

РЕПО с КСУ с автоматической капитализацией процентов

10 сентября 2026



Основные характеристики

Открытая дата

- Максимальный срок 360 дней
- Выход из сделки в одностороннем порядке
- Ежедневное начисление и списание комиссии



Плавающая ставка

- Ключевая ставка Банка России (FKPO)
- RUSFAR (FRPO)



Капитализация процентов

- Сложные проценты
- Логика сделок ON



Безадресный режим

- КСУобл, КСУакц, КСУвсе
- Evergreen = 1



Расчет процентов*

В случае если дата, предшествующая дате расчета дохода по Сделке РЕПО с открытой датой с компаундингом, НЕ является Расчетным днем, доход по Сделке РЕПО с открытой датой с компаундингом рассчитывается по следующей формуле:

$$I_j = \left(N + \sum_{x=1}^i A_x \right) * \left(\sum_{T_{i+1}}^{T_j} \frac{r_j}{Y_j * 100} \right)$$



В случае если дата, предшествующая дате расчета дохода по Сделке РЕПО с открытой датой с компаундингом, является Расчетным днем, доход по Сделке РЕПО с открытой датой с компаундингом рассчитывается по следующей формуле:

$$I_j = \left(N + \sum_{x=1}^{j-1} A_x \right) * \left(\frac{r_j}{Y_j * 100} \right)$$

Где:

I_j — доход по Сделке РЕПО с открытой датой с компаундингом в j-й день

N — сумма первой части Сделки РЕПО с открытой датой с компаундингом

r_j — значение ставки РЕПО для даты «j»

Y_j — число дней в календарном году, на который приходится j-й день

$\sum_{x=1}^i A_x$ — накопленный доход по Сделке РЕПО с открытой датой с компаундингом с даты исполнения первой части Сделки РЕПО с открытой датой с компаундингом по Расчетный день, предшествующий j-му дню (включая его)

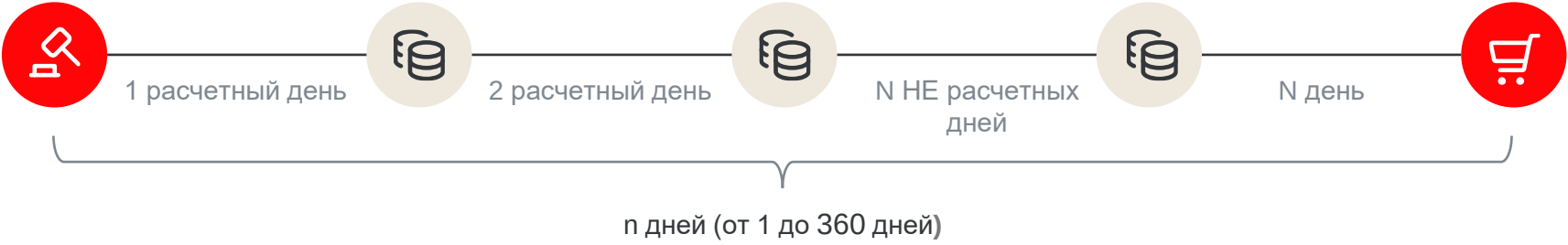
i — дата Расчетного дня, предшествующего дате расчета дохода по Сделке РЕПО с открытой датой с компаундингом

T_{i+1} — дата первого из дней, предшествующих дате расчета дохода по Сделке РЕПО с открытой датой с компаундингом, не являющихся Расчетными днями



* п.21.12.2 Правила клиринга Часть II

Капитализация процентов



Пример:

Сумма первой части — 10 000 000р,
Индикатор RUSFAR
Ставка = значение индикатора
(T-1) + спред

День		База начисления	Формула (индикатор + спред)	Сумма процентов	Капитализация (на конец дня)
16.09, ср	Заклучение сделки				
17.09, чт	расчетный	10 000 000,00	$10\,000\,000,00 * \frac{13,89\%}{365}$	3 805,48	10 003 805,48
18.09, пт	расчетный	10 003 805,48	$10\,003\,805,48 * \frac{13,93\%}{365}$	3 817,89	10 007 623,37
19.09, сб	нерасчетный	10 007 623,37	$10\,007\,623,37 * \frac{13,77\%}{365} * 3$	11 326,44	—
20.09, вс	нерасчетный				
21.09, пн	расчетный				10 018 949,81
22.09, вт	расчетный	10 018 949,81	$10\,018\,949,81 * \frac{13,97\%}{365}$	3 834,65	10 022 784,46

Плавающие ставки

Применение индикаторов

- RUSFAR за предыдущий Расчетный день
- Ключевая ставка БР за текущий Расчетный день

Т.е. используется известное значение индикатора на утро текущего дня



Ограничение по ставке

В случае если сумма индикатора и спреда меньше или равна нулю, то ставка РЕПО с КСУ принимается равной 0.01%



RUSFAR

Если в текущем дне расчет значения индикатора RUSFAR не производится, его значение принимается равным последнему известному значению

RUSFAR не рассчитывается:

- в последний торговый день года
- в нерабочие торговые дни
- в рабочие субботы и воскресенья



Применение индикатора Ключевая ставка Банка России

При использовании индикатора Ключевая ставка Банка России проценты рассчитываются с учетом ежедневного изменения + спред

Значение индикатора для Ключевой ставки БР применяется за текущий Расчетный день



Пример:

Дни недели	ВТ Первая часть РЕПО	СР	ЧТ	ПТ	СБ	ВС	ПН	ВТ Вторая часть РЕПО
Значение индикатора (%)	14	14	14	14			13,75	13,75
Применение Ключевой ставки Банка России для расчета процентов		↓	↓	↓	↓	↓	↓	↓

Применение индикатора RUSFAR

Проценты рассчитываются с учетом ежедневного изменения индикатора + спред

Значение индикатора RUSFAR(ON) применяется за **предыдущий** Расчетный день



Пример:

Дни недели	ВТ	СР	ЧТ	ПТ	СБ	ВС	ПН	ВТ
	Первая часть РЕПО							Вторая часть РЕПО
Значение индикатора (%)	13,98	13,95	13,97	13,87			13,93	13,83
Применение индикатора RUSFAR(ON) для расчета процентов	↓	↓	↓	↓	↓	↓	↓	↓

Выставление заявки на заключение сделки

Ввод заявки РЕПО с ЦК

Купить/Продать Продать/Купить [Заполнить последней](#)

Режим: РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.

Инструмент: КСУ обл.

Валюта расч.: руб.

Открытая дата по плавающей ставке со сложными процентами

5 - Заявки		Статус	К/П	Лоты	Остаток лотов	Объем	Код расчетов	Срок РЕПО	Стоимость выкупа РЕПО	Стоимость выкупа РЕПО с открытой датой	Индикатор	Значение индикатора, %	Цена	Открытое РЕПО T+1	Открытое РЕПО T+2	Открытое РЕПО доход T+1/T+2	Период до исполнения второй части РЕПО	Репо с "Открытой датой"	Сложный процент	Плавающая ставка
FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	+	К/П	30 000		30 000 000,00	Y0	359	34 317 967,04	30 011 572,60	RUSFAR ...	13,99	0,10	03.09.2026	04.09.2026	11 568,85	1	Да	Да	Плавающая
FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	+	К/П	50 000		50 000 000,00	Y0	359	57 307 042,09	50 019 315,07	Ключев...	14	0,10	03.09.2026	04.09.2026	19 308,82	1	Да	Да	Плавающая

* 10 - Сделки

Дата расчета	Код режима	Режим	Статус	Тип	К/П	▲ Лоты	Объем	Код расчетов	Индикатор	Значение индикатора, %	Ставка / Спред, %	Сложный процент	Репо с "Открытой датой"	Плавающая ставка	Открытое РЕПО доход T+1/T+2	Открытое РЕПО T+1	Открытое РЕПО T+2
02.09.2026	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	+	ЦК	К/П	30 000	30 000 000,00	Y0	RUSFAR о...	13,99	0,10	Да	Да	Плавающая	11 568,85	03.09.2026	04.09.2026
02.09.2026	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	+	ЦК1	К	30 000	30 000 000,00	Y0	RUSFAR о...	13,99	0,10	Да	Да	Плавающая	-30 011 572,60	03.09.2026	04.09.2026
02.09.2026	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	+	ЦК	К/П	50 000	50 000 000,00	Y0	Ключевая...	14	0,10	Да	Да	Плавающая	19 308,82	03.09.2026	04.09.2026
02.09.2026	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	+	ЦК1	К	50 000	50 000 000,00	Y0	Ключевая...	14	0,10	Да	Да	Плавающая	-50 019 315,07	03.09.2026	04.09.2026

MTSE таб. «Сделки для исполнения»

Наименование поля	1-я часть РЕПО (ЦК)	2-я часть РЕПО (ЦК2)
Сумма/Сумма РЕПО	Сумма первой части РЕПО	Сумма первой части РЕПО
Стоимость выкупа РЕПО/ Проценты по Займу и Сумма возврата РЕПО	Сумма первой части РЕПО + сумма всех процентов рассчитанных по прогнозным значениям индикатора (риск-параметры процентных рисков, значение «Расчетная ставка РЕПО, %») с учетом капитализации	Сумма первой части РЕПО + сумма всех процентов рассчитанных по известным и прогнозным значениям индикатора (риск-параметры процентных рисков, значение «Расчетная ставка РЕПО, %») с учетом капитализации
Сумма к исполнению	Сумма первой части РЕПО	В дату заключения сделки (индикативно): - Сумма первой части РЕПО + начисленные проценты на ближайшую возможную дату исполнения (T+1) по известным значениям индикатора В последующие даты: - Сумма первой части РЕПО + начисленные проценты на текущую дату по известным значениям индикатора с учетом капитализации
Стоимость выкупа РЕПО с открытой датой	—	Сумма первой части РЕПО + начисленные проценты на ближайшую возможную дату исполнения (T+1) по известным значениям индикатора и прогнозным значениям индикатора с учетом капитализации
Сложный процент (новое поле)	РЕПО со сложными процентами (да)	РЕПО со сложными процентами (да)

Сделки для исполнения

Test identifier 1 - Управляющий фирмы - MOEX Trade SE (тестовая версия)

Сеанс Вид Действие Таблица Запрос Чат Новости НКЦ НРД Сервис Данные Окно Справка

Найти:

14 - Сделки для исполнения

Дата сделки	Дата исполнения	Код режима	Режим	К/П	Тип	Код расчетов	Срок	Период до исполнен второй части	Сумма / Сумма РЕПО	Стоимость выкупа РЕПО/ Проценты по Займу	Сумма возврата РЕПО/ Проценты по Займу	Стоимость выкупа РЕПО с открытой датой	Сумма к исполнению	Лоты	Статус	Индикатор	Значени индикат	Ставка / Спред, %	Статус РЕПО с открытой датой	Плавающая ставка	Сложный процент
02.09.2026	02.09.2026	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	К	ЦК1	Y0			30 000 000,00	34 317 967,04	34 317 967,04			30 000	Подтв	RUSFAR ...		0,10	Да	Плавающая	Да
02.09.2026	27.08.2027	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	П	ЦК2	YOD12M	359	1	30 000 000,00	34 317 967,04	34 317 967,04	30 011 572,60	30 011 580,82	30 000	Подтв	RUSFAR ...	13,99	0,10	Да	Плавающая	Да
02.09.2026	02.09.2026	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	К	ЦК1	Y0			50 000 000,00	57 307 042,09	57 307 042,09			50 000	Подтв	Ключев...		0,10	Да	Плавающая	Да
02.09.2026	27.08.2027	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	П	ЦК2	YOD12M	359	1	50 000 000,00	57 307 042,09	57 307 042,09	50 019 315,07	50 019 315,07	50 000	Подтв	Ключев...	14	0,10	Да	Плавающая	Да

Сумма выкупа РЕПО с ОД на дату заключения сделки =
ОКРУГЛ $(30\,000\,000 * (1 + (13,98 + 0,1) / 100 / 365); 2)$

Используется прогнозное* значение индикатора из риск-параметров

Далее в течение жизни сделки за даты в которых значение уже определилось известные значения, на T+1 прогнозные значения. Например на 04/09:

- для 03/09 известное* значение 13,88% с 02/09
- для 04/09 известное* значение 13,95% с 03/09
- для 07/09 прогнозные* на 07/09 из риск параметров сформированных 04/09 — 13,94%

Сумма к исполнению =
ОКРУГЛ $(30\,000\,000 * (1 + (13,99 + 0,1) / 100 / 365); 2)$

Используется последнее известное* значение* индикатора

Далее в течение жизни сделки так же используются только известные* значения индикатора с итоговым расчетом на текущую дату. Например на 04/09:

- для 03/09 известное* значение 13,88% с 02/09
- для 04/09 известное* значение 13,95% с 03/09

И не забываем про капитализацию процентов в базу для расчета начиная с 04/09

* 732 - Параметры про...

Актив	Дата расчетов	Расчетная ставка РЕПО, %
RREFKEYR	02.09.2026	14,00
RUSFAR	02.09.2026	13,99
RREFKEYR	03.09.2026	14,00
RUSFAR	03.09.2026	13,98
RREFKEYR	04.09.2026	13,99
RUSFAR	04.09.2026	13,97
RREFKEYR	05.09.2026	13,99
RUSFAR	05.09.2026	13,96
RREFKEYR	06.09.2026	13,98
RUSFAR	06.09.2026	13,95
RREFKEYR	07.09.2026	13,98
RUSFAR	07.09.2026	13,93
RREFKEYR	08.09.2026	13,97
RUSFAR	08.09.2026	13,92
RREFKEYR	09.09.2026	13,97
RUSFAR	09.09.2026	13,91
RREFKEYR	10.09.2026	13,96
RUSFAR	10.09.2026	13,90

* Для ключевой ставки значение на дату расчета, для RUSFAR за предыдущий расчетный день

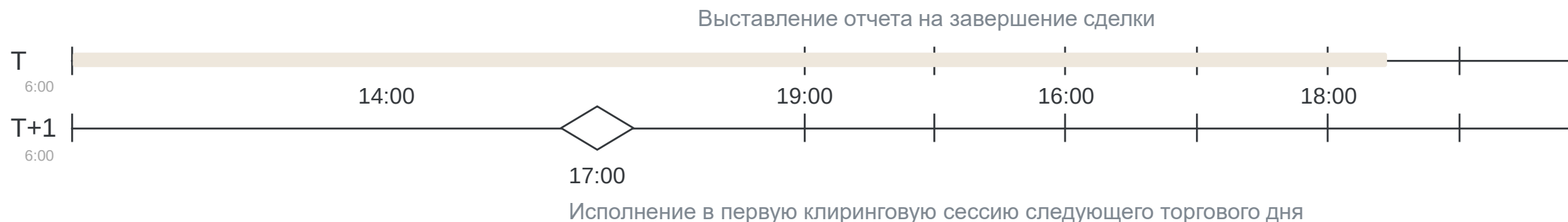
Порядок выставления отчетов на исполнение и расчеты

Поручение на закрытие можно подавать начиная с даты заключения сделки РЕПО с открытой датой

Сделка РЕПО с открытой датой становится срочной к исполнению **на следующий расчетный день** при подаче поручения на завершение в течение основной торговой сессии



Выставление поручения на завершение РЕПО с открытой датой возможно в период времени (06:50-19:00) с исполнением в первую клиринговую сессию **следующего** расчетного дня



Заккрытие сделки РЕПО

Ввод отчета на закрытие сделки РЕПО с открытой датой

Сделка №: 4 669 066 661

Клиринговая фирма: Берестовой

Партнер:

Режим: РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.

Инструмент: КСУ обл.

Бумаг к исполнению: -30 000 000

Сумма к исполнению: 30 011 580,82 руб.

Дата исполнения: 27.08.2027

Стоимость выкупа, на след. день: 30 011 572,60

Ввести отчет

Закрыть

Ввести отчет на исполнение...

Ввести срочный отчет на исполнение...

Ввести отчет на исполнение без подтверждения...

Ввести отчет на отказ...

Ввести отчет на досрочное исполнение...

Ввести отчет на закрытие сделки РЕПО с открытой датой...

Ввести отчет на исполнение сделки Подтверждения...

Принять...

Изменить...

Снять

Ввести адресную заявку РЕПО с ЦК...

Запрос по торговому счету...

Даты процентных периодов

Копировать ячейку

Фильтр...

Фильтр по столбцу...

Использовать фильтр

Фильтры

Шаблоны

Свойства...

Дата сделки	Дата исполнения	Код режима	Режим	К/П	Тип	Код расчетов	Срок	Период до исполнения второй части	Сум	Сум	Лоты	Статус
02.09.2026	02.09.2026	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	К	ЦК1	Y0			30			
02.09.2026	27.08.2027	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	П	ЦК2	YOD12M	359	1	30 011 580,82	30 011 572,60	30 000	Подтв

Контрагенту по сделке
приходит уведомление

MOEX Trade SE (тестовая версия)

Уважаемый участник!

Ваш контрагент по сделке № 4 669 067 385 подал отчет на закрытие сделки РЕПО с открытой датой.

Закрыть

Дата исполнения изменяется на следующий
расчетный день и сделка подкрашивается цветом

Дата сделки	Дата исполнения	Код режима	Режим	К/П	Тип	Код расчетов	Срок	Период до исполнения второй части РЕПО	Сумма / Сумма РЕПО	Стоимость выкупа РЕПО/ Проценты по Займу	Сумма возврата РЕПО/ Проценты по Займу	Стоимость выкупа РЕПО с открытой датой	Сумма к исполнению	Лоты	Статус
02.09.2026	04.09.2026	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	П	ЦК2	YOD12M	2		10 000 000,00	11 456 317,48	11 456 317,48	10 007 727,52	10 003 863,01	10 000	Подтв

При этом сумма выкупа, возврата,
к исполнению не пересчитывается

Изменения в торговых отчетах



Название атрибута	Описание
Compounding	Признак применения сложных процентов

SEM02 Выписка из реестра заявок

TradeDate	BoardId	BoardName	BuySell	SecShortName	Value	SettleCode	RateType	Benchmark	RepoRate	Compounding	EvergreenPeriod	IsOpenRepo
02.09.2026	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	S	КСУ обл.	50000000	Y0/YOD12M	FLOATING	RREFKEYR	0,1	Y		1 Y
02.09.2026	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	S	КСУ обл.	50000000	Y0/YOD12M	FLOATING	RREFKEYR	0,1	Y		1 Y
02.09.2026	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	S	КСУ обл.	10000000	Y0/YOD12M	FLOATING	RREFKEYR	0,1	Y		1 Y
02.09.2026	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	S	КСУ обл.	30000000	Y0/YOD12M	FLOATING	RUSFAR	0,1	Y		1 Y
02.09.2026	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	S	КСУ обл.	10000000	Y0/YOD12M	FLOATING	RUSFAR	0,3	Y		1 Y

SEM03 Выписка из реестра сделок с ценными бумагами

TradeDate	BoardId	BoardName	SecShortName	BuySell	SettleCode	RepoValue	EvergreenP	RateType	Benchmark	RepoRate	Compounding	IsOpenRepo
02.09.2026	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	КСУ обл.	B	Y0/YOD12M	50000000	1	FLOATING	RREFKEYR	0,1	Y	Y
02.09.2026	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	КСУ обл.	B	Y0/YOD12M	50000000	1	FLOATING	RREFKEYR	0,1	Y	Y
02.09.2026	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	КСУ обл.	B	Y0/YOD12M	10000000	1	FLOATING	RREFKEYR	0,1	Y	Y
02.09.2026	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	КСУ обл.	B	Y0/YOD12M	30000000	1	FLOATING	RUSFAR	0,1	Y	Y
02.09.2026	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	КСУ обл.	B	Y0/YOD12M	10000000	1	FLOATING	RUSFAR	0,3	Y	Y

Изменения в клиринговых отчетах



Название атрибута

Описание

Compounding

Признак сложного начисления процентов

EQM06* Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг

ReportDate	CurrencyId	BoardId	BoardName	SecShortName	TradeDate	BuySell	SettleCode	Quantity	Amount	RepoPart	RateType	OpenRepo	Compounding	Benchmark	BenchmarkRate	CurRepoRate
02.09.2026	RUR	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	КСУ обл.	02.09.2026	B	Y0	50000000	50000000	1	FLOATING	Y	Y	RREFKEYR	14	14,1
02.09.2026	RUR	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	КСУ обл.	02.09.2026	B	Y0	50000000	50000000	1	FLOATING	Y	Y	RREFKEYR	14	14,1
02.09.2026	RUR	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	КСУ обл.	02.09.2026	B	Y0	10000000	10000000	1	FLOATING	Y	Y	RREFKEYR	14	14,1
02.09.2026	RUR	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	КСУ обл.	02.09.2026	B	Y0	30000000	30000000	1	FLOATING	Y	Y	RUSFAR	13,99	14,09
02.09.2026	RUR	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	КСУ обл.	02.09.2026	B	Y0	10000000	10000000	1	FLOATING	Y	Y	RUSFAR	13,99	14,29
02.09.2026	RUR	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	КСУ обл.	02.09.2026	S	YOD12M	50000000	57307042,1	2	FLOATING	Y	Y	RREFKEYR	14	14,1
02.09.2026	RUR	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	КСУ обл.	02.09.2026	S	YOD12M	50000000	57307042,1	2	FLOATING	Y	Y	RREFKEYR	14	14,1
02.09.2026	RUR	FKPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. КлСт од.	КСУ обл.	02.09.2026	S	YOD12M	10000000	11461408,4	2	FLOATING	Y	Y	RREFKEYR	14	14,1
02.09.2026	RUR	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	КСУ обл.	02.09.2026	S	YOD12M	30000000	34317967	2	FLOATING	Y	Y	RUSFAR	13,99	14,09
02.09.2026	RUR	FRPO	РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.	КСУ обл.	02.09.2026	S	YOD12M	10000000	11461827,8	2	FLOATING	Y	Y	RUSFAR	13,99	14,29
02.09.2026	RUR	PSGC	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	25.08.2026	S	YOD360	10000000	11409178,1	2	FLOATING	Y		RUSFAR	13,99	14,99
02.09.2026	RUR	PSGC	РЕПО с ЦК с КСУ адресное	КСУ обл.	26.08.2026	S	YOD359	1000000	1140515,07	2	FLOATING	Y		RUSFAR	13,99	14,99

```
<BOARD BoardId="FRPO" BoardName="РЕПО с ЦК с КСУ пл. RUSFAR од.">
  <SECURITY SecurityId="RU000A0JW4Z1" ISIN="RU000A0JW4Z1" SecShortName="КСУ обл." PriceType="CASH">
    <RECORDS RecNo="9" TradeNo="4669066659" TradeDate="2026-09-02" TradeSessionDate="2026-09-02" TradeTime="12:03:23" BuySell="S" SettleCode="YOD12M" Decimals="3" Price="1.144"
      Quantity="30000000" Value="34317967.04" AccInt="0" Amount="34317967.04" Balance="30000000" ExchComm="0" ClrComm="0" TrdAccId="S00+4190AC53" CPFirmId="MC0888800000" CPFirmShortName
        ="НКО НКЦ (АО)" Price2="1.144" RepoPart="2" DueDate="2027-08-27" EarlySettleStatus="N" RepoRate="0.1" RateType="FLOATING" OpenRepo="Y" Compounding="Y" DaysBeforeSettleDate="1"
        Benchmark="RUSFAR" BenchmarkRate="13.99" CurRepoRate="14.09" RepoSum="34317967.04"/>
  </SECURITY>
</BOARD>
```

В бумажной форме отчета EQM06 атрибут не отображается

* — а также EQM06P/EQM06R, EQM6C, EQM6D, EQM63

Отчет о риск-параметрах фондового рынка (EQM44)

Небанковская кредитная организация-центральный контрагент
«Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество)

EQM44

Риск параметры Четверг 03.09.2026

Прогнозные значения ставок индикаторов по датам:

Дата	RREFKEYR	RUONIA	RUSFAR	RUSFAR1M	RUSFAR1W	RUSFAR2W	RUSFAR3M	RUSFARC1W	RUSFARCNY
04.09.2026	14	13.61	13.95	13.89	13.91	13.88	13.96	0.85	0.33
05.09.2026	14	13.62	13.89	13.89	13.92	13.88	13.96	1.04	0.35
06.09.2026	14	13.62	13.83	13.89	13.94	13.89	13.97	1.22	0.37
07.09.2026	14	13.63	13.77	13.89	13.95	13.89	13.97	1.41	0.39
08.09.2026	13.99	13.64	13.74	13.89	13.97	13.9	13.97	1.75	0.44
09.09.2026	13.98	13.65	13.73	13.9	13.98	13.9	13.98	2.1	0.51
10.09.2026	13.97	13.67	13.73	13.9	14	13.91	13.98	2.44	0.59
11.09.2026	13.96	13.68	13.74	13.9	14.01	13.91	13.98	2.78	0.68

```
<EQM44 ReportDate="2026-09-03" Weekday="Четверг">
  <INFO InfoType="M">
  <INFO InfoType="I">
  <INDICATORS>
    <DATE RecNo="1" TradeDate="2026-09-04">
    <DATE RecNo="2" TradeDate="2026-09-05">
    <DATE RecNo="3" TradeDate="2026-09-06">
    <DATE RecNo="4" TradeDate="2026-09-07">
      <INDICATOR Id="RREFKEYR" Value="14"/>
      <INDICATOR Id="RUONIA" Value="13.63"/>
      <INDICATOR Id="RUSFAR" Value="13.77"/>
      <INDICATOR Id="RUSFAR1M" Value="13.89"/>
      <INDICATOR Id="RUSFAR1W" Value="13.95"/>
      <INDICATOR Id="RUSFAR2W" Value="13.89"/>
      <INDICATOR Id="RUSFAR3M" Value="13.97"/>
      <INDICATOR Id="RUSFARC1W" Value="1.41"/>
      <INDICATOR Id="RUSFARCNY" Value="0.39"/>
    </DATE>
  </DATE>
</EQM44>
```

При расчете значения обязательств (Amount) в отчете EQM06 по дням для прошедших и текущих дат применяется известная ставка, для будущих — прогнозная

Прогнозное значение ставки отражается в клиринговом отчете EQM44, который формируется вечером и содержит значения риск-параметров на следующий расчетный день

Для расчета Amount в EQM06 необходимо анализировать значение INDICATOR в EQM44 за предыдущий (относительно EQM06) расчетный день на дату исполнения второй части сделки (TradeDate="2026-09-07")



См. также примеры расчетов Amount в Excel в разделе Материалы на странице [НКЦ | Клиринговые отчеты](#)

Отчет о расчете процентов по сделкам РЕПО с плавающей ставкой EQM64

EQM64

Небанковская кредитная организация-центральный контрагент
«Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество)

Отчет о расчете процентов по сделкам РЕПО с плавающей ставкой

Пятница 04.09.2026

Наименование Участника клиринга: Берестовой
Идентификатор Участника клиринга: MC9067500000

№ п/п	Номер сделки	Направ- ленность второй части сделки РЕПО	Дата торгов	Валюта расчетов	Код ценной бумаги	Наименование ценной бумаги	Индикатор	Значение индикатора*	Спред	Ставка, примененная в текущем дне*	Сумма рассчитанных процентов
1	4667636654	S	25.08.2026	RUR	RU000A0JW4Z1	KCY обл.	RUSFAR	13.950000	1.000000	14.950000	40,210.96
2	4668432693	S	26.08.2026	RUR	RU000A0JW4Z1	KCY обл.	RUSFAR	13.950000	1.000000	14.950000	3,618.36
3	4669066659	S	02.09.2026	RUR	RU000A0JW4Z1	KCY обл.	RUSFAR	13.950000	0.100000	14.050000	23,042.78
4	4669066670	S	02.09.2026	RUR	RU000A0JW4Z1	KCY обл.	RREFKEYR	14.000000	0.100000	14.100000	38,637.60
5	4669067380	S	02.09.2026	RUR	RU000A0JW4Z1	KCY обл.	RREFKEYR	14.000000	0.100000	14.100000	38,637.60
6	4669067383	S	02.09.2026	RUR	RU000A0JW4Z1	KCY обл.	RREFKEYR	14.000000	0.100000	14.100000	7,727.52
7	4669123156	S	02.09.2026	RUR	RU000A0JW4Z1	KCY обл.	RUSFAR	13.950000	0.300000	14.250000	7,790.56

* - указано значение индикатора / ставки на дату формирования отчета. При расчете процентов за выходные дни используется значение на дату расчета.

Выдержки из клиринговых отчетов с информацией о сделке

EQM44

Дата		RUSFAR определен и опубликован в отчете за указанную дату	RUSFAR, применяемый в указанную дату
02.09.2026	ср	13,88	% не начисляется
03.09.2026	чт	13,95	13,88
04.09.2026	пт	14,15	13,95
05.09.2026	сб		14,15
06.09.2026	вс		14,15
07.09.2026	пн	13,99	14,15

EQM06

Дата		Событие	Amount
02.09.2026	ср	первая часть	11 461 827,80
03.09.2026	чт	начисление процентов	11 462 189,21
04.09.2026	пт	подали отчет на исполнение	11 461 272,81
05.09.2026	сб	нерасчетные дни, отчет не формируется	
06.09.2026	вс		
07.09.2026	пн	вторая часть	10 019 676,52

EQM64

Дата	BenchmarkRate	Spread	CurRepoRate	InterestAmount
02.09.2026	отчет не формируется, т.к. нет начисленных процентов			
03.09.2026	13,88	0,3	14,18	3884,93
04.09.2026	13,95	0,3	14,25	7790,56
05.09.2026	2 нерасчетных дня, в пн будет начислен простой процент за 3 дня (сб, вс, пн)			
06.09.2026				
07.09.2026	14,15	0,3	14,45	19676,52

Расчет
в Excel

Дата		Событие	База начисления	Индикатор	Спред	Ставка	Кол-во дней начисления	Сумма процентов	Капитализация
02.09.2026	ср	первая часть сделки							10 000 000,00
03.09.2026	чт	начисление процентов	10 000 000,00	13,88%	0,30%	14,18%	1	3 884,93	10 003 884,93
04.09.2026	пт	подали отчет на исполнение	10 003 884,93	13,95%	0,30%	14,25%	1	3 905,63	10 007 790,56
05.09.2026	сб	2 нерасчетных дня, в пн будет начислен простой процент за 3 дня (сб, вс, пн)							
06.09.2026	вс								
07.09.2026	пн	исполнение	10 007 790,56	14,15%	0,30%	14,45%	3	11 885,96	10 019 676,52

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 144A 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.