



**«Услуга по совершению внебиржевых сделок РЕПО
(ОТС-РЕПО)»**

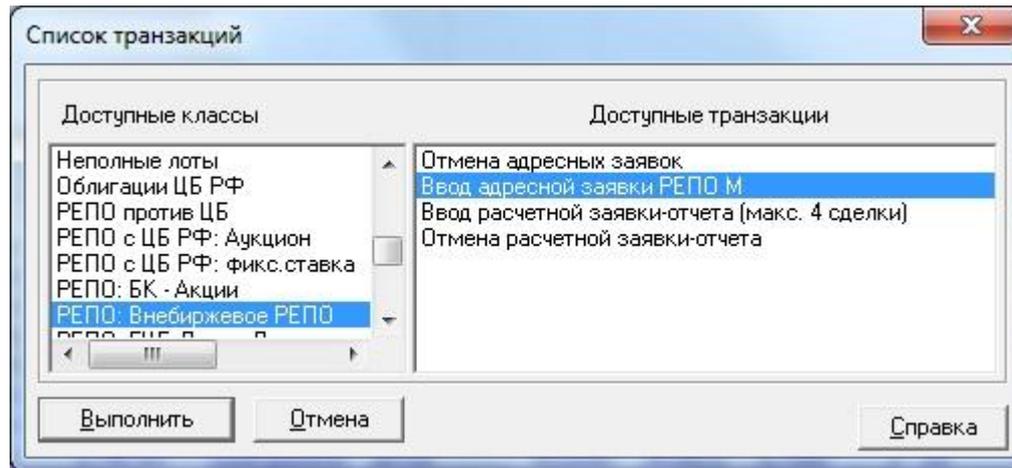
Презентация по работе с системой QUIK

**Управление розничного брокерского
обслуживания и поддержки сети
продаж**

| Апрель 2012 года

Ввод заявки на сделку ОТС-РЕПО (1)

1. Для ввода заявки на сделку ОТС-РЕПО в системе QUIK выберите в главном меню пункт «Торговля / Транзакции» , либо нажмите Ctrl + T. Откроется окно «Список транзакций».
2. В левой части открывшегося окна выберите класс «РЕПО: Внебиржевое РЕПО».
3. В правой части окна выберите пункт «Ввод адресной заявки РЕПО М» и нажмите «Выполнить», откроется форма ввода заявки на сделку ОТС-РЕПО.



Ввод заявки на сделку ОТС-РЕПО (2)

В открывшейся форме ввода заявки укажите следующие параметры:

- Инструмент – Выберите из списка;
- Торговый счет – L01-00000F00;
- Операция – Продажа;
- Код расчетов – Rb (в случае заключения новой сделки) или S0 (в случае пролонгации);
- Сумма РЕПО или Количество ЦБ – Заполните только одно поле ! Количество ЦБ указывается в штуках;
- Дисконт (начальный) – В соответствии с условиями, опубликованными на сайте;
- Дисконт (нижний, верхний) – Поля не заполняются;
- Ставка РЕПО – В соответствии с условиями, опубликованными на сайте;
- Срок РЕПО – В соответствии с условиями, опубликованными на сайте;
- Возмещение – Поле не заполняется;
- Партнер – Сбербанк;
- Ссылка – Поле не заполняется;
- Код клиента – Пятизначный код клиента для ТС ФБ ММВБ;
- Поручение – Поле не заполняется.

Если поля будут заполнены не в соответствии с данным алгоритмом, заявка не будет принята к исполнению

При выставлении заявки возможно отклонение таких параметров, как Сумма РЕПО / Дисконт (начальный) из-за особенностей алгоритма обработки таких заявок системой QUIK.

Если планируемая Дата расчетов по второй части ОТС-РЕПО, заключаемой на 35/105 дней, приходится на неторговый день, то в заявке на сделку ОТС-РЕПО необходимо указать Срок ОТС-РЕПО, увеличенный на количество дней до следующего торгового дня. При этом Ставка ОТС-РЕПО остается неизменной.

РЕПО: Вне биржевое РЕПО Ввод адрес...

Инструмент: Сбербанк-п | Торговый Счет: L01-00000F00

Блокировать бумаги на время операции РЕПО

Операция: Покупка **Продажа** | Код расчетов: Rb

Сумма РЕПО: 1000000 | Количество: 1 | Лот: 1

Дисконт (%) [начальный, нижний, верхний]: 37

Ставка РЕПО: 13 | Срок РЕПО (0-180): 35 | Возмещение:

Партнер: СБЕРБАНК | Ссылка:

Код Клиента: 4A001 | Поручение:

Ввести | Отмена

Просмотр заявок на сделки ОТС-РЕПО

Если Вы хотите просмотреть свои выставленные заявки:

1. Заявки на сделки ОТС-РЕПО отображаются в «Таблице заявок на внебиржевые сделки».
2. Для создания таблицы выберите в главном меню пункт «Торговля / РПС / Внебиржевые заявки», откроется окно создания таблицы.
3. Выберите класс «РЕПО: Внебиржевое РЕПО».
4. Настройте фильтры в соответствии с рисунком справа.
5. Добавьте основные параметры заявки, такие как: *Бумага сокр.*, *Цена*, *Кол-во*, *Сумма РЕПО*, *Начальный дисконт*, *Ставка РЕПО %*, *Срок РЕПО*, *Код расчетов*, *Цена выкупа*, *Объем выкупа РЕПО*.
6. Нажмите кнопку «Да». Откроется окно «Таблица заявок на внебиржевые сделки».

Редактирование таблицы заявок на внебиржевые сделки

Имя таблицы: Таблица заявок на внебиржевые сделки

Выбранные классы:

- РЕПО-М: Акции
- РЕПО-М: Облигации
- РЕПО: Акции
- РЕПО: БК - Акции
- РЕПО: Внебиржевое РЕПО
- РПС: А1-Акции
- РПС: А1-Облигации
- РПС: А2-Акции
- РПС: Б-Акции
- РПС: Б-Облигации
- РПС: Брокерские котир

Очистить Выделить все

РЕПО: Внебиржевое РЕПО

Фильтр ценных бумаг ...

Фильтр фирм ...

Фильтр клиентов ...

Фильтр счетов депо ...

Показывать полученные

Показывать отправленные

Выделять состояние цветом

Фильтр состояния

- Активные
- Исполненные
- Снятые

Фильтр операции

- Покупка
- Продажа

Набор параметров

Доступные параметры

- Номер
- Встречная безадр. заявка
- Дата
- Выставлена(время)
- Дата активации
- Время активации
- Снята(время)
- Бумага сокр.
- Бумага

Добавить

Добавить все

Убрать

Очистить

Заголовки столбцов

- Выставлена(время)
- Код клиента
- Бумага сокр.
- Операция
- Цена
- Кол-во
- Сумма РЕПО
- Начальный дисконт(%)
- Ставка РЕПО(%)

Да Отмена Справка

	Выстав	Код кл	Бумага сокр	Операция	Цена	Кол-во	Сумма РЕПО	Началь	Ставка	Срок РЕПО	Код	Цена выкупа	Объем выкупа РЕПО
1	12:20:41	4A001	Сбербанк-п	Продажа	49,01	20 403	999 951,03	37,00	13,00	35	Рб	49,62	1 012 396,86

Просмотр сделок ОТС-РЕПО

Если Вы хотите просмотреть свои сделки:

1. Сделки ОТС-РЕПО отображаются в «Таблице сделок».
2. Для создания таблицы выберите в главном меню пункт «Торговля / Сделки», откроется окно создания таблицы
3. Выберите класс «РЕПО: Внебиржевое РЕПО»
4. Настройте фильтры в соответствии с рисунком справа.
4. Добавьте основные параметры сделки, такие как: *Время, Бумага сокр., Цена, Кол-во, Объем, Начальный дисконт, Ставка РЕПО %, Срок РЕПО, Код расчетов, Цена выкупа, Объем выкупа РЕПО.*
5. Нажмите кнопку «Да». Откроется окно «Таблица сделок».

Редактирование таблицы сделок

Имя таблицы:

Выбранные классы:

- РЕПО-М: Акции
- РЕПО-М: Облигации
- РЕПО: Акции
- РЕПО: БК - Акции
- РЕПО: Внебиржевое РЕПО
- РПС: А1-Акции
- РПС: А1-Облигации
- РПС: А2-Акции
- РПС: Б-Акции
- РПС: Б-Облигации

Очистить | Выделить все

Фильтры:

- Фильтр ценных бумаг
- Фильтр фирм
- Фильтр счетов депо
- Фильтр клиентов
- Фильтр типа сделки
 - Немаржинальная
 - Маржинальная
- Фильтр операции
 - Покупка
 - Продажа

Набор параметров:

Доступные параметры:

- Комиссия ТС
- Клиринговая комиссия
- ФБ комиссия
- ТС комиссия
- Доход(%) на дату выкупа
- Сумма РЕПО**
- Объем выкупа РЕПО
- Срок РЕПО
- Начальный дисконт(%)

Заголовки столбцов:

- Цена
- Кол-во
- Сумма РЕПО
- Начальный дисконт(%)
- Ставка РЕПО(%)
- Срок РЕПО
- Код расчетов
- Цена выкупа
- Объем выкупа РЕПО

Добавить | Добавить все | Убрать | Очистить

Да | Отмена | Справка

Дата то	Время	Код клиен	Бумага со	Опера	Цена	Кол-во	Объем	Начальный	Ставка РЕПО(%)	Срок	Код	Цена в	Объем выку	
1	04.04.2011	13:06:05	4A001	Сбербанк-п	Продаж	49,01	20 403	999 951,03	37,00	13,00	35	Rb	49,62	1 012 396,86

Просмотр обязательств по сделке ОТС-РЕПО (1) (2-ые части ОТС-РЕПО)

Если Вы хотите просмотреть информацию о своих обязательствах:

1. Обязательства по сделке ОТС-РЕПО Сделки ОТС-РЕПО отображаются в «Таблице сделок для исполнения».
2. Для создания таблицы выберите в главном меню пункт «Торговля / РПС /Сделки для исполнения», откроется окно создания таблицы
3. Выберите класс «РЕПО: Внебиржевое РЕПО»
4. Настройте фильтры в соответствии с рисунком справа.
5. Добавьте основные параметры сделки, такие как: *Дата торгов, Дата исполнения, Бумага сокр., Цена 1-ой части, Кол-во, Объем, Цена выкупа, Объем выкупа РЕПО, Начальный дисконт, Ставка РЕПО %, Срок РЕПО.*
6. Нажмите кнопку «Да». Откроется окно «Сделки для исполнения».

Имя таблицы:

Выбранные классы:

- РЕПО-М: Акции
- РЕПО-М: Облигации
- РЕПО: Акции
- РЕПО: БК - Акции
- РЕПО: Внебиржевое РЕПО
- РПС: А1-Акции
- РПС: А1-Облигации
- РПС: А2-Акции
- РПС: Б-Акции
- РПС: Б-Облигации
- РПС: Брокерские котир
- РПС: В-Облигации ММВБ
- РПС: В-акции ММВБ
- РПС: Внесписочные ак
- РПС: Внесписочные об.

Фильтр состояний:

- Не исполненные
- Включенные в отчет
- Исполненные

Фильтр операции:

- Покупка
- Продажа

Фильтр по типу:

- Внесистемные
- 1-ые части РЕПО
- 2-ые части РЕПО
- Взносы компенсации
- Обязательства дефолтера
- Требования пострадавшего

Набор параметров:

Доступные параметры:

- Номер
- Номер заявки
- Дата торгов
- Дата исполнения
- Класс
- Бумага сокр.
- Бумага
- Операция
- Код клиента
- Комментарий

Заголовки столбцов:

- Дата торгов
- Дата исполнения
- Код клиента
- Бумага сокр.
- Операция
- Цена 1ой части РЕПО
- Кол-во
- Объем
- Цена выкупа
- Объем выкупа РЕПО

Очистить | Выделить все

Добавить | Добавить все | Убрать | Очистить

Да | Отмена | Справка

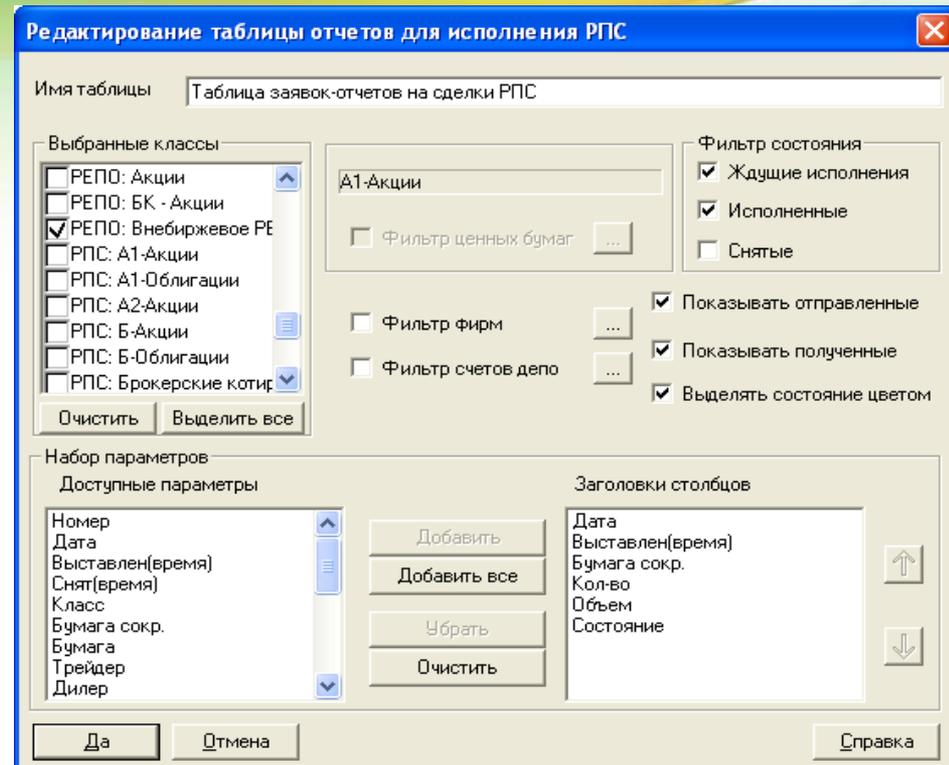
№	Дата торгов	Дата испо	Код кл	Бумага со	Операци	Цена 1ой	Кол-во	Объем	Цена выкупа	Объем выкуп.	Дисконт	Ставка РЕПО(%)	Срок
1	04.04.2012	09.05.2012	44001	Сбербанк-п	Купля	49,01	20 403	999 951,03	49,62	1 012 396,86	37,00	13,00	35

Исполнение сделки ОТС-РЕПО (в т.ч. досрочное) путём проведения расчетов по второй части сделки.

Если Вы хотите самостоятельно исполнить вторую часть сделки ОТС-РЕПО (вернуть денежные средства):

1. Для проведения расчетов по второй части сделки ОТС-РЕПО в дату исполнения второй части сделки (или досрочно) необходимо обеспечить наличие на брокерском счете денежных средств в размере не менее суммы выкупа за вычетом ранее внесенных маржинальных взносов не позднее 16:00 мск.
2. Для проведения расчетов по второй части ОТС-РЕПО необходимо создать таблицу с отчетами на исполнение сделок ОТС-РЕПО. Для этого выберите в главном меню пункт «Торговля / РПС / Отчеты по сделкам для исполнения», откроется окно создания таблицы.
3. Выберите класс «РЕПО: Внебиржевое РЕПО».
4. Настройте фильтры в соответствии с рисунком справа.
5. Добавьте основные параметры отчета, такие как: *Дата, Выставлена (время), Бумага сокр., Кол-во, Объем, Состояние*.
6. Нажмите кнопку «Да». Откроется «Таблица заявок-отчетов на сделки РПС» с необходимыми настройками.
7. Перейдите в «Таблицу сделок для исполнения», выберите сделку и выполните операцию контекстного меню «Подтвердить отчетом», после чего Отчет на исполнение сделки ОТС-РЕПО отобразится в «Таблице заявок-отчетов на сделки РПС».
8. После проведения Банком расчетов по второй части сделки ОТС-РЕПО состояние отчета с «Ждет исполнения» изменится на «Исполнен», что подтверждает исполнение второй части сделки ОТС-РЕПО.

В случае, если Вы не проведете вышеуказанные действия, Банк проведет их самостоятельно, без Вашего участия.



	Дата	Выставл	Бумага сок	Кол-во	Объем	Состояние
1	04.04.2012	14:22:11	Сбербанк-п	20 403	999 951,03	Ждет исполнения

Пролонгация сделки ОТС-РЕПО

(заключение новой сделки ОТС-РЕПО в дату расчетов по второй части ранее заключенной сделки).

1. Для пролонгации сделки ОТС-РЕПО (под пролонгацией понимается заключение новой сделки ОТС-РЕПО в дату исполнения второй части ранее заключенной (пролонгируемой) сделки) необходимо подать заявку на новую сделку ОТС-РЕПО не позднее 16:00 мск. При этом дополнительных действий по исполнению расчетов по пролонгируемой сделке выполнять не требуется.
2. При пролонгации у Вас существует возможность увеличить либо уменьшить объем сделки, а также заменить ценные бумаги, которые будут объектом сделки ОТС-РЕПО. Подробную консультацию о возможностях при пролонгации сделки ОТС-РЕПО Вы можете получить по телефону Службы поддержки (хелп-деск) 8 800 555 55 51.
3. Сумма текущего остатка на брокерском счете и объема заявки на «новую» сделку ОТС-РЕПО должна быть не менее суммы выкупа по пролонгируемой сделке ОТС-РЕПО.
4. При вводе заявки на новую сделку ОТС-РЕПО необходимо указывать Код расчетов – S0 (см. слайд 3).
5. Если заявка удовлетворяет всем условиям, опубликованным на сайте Банка, то Банк принимает заявку к исполнению, после чего проводит расчеты по пролонгируемой и новой сделкам ОТС-РЕПО одновременно.
6. После проведения Банком расчетов по старой и новой сделкам ОТС-РЕПО в «Таблице сделок для исполнения» будут отображаться только обязательства по второй части новой сделки ОТС-РЕПО, а в «Таблице заявок-отчетов на сделки РПС» будет отображаться отчет по пролонгированной сделке ОТС-РЕПО со статусом «Исполнен» (см. слайд 7).

Кроме того вы можете пролонгировать сделку ОТС-РЕПО, подав заявку на новую сделку по телефону Службы приема заявок (трейд-деск) 8 800 555 55 71

Если Вы не пролонгируете сделку, Банк предпримет все возможные меры по закрытию сделки (в т.ч. самостоятельно осуществит продажу ценных бумаг при недостаточности денежных средств на Вашем брокерском счете).