регламент совершения сделок РЕПО с Центральным банком Российской Федерации (Банком России) в фондовой секции ЗАО «Санкт-Петербургская Валютная биржа».

1.3.4. КО – Участники торгов, являющиеся кредитными организациями, заключившие с Банком России генеральное соглашение, предусматривающее совершение сделок РЕПО с Банком России на СПВБ, действующие от своего имени и за свой счет.

1.4. Регламент дополняет Правила торговли и Регламент торгов в части особенностей регулирования сделок РЕПО с Банком России.

1.5. Под сделкой РЕПО в настоящем Регламенте понимаются только сделки прямого РЕПО с Банком России.

1.6. Банк России всегда является покупателем ценных бумаг по первой части сделки РЕПО и продавцом ценных бумаг по второй части сделки РЕПО. КО всегда является продавцом ценных бумаг по первой части сделки РЕПО и покупателем ценных бумаг по второй части сделки РЕПО.

1.7. Регламент утверждается Правлением СПВБ по согласованию с Банком России.

2. Порядок взаимодействия СПВБ, Банка России, НРД и КО

№	Время	Наименование Операции
1.	До начала аукциона (с 8-00 до 11-00)	Обмен электронными документами, загрузка в Систему торгов и Клиринговую систему СПВБ информации о счетах КО, лимитах, параметрах сделок и ценных бумагах, входящих в корзину РЕПО, извещение КО о лимитах, ограничениях и расписании проведения аукционов РЕПО на день. Информация о перечне ценных бумаг, входящих в корзину РЕПО, ценах и дисконтах, а также расписание проведения аукциона и основные условия сделок РЕПО, доводятся до КО путем раскрытия информации на официальном сайте СПВБ в сети Интернет www.spcex.ru . Информация о

		лимитах и ограничениях по перечню ценных бумаг доводится до КО в индивидуальном порядке.
2.	10:45 - 11:15	Первый аукцион, прием заявок
Описание операции		
<p>Торговая сессия по заключению сделок РЕПО на аукционе проводится в торговом сегменте «РЕПО ЦБ» Фондовой секции СПВБ. Параметры возможных сделок РЕПО содержатся в Спецификации РЕПО (форма приведена в Приложении 1 к настоящему Регламенту).</p> <p>КО подают в Систему торгов заявки на привлечение денежных средств, адресованные Банку России. СПВБ обеспечивает контроль в Системе торгов за соблюдением КО условий Спецификации РЕПО – заявки КО, не соответствующие условиям Спецификации РЕПО, отклоняются.</p>		
3.	11:15-11:30	СПВБ передает Банку России реестр заявок по первому аукциону
Описание операции		
СПВБ фиксирует все поданные КО заявки на аукцион и передает их реестр Банку России.		
4.	11:30 – 11:45	Получение и загрузка реестра оферт от Банка России
Описание операции		
<p>а) Банк России рассматривает реестр заявок КО, поданных на аукцион, и принимает решение о ставке отсечения. В соответствии с принятым решением, Банк России формирует на основе заявок КО свои оферты на заключение сделок РЕПО и направляет их СПВБ.</p> <p>б) СПВБ регистрирует на основании полученных оферт Банка России предварительные договоры РЕПО</p>		
5.	До 11:50	Формирование и передача отчетов для Участников торгов (Банк России и КО)
Описание операции		
<p>а) СПВБ формирует и направляет Участникам торгов Отчет о предварительных договорах РЕПО (STR-01), в формате pdf (формы отчетов приведены в Приложении 2 к настоящему Регламенту)</p> <p>б) СПВБ на основании зарегистрированных предварительных договоров РЕПО и сделок РЕПО с текущей датой исполнения рассчитывает предполагаемую нетто-позицию КО. СПВБ направляет Участникам торгов Отчет о нетто-позиции РЕПО (SCR-01), в формате pdf, Отчет по нетто-позиции Участника Клиринга (SCR-10), в формате xml. Отчет содержит информацию о сумме денежных средств и/или стоимости ценных бумаг, наличие которых КО должна обеспечить на торговых счетах (разделах счетов) для исполнения обязательств перед Банком России.</p>		
6.	до 14:10	Перевод КО ценных бумаг на торговые разделы счетов депо в НРД и денежных средств на торговые счета в НРД
Описание операции		
<p>КО на основании полученных от СПВБ отчетов формируют и направляют в НРД поручения на перевод ценных бумаг/денежных средств.</p> <p>КО должны до указанного времени обеспечить наличие на своих торговых счетах (разделах счетов) необходимое количество ценных бумаг и/или суммы денежных средств.</p>		
7.	14:10-14:20	Получение и загрузка остатков на торговых счетах (разделах счетов) КО в НРД. Блокировка торговых разделов счетов депо и денежных торговых счетов в НРД
Описание операции		
НРД передает в адрес СПВБ сведения об остатках на торговых разделах счетов депо и денежных торговых счетах КО. Сведения об указанных остатках могут использоваться СПВБ для подбора Обеспечения и акцепта оферт Банка России.		
8.	14:20 – 14:30	Подбор Обеспечения, акцепт оферт Банка России
Описание операции		
<p>а) СПВБ на основании информации об остатках на торговых счетах (разделах счетов) КО осуществляет подбор Обеспечения, необходимого для акцепта оферт Банка России. При подборе Обеспечения СПВБ проверяет возможность зачета встречных обязательств/требований по первым и вторым частям Однородных сделок РЕПО и формирует определённый набор ценных бумаг по каждой акцептованной оферте Банка России. Подбор Обеспечения осуществляется СПВБ автоматически по алгоритму, позволяющему подобрать Обеспечение для исполнения наибольшего объема встречных обязательств/требований КО.</p> <p>б) Оферты, по которым подобрано Обеспечение, автоматически акцептуются от имени КО.</p>		
9.	14:30	СПВБ регистрирует обеспеченные сделки РЕПО.
Описание операции		
Акцептованные оферты регистрируются в Системе торгов как вновь заключенные сделки РЕПО. Акцепт		

необеспеченных оферт переносится на период времени после второго аукциона.		
10.	14:30 – 15:20	Проведение клиринга и расчетов, 1-я сессия
Описание операции		
а) СПВБ формирует сводные поручения на расчеты на основании нетто-обязательств Участников торгов по клиринговому пулу, в который включаются первые части вновь заключенных сделок РЕПО и обеспеченные вторые части ранее заключенных сделок РЕПО. Сводные поручения передаются для исполнения в НРД. б) НРД исполняет сводные поручения СПВБ. в) СПВБ и НРД производят сверку в соответствии с Правилами клиринга. СПВБ направляет Участникам торгов отчеты о рассчитанных нетто-требованиях и нетто-обязательствах по ценным бумагам и денежным средствам по сделкам, включенным в клиринговый пул (SCR-02, SCR-03).		
11.	До 15:25	Разблокирование денежных средств на торговых счетах и ценных бумаг на торговых разделах счетов депо КО
Описание операции		
После успешного проведения сверки торговые счета и торговые разделы счетов депо становятся доступны для списания денежных средств и ценных бумаг КО.		
12.	14:45 – 15:15	Второй аукцион, прием заявок
Описание операции		
См. п. 2.		
13.	15:15 – 15:30	СПВБ передает Банку России реестр заявок по второму аукциону.
Описание операции		
См. п. 3.		
14.	15:30 – 15:45	Получение и загрузка реестра оферт от Банка России.
Описание операции		
См. п. 4.		
15.	до 16:00	Формирование и передача отчетов для Участников торгов (Банк России и КО)
Описание операции		
См. п. 5. При расчете нетто-позиции РЕПО учитываются также неисполненные обязательства по предварительным договорам РЕПО, заключённым по итогам первого аукциона (см. п.9).		
16.	до 16:50	Перевод КО ценных бумаг на торговые разделы счетов депо в НРД и денежных средств на торговые счета в НРД
Описание операции		
См. п. 6.		
17.	17:00-17:10	Получение и загрузка остатков на торговых счетах (разделах счетов) КО в НРД. Блокировка торговых разделов счетов депо и денежных торговых счетов в НРД
Описание операции		
См. п. 7		
18.	17:00 - 17:20	Подбор Обеспечения, акцепт оферт Банка России
Описание операции		
См. п. 8		
19.	17:20	СПВБ регистрирует обеспеченные сделки РЕПО.
Описание операции		
Акцептованные оферты регистрируются в Системе торгов как вновь заключенные сделки РЕПО. В случае, если на торговых счетах КО недостаточно денежных средств для расчетов по вторым частям сделок РЕПО и/или ценных бумаг для акцепта оферт, СПВБ информирует Банк России и КО о факте неисполнения обязательств по сделкам РЕПО и /или предварительным договорам.		
20.	17:20-17:30	Проведение клиринга и расчетов, 2-я сессия
Описание операции		
См. п. 10.		
21.	до 17:30	Разблокирование денежных средств на торговых счетах и ценных бумаг на торговых разделах счетов депо КО
Описание операции		
См. п. 11.		
22.	18:00 – 18:30	Формирование и отправка отчетов для Банка России и КО по итогам торгового

		дня: Отчет о заключенных сделках РЕПО (STR-02); Отчет об обязательствах по денежным средствам (SCR-02); Отчет об обязательствах по ценным бумагам (SCR-03); Отчет об исполненных сделках РЕПО (SCR-04); Отчет об обеспечении по первым частям сделок РЕПО (SCR-05); Отчет об обеспечении по вторым частям сделок РЕПО (SCR-06); Отчет по неисполненным предварительным договорам РЕПО (SCR-07); Отчет по неисполненным сделкам РЕПО (SCR-08); Отчет по сделкам РЕПО Участника Клиринга (SCR09).
--	--	--

Примечание. Время, указанное в Регламенте, может быть изменено в случае внесения изменений в расписание проведения аукциона, устанавливаемое Банком России.

Приложение №1
к Регламенту совершения сделок РЕПО
с Центральным банком Российской Федерации (Банком России)
в фондовой секции ЗАО «Санкт-Петербургская валютная биржа»

Спецификация РЕПО № 1

Утверждено:

Правлением СПВБ Протокол № ____ от _____ г.

Управляющий СПВБ А.Ю. Филаретов _____

Код Спецификации	Срок РЕПО	Код расчетов	Торговый код корзины РЕПО	Минимальная ставка РЕПО, % годовых
CBR-RD-1SO	overnight*	S0	SPCEXRB01CBR	5,5

* Срок РЕПО принимается равным количеству календарных дней, начиная с даты исполнения первой части сделки РЕПО и до даты исполнения второй части сделки РЕПО включительно при условии, что количество рабочих дней между этими двумя датами равняется 1.

Информация о ценных бумагах, входящих в корзину РЕПО, доводится до Участников торгов путем раскрытия информации о ценных бумагах, составляющих корзину РЕПО по сделкам РЕПО с Банком России, на официальном сайте СПВБ в сети Интернет www.spcex.ru.

Информация о значении базовой цены ценной бумаги и начальном дисконте доводится до Участников торгов ежедневно путем раскрытия информации на официальном сайте СПВБ в сети Интернет www.spcex.ru.

Информация о значении минимальной ставки РЕПО доводится до Участников торгов ежедневно путем раскрытия информации на официальном сайте СПВБ в сети Интернет www.spcex.ru.

Информация об ограничениях на принимаемое от Участника торгов Обеспечение по сделкам РЕПО (перечень ценных бумаг, в отношении которых Банком России принято решение не заключать сделки РЕПО с Участником торгов) доводится до Участников торгов ежедневно в индивидуальном порядке в соответствии с Генеральным соглашением.

к Регламенту совершения сделок РЕПО
с Центральным Банком Российской Федерации (Банком России)
в фондовой секции ЗАО «Санкт-Петербургская валютная биржа»

Формы отчетов, предоставляемых участникам торгов

ОТЧЕТ О ПРЕДВАРИТЕЛЬНЫХ ДОГОВОРАХ РЕПО (ОФЕРТАХ БАНКА РОССИИ) _____ (дата, время)

Код участника торгов: _____

Наименование участника торгов: _____

№	Номер заявки	Номер оферты Банка России (предварительного договора РЕПО)	Спецификация	Дата исполнения 1-ой части сделки РЕПО	Дата исполнения 2-ой части сделки РЕПО	Срок сделки РЕПО, дн.	Ставка РЕПО, %	Код контрагента	Код клиента	Направление сделки	Код Обеспечения по сделке РЕПО	Сумма РЕПО, руб.
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)	(13)

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

Расшифровка полей:

- (1) Номер записи в таблице по порядку,
- (2) Номер заявки, на основании которой заключен предварительный договор РЕПО
- (3) Номер оферты Банка России (предварительного договора РЕПО),
- (4) Код спецификации РЕПО,
- (5) Дата исполнения первой части сделки РЕПО,
- (6) Дата исполнения второй части сделки РЕПО,
- (7) Срок РЕПО,
- (8) Ставка РЕПО,
- (9) Код контрагента по предварительному договору РЕПО,
- (10) Код клиента по предварительному договору РЕПО (для сделок РЕПО с Банком России поле не заполняется),
- (11) S – продажа ценных бумаг по первой части сделки РЕПО, B – покупка ценных бумаг по первой части сделки РЕПО,
- (12) Код Корзины РЕПО,
- (13) Сумма РЕПО, указанная в оферте Банка России

ОТЧЕТ О ЗАКЛЮЧЕННЫХ СДЕЛКАХ РЕПО _____ (дата, время)

Код участника клиринга: _____

Наименование участника клиринга: _____

№	Номер сделки РЕПО	Номер заявки	Спецификация	Направление сделки	Код контрагента	Код клиента	Срок РЕПО, дн.	Ставка РЕПО, %	Вид обеспечения по сделке РЕПО*	Дата исполнения 1-ой части сделки РЕПО	Дата исполнения 2-ой части сделки РЕПО	Сумма РЕПО, руб.	Стоимость обратного выкупа, руб.	Сумма комиссии, руб.
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)	(13)	(14)	(15)

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

Расшифровка полей:

- (1) Номер записи в таблице по порядку,
- (2) Номер сделки РЕПО, присвоенный Системой торгов,
- (3) Номер заявки (совпадает с номером оферты Банка России (предварительного договора РЕПО)),
- (4) Код спецификации РЕПО,
- (5) S – продажа ценных бумаг по первой части сделки РЕПО, B – покупка ценных бумаг по первой части сделки РЕПО,
- (6) Код контрагента по сделке РЕПО,
- (7) Код клиента по сделке РЕПО (для сделок РЕПО с Банком России поле не заполняется),
- (8) Срок РЕПО,
- (9) Ставка РЕПО,
- (10) Код Корзины РЕПО или торговый код (биржевой код) ценной бумаги,
- (11) Дата исполнения первой части сделки РЕПО,
- (12) Дата исполнения второй части сделки РЕПО,
- (13) Сумма РЕПО,
- (14) Стоимость обратного выкупа по сделке РЕПО,
- (15) Сумма комиссионного вознаграждения СПВБ.

* Информация об обеспечении содержится в форме SCR-05

ОТЧЕТ О НЕТТО-ПОЗИЦИИ РЕПО _____ (дата, время)

Наименование участника клиринга: _____

Код участника клиринга: _____

№	Номер позиции	Дата	Код контрагента	Обязательства по денежным средствам, руб.	Требования по денежным средствам, руб.	Нетто-позиция по денежным средствам, руб.	Стоимость передаваемого обеспечения, руб.	Стоимость принимаемого обеспечения, руб.	Нетто-позиция по обеспечению, руб.
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)
ИТОГО									

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

Расшифровка полей:

- (1) Номер записи в таблице по порядку,
- (2) Идентификатор (номер) предварительного договора или сделки РЕПО, входящих в расчет нетто-позиции,
- (3) Дата, на которую производится расчет позиции,
- (4) Код контрагента по предварительному договору РЕПО/по сделке РЕПО,
- (5) Общая сумма денежных обязательств по договорам с соответствующим контрагентом (сумма размещения по предварительным договорам (покупка Обеспечения) и стоимость обратного выкупа (в части покупки ценных бумаг) по 2 частям сделок РЕПО),
- (6) Общая сумма денежных требований по договорам с соответствующим контрагентом (сумма привлечения по предварительным договорам (продажа Обеспечения) и стоимость обратного выкупа (в части продажи ценных бумаг) по 2 частям сделок РЕПО),
- (7) Разность (5) – (4). Знак «+» означает нетто-требование по денежным средствам (достаточность денежных средств), знак «-» – нетто-обязательство по денежным средствам (необходимость зачисления денежных средств на торговый счет) по отношению к соответствующему контрагенту,
- (8) Стоимость передаваемого обеспечения численно равна сумме привлечения по предварительным договорам и текущей стоимости* ценных бумаг продаваемых по 2 частям РЕПО ценных бумаг,
- (9) Стоимость принимаемого обеспечения численно равна сумме размещения по предварительным договорам и текущей стоимости* выкупаемых по 2 частям РЕПО ценных бумаг),
- (10) Разность (8) – (7). Знак «+» означает нетто-требование по ценным бумагам (достаточность ценных бумаг), знак «-» – нетто-обязательство по ценным бумагам (необходимость дополнительного перевода ценных бумаг на торговый раздел счета).

*Стоимость ценной бумаги рассчитывается исходя из ее базовой цены, уменьшенной на размер начального дисконта

ОТЧЕТ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬСТВАХ ПО ДЕНЕЖНЫМ СРЕДСТВАМ _____ (дата, время)

Код участника клиринга: _____

Наименование участника клиринга: _____

№	Дата	Код контрагента	Номер денежного счета	Обязательства, руб.	Требования, руб.	Нетто-позиция, руб.
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

Расшифровка полей:

- (1) Номер записи в таблице по порядку,
- (2) Дата исполнения обязательств по сделкам РЕПО,
- (3) Код контрагента по сделкам РЕПО,
- (4) Номер торгового денежного счета, предназначенного для исполнения обязательств по сделкам РЕПО,
- (5) Сумма обязательств участника клиринга по денежным средствам по сделкам РЕПО с текущей датой исполнения (покупка ценных бумаг),
- (6) Сумма требований участника клиринга по денежным средствам по сделкам РЕПО бумаг с текущей датой исполнения (продажа ценных бумаг),
- (7) Разность (6) – (5). Знак «+» означает нетто-требование, знак «-» – нетто-обязательство по денежным средствам участника клиринга.

ОТЧЕТ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬСТВАХ ПО ЦЕННЫМ БУМАГАМ _____ (дата, время)

Код участника клиринга: _____

Наименование участника клиринга: _____

№	Дата	Код контрагента	Номер торгового раздела счета депо	Торговый код ценной бумаги	ISIN ценной бумаги	Обязательства, шт.	Требования, шт.	Нетто-позиция, шт.
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

Расшифровка полей:

- (1) Номер записи в таблице по порядку,
- (2) Дата исполнения обязательств по сделкам РЕПО,
- (3) Код контрагента по сделкам РЕПО,
- (4) Номер торгового раздела счета депо,
- (5) Торговый код (биржевой код) ценной бумаги,
- (6) Код ISIN ценной бумаги,
- (7) Количество ценных бумаг, передаваемых участником клиринга по сделкам РЕПО с текущей датой исполнения (продажа ценных бумаг),
- (8) Количество ценных бумаг, принимаемых участником клиринга по сделкам РЕПО, с текущей датой исполнения (покупка ценных бумаг),
- (9) Разность (8) – (7). Знак «+» означает нетто-требование, знак «-» – нетто-обязательство по ценным бумагам участника клиринга

ОТЧЕТ ОБ ИСПОЛНЕННЫХ СДЕЛКАХ РЕПО _____ (дата, время)

Код участника клиринга: _____

Наименование участника клиринга: _____

№	Номер сделки РЕПО	Часть РЕПО	Направление сделки	Код контрагента	Код клиента	Срок РЕПО, дн.	Ставка РЕПО, %	Вид обеспечения по сделке РЕПО*	Дата исполнения 1-ой части сделки РЕПО	Дата исполнения 2-ой части сделки РЕПО	Сумма сделки, руб.
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

Расшифровка полей:

- (1) Номер записи в таблице по порядку,
- (2) Номер сделки РЕПО, присвоенный Системой торгов,
- (3) 1 – первая часть сделки РЕПО, 2 – вторая часть сделки РЕПО,
- (4) S – продажа ценных бумаг по первой части сделки РЕПО, В – покупка ценных бумаг по первой части сделки РЕПО,
- (5) Код контрагента по сделке РЕПО,
- (6) Код клиента по сделке РЕПО (для сделок РЕПО с Банком России поле не заполняется),
- (7) Срок РЕПО,
- (8) Ставка РЕПО,
- (9) Код Корзины РЕПО или торговый код (биржевой код) ценной бумаги,
- (10) Дата исполнения первой части сделки РЕПО,
- (11) Дата исполнения второй части сделки РЕПО,
- (12) Сумма РЕПО (в отношении исполнения первой части сделки РЕПО) или стоимость обратного выкупа (в отношении исполнения второй части сделки РЕПО).

* Информация об обеспечении содержится в формах SCR-05, SCR-06

ОТЧЕТ ОБ ОБЕСПЕЧЕНИИ ПО ПЕРВЫМ ЧАСТЯМ СДЕЛОК РЕПО _____ (дата, время)

Код участника клиринга: _____

Наименование участника клиринга: _____

№	Номер сделки РЕПО	Код обеспечения по сделке РЕПО	Стоимость обеспечения, руб.	Состав обеспечения						
				Торговый код ценной бумаги	ISIN ценной бумаги	Цена, руб.	Количество, шт.	НКД, руб.	Стоимость ценных бумаг, руб.	Дисконт, %
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

Расшифровка полей:

- (1) Номер записи в таблице по порядку,
- (2) Номер сделки РЕПО, присвоенный Системой торгов,,
- (3) Код Корзины РЕПО или торговый код (биржевой код) ценной бумаги,
- (4) Общая стоимость ценных бумаг, переданных по соответствующей сделке РЕПО, равная сумме указанных в колонке (10) стоимостей ценных бумаг, входящих в обеспечение по соответствующей сделке РЕПО, а также сумме РЕПО по соответствующей сделке РЕПО.
- (5) Торговый код (биржевой код) ценной бумаги,
- (6) Код ISIN ценной бумаги,
- (7) Учетная цена ценной бумаги на дату заключения сделки РЕПО, для акций (7) = (Базовая цена) x (1 - (Начальный дисконт*) / 100), для облигаций (7) = ((Базовая цена) x (Номинал) / 100 + (9)) x (1 - (Начальный дисконт*) / 100) - (9),
- (8) Количество ценных бумаг,
- (9) Размер накопленного купонного дохода (НКД) по облигациям, рассчитанный по состоянию на дату формирования отчета,
- (10) Стоимость соответствующих ценных бумаг. Стоимость рассчитывается как (10) = ((7) + (9))x (8) .
- (11) Начальный дисконт по выпуску ценных бумаг. Указывается с точностью по 4 знака после запятой.

* точное значение начального дисконта рассчитывается СПВБ с точностью, необходимой для соблюдения равенства суммы РЕПО и суммы стоимостей отдельных ценных бумаг (10), входящих в обеспечение по соответствующей сделке РЕПО.

ОТЧЕТ ОБ ОБЕСПЕЧЕНИИ ПО ВТОРЫМ ЧАСТЯМ СДЕЛОК РЕПО _____ (дата, время)

Код участника клиринга: _____

Наименование участника клиринга: _____

№	Номер сделки РЕПО	Код обеспечения по сделке РЕПО	Стоимость обеспечения, руб.	Состав обеспечения					
				Торговый код ценной бумаги	ISIN ценной бумаги	Цена, руб.	Количество, шт.	НКД, руб.	Стоимость ценных бумаг, руб.
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)

Уполномоченный сотрудник СПВБ _____

Расшифровка полей:

- (1) Номер записи в таблице по порядку,
- (2) Номер сделки РЕПО, присвоенный Системой торгов,
- (3) Код Корзины РЕПО или торговый код (биржевой код) ценной бумаги, ,
- (4) Стоимость ценных бумаг, переданных по соответствующей сделке РЕПО, равная сумме стоимостей указанных в колонке (10) ценных бумаг, входящих в обеспечение по соответствующей сделке РЕПО, а также сумме обратного выкупа по соответствующей сделке РЕПО.
- (5) Торговый код (биржевой код) ценной бумаги,
- (6) Код ISIN ценной бумаги,
- (7) Учетная цена ценной бумаги на дату исполнения второй части сделки РЕПО, для акций (7) = (10) / (8), для облигаций (7) = (10) / (8) - (9)
- (8) Количество ценных бумаг,
- (9) Размер накопленного купонного дохода (НКД) по облигациям, рассчитанный по состоянию на дату формирования отчета,
- (10) Стоимость обратного выкупа по сделке РЕПО, приходящаяся на ценные бумаги соответствующего выпуска, входящие в обеспечение по соответствующей сделке РЕПО.

* в отчет входит информация об обеспечении как по исполненным, так и по неисполненным сделкам

ОТЧЕТ ПО НЕИСПОЛНЕННЫМ ПРЕДВАРИТЕЛЬНЫМ ДОГОВОРАМ РЕПО _____ (дата, время)

Наименование участника клиринга: _____

Код участника клиринга: _____

№	Номер oferty Банка России (предварительного договора РЕПО)	Дата заключения предварительного договора	Направление	Код Обеспечения	Код контрагента	Код Спецификации	Дата исполнения 1-ой части РЕПО	Дата исполнения 2-ой части РЕПО	Ставка РЕПО	Сумма РЕПО	Неакцептованная часть суммы РЕПО	Причина неисполнения
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)	(13)
										Итого:	Итого:	

Подпись уполномоченного сотрудника СПВБ _____

Расшифровка полей:

- (1) Номер записи в таблице по порядку,
- (2) Номер oferty Банка России (предварительного договора РЕПО),
- (3) Дата заключения предварительного договора РЕПО,
- (4) S – продажа ценных бумаг по первой части сделки РЕПО, B – покупка ценных бумаг по первой части сделки РЕПО
- (5) Код Корзины РЕПО,
- (6) Код контрагента по предварительному договору РЕПО,
- (7) Код Спецификации РЕПО,
- (8) Дата исполнения первой части сделки РЕПО,
- (9) Дата исполнения второй части сделки РЕПО,
- (10) Ставка РЕПО,
- (11) Сумма РЕПО, указанная в ofercie Банка России,
- (12) Сумма РЕПО, указанная в ofercie Банка России, в части, не обеспеченной ценными бумагами,
- (13) Код причины неисполнения обязательств: 1 — неисполнение обязательств участником клиринга, 2 — неисполнение обязательств контрагентом участника клиринга по предварительному договору РЕПО, 3 — отмена расчетов по итогам торгового дня

ОТЧЕТ ПО НЕИСПОЛНЕННЫМ СДЕЛКАМ РЕПО _____ (дата, время)

Наименование участника клиринга: _____

Код участника клиринга: _____

№	Номер сделки РЕПО	Дата заключения сделки РЕПО	Код Обеспечения	Направление сделки	Код контрагента	Код клиента	Часть РЕПО	Дата исполнения 1-ой части сделки РЕПО	Дата исполнения 2-ой части сделки РЕПО	Сумма неисполненной части сделки РЕПО	Причина неисполнения
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)
										Итого	

Подпись уполномоченного сотрудника СПВБ _____

Расшифровка полей:

- (1) Номер записи в таблице по порядку,
- (2) Номер сделки РЕПО, присвоенный Системой торгов,
- (3) Дата заключения сделки РЕПО,
- (4) Код Корзины РЕПО или торговый код (биржевой код) ценной бумаги,
- (5) S – продажа ценных бумаг по первой части сделки РЕПО, B – покупка ценных бумаг по первой части сделки РЕПО,
- (6) Код контрагента по сделке РЕПО,
- (7) Код клиента по сделке РЕПО (для сделок РЕПО с Банком России поле не заполняется),
- (8) 1 – первая часть РЕПО, 2 – вторая часть РЕПО, (для сделок РЕПО с Банком России всегда 2)
- (9) Дата исполнения первой части сделки РЕПО,
- (10) Дата исполнения второй части сделки РЕПО,
- (11) Сумма неисполненных обязательств по соответствующей сделке РЕПО (для сделок РЕПО с Банком России – только стоимость обратного выкупа),
- (12) Код причины неисполнения обязательств 1 – неисполнение обязательств участником клиринга, 2 – неисполнение обязательств контрагентом участника клиринга по сделке РЕПО, 3 – отмена расчетов по итогам торгового дня

ОТЧЕТ ПО СДЕЛКАМ РЕПО УЧАСТНИКА КЛИРИНГА (УК)

Вид: электронный документ

Формат: XML

Наименование (имя файла): SCR09<ДДММГГ>_<Код УК>.xml, где <ДДММГГ> - дата формирования файла,

<Код УК> - биржевой код УК

Структура:

Название тегов	Название атрибутов	Описание	Обязательное	Тип	Размер	Десятичные знаки
SPCEX_DOC		Корневой элемент XML документа.	Да			
DOC_REQUISITIONS		Блок информации о файле	Да			
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Да	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Да	Time		
	DOC_TYPE	Тип документа: «SCR09»	Да	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор Стороны, посылающей файл	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование Стороны, посылающей файл	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор Стороны, принимающей файл	Нет	Character	1-12	
	RECEIVER_NAME	Краткое наименование Стороны, принимающий файл	Нет	Character	1-30	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
/DOC_REQUISITIONS		Завершение блока информации о документе	Да			
SCR09		Блок данных отчета по сделкам	Да			
	VER	Ограничения на версию документа	Да	Character	3-12	
SCR09_TAB		Отчет о сделках РЕПО	Да			
	REPORT_CODE	Тип документа: «SCR09»	Да	Character	1-12	
	REPORT_NAME	Наименование документа “Отчет о сделках РЕПО”	Да	Character	1-30	
	REPORT_VER	Версия документа “1.0”	Да	Character	1-3	
	REPORT_DT	Дата отчета	Да	Date		
	PARTCODE	Идентификатор участника	Да	Character	1-12	
	PARTNAME	Наименование Участника	Да	Character	1-120	
SCR09_AGREEMENT		Группа по договору	Да			
	PARTCODE	Идентификатор участника	Да	Character	1-12	
	PARTNAME	Наименование Участника	Да	Character	1-120	
	ORDER_NUM	Номер заявки, на основании которой заключена сделка	Да	Number	11	
	TRADE_NUM	Номер сделки	Да	Number	11	

	TRADE_TIME	Время заключения сделки	Да	Time		
	REPO_PART	Часть РЕПО ("1"-первая часть сделки РЕПО,"2"-вторая часть сделки РЕПО)	Да	Number	1	
	TRADE_DIRECTION	Направление сделки РЕПО – "S", "B"	Да	Character	1	
	DIRECT_PARTCODE	Код контрагента	Да	Character	1-12	
	DIRECT_PARTNAME	Наименование контрагента	Да	Character	1-120	
	CLIENT_CODE	Код клиента	Да	Character	1-6	
	REPO_PERIOD	Срок сделки РЕПО	Да	Number	2	
	REPO_RATE	Ставка РЕПО	Да	Date		
	VARIETY_OF_ISS	Вид обеспечения по сделке РЕПО	Да	Character	1-12	
	EXEC_DATE	Дата исполнения первой части РЕПО	Да	Date		
	REPAYM_DATE	Дата исполнения второй части РЕПО	Да	Date		
	TRADE_SUMM	Сумма сделки	Да	Number	22-2	
	BACK_VALUE	Стоимость обратного выкупа	Да	Number	22-2	
	STATUS	Статус ("1" - исполненные сделки предыдущих дней; "2" - исполненные сделки текущего дня; "3" - сделки текущего дня, подлежащие исполнению; "4" - неисполненные сделки.)	Да	Character	1	
	SUM_FEE	Сумма комиссионного вознаграждения биржи в рублях				
	COMMENT	Комментарий	Да	Character	1-120	
SCR09_COLLATERAL		Группа обеспечения по сделке	Да			
	SECURITYID	Торговый код ценной бумаги	Да	Character	1-12	
	ISIN	ISIN ценной бумаги	Да	Character	1-12	
	PRICE	Цена	Да	Number	28-8	
	QUANTITY	Количество	Да	Number	11	
	NKD	НКД	Да	Number	20-4	
	AMOUNT_VALUE	Стоимость ценных бумаг	Да	Number	32-16	
	DISCOUNT	Дисконт	Да	Number	32-20	
/		Завершение блока информации COLLATERAL	/			
/SCR09_AGREEMENT		Завершение блока информации о договоре	/			
/ SCR09_TAB			Да			
/ SCR09			Да			
/SPCEX_DOC			Да			

ОТЧЕТ ПО НЕТТО-ПОЗИЦИИ УЧАСТНИКА КЛИРИНГА (УК)

Вид: электронный документ

Формат: XML

Наименование (имя файла): SCR10<ДДММГГ>_<Код УК>.xml, где <ДДММГГ> - дата формирования файла,

<Код УК> - биржевой код УК

Структура:

Название тегов	Название атрибутов	Описание	Обязательное	Тип	Размер	Десятичные знаки
SPCEX_DOC		Корневой элемент XML документа.	Да			
DOC_REQUISITIONS		Блок информации о файле	Да			
	DOC_NO	Уникальный учетный номер документа в системе электронного документооборота	Нет	Character	1-12	
	DOC_DATE	Дата формирования файла	Да	Date		
	DOC_TIME	Время формирования файла	Да	Time		
	DOC_TYPE	Тип документа: «SCR10»	Да	Character	1-12	
	SENDER_ID	Идентификатор Стороны, посылающей файл	Нет	Character	1-12	
	SENDER_NAME	Краткое наименование Стороны, посылающей файл	Нет	Character	1-30	
	RECEIVER_ID	Идентификатор Стороны, принимающей файл	Нет	Character	1-12	
	RECEIVER_NAME	Краткое наименование Стороны, принимающий файл	Нет	Character	1-30	
	REMARKS	Текст примечания к файлу	Нет	Character	1-120	
/DOC_REQUISITIONS		Завершение блока информации о документе	Да			
SCR10		Блок данных отчета о нетто-позиции РЕПО	Да			
	VER	Ограничения на версию документа	Да	Character	3-12	
SCR10_TAB		Отчет о нетто-позиции РЕПО	Да			
	REPORT_CODE	Тип документа: «SCR10»	Да	Character	1-12	
	REPORT_NAME	Наименование документа “ ОТЧЕТ О НЕТТО ПОЗИЦИИ РЕПО”	Да	Character	1-30	
	REPORT_VER	Версия документа “1.0”	Да	Character	1-3	
	REPORT_DT	Дата отчета	Да	Date		
	PARTCODE	Идентификатор участника	Да	Character	1-12	
	PARTNAME	Наименование Участника	Да	Character	1-120	
	SUM_MONEY_ORDER	Сумма денежных обязательств	Да	Number	28-2	
	SUM_MONEY_DEMAND	Сумма денежных требований	Да	Number	28-2	
	SUM_MONEY_NETTO	Сумма нетто-обязательств по деньгам	Да	Number	28-2	

	SUM_VALUE_PASS	Сумма обязательств по ценным бумагам	Да	Number	28-2	
	SUM_VALUE_TAKE	Сумма требований по ценным бумагам	Да	Number	28-2	
	SUM_VALUE_NETTO	Сумма нетто-обязательств по ценным бумагам	Да	Number	28-2	
SCR01_REC		Группа по контрагенту	Да			
	TRADE_NUM	Идентификатор (номер) предварительного договора или сделки РЕПО, входящих в расчет нетто-позиции (номер сделки - для второй части РЕПО и номер предварительного договора - для первой части).	Да	Number	11	
	TRADE_DATE	Дата, на которую производится расчет позиции.	Да	Date		
	DIRECT_PARTCODE	Код контрагента	Да	Character	1-12	
	DIRECT_PARTNAME	Наименование контрагента	Да	Character	1-120	
	MONEY_ORDER	Размер обязательств по деньгам	Да	Number	28-2	
	MONEY_DEMAND	Размер требований по деньгам	Да	Number	28-2	
	MONEY_NETTO	Размер нетто-обязательств по деньгам	Да	Number	28-2	
	VALUE_PASS	Размер обязательств по ценным бумагам	Да	Number	28-2	
	VALUE_TAKE	Размер требований по ценным бумагам	Да	Number	28-2	
	VALUE_NETTO	Размер нетто-обязательств по ценным бумагам	Да	Number	28-2	
/		Завершение блока информации REC	Да			
/ SCR10_TAB			Да			
/ SCR10			Да			
/SPCEX_DOC			Да			