
Памятка по сделкам РЕПО Банка России с корзиной и клирингом НРД в рамках дополнительного механизма

Вводная. На странице Банка России есть материалы по запуску операций репо в рамках дополнительного механизма:

https://cbr.ru/explan/oper_br/om_dm/#highlight=%D0%B4%D0%BE%D0%BF%D0%BE%D0%BB%D0%BD%D0%B8%D1%82%D0%B5%D0%BB%D1%8C%D0%BD%D1%8B%D0%B9%7C%D0%BC%D0%B5%D1%85%D0%B0%D0%BD%D0%B8%D0%B7%D0%BC%7C%D1%80%D0%B5%D0%BF%D0%BE .

Размещения денежных средств в репо в рамках основного и дополнительного механизмов будет проходить в рамках одного Генерального соглашения с каждой кредитной организацией.

Репо в рамках дополнительного механизма будет проводиться с отдельной корзиной ценных бумаг GCOLLATERALD. Список таких ценных бумаг не будет пересекаться с ценными бумагами, принимаемыми Банком России в репо в рамках основного механизма. При заключении сделок в рамках дополнительного механизма Банк России принимает в обеспечение ценные бумаги, входящие в состав корзины GCOLLATERALD, выбор дополнительного идентификатора корзины кредитной организацией при подаче заявки на заключение сделки репо не допускается.

Данная памятка относится только к сделкам РЕПО Банка России с корзиной и клирингом НРД.

Все сделки репо Банка России будут разделены на две группы сделок, по которым будет **раздельно** производиться управление обеспечением (в т.ч. расчет обеспеченности и исполнение компенсационных взносов). В рамках каждой группы сделок (группа сделок CBR1 – сделки репо в рамках основного механизма, группа сделок CBR2 - сделки репо в рамках дополнительного механизма) будут формироваться отдельные отчеты об обеспеченности пула (MS118), отчеты об изменении обязательств по каждой сделке (MS018), сводные отчеты о регистрации/изменении и прекращении обязательств по Сделкам РЕПО за период (MS218). Клиринговые и депозитарные отчеты по сделкам репо (MS007, MS009, MS101, MS102) всегда формируются в разрезе счетов, по которым проходили операции.

Банк России открывает дополнительный депозитарный код для операций репо в рамках дополнительного механизма, данный депкод идентифицирует отдельный пул сделок репо в рамках дополнительного механизма. Учет денежных средств Банка России, относящихся к репо в рамках дополнительного механизма, будет производиться на том же торговом банковском счете для клиринга НРД с маской 30411810, который используется для сделок репо в рамках основного механизма.

Кредитная организация использует для расчетов по сделкам репо в рамках дополнительного механизма счет депо TS и раздел счета депо + торговый банковский счет с маской 30411810, которые уже используются для расчетов сделок репо со всеми Глобальными кредиторами в конкретной валюте.

На момент запуска операций репо в рамках дополнительного механизма Банк России произведет разделение ценных бумаг ломбардного списка на 2 группы. В качестве обеспечения сделок репо в рамках основного механизма будут приниматься только ценные бумаги 1 группы более высокого качества. В качестве обеспечения сделок репо в рамках дополнительного механизма будут приниматься только ценные бумаги 2 группы более низкого качества. Открытые (еще не исполненные по 2 части) на момент запуска операций репо в рамках дополнительного механизма сделки репо будут квалифицироваться как сделки репо в рамках основного механизма и относиться к группе сделок CBR1. Если в таких открытых сделках основного механизма у кредитной организации будут ценные бумаги, отнесенные ко 2 группе, НРД будет ежедневно производить на маркированных счетах депо кредитной организации поиск ценных бумаг, отнесенных к 1 группе, и производить замену ценных бумаг 2 группы на ценные бумаги из 1 группы до даты расчета 2 части таких сделок. Подбор ценных бумаг в сделки репо в рамках дополнительного механизма будет производиться только из ценных бумаг 2 группы более низкого качества.

В остальном управление обеспечением, клиринг и расчеты сделок репо в рамках дополнительного механизма будет проходить стандартным образом.

Необходимые действия для кредитных организаций.

1. С НРД: Необходимо до расчета 1 части первой сделки репо в рамках дополнительного механизма подать поручение маркирования в НРД для указания счетов и разделов счетов депо, с которых можно подбирать ценные бумаги для расчетов по сделкам РЕПО в рамках дополнительного механизма. Это закладка РЕПО БР (ДМ) в поручении маркирования в веб-кабинете СУО.

Планируемые изменения в отчетах.

Изменения для MS118

Код формы отчета	Имя файла отчета	Имя поля отчета	Описание поля	Значение в поле для сделок репо Банка России в рамках основного механизма	Значение в поле для сделок репо Банка России в рамках дополнительного механизма
MS118	expaccsec.dbf	Con_code	Депкод Контрагента	MZ0000200000	MZ005000REPO
MS118	expaccsec.dbf	Con_name	Наименование Контрагента	Банк России	Банк России
MS118	expaccsec.dbf	Gs_type	Группа сделок СУО	CBR1	CBR2
MS118	expaccsec.dbf	Gs_type_n	Наименование группы сделок СУО	Для прямого РЕПО с Банком России (основной механизм)	Для прямого РЕПО с Банком России (дополнительный механизм)
MS118	exptype.dbf	Exp_type	Код типового ген. соглашения	RCBR	DCBR
MS118	exptype.dbf	Exp_type_n	Наименование типового ген. соглашения	Генеральное соглашение об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок прямого РЕПО (основной механизм)	Генеральное соглашение об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок прямого РЕПО (дополнительный механизм)

Изменения для MS018

Код формы отчета	Имя файла отчета	Имя поля отчета	Описание поля	Значение в поле для сделок репо Банка России в	Значение в поле для сделок репо Банка России в
------------------	------------------	-----------------	---------------	--	--

				рамках основного механизма	рамках дополнительного механизма
MS018	exposure.dbf	Con_code	Депкод Контрагента	MZ0000200000	MZ005000REPO
MS018	exposure.dbf	Con_name	Наименование Контрагента	Банк России	Банк России
MS018	exposure.dbf	Gs_type	Группа сделок СУО	CBR1	CBR2
MS018	exposure.dbf	Gs_type_n	Наименование группы сделок СУО	Для прямого РЕПО с Банком России (основной механизм)	Для прямого РЕПО с Банком России (дополнительный механизм)
MS018	exposure.dbf	Exp_type	Код типового ген. соглашения	RCBR	DCBR
MS018	exposure.dbf	Exp_type_n	Наименование типового ген. соглашения	Генеральное соглашение об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок прямого РЕПО (основной механизм)	Генеральное соглашение об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок прямого РЕПО (дополнительный механизм)

Изменения для MS218 аналогичны описанным выше (будут иметь указанные выше значения в полях Con_code, Con_name, Gs_type, Gs_type_n, Exp_type, Exp_type_n).