

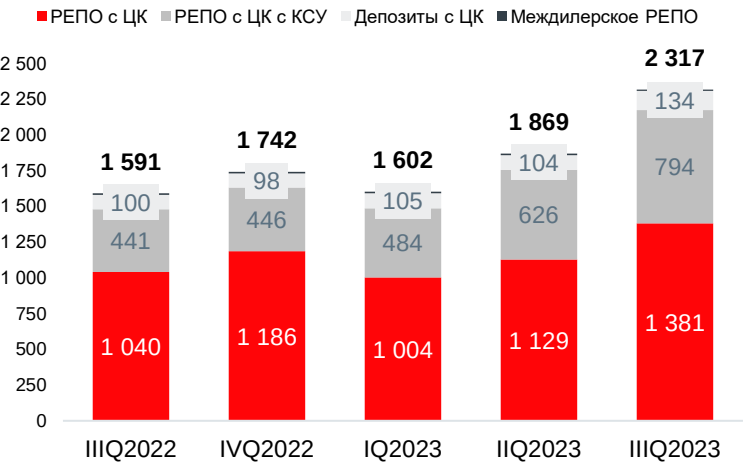
ИНСТРУМЕНТЫ ДЕНЕЖНОГО РЫНКА ДЛЯ ЭФФЕКТИВНОГО УПРАВЛЕНИЯ БЮДЖЕТНЫМИ СРЕДСТВАМИ



ДИНАМИКА НА ДЕНЕЖНОМ РЫНКЕ

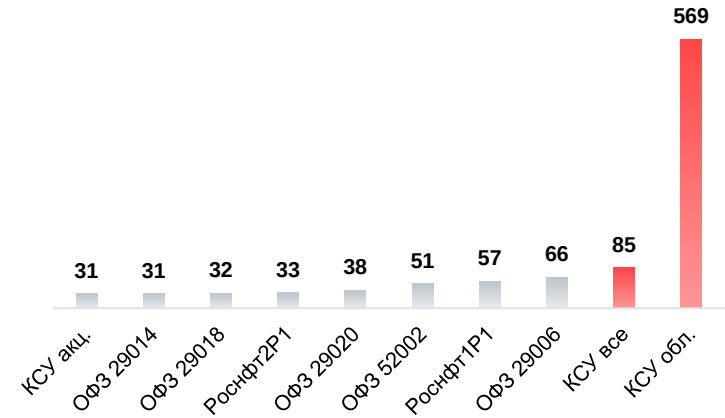
все данные на 21.09.2023 г.

Среднедневной объем торгов, млрд руб.

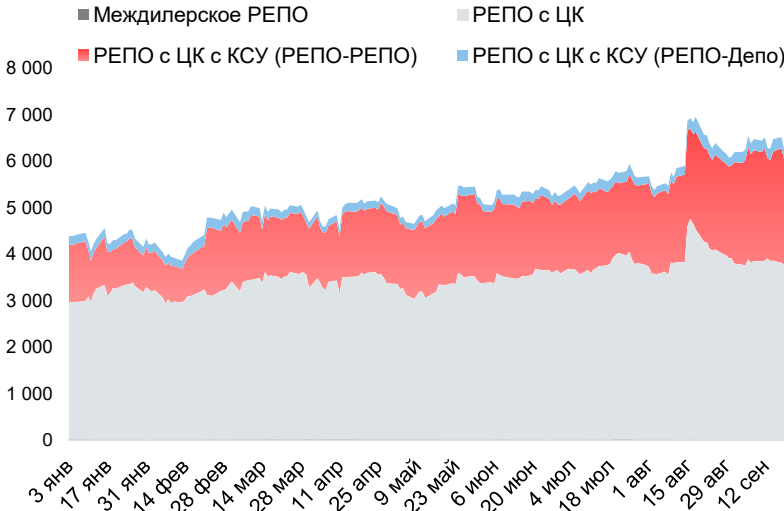


Топ-10 ценных бумаг в РЕПО с ЦК

Среднедневной объем торгов 9М2022, млрд руб.

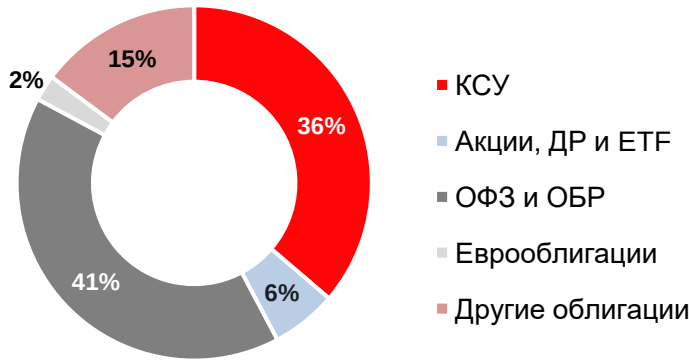


Объем открытой позиции, млрд руб.



Структура рынка РЕПО с ЦК

Объем торгов, 9М2023, %



Комментарии

- Среднедневной объем торгов на Денежном рынке (РЕПО и депозитно-кредитные операции) составил – **3,0 трлн руб.**
- Среднедневная открытая позиция **РЕПО с ЦК** составила – **3,4 трлн руб.**
- Доля РЕПО с ЦК (вкл. РЕПО с КСУ) в объеме биржевого рынка РЕПО – **89%**
- Доля РЕПО с КСУ (вкл. Депозиты с ЦК) в объеме биржевого рынка РЕПО – **31%**
- Средний срок РЕПО с ЦК (вкл. РЕПО с КСУ) составил **3,8 дня**
- Среднедневная открытая позиция по **РЕПО с КСУ (вкл. Депозиты с ЦК)** в августе составила **3,9 трлн руб.**
- Среднедневная открытая позиция по **операциям размещения средств Федерального казначейства через ЦК** составила **494,2 млрд руб.**
- Среднедневной объем торгов в сегменте депозитно-кредитных операций составил **697 млрд руб.**

Данные за 21.09.2023 г.

РАЗМЕЩЕНИЕ СРЕДСТВ С ЦЕНТРАЛЬНЫМ КОНТРАГЕНТОМ



**ФЕДЕРАЛЬНОЕ
КАЗНАЧЕЙСТВО**

В 2022 г. размещено в **РЕПО с ЦК** – 9,3 трлн руб.
В 2023 г. размещено в **РЕПО с ЦК** – 19,1 трлн руб. +105%

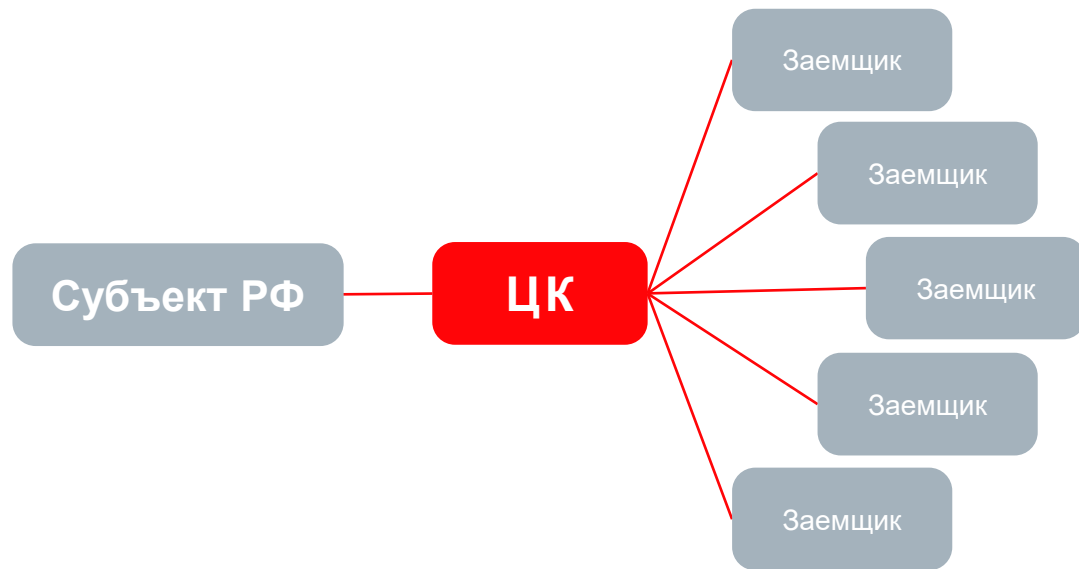
В 2022 г. размещено в **Депозиты с ЦК** – 22,9 трлн руб.
В 2023 г. размещено в **Депозиты с ЦК** – 12,8 трлн руб.



**КОМИТЕТ
ФИНАНСОВ
САНКТ-ПЕТЕРБУРГА**

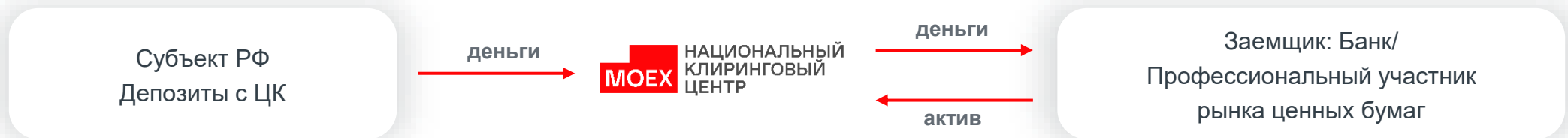
С апреля 2021 г. размещено
в **Депозиты с ЦК** – 206 млрд руб.

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 Национальный клиринговый центр (НКЦ), надежность которого подтверждена кредитными рейтингами, а также Банком России.
- Все сделки размещения денежных средств через Центрального контрагента обеспечены активами, которые Национальный клиринговый центр 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



М-ДЕПОЗИТЫ

М-Депозиты – это рынок депозитных аукционов, на которых Организатор аукциона размещает денежные средства в кредитных организациях

Конкуренция на депозитном аукционе проходит по процентным ставкам, которые Участники указывают в заявках на привлечение денежных средств.



ОРГАНИЗАТОР АУКЦИОНА Сумма: 5 млрд руб.		
↓	↓	×
3 млрд руб Участник А:	2 млрд руб Участник Б:	4 млрд руб Участник В:
По ставке 13,00%	По ставке 12,55%	По ставке 12,35%



МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

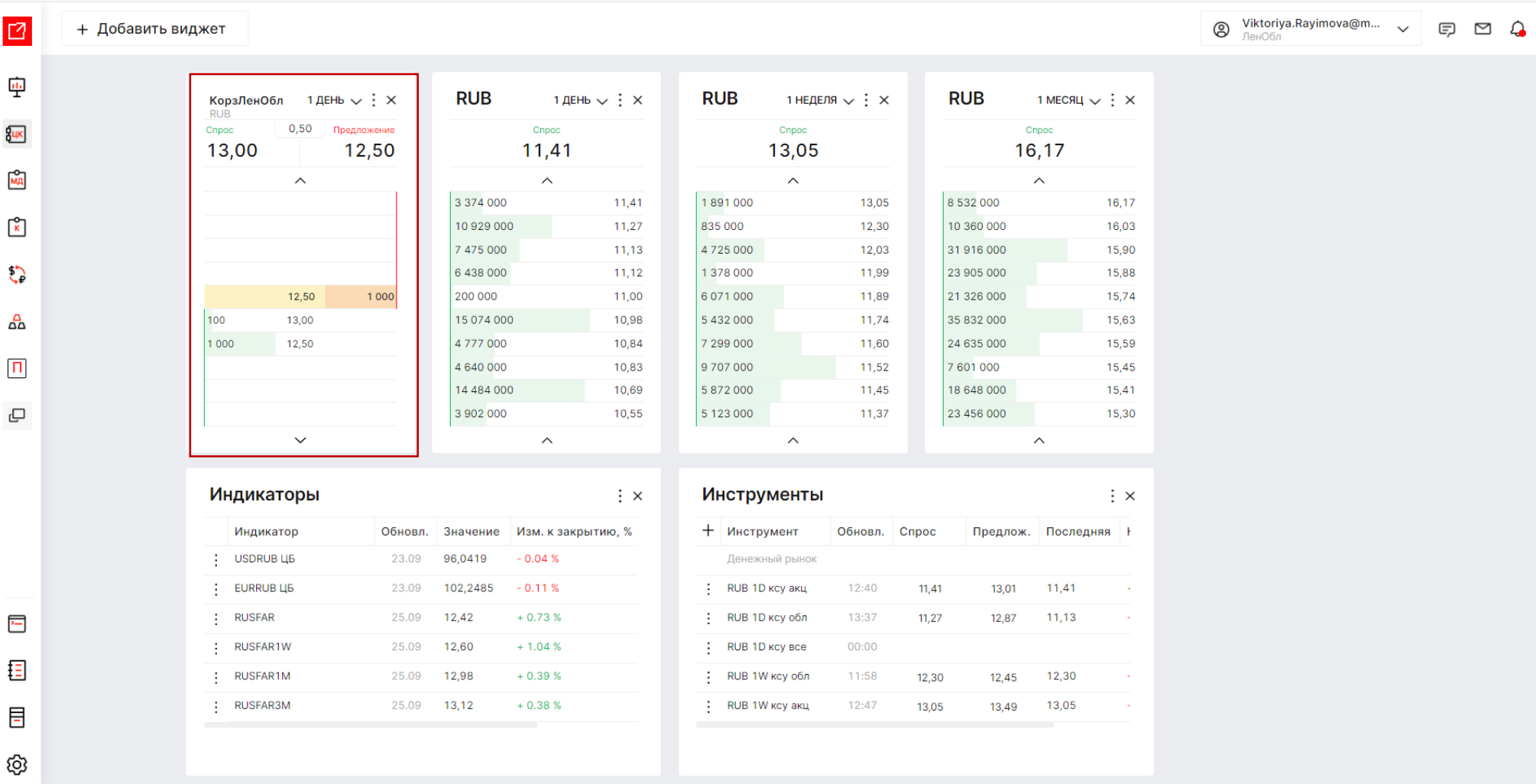
С января 2022 г. размещено
в М-депозитах более 918 млрд руб.

Данные по состоянию на 21.09.2023

ТЕРМИНАЛ МОЕХ TREASURY ДЛЯ СУБЪЕКТОВ РФ

MOEX Treasury – это единый Web интерфейс для работы клиентов на рынках Группы Московская Биржа.

Для субъектов РФ в терминале реализована возможность проводить аукционы с Центральным Контрагентом (ЦК) и аукционы без Центрального контрагента (М-Депозиты) на Московской Бирже.



приведен пример корзины, реализованный для комитета финансов Ленинградской области

АУКЦИОНЫ ДЕНЕЖНОГО РЫНКА С ЦК СТАЛИ УДОБНЕЕ ДЛЯ ЗАЁМЩИКОВ

НОВАЯ ТАБЛИЦА АУКЦИОНОВ ДЕНЕЖНОГО РЫНКА С ЦК

С 25 сентября 2023г. для аукционов денежного рынка с ЦК (Федерального казначейства и Комитета Финансов Санкт-Петербурга) реализована отдельная таблица в терминале MTSE.

Все аукционы с ЦК в одном окне с возможностью поднимать «стакан» аукциона и с агрегированным отражением итогов.

Участвовать в аукционах могут все участники фондового рынка, минимальная сумма заявки **100млн. руб.**

3 - Аукционы денежного рынка

Фирма	Код режима	Режим	К/П	Время заявки	Время окончания аукциона	Время активации	Код инструмента	Инструмент	Объем	Количество	Валюта расчетов	Ставка, %	Срок	Дата расчетов	Код расчетов	Статус аукциона	Сделок	Максимум	Минимум	Средневзвешенная
ФК	FKOW	Аукцион с ЦК 1 неделя	К/П	12:10:07	12:30:00	12:30:00	GCC_BasketFT	КорзФК ФБ	500 000 000,00	500 000 000	руб.	13,00	7	02.10.2023	Y0	Завершенный	2	13,30	13,00	13,24
ФК	FROM	Аукцион РЕПО с ЦК 1 месяц	К/П	12:18:21	12:30:00	12:30:00	GCC_BaskEKSР	КорзФР ЕКС	394 127 845,67	425 827	руб.	13,0000	30	25.10.2023	Y0	Завершенный	2	13,5000	13,0000	13,3750
ФК	FSRP	Аукцион обр.РЕПО с ЦК 1 день	П/К	12:19:33	12:30:00	12:30:00	SU26229RMFS3	ОФЗ 26229	347 110 800,00	400 000	руб.	13,0000	1	26.09.2023	Y0	Завершенный	2	13,0000	12,7000	12,8125

**Пример заполнения таблицы тестовыми данными*

В столбцах «Объем» и «Количество» на этапе аукцион **«Активен»** отражается объем и количество указанные организатором. После **завершения** аукциона в столбцах отражается объем и количество заключенных сделок.

Столбцы «Сделок», «Максимум», «Минимум» и «Средневзвешенная» заполняются по итогам аукциона и отражают количество сделок, диапазон ставок и средневзвешенное значение ставки, сложившееся по итогам аукциона.

НОВАЦИИ НА ДЕНЕЖНОМ РЫНКЕ

- ✓Расширение сроков в РЕПО с ЦК по ОФЗ, привязанным к RUONIA, до 1 месяца
- ✓Новые операции РЕПО БР постоянного действия с плавающей ставкой
- ✓Сделки с открытой датой, Запросы RFQ на Денежном рынке
- ✓Возможность допуска рейтинговых агентств и бирж к Депозитам с ЦК

- ✓Юаневые депозиты с ЦК до 1 года, юани на рынке М-депозиты, индикатор RUSFARCNY real time

- ✓**Расчеты через НРД на рынке М-Депозиты**
- ✓**Развитие виджетов по аналитике в MOEX Treasury**
- ✓**Подключение Федерального Казначейства к MOEX Treasury**

КОНТАКТЫ

КЮЧУКОВА ИРИНА ЮРЬЕВНА

Управление федеральных и региональных
органов власти и институтов развития,

Департамент развития клиентского бизнеса

ПАО Московская Биржа

М +7 (965) 090-04-35

Е Irina.Kyuchukova@moex.com

СПАСИБО
ЗА ВНИМАНИЕ