

ОТЧЕТ № 3392540

от 03 апреля 2018 г. 11:41:28

Операция:	Обслуживание зарегистрированных системой управления обеспечением обязательств			89
Дата и время оценки:	03 апреля 2018 г. 11:41:28		Операционный день не закончен	
Отправитель отчета:	NSDCLR0 00000	НКО АО НРД		
	Депозитарный код		Краткое наименование	
Инициатор поручения:	NSDCLR0 00000	НКО АО НРД		
	Депозитарный код		Краткое наименование	
Сторона по обязательствам:	MC	Банк		
	Депозитарный код		Краткое наименование	
Контрагент:	TRROSKA ZNA02	Казначейство России		
	Депозитарный код		Краткое наименование	
Счет депо обеспечения:	TS			
	Счет депо			
Раздел счета депо:	BR MC			

Группа сделок CVO	KZN1	Для РЕПО с Федеральным Казначейством
-------------------	------	--------------------------------------

Тип ГС	Наименование ГС (Генерального соглашения)
RKZN	Генеральное соглашение об общих условиях совершения Федеральным Казначейством и кредитной организацией сделок прямого РЕПО на внебиржевом рынке

Общая сумма обеспечения	13 011 138 544, 66	Допустимый уровень переоценки в рублях	6 505 568, 63
Общая сумма обязательств	13 011 137 260, 28	Обеспеченность	FLAT

Обеспечение в ценных бумагах

Код ценной бумаги	Краткое наименование	Количество	Рыночная цена в рублях	Для всех сделок Группы исключается из подбора по КД	Текущие/плановые корпоративные действия				Блокируемая в период КД
					КД 1	Дата фиксации	КД 2	Дата фиксации	
SU46011RMFS1	ОФЗ АД(46011)	11203494	1 222, 47	Нет					Нет

Перечень сделок

Дата закрытия	Право установить/приблизить дату исполнения сделки	Дата открытия	Референс	Регистрационный номер	Контрагент	Краткое наименование	Место заключения	Код ГС	Обеспеченность	Допустимый уровень переоценки в рублях				
03.04.2018	Кредитор	29.03.2018	1001754	27844	TRROSKA ZNA02	Казначейство России	BLM	RKZN	FLAT					
Дополнительные условия														
Денежные средства: обязательство			Фикс. ставка		Индикатор	RUONmDS	Спрэд	0,03000	Текущая стоимость в рублях: 12 010 954 520,55					
Номер счета	RUB	MICURUMMXXX	Текущая стоимость в валюте сделки	12 010 954 520,55		Сумма РЕПО	12 000 000 000,00		Ставка РЕПО	6,68000	Метод	365/366	Стоимость обратного выкупа	12 010 954 520,55
Ценные бумаги: требование		Вариант возврата доходов:			Код корзины:		GCFEDBONDS		Дисконтированная стоимость в рублях: 12 010 955 582,51					
Счет депо	Раздел счета депо	С реюзом	Код ценной бумаги	Краткое наименование		Количество	Курс валюты	Дисконтированная цена	Расчетная цена		НКД		Расчетная стоимость	
	00000000000000000000	N	SU46011RMFS1	ОФЗ АД(46011)		10342267	1,0000	1 161.3465	1 160.2872		59.18000000		12 000 000 000.00	

Связанные денежные обязательства по сделке

Дата открытия	Регистрационный номер	Направление	Сумма	Валюта	Тип обязательства	Дополнительная информация

Дата закрытия	Право установить/приблизить дату исполнения сделки	Дата открытия	Референс	Регистрационный номер	Контрагент	Краткое наименование	Место заключения	Код ГС	Обеспеченность	Допустимый уровень переоценки в рублях				
03.04.2018	Кредитор	02.04.2018	1022264	27849	TRROSKA ZNA02	Казначейство России	BLM	RKZN	FLAT					
Дополнительные условия														
Денежные средства: обязательство			Фикс. ставка	6,67000	Индикатор		Спрэд		Текущая стоимость в рублях: 1 000 182 739,73					
Номер счета	RUB	MICURUMMXXX	Текущая стоимость в валюте сделки	1 000 182 739,73		Сумма РЕПО	1 000 000 000,00		Ставка РЕПО	6,67000	Метод	365/366	Стоимость обратного выкупа	1 000 182 739,73
Ценные бумаги: требование		Вариант возврата доходов:			Код корзины:		GCFEDBONDS		Дисконтированная стоимость в рублях: 1 000 182 962,15					
Счет депо	Раздел счета депо	С реюзом	Код ценной бумаги	Краткое наименование		Количество	Курс валюты	Дисконтированная цена	Расчетная цена		НКД		Расчетная стоимость	
	00000000000000000000	N	SU46011RMFS1	ОФЗ АД(46011)		861227	1,0000	1 161.3465	1 161.1341		59.18000000		1 000 000 000.00	

Связанные денежные обязательства по сделке

Дата открытия	Регистрационный номер	Направление	Сумма	Валюта	Тип обязательства	Дополнительная информация

Дата исполнения операции: 03.04.2018 11:41:28

Дата операционного дня исполнения операции: 03.04.2018

Основание :

ПОРУЧЕНИЕ № BGN180403 от 03 апреля 2018 г.

Рег. № поручения: 867455 Дата регистрации поручения: 03.04.2018 11:31:53

Дата принятия на исполнение: 03.04.2018 11:31:59

Операционист: _____

МП Подпись: _____