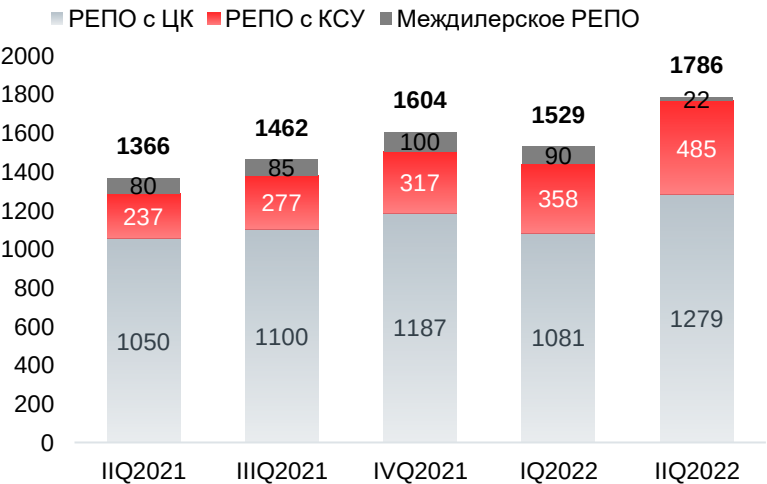


ИНСТРУМЕНТЫ ДЕНЕЖНОГО РЫНКА ДЛЯ ЭФФЕКТИВНОГО УПРАВЛЕНИЯ БЮДЖЕТНЫМИ СРЕДСТВАМИ

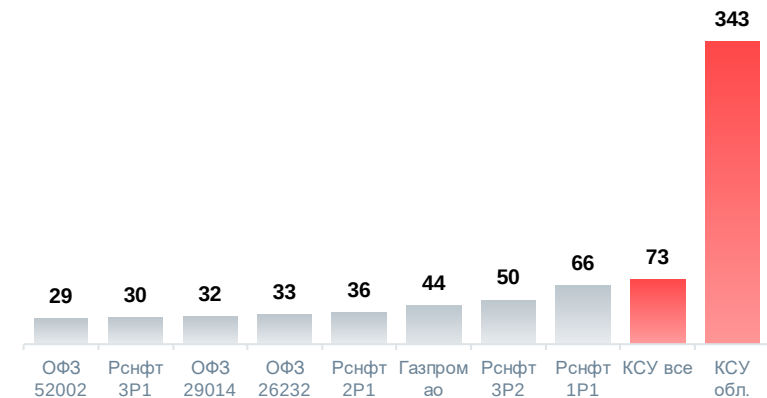


ДИНАМИКА НА ДЕНЕЖНОМ РЫНКЕ

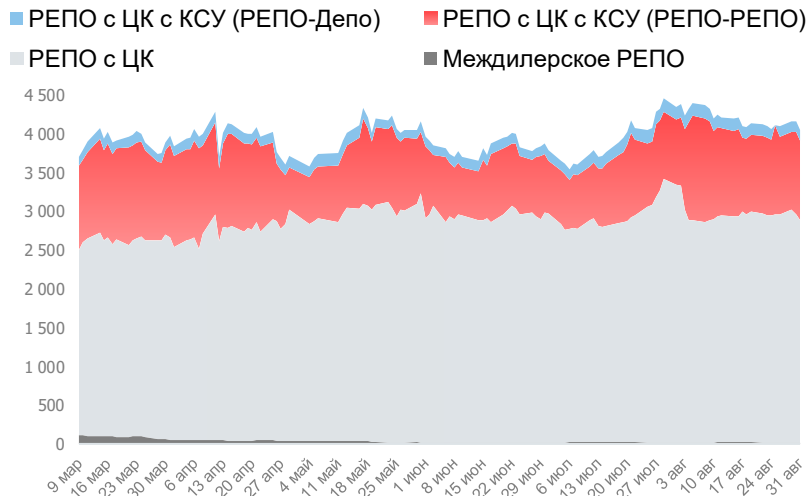
Среднедневной объем торгов, млрд руб.



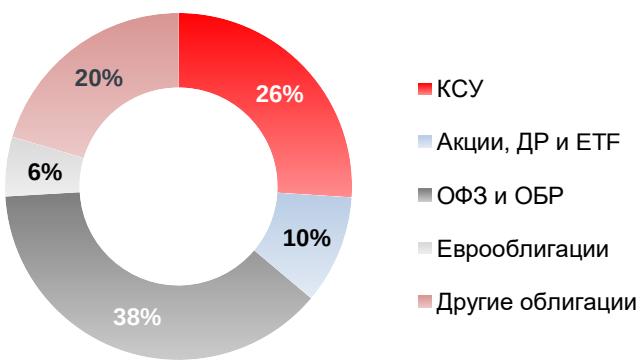
Топ-10 ценных бумаг в РЕПО с ЦК
Среднедневной объем торгов 8М2022, млрд руб.



Объем открытой позиции, млрд руб.



Структура рынка РЕПО с ЦК
Объем торгов, 8М2022, %



Комментарии

- Среднедневной объем торгов на Денежном рынке (РЕПО и депозитно-кредитные операции) составил – **2,3 трлн руб.**
- Среднедневная открытая позиция **РЕПО с ЦК** составила – **2,9 трлн руб.**
- Доля РЕПО с ЦК (вкл. РЕПО с КСУ) в объеме биржевого рынка РЕПО – **92%**
- Доля РЕПО с КСУ (вкл. Депозиты с ЦК) в объеме биржевого рынка РЕПО – **32%**
- Средний срок РЕПО с ЦК (вкл. РЕПО с КСУ) составил **3,6 дня**
- Среднедневная открытая позиция по **РЕПО с КСУ (вкл. Депозиты с ЦК)** в марте составила **1,2 трлн руб.**
- Среднедневная открытая позиция по **операциям размещения средств Федерального казначейства через ЦК** составила **483 млрд руб.**
- Среднедневной объем торгов в сегменте депозитно-кредитных операций составил **492 млрд руб.**

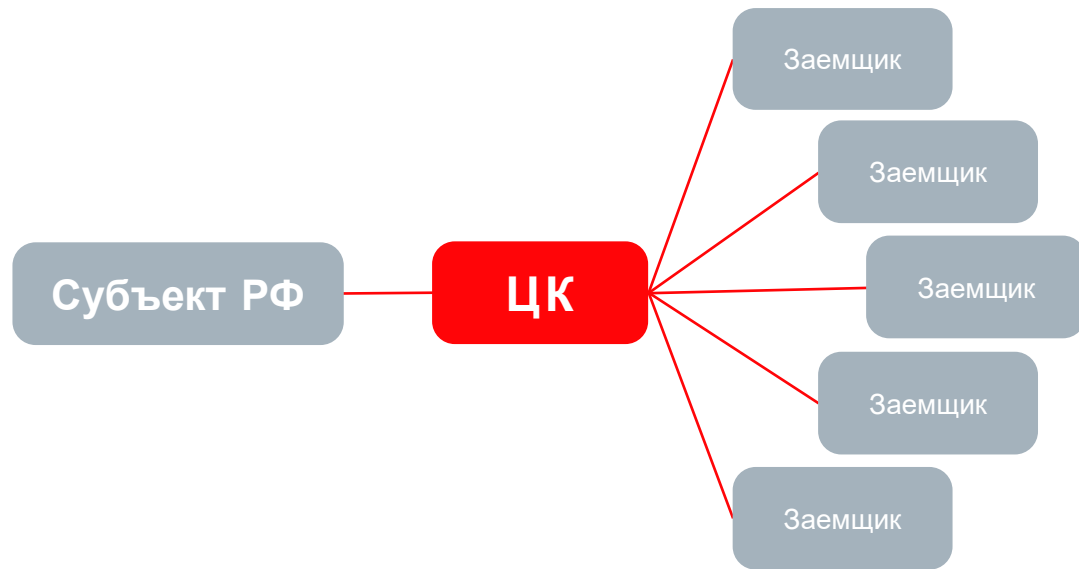
Данные за август 2022 г.

ПЛАНИРУЕМЫЕ НОВАЦИИ НА ДЕНЕЖНОМ РЫНКЕ

Сентябрь 2022 года:

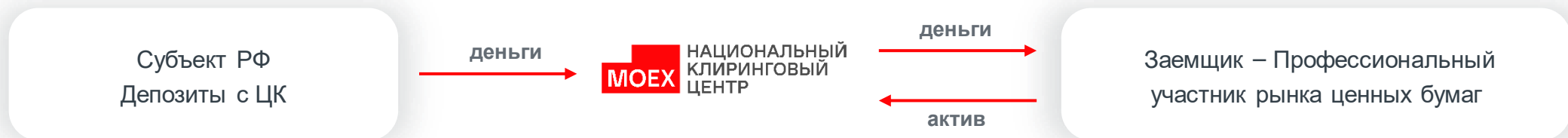
- Старт торгов в режимах РЕПО с КСУ, Депозитах с ЦК, Междилерском РЕПО и Кредитах с расчетами в китайских юанях
- В РЕПО с ЦК с расчетами в CNY добавятся длинные сроки в безадресных режимах до 1 недели (для ОФЗ – до 3 месяцев)
- Запуск индекса RUSFAR CNY, который станет индикатором стоимости юаневой ликвидности в России
- Поддержание ликвидности в РЕПО с КСУ с расчетами в китайских юанях профессиональными маркет-мейкерами

ДЕПОЗИТЫ С ЦЕНТРАЛЬНЫМ КОНТРАГЕНТОМ ДЛЯ СУБЪЕКТОВ РФ



- У Субъекта РФ договорные отношения только с Центральным контрагентом, который полностью обеспечивает риск-менеджмент по сделкам
- Центральным контрагентом по сделкам депозитов с ЦК является НКЦ (Национальный клиринговый центр), надежность которого подтверждена кредитными рейтингами, а также Банком России.
- Все сделки размещения денежных средств через Центрального контрагента обеспечены активами, которые НКЦ принимает в обеспечение по сделке со стороны заемщика.
- Удобная система расчетов (возврат депозита возможен уже утром в день его окончания)
- Операционное удобство: взаимозачет встречных требований и обязательств по погашаемым и новым депозитам (неттинг).

Движение денег/обеспечения



ПРИМЕР РАЗМЕЩЕНИЯ СРЕДСТВ ФЕДЕРАЛЬНЫМ КАЗНАЧЕЙСТВОМ И КОМИТЕТОМ ФИНАНСОВ САНКТ-ПЕТЕРБУРГА (С ЦК)



**ФЕДЕРАЛЬНОЕ
КАЗНАЧЕЙСТВО**

В 2022 г. размещено в **РЕПО с ЦК** – 2 трлн руб.

В 2022 г. размещено в **Депозиты с ЦК** – 54 трлн руб.



**КОМИТЕТ
ФИНАНСОВ
САНКТ-ПЕТЕРБУРГА**

С апреля 2021 г. размещено
в **Депозиты с ЦК** – 580 млрд руб.

СПАСИБО
ЗА ВНИМАНИЕ