

Досрочное изъятие части депозита

MOEX Treasury

12/09/2022

- Появилась возможность оперативно управлять ликвидностью посредством заявления на досрочное изъятие части суммы из депозита (с даты, следующей за датой заключения депозитной сделки);
- Изъятие осуществляется на рыночных условиях в рамках размещенного депозита, что позволит получить конкурентную итоговую ставку по депозиту;
- Повышается привлекательность заключения депозитных сделок с длинными сроками (от недели и более).

Схема работы сервиса



- Возможность изменения суммы депозитов предоставляется Участникам рынка депозитов допущенным к клирингу с **частичным обеспечением на любой срок**, Участникам рынка депозитов допущенным к клирингу с **полным обеспечением только до даты возврата депозита**;
- Реализован отдельный **«стакан»** для подачи заявлений на изъятие содержащий только предложение денежных средств и состоящий только из заявок РЕПО;
- Новые таблицы в терминале MOEX Treasury: **«Депозиты»** - информация обо всех заключенных и неисполненных депозитах с учетом изъятий, **«Календарь депозитов»** – информация по всем дням с событиями (пополнение, изъятие) в разрезе каждого депозита .
- Заявление на изменение суммы депозита может подаваться как в **адресном режиме** стандартным образом так и в **безадресном режиме** с типом исполнения по остатку **«Полностью или отклонить»** или **«Снять остаток»**;
- Стоимость изъятия пропорционально уменьшает изначальную ставку депозита с даты заключения депозита до даты обязательства вернуть изъятые средства и в итоге формирует **скорректированную ставку депозита**;
- Количество и параметры изъятий в рамках одного депозита ограничены только **суммой, сроком депозита и проверкой на положительное значение скорректированной ставки депозита. Проверки при подаче заявления на изъятие:**
 - Сумма в заявлении на изъятие < Суммы в изначальном депозите (в депозите должна остаться как минимум 1000руб. /1 лот КСУ/);
 - Срок в заявлении на изъятие \leq Сроку в изначальном депозите (вторая часть заявления на изъятие не может быть после даты возврата депозита);
 - Скорректированная ставка депозита рассчитанная с учетом ставки изъятия не может быть \leq нулю.
- **Обязательство по пополнению суммы депозита** возникает во всех случаях за исключением изъятия на срок до даты исполнения депозита. Т.е. если вторая часть заявления на изъятие = дате возврата депозита, то обязательство вернуть изъятие в депозит не возникает, в дату возврата депозита НКЦ возвращает остаток тела депозита (с учетом изъятия) + проценты;
- **Заявления на изъятие средств из депозита исполняются раньше** обязательств Участников по возврату изъятых из депозитов сумм и обязательств Участников по внесению денежных средств для заключения депозитных договоров. Т.е. средствами полученными из изъятия можно обеспечить обязательства как по предыдущим изъятиям так и по обязательствам по внесению денежных средств для заключения депозитных договоров;
- Если пополнения суммы депозита в плановую дату не происходит, то осуществляется перенос на следующий Расчетный день, если и в льготный день не происходит пополнения, то дата возврата депозита изменяется на этот день с изменением срока депозита (депозит прекращается досрочно) с выплатой тела депозита и накопленных по нему процентов. Возникновение обязательства по уплате комиссионного вознаграждения за перенос на льготный день и отступное за изменение срока депозита.

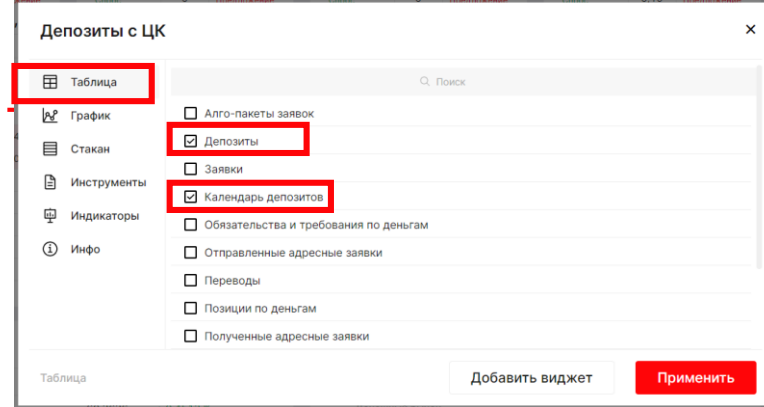
Практическое пособие по процедуре изъятия депозитов

Таблица «Депозиты»



+ Добавить виджет

На вкладке **депозиты** отражаются все заключенные депозиты (не предложения на заключение депозитов).



Депозиты

Календарь депозитов



+	Депозит №	Инструмент	Валюта	Дата размещения	Дата возврата	Начальная сумма депозита	Текущая сумма депозита	Сумма к исполнению	Ставка депозита нач., %	Эффективная ставка, %
⋮	4 288 967 258	КСУ обл.	RUB	29.08.2022	31.10.2022	100 000 000	100 000 000	101 829 589,04	10,6	10,6
⋮	4 288 967 255	КСУ акц.	RUB	29.08.2022	31.10.2022	100 000 000	100 000 000	101 829 589,04	10,6	10,6

Начальная сумма депозита – сумма заключенного депозита
Текущая сумма депозита – сумма депозита с учетом изъятий
Сумма к исполнению – тело депозита + проценты на дату возврата депозита
Ставка депозита нач., % - ставка зафиксированная на момент заключения депозита

Эффективная ставка, %* - ставка рассчитанная исходя из средневзвешенной суммы депозита с учетом изъятий и процентов исходя из скорректированной ставки (информационное значение для отражения влияния изъятий на депозит)

$$* \text{Эффективная ставка} = P / Scв * (Y / T)$$

P - сумма процентов к получению по депозиту с учетом процентов за изъятия

Scв - средневзвешенная сумма депозита с учетом сумм изъятий из депозита



Y - количество дней в году (365, 366) база в году


T - срок депозита

Практическое пособие по процедуре изъятия депозитов

Таблица «Календарь депозитов»

Можно открыть в отдельном окне календарь каждого депозита (правой кнопкой мыши по депозиту)



Таблицы  


Депозиты Календарь депозитов 

+	Депозит №	Инструмент	Валюта	Дата размещения	Дата возврата	Начальная сумма депозита	Ставка депозита нач., %	Текущая сумма депозита	Эффективная ставка, %	Сумма к
⋮	4 288 967 255	КСУ акц.	RUB	29.08.2022	31.10.2022	100 000 000	10,6		9,8608287	
⋮	4 288 967 258	КСУ обл.	RUB	29.08.2022	31.10.2022	100 000 000	10,6		10,5636772	

- ☰ Стакан для изъятия
- ☰ Безадресная заявка на изъятие
- ☰ Адресная заявка на изъятие
- ☰ Календарь депозита

На вкладке **Календарь депозитов** отражаются все депозиты по датам с событиями (изъятие, пополнение)

Таблицы  

Депозиты **Календарь депозитов** 

+	Депозит №	Инструмент	Валюта	Дата	Текущий объём	Плановый объём	Текущая ставка, %	Плановая ставка, %	Изъятие	Пополнение	В заявках на изъятие	В заявках на пополнение
⋮	4 288 967 258	КСУ обл.	RUB	31.10.2022	0	0	10,6	10,6	100 000 000	0	0	0
⋮	4 288 967 258	КСУ обл.	RUB	29.08.2022	100 000 000	100 000 000	10,6	10,6	0	100 000 000	0	0
⋮	4 288 967 255	КСУ акц.	RUB	31.10.2022	0	0	10,6	10,6	100 000 000	0	0	0
⋮	4 288 967 255	КСУ акц.	RUB	29.08.2022	100 000 000	100 000 000	10,6	10,6	0	100 000 000	0	0

Практическое пособие по процедуре изъятия депозитов

Управление таблицами

В рамках таблицы можно добавить все необходимые вкладки

Таблицы  

Депозиты Календарь депозитов Заявки Переводы Предложения/Изъятия Отправленные адресные заявки 



	Депозит №	Инструмент	Валюта	Дата размещения	Дата возврата	Начальная сумма депозита	Текущая сумма депозита	Ставка депозита нач., %	Эффект	Вкладки таблицы
+	4 288 967 255	КСУ акц.	RUB	29.08.2022	31.10.2022	100 000 000	20 000 000	10,6		<input type="checkbox"/> Поиск
⋮	4 288 967 258	КСУ обл.	RUB	29.08.2022	31.10.2022	100 000 000	40 000 000	10,6		<input checked="" type="checkbox"/> Депозиты



Вкладки таблицы:

- Депозиты
- Календарь депоз...
- Заявки
- Переводы
- Предложения/Из...
- Отправленные ад...





Практическое пособие по процедуре изъятия депозитов

Изъятие (стакан для изъятий, адресный, безадресный режим)

Таблицы  

Депозиты  Календарь депозитов 


+	Депозит №	Инструмент	Валюта	Дата размещения	Дата возврата	Начальная сумма депозита	Ставка депозита нач., %	Текущая сумма депозита	Эффективная ставка, %	Сумма к
⋮	4 288 967 255	КСУ акц.	RUB	29.08.2022	31.10.2022	100 000 000	10,6		9,8608287	
⋮	4 288 967 258	КСУ обл.	RUB	29.08.2022	31.10.2022	100 000 000	10,6		10,5636772	

-  Стакан для изъятия
-  Безадресная заявка на изъятие
-  Адресная заявка на изъятие
-  Календарь депозита


Безадресное изъятие доступно только с типами «снять остаток» и «Полностью или отклонить» (т.е. заявка в стакане стоять не может)


Стакан для изъятия содержит только сторону предложения и только РЕПО

Адресная заявка идентична адресному размещению депозита, за исключением направления заявки

Изъять из депозита 

КСУ обл. — RUB

Номер депозита: 4 288 967 258 

Срок изъятия: 1 день 

Срок депозита: 29.08.2022 - 31.10.2022
Сумма депозита: 100 000 000. Ставка: 10,6 %
Текущая сумма депозита: 100 000 000. Текущая ставка: 10,6 %

Дата пополнения 31 авг 2022


Ставка изъятия: 8,08 %


Сумма изъятия: 60 000 000

Лоты: 60 000

Сумма с учётом округления до лотов 60 000 000

1M RUB 10M RUB 100M RUB 1000M RUB

Компания и счёт: КМП тест 26 — 001 

Код клиента: 

Дополнительные параметры

Поставить в очередь Снять остаток Полностью или отклонить

Тип заявки


Лимитная заявка Рыночная цена

ПЭП: МУ9081300001


Отправить

Выбор срока в стакане для изъятия, выбор инструмента

Возврат части депозита

КСУ обл. 

RUB

1 день 


Предложение

8,080


8,080 200 000 000


8,240 286 148 000

Доступные типы заявки на изъятие

Изъять из депозита 


Адресная заявка


Номер депозита: 4 288 967 255 


Партнёр: 

Параметры депозита:
Инструмент: КСУ акц.
Срок депозита: 29.08.2022 - 31.10.2022
Валюта депозита: RUB

Сумма депозита: 100 000 000
Ставка: 10,6 %
Текущая сумма депозита: 100 000 000
Текущая ставка: 10,6 %

Дата изъятия: 30 авг 2022 

Срок изъятия: 10 дней 

Инструмент: КСУ акц. 

Дата пополнения 9 сен 2022


Ставка изъятия: 8,080 %


Сумма изъятия: 80 000 000


Лоты: 80 000

Сумма с учётом округления до лотов 80 000 000

1M RUB 10M RUB 100M RUB 1000M RUB

Компания и счёт: КМП тест 26 — 00000 

Код клиента: 

ПЭП: МП 

Отправить


Практическое пособие по процедуре изъятия депозитов

Календарь депозита после выставления адресного изъятия*

Календарь депозита № 4 288 967 255

Инструмент: КСУ акц.

Валюта: RUB

Расчётный код: 

Дата	Текущий объём	Планный объём	Текущая ставка, %	Планируемая ставка, %	Изъятие	Пополнение	В заявках на изъятие	В заявках на пополнение
29.08.2022	100 000 000	100 000 000	10,6	10,6	0	100 000 000	0	0
30.08.2022	100 000 000	20 000 000	10,6	10,6	0	0	80 000 000	0
09.09.2022	100 000 000	100 000 000	10,6	10,6	0	0	0	80 000 000
31.10.2022	0	0	10,6	10,6	100 000 000	0	0	0

Надлежащая дата возврата депозита

Размещение депозита

Выставлено адресное изъятие

* В заявки может попадать только адресное изъятие, безадресное исполняется полностью иначе отклоняется тип «полностью или отклонить» либо исполняется частично, а остаток снимается тип «снять остаток».

депозит по которому заключено изъятие

Таблицы		Депозиты Календарь депозитов Заявки Переводы Предложения/Изъятия Отправленные адресные заявки									
+	Заявка №	Дата размещения	Статус	Режим	Инструмент	Валюта	Направление	Ставка, %	Депозит №	Сумма депозита	Срок депозита
⋮	32 300 547 992	30.08.2022	Исполнена	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ акц.	RUB	Изъять	8,08	4 288 967 255	80 000 000	10

Практическое пособие по процедуре изъятия депозитов

Таблицы «Депозит» и «Календарь депозита» после заключения изъятия

Таблицы										Депозиты	Календарь депозитов
+	Депозит №	Инструмент	Валюта	Дата размещения	Дата возврата	Начальная сумма депозита	Текущая сумма депозита	Сумма к исполнению	Ставка депозита нач., %	Эффективная ставка, %	
⋮	4 288 967 255	КСУ акц.	RUB	29.08.2022	31.10.2022	100 000 000	20 000 000	101 652 493,15	10,6	9,8608287	
⋮	4 288 967 255	КСУ акц.	RUB	29.08.2022	31.10.2022	100 000 000	20 000 000	101 652 493,15	10,6	9,8608287	

Календарь депозита № 4 288 967 255

Инструмент: КСУ акц.

Валюта: RUB

Расчётный код:

Дата	Текущий объём	Плановый объём	Текущая ставка, %	Плановая ставка, %	Изъятие	Пополнение	В заявках на изъятие	В заявках на пополнение
29.08.2022	100 000 000	100 000 000	17,32	17,32	0	100 000 000	0	0
30.08.2022	20 000 000	20 000 000	17,32	17,32	80 000 000	0	0	0
09.09.2022	100 000 000	100 000 000	10,6	10,6	0	80 000 000	0	0
31.10.2022	0	0	10,6	10,6	100 000 000	0	0	0

* *Скорректированная ставка депозита – ставка депозита с учетом стоимости изъятия (ставка в заявке на изъятие), начиная с первого дня начисления процентов заканчивая плановой датой возврата средств в депозит. В случае изъятия до надлежащей даты возврата, ставка корректируется на весь срок депозита.*

Изменения в клиринговых отчетах

~~EQM4D~~ «Отчет о требованиях и обязательствах по депозитным договорам» - **Упразднен**

EQM85 «Отчет об изменении суммы депозита» – **Новый отчет**

Изменения в структуре отчетов:

EQM06 «Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг»

EQM13 «Отчет об итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях»

EQM35 «Уведомление об обязательствах по уплате отступного (по депозитным договорам)»

Структура отчета не меняется, отчет дополняется данными связанными с событиями (операциями) по изменению суммы депозита:

EQM15 «Отчет по обязательствам участника клиринга по комиссионному вознаграждению»

ССХ26 «Отчет о начисленных и выплаченных процентах по депозитным договорам»

ССХ99 «Отчет о движении денежных средств»

Структура XML файлов - <https://fs.moex.com/files/951/42664>

Новый отчет EQM85 раскрывает измененные параметры депозита(ов) в случае изменения их суммы.

Отчет об изменении суммы депозита

Дата отчета: 30.08.2022

Наименование участника клиринга: ОБЩЕСТВО С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ

Идентификатор участника клиринга:

Депозиты с измененной суммой

Первоначальные характеристики депозитов							Изменившиеся характеристики депозитов				
Номер депозитного договора	Валюта расчетов	Расчетный код	Дата заключения депозитного договора	Дата возврата депозита по договору	Первоначальная сумма	Первоначальная процентная ставка	Дата изменения суммы депозита	Остаток депозита на конец даты изменения суммы депозита	Актуальная процентная ставка	Требования по возврату депозита	Дата исполнения обязательств по возврату депозита
622	RUR		25.08.2022	01.09.2022	200,000,000.00	7.91	30.08.2022	130,000,000.00	7.8980051	200,287,509.61	01.09.2022

Расчетный код:

Валюта расчетов: RUR

Номер депозитного договора: 6222

Изменения требований по возврату депозита, периоды действия процентных ставок

Дата*	Увеличение размера депозита: размещения, суммы пополнений за день	Уменьшение размера депозита: сумма частичных выводов за день, возврат	Остаток депозита на конец даты изменения суммы депозита	Актуальная процентная ставка, действующая с указанной даты*
25.08.2022	200,000,000.00	0.00	200,000,000.00	7.8980051
29.08.2022	0.00	1,601,000.00	198,399,000.00	7.8980051
30.08.2022	1,601,000.00	70,000,000.00	130,000,000.00	7.8980051
31.08.2022	70,000,000.00	0.00	200,000,000.00	7.91
01.09.2022	0.00	200,000,000.00	0.00	7.91

СПАСИБО
ЗА ВНИМАНИЕ