

РОЛЬФ | ВЕДУЩИЙ ДИЛЕРСКИЙ ХОЛДИНГ РОССИИ



Инструменты управления ликвидностью

Капускин Алексей

Руководитель группы управления казначейскими продуктами
Департамент казначейства и управления рисками

КСУ обл. - Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 д...		
(П) Сумма	Ставка, %	(Р) Сумма
1 000 000 000,00	6,31	
1 000 000 000,00	6,41	
200 000 000,00	6,50	
6 000 000 000,00	6,60	
200 000 000,00	6,61	
500 000 000,00	6,66	
600 000 000,00	6,70	
700 000 000,00	6,71	
400 000 000,00	6,74	
650 000 000,00	6,75	
	6,76	80 000 000,00
	6,80	500 000 000,00
	6,81	200 000 000,00
	6,84	200 000 000,00
	6,85	60 000 000,00
	6,89	30 000 000,00
	6,90	900 000 000,00
	6,99	800 000 000,00
	7,00	1 204 250 000,00
	7,10	300 000 000,00

КСУ акц. - Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн...		
(П) Сумма	Ставка, %	(Р) Сумма
200 000 000,00	6,61	
200 000 000,00	6,70	
400 000 000,00	6,72	
	6,74	400 000 000,00
	6,75	200 000 000,00
	6,76	200 000 000,00
	6,78	200 000 000,00
	6,99	300 000 000,00
	7,20	40 000 000,00

* [16 - Финансовые инструменты]									
Режим	Спрос	Предложение	Первая	Максимум	Минимум	Последняя	Сделок за с...	Объем за сегодня	
Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	6,75	6,76	6,76	6,80	6,75	↑ 6,75	202	73 770 158 000	
Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн			6,80	6,80	6,77	↑ 6,80	28	9 695 320 000	
Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	6,72	6,74	6,78	6,80	6,75	↑ 6,75	14	5 184 800 000	
Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 7 дн	6,77	6,80	6,82	6,82	6,78	↓ 6,78	11	4 161 960 000	
Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 мес	6,85	6,86	6,85	6,85	6,85	6,85	4	1 150 000 000	
Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 7 дн			6,82	6,82	6,82	↓ 6,82	1	600 000 000	
Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 14 дн	6,85	6,86	6,85	6,85	6,85	↑ 6,85	2	167 671 000	

262 - Все сделки

Время	Режим	Инструмент	Ставка депозита	Сумма депозита/ РЕПО	Срок депозита
16:42:40	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,77	1 194 475 000,00	1
16:43:58	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ акц.	6,80	884 000 000,00	1
16:43:58	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ акц.	6,80	200 000 000,00	1
16:43:58	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ акц.	6,80	200 000 000,00	1
16:45:31	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,79	20 000 000,00	1
16:45:32	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,77	17 150 000,00	1
16:45:32	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,76	242 200 000,00	1
16:45:32	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,76	14 650 000,00	1
16:47:11	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,76	92 060 000,00	1
16:50:01	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,76	80 400 000,00	1
16:51:04	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ акц.	6,76	180 000 000,00	1
16:51:14	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ акц.	6,76	20 000 000,00	1
16:51:14	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ акц.	6,75	180 000 000,00	1
16:51:20	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,76	112 890 000,00	1
16:51:38	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,75	300 000 000,00	1
16:51:38	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,75	101 000 000,00	1
16:52:38	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,75	300 000 000,00	1
16:52:52	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 7 дн	КСУ обл.	6,80	500 000 000,00	7
16:52:52	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 7 дн	КСУ обл.	6,80	500 000 000,00	7
16:52:55	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,75	300 000 000,00	1
16:54:14	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 7 дн	КСУ обл.	6,78	200 000 000,00	7
16:54:14	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 7 дн	КСУ обл.	6,78	200 000 000,00	7
17:00:52	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,75	200 000 000,00	1
17:01:51	Депозиты/РЕПО с КСУ с ЦК 1 дн	КСУ обл.	6,75	150 000 000,00	1

Viewer 2 - Наблюдатель организатора аукциона - Денежный - MICEX Trade TI

Сеанс Вид Действие Таблица Запрос Сервис Данные Окно Справка

224 - Участники

Фирма	У К Тип участника	T	Статус	Ак
Технц МБТЕХ	Ц D TC	*	Да	
Технц МБТЕХ	Ц D TC	*	Да	
Технц НВФБ	Ц G TC	*	Да	
Технц НВФБ	Ц G TC	*	Да	
Рольф	У M Управляющий фирмы	3	Да	
Рольф	У M Наблюдатель организатора аукциона	*	Да	
ТС ITRD(ЭЦП)	И M TC	*	Да	
ТС ITRD(ЭЦП)	И M TC	*	Да	
ТС ITRD(ЭЦП)	И M TC	*	Да	
ТС ITRD(ЭЦП)	И M TC	*	Да	
Альфа	У M Управляющий фирмы	3	Да	
ЮниКредБанк	У M Управляющий фирмы	3	Да	
Сбербанк	П M Управляющий фирмы	3	Да	
Сбербанк	К M Управляющий фирмы	3	Да	
ВТБ РФ	Я M Управляющий фирмы	3	Да	
ГПБ (ОАО)	У M Управляющий фирмы	3	Да	
ГПБ (ОАО)	У M Управляющий фирмы	3	Да	
Промсвязь	У M Управляющий фирмы	3	Да	
Промсвязь	У M Управляющий фирмы	3	Да	
Промсвязь	У M Управляющий фирмы	3	Да	
Промсвязь	У M Управляющий фирмы	3	Да	

9 - Справочник валют

2 / 21 - Позиции по деньгам

Фирма	Позиция	Код позиции	Валют	Описание	Входящий	Текущая
Совкомбанк	DPOR	MC02538DPOR1	SUR	Лимит RUB М-Депз. АРСГ НО DPAO	0,00	0,00
Совкомбанк	DPPR	MC02538DPPR1	SUR	Лимит RUB М-депз. Т Плюс DPAO	0,00	0,00
Совкомбанк	DPQR	MC02538DPQR1	SUR	Лимит RUB М-Депз. ЕвразБР DPAO	0,00	0,00
Совкомбанк	DPRR	MC02538DPRR1	SUR	Лимит RUB М-депз. Рольф DPAO	0,00	0,00
Совкомбанк	DPSR	MC02538DPSR1	SUR	Лимит RUB М-Депз. РУСАЛ DPAO	0,00	0,00
Совкомбанк	DPTR	MC02538DPTR1	SUR	Лимит RUB М-депз. РосАтом DPAO	0,00	0,00

ROLF01_001_190919 - Редактор до

Основные

Новый Загрузить Сохранить Подписать и зашифровать Подписать, зашифровать и отправить Настройки

Основные Валидата Парам...

Параметры лимитов

Дата 19.09.2019 Код инструмента ROLF_DEP

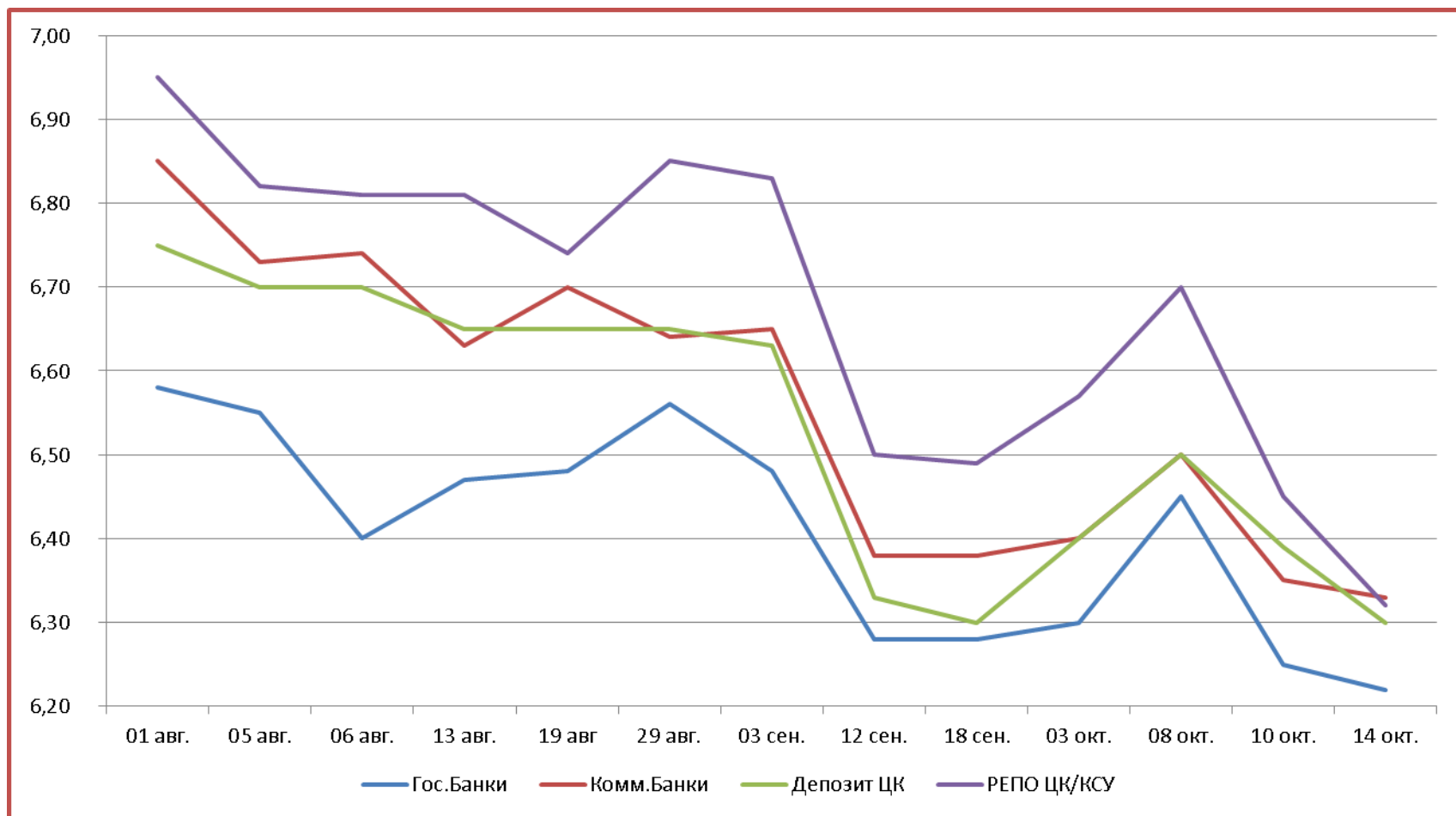
Номер аукциона 4 Валюта депозитов RUB

Добавить Удалить

Краткое наименование Участника	Размер Лимита
Акционерное общество "ЮниКредит Банк "	1 000 000 000,00
Акционерное общество "Райффайзенбанк"	1 000 000 000,00
Публичное акционерное общество "РОСБАНК"	1 000 000 000,00
Публичное акционерное общество "Совкомбанк"	1 000 000 000,00

13:29:58 Подключено

Оповещения Рынок Инструменты Заявки Сделки Оповещения



НСО и депозиты

			Лимит o/n 1w 1m	Ставка	
	Банк	ГС			
Gov.	1	да		6,25	L.G.
	2	да		6,30	W.G.
	3			6,20	
	4	да		6,15	L.G.
	5	да		6,05	L.G.
	6			6,50	
Comm.	7			5,90	
	8	да		6,19	L.C.
	9	да		6,25	L.C.
	10			6,20	
	11			6,31	
	12	да		6,00	
	13	да		6,45	
	14	да		6,50	W.C.
	15			6,61	
	16	да		6,23	L.C.
	17			5,95	

DEAL

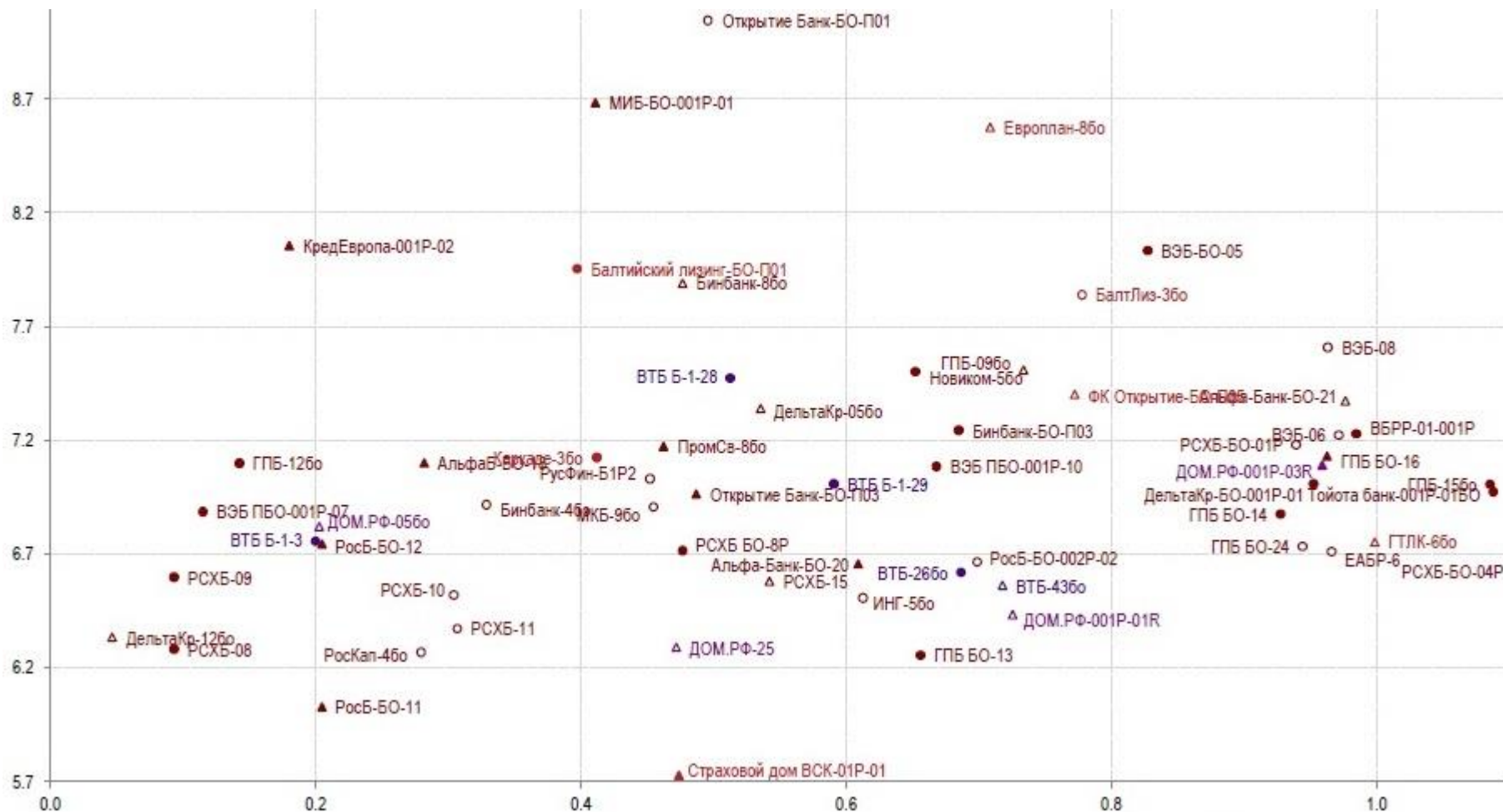
Gov.	6,30
Comm.	6,50

Биржа

Ставка		
o/n		комиссия
Депозит с ЦК		0,47
6,75		6,28
РЕПО с ЦК		0,30
1	6,80	6,50
2	7,30	7,00
3	6,80	6,50
4	6,90	6,60

М-Депозиты

--



+ Создать заявку



Пользователь

Заявки

ON

1W

1M

Привлечение

Объем	Цена	Дата	Участник
2 200 000 000 ₽	6,8%	18.09.2019	ALFCM
300 000 000 ₽	6,5%	18.09.2019	SOVKM
1 500 000 000 ₽	6,3%	18.09.2019	VTBMM
2 000 000 000 ₽	6%	18.09.2019	OTKRT
600 000 000 ₽	5%	17.09.2019	BCSBK
9 000 000 000 ₽	3%	01.08.2019	FINAM

Нельзя торговать, проверьте настройки

Размещение

Свои заявки

Все заявки

Объем	Дата	Участник	Информация

Заявка на привлечение

Сумма

2 200 000 000 ₽

Ставка

6,8%

ИСПОЛНИТЬ

Дата

18.09.19 15:00

Статус

Активная

Операция

Привлечение

Валюта

RUB

Пользователь

ALFCM_tr

Код клиента

ALFCM

Дополнительная информация

Вернуть денежные средства до 10:00 19 сентября 2019 года

Журнал заявок

Все

Исполненные

Участник	Объем	Цена	Дата	Статус	Срок депозита	Отчет
ALFCM	2 200 000 000 ₽	6,8%	18.09.19 16:00	Исполнена	7 дней	📄
FINAM	300 853 000 ₽	7%	17.08.2019	Исполнена	120 дней	📄
BCSBK	200 853 000 ₽	7,1%	16.08.2019	Подтверждена	120 дней	
SOVKM	300 853 000 ₽	7,1%	16.08.2019	Неисполнена	120 дней	
SOVKM	200 853 000 ₽	6,9%	15.08.2019	Подтверждена	120 дней	
VTBMM	500 853 000 ₽	6,5%	14.08.2019	Подтверждена	120 дней	
SOVKM	100 853 000 ₽	6,4%	14.08.2019	Исполнена	120 дней	📄
ALFCM	2 853 000 ₽	6,7%	14.08.2019	Подтверждена	120 дней	

Участники

Код	Название	
★ SOVKM	Совкомбанк	✎
☆ ALFCM	Альфабанк	✎
★ VTBMM	ВТБ	✎
★ RSHBK	Россельхозбанк	✎
FINAM	Финам	✎
☆ OTKRT	Банк Открытие	✎
SBERB	Сбербанк	✎
★ BCSBK	БКС Банк	✎