

An aerial view of a city skyline at sunset, with several prominent skyscrapers in the foreground and a river winding through the city. The sky is a mix of orange and blue, and there is a layer of clouds at the bottom of the frame.

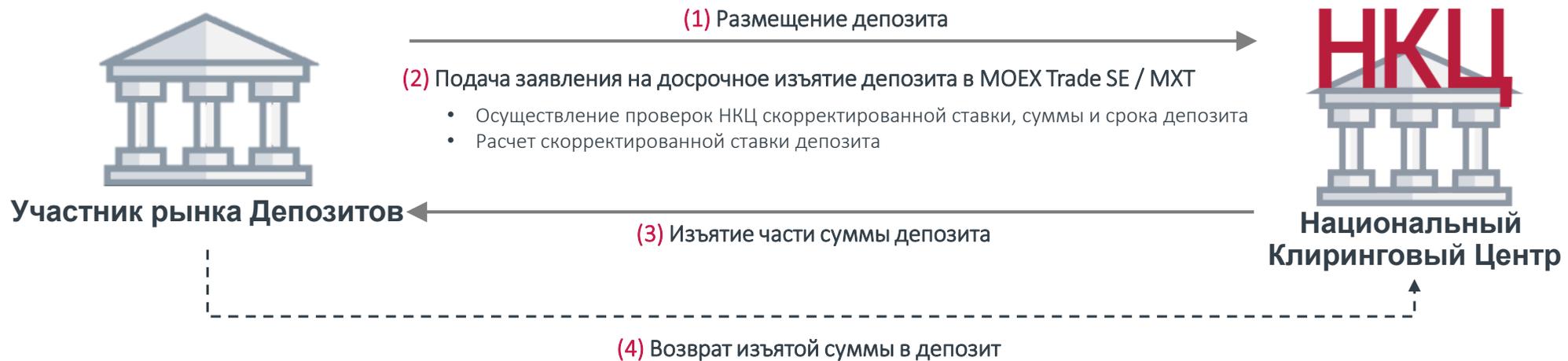
Досрочное изъятие части депозита

ТМOEX Trade SE

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 Trade SE: **«Депозиты»** - информация обо всех заключенных и неисполненных депозитах с учетом изъятий, **«История 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 обязательства 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

Подключение сервиса

1. При регистрации в Торговой Системе развернуть окно по кнопке «Показать параметры»;

2. Нажать на кнопку с молоточком;

3. В отрывшемся окне выбрать закладку «Сервисное подключение»;

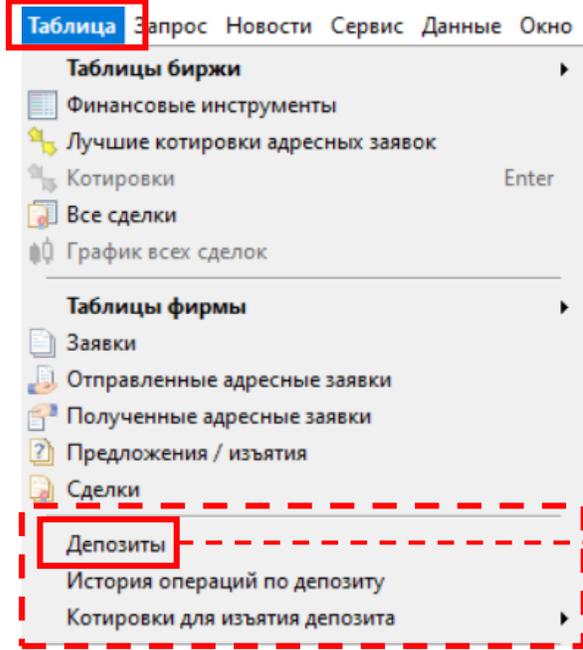
4. Поставить галочку «Разрешить подключение».

Для подключения сервиса «Досрочное изъятие депозитов» необходимо:

1. При регистрации в Торговой Системе развернуть окно по кнопке «Показать параметры»;
2. Нажать на кнопку с молоточком;
3. В отрывшемся окне выбрать закладку «Сервисное подключение»;
4. Поставить галочку «Разрешить подключение».

Практическое пособие по процедуре изъятия депозитов

Таблица «Депозиты»



Таблицы сервиса изъятия депозитов

В таблице «Депозиты» отражаются все заключенные депозиты (не предложения на заключение депозитов).

Дата фактического возврата – дата возврата депозита при изменении срока депозита
 Сумма депозита – сумма заключенного депозита
 Текущая сумма – сумма депозита с учетом изъятий
 Сумма возврата – тело депозита + проценты на дату возврата депозита
 Ставка, % - 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)

* Эффективная ставка = $P / Scv * (Y / T)$

P - сумма процентов к получению по депозиту с учетом процентов за изъятия
 Scv - средневзвешенная сумма депозита с учетом сумм изъятий из депозита
 Y - количество дней в году (365, 366) база в году
 T - срок депозита

Депозит №	Код инструмента	Инструмент	Валюта	Код фирмы	Расчетный код	Дата размещения	Дата возврата	Дата фактического возврата	Сумма депозита	Текущая сумма	Ставка, %	Эффективная ставка, %	Сумма возврата	Средневзвешенная сумма	Фирма
4 289 528 858	RU000A0JW4Z1	КСУ обл.	руб.			31.08.2022	09.12.2022	09.12.2022	300 000 000,00	300 000 000,00	8,0800000	8,0800000	306 641 095,89	300 000 000,00	

Практическое пособие по процедуре изъятия депозитов

Таблица «История операций по депозиту»

9 - Депозиты

Депозит №	Код инструмента	Инструмент	Валют
4 259 782 900	KU000A0JW4Z1	КСУ обл.	руб.
4 259 782 900	RU000A0JW4Z1	КСУ обл.	руб.
4 259 782 903	RU000A0JW4Z1	КСУ обл.	руб.
4 259 785 107	RU000A0JW4Z1	КСУ обл.	руб.
4 259 967 844	RU000A0JW4Z1	КСУ обл.	руб.
4 260 136 519	RU000A0JW4Z1	КСУ обл.	руб.
4 290 082 977	RU000A0JW4Z1	КСУ обл.	руб.

- Ввести заявку изъятия депозита...
- Ввести адресную заявку изъятия депозита...
- История операций по депозиту**
- Котировки для изъятия депозита

Таблицу **История операций по депозиту** можно открыть из контекстного меню таблицы **Депозиты**

В таблице **Календарь депозитов** отражается выбранный депозит по датам с событиями (изъятие, пополнение)

2 - КСУ обл. - 02.09.2022-30.09.2022 - 300 000 000,00 руб. - 7,8700000% - История операций по депозиту #4 290 082 977

Номер депозита	Фирма	Инструмент	Дата изменения	Валюта расчетов	Текущий объем	Текущая ставка	Изъятие	Пополнение	В заявках на изъятие	В заявках на пополнение	Плановый объем	Плановая ставка	Расчетный код	Код инструмента	Код фирмы
4 290 082 977		КСУ обл.	02.09.2022	руб.	300 000 000,00	7,8700000		300 000 000,00			300 000 000,00	7,8700000		RU000A0JW4Z1	
4 290 082 977		КСУ обл.	30.09.2022	руб.		0,00	300 000 000,00					0,00		RU000A0JW4Z1	

Стакан для изъятий, безадресный режим

* 1 - Депозиты

Депозит №	Код инструмента	Инструмент	Валюта	Код фирмы	Расчетный код	Дата размещения	Д
4 290 082 877	RU000A01M471	КСУ с б...	руб	МСР		02.09.2022	

Ввести заявку изъятия депозита...
Ввести адресную заявку изъятия депозита...

История операций по депозиту

Котировки для изъятия депозита

Срок	Объем	Ставка
1 дн	530 556 000,00	8,270%
7 дн.		
7 дн	4 742 000,00	7,480%
14 дн.		
14 дн	268 904 000,00	10,190%
1 мес.		
1 мес	2 342 000,00	7,860%
2 мес.		
2 мес	21 517 000,00	10,590%
3 мес.		
3 мес	22 940 000,00	10,600%
6 мес.		
6 мес	1 197 000,00	11,060%
9 мес.		
9 мес	15 582 000,00	2,830%
1 год		
1 г		

Копировать ячейку Ctrl+C
Фильтр...
Фильтр по столбцу...
Использовать фильтр Ctrl+Space
Фильтры
Шаблоны
Свойства...

Котировки для изъятия «стакан» можно открыть из контекстного меню таблицы **Депозиты** или аналогичным образом их таблицы **История операций по депозиту**

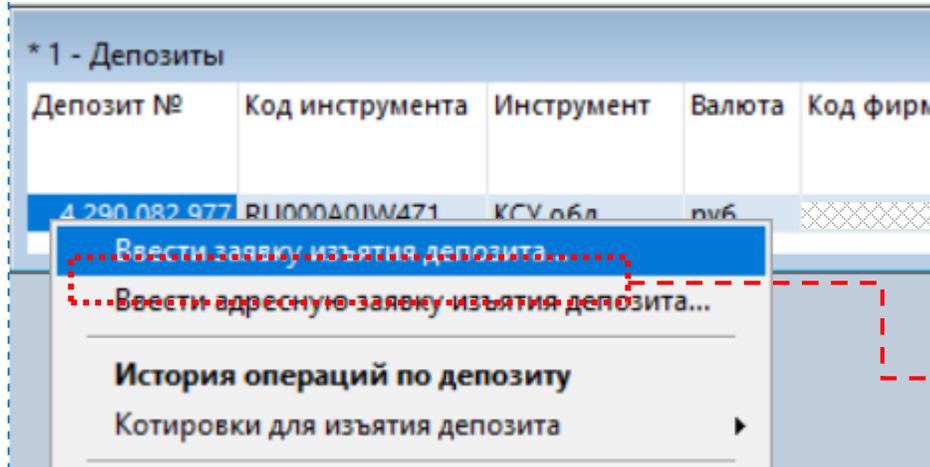
«Стакан» для изъятия содержит только сторону предложения и только РЕПО

Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн - К...

Срок изъятия: 1 дн

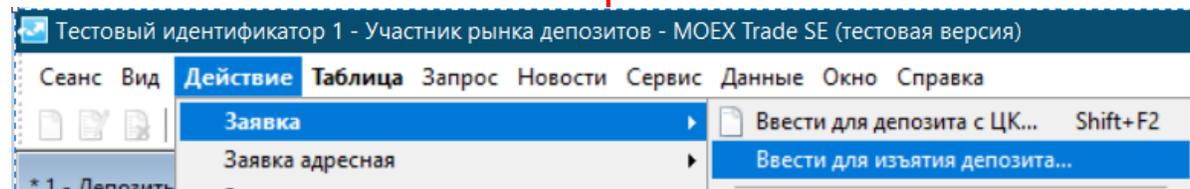
Ставка, %	(Рз) Объем
8,270	530 556 000,00
8,370	28 136 000,00
8,480	25 030 000,00
8,590	23 602 000,00
8,690	21 356 000,00
8,800	24 222 000,00
8,910	28 109 000,00
9,010	32 234 000,00
9,120	24 282 000,00
9,230	22 713 000,00
9,330	30 987 000,00
9,440	25 832 000,00
9,550	25 052 000,00
9,650	31 367 000,00
9,760	30 537 000,00
9,870	26 022 000,00
9,970	22 030 000,00
10,080	32 855 000,00
10,190	31 336 000,00
10,290	31 179 000,00

Изъятие (безадресный режим)



Безадресную заявку можно выставить из контекстного меню таблиц «Депозиты», аналогично из таблицы «История операций по депозитам», из стакана котировок на изъятие, а так же из главного меню «Действие»

Ставка, %	(Рз) Объем
8,270	530 556 000,00
8,370	28 136 000,00
8,480	25 030 000,00
8,590	23 602 000,00
8,690	21 356 000,00
8,800	24 222 000,00
8,910	28 109 000,00

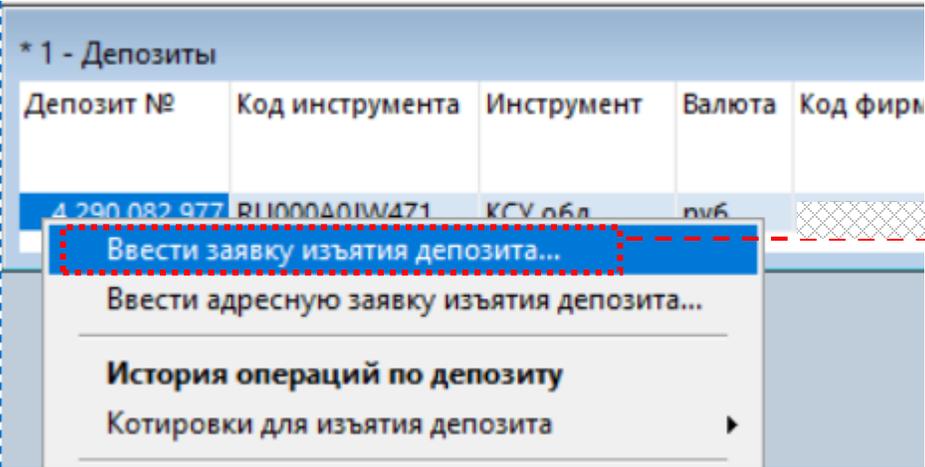


Доступные типы заявки на изъятие:

- Лимитная;
- Снять остаток или Полностью или отклонить;
- По разным ценам.

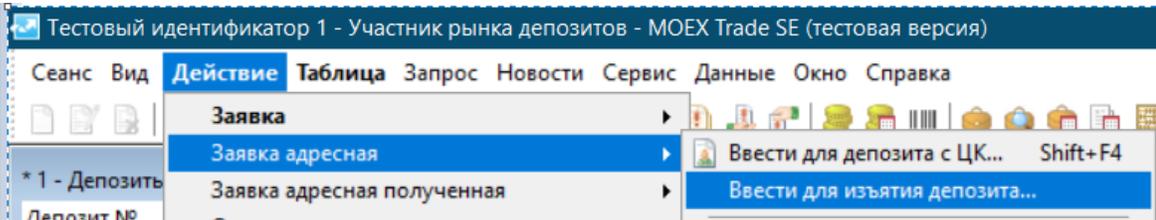
Практическое пособие по процедуре изъятия депозитов

Изъятие (адресный режим)



Адресная заявка практически идентична адресному размещению депозита, за исключением направления заявки

Адресную заявку можно выставить из контекстного меню таблиц «Депозиты», аналогично из таблицы «История операций по депозитам», а так же из главного меню «Действие»



Ввод адресной заявки изъятия депозита

Изъять [Заполнить последней](#)

Депозит №: 4 290 082 977
 Инструмент: КСУ обл., срок депозита: 02.09.2022 - 30.09.2022
 Сумма депозита: 300 000 000,00 руб., ставка: 7,87000000%
 Текущая сумма: 300 000 000,00 руб., текущая ставка: 7,87000000%

Партнер: [] Дата изъятия: 05.09.2022 ?

Первая часть сделки изъятия депозита
 Лотов: 100 000 [] [] [] []
 Размер лота: 1 000 [] [] [] [] [] []

Вторая часть сделки изъятия депозита
 Срок изъятия, дней: 1 []
 Режим: Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК адрес

Сумма изъятия: 100 000 000,00 [-> лоты] Ставка, %: 7,870 ?

Валюта: руб. Дата изъятия: 05.09.2022 Дата возврата: 06.09.2022

Торговый счет: [] Клиринговый расчетный код: 07991
 Клиент: [] Поручение: []
 Ссылка: []

Ввести заявку [] []

Практическое пособие по процедуре изъятия депозитов

История операций по депозиту после выставления адресного изъятия*

Выставлено адресное изъятие на 1 день

4 - КСУ обл. - 02.09.2022-30.09.2022 - 300 000 000,00 руб. - 7,8700000% - История операций по депозиту #4 290 082 977

Номер депозита	Фирма	Инструмент	Дата изменения	Валюта расчетов	Текущий объем	Текущая ставка	Изъятие	Пополнение	В заявках на изъятие	В заявках на пополнение	Плановый объем	Плановая ставка	Расчетный код	Код инструмента	Код фирмы
4 290 082 977		КСУ обл.	02.09.2022	руб.	300 000 000,00	7,8700000		300 000 000,00			300 000 000,00	7,838888		RU000A0JW4Z1	
4 290 082 977		КСУ обл.	06.09.2022	руб.	300 000 000,00	7,8700000			150 000 000,00		150 000 000,00	7,838888		RU000A0JW4Z1	
4 290 082 977		КСУ обл.	07.09.2022	руб.	300 000 000,00	7,8700000				150 000 000,00	300 000 000,00	7,8700000		RU000A0JW4Z1	
4 290 082 977		КСУ обл.	30.09.2022	руб.	0,00	7,8700000	300 000 000,00				0,00	7,8700000		RU000A0JW4Z1	

* 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.
По полю «Системная ссылка» можно идентифицировать принадлежность изъятия к определенному депозиту в таблицах «Сделки для исполнения» и «Предложения / изъятия».

1 - Отправленные адресные заявки

Заявка №	Время	Статус	Режим	Инструмент	Операция	Код расче	Ставка, %	Сумма/Сумма д	Срок,	Сумма возврат	Партнер	Время изме	Расчетный	Системная ссылка
32 463 369 274	9:47:21	Ак	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК адрес	КСУ обл.	Из	Y0	8,150	150 000 000,00	1	150 033 493,15			07991	4290082977

Практическое пособие по процедуре изъятия депозитов

Таблицы «Депозит» и «История операций по депозиту» после заключения изъятия

Сумма депозита с учетом изъятия (80млн.)

Ставка депозита с учетом влияния изъятия в целом

* 1 - Депозиты

Депозит №	Код инструмента	Инструмент	Валюта	Код фирмы	Расчетный код	Дата размещения	Дата возврата	Дата фактического возврата	Сумма депозита	Текущая сумма	Ставка, %	Эффективная ставка, %	Сумма возврата	Средневзвешенная сумма
4 290 082 977	RU000A0JW4Z1	КСУ обл.	руб.	MC9043100000		02.09.2022	30.09.2022	30.09.2022	300 000 000,00	150 000 000,00	7,8700000	7,7953309	301 777 684,92	297 272 727,27

Скорректированная ставка*

Изъятие заключилось (дата, сумма)

Возврат изъятия (дата, сумма)

4 - КСУ обл. - 02.09.2022-30.09.2022 - 300 000 000,00 руб. - 7,8700000% - История операций по депозиту #4 290 082 977

Номер депозита	Фирма	Инструмент	Дата изменения	Валюта расчетов	Текущий объем	Текущая ставка	Изъятие	Пополнение	В заявках на изъятие	В заявках на пополнение	Планный объем	Планируемая ставка	Расчетный код	Код инструмента	Код фирмы
4 290 082 977		КСУ обл.	02.09.2022	руб.	300 000 000,00	7,8388889		300 000 000,00			300 000 000,00	7,8388889	07991	RU000A0JW4Z1	
4 290 082 977		КСУ обл.	06.09.2022	руб.	150 000 000,00	7,8388889	150 000 000,00				150 000 000,00	7,8388889	07991	RU000A0JW4Z1	
4 290 082 977		КСУ обл.	07.09.2022	руб.	300 000 000,00	7,8700000		150 000 000,00			300 000 000,00	7,8700000	07991	RU000A0JW4Z1	
4 290 082 977		КСУ обл.	30.09.2022	руб.	0,00	7,8700000	300 000 000,00				0,00	7,8700000	07991	RU000A0JW4Z1	

* 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.

Практическое пособие по процедуре изъятия депозитов

Таблицы «Сделки для исполнения» и «Предложения / изъятия» после заключения изъятия

Сделка №	Дата сделки	Дата исполнения	Инструмент	Режим	Код расчетов	Тип	Операция	Лоты	Бумаг к исполнению	Лотов к исполнению	Сумма/Сумма депозита	Сумма к исполнению	Ставка, %	Срок, дней	Расчетный кол	Торговый счет партнера	Статус	Системная ссылка
4 291 032 750	06.09.2022	07.09.2022	КСУ обл.	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК ...	Y1	DA2	P	150 000	150 000 000	150 000	150 000 000,00	150 033 493,15	8,150	1		S01+00000F00	Подтв	4290082977

Поле «Системная ссылка» содержит номер депозита по которому заключено изъятие, таким образом можно идентифицировать принадлежность обязательства и изъятия к определенному депозиту в таблицах «Сделки для исполнения» и «Предложения / изъятия».

Предложен	Время	Заявка №	Инструмент	Режим	Код расче	Операция	Ставка, %	Сумма/Сумма	Срок	Сумма возврат	Расчетный	Дата торгс	Дата расче	Комиссия с	Комиссия	Комиссия	Системная ссылка
4 291 032 748	12:26:22	32 463 369 274	КСУ обл.	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК адрес	Y0	Из	8,150	150 000 000,00	1	150 033 493,15		06.09.2022	06.09.2022	0,02	0,00	0,02	4290082977

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