

Формули розрахунку параметрів операції РЕПО

(нова редакція)

Даний документ розроблений відповідно до Правил АТ «Фондова Біржа ПФТС» з метою визначення формул розрахунку параметрів операції РЕПО відповідно до вказаних учасником торгів умов заявки РЕПО, поданої засобами електронної торговельної системи, а також при виконанні другої частини операції РЕПО в іншу дату, ніж передбачено умовами укладеного договору РЕПО.

Всі терміни у цьому документі вживаються згідно з діючими законодавчими та підзаконними актами, правилами, положеннями та стандартами Біржі.

1. В формулах, наведених в цьому документі, використовуються наступні позначення:

Сума₁ – вказана у заявці РЕПО сума першої частини операції РЕПО, виражена в гривнях з точністю до копійок;

Кількість_{шт} – вказаний у заявці РЕПО обсяг операції РЕПО в штуках цінних паперів;

Ціна₁, *Ціна₂* – ціна за один цінний папір (за 1 шт.) в першій та в другій частинах операції РЕПО (якщо параметрами випуску цінних паперів передбачена виплата процентного доходу, накопичений процентний дохід включений у ціну), виражена в гривнях з точністю – як встановлено для вираження ціни даного цінного паперу;

Ставка% – вказана у заявці РЕПО ставка РЕПО у відсотках річних, виражена з точністю до чотирьох знаків після коми;

Дохід_{грн} – сума процентного доходу (витрат) за операцією РЕПО, яка розраховується в залежності від вказаних в заявці РЕПО параметрів операції РЕПО і виражається в гривнях з точністю до копійок;

Термін_{365дн} - кількість днів між виконанням першої та другої частинами операції РЕПО, що припадають на календарні роки, які складаються з 365 днів;

Термін_{366дн} – кількість днів між виконанням першої та другої частинами операції РЕПО, що припадають на календарні роки, які складаються з 366 днів.

Термін_{365дн} та *Термін_{366дн}* визначаються, виходячи із вказаного в заявці РЕПО строку РЕПО.

2. **Ціна для першої частини операції РЕПО** розраховується, виходячи із вказаної учасником торгів інформації в заявці РЕПО, за формулою:

$$Ціна_1 = Сума_1 / Кількість_{шт}$$

3. Формули розрахунків інших параметрів операції РЕПО залежать від режиму, в якому учасники торгів проводять ці операції:

3.1. Якщо операції здійснюються учасниками торгів у режимі торгів «**РЕПО: Державні ЦП (на суму)**», параметри операції РЕПО розраховуються, виходячи із вказаної учасником торгів інформації в заявці РЕПО, таким чином:

3.1.1. **Сума процентного доходу (витрат) за операцією** розраховується за наступною формулою:

$$\text{Дохід}_{\text{грн}} = \text{Сума}_1 \cdot \text{Ставка}\% / 100 \cdot (\text{Термін}_{365\text{дн}}/365_{\text{дн}} + \text{Термін}_{366\text{дн}}/366_{\text{дн}})$$

3.1.2. **Сума другої частини операції РЕПО (сума зворотного викупу)** розраховується за формулою:

$$\text{Сума}_2 = \text{Сума}_1 + \text{Дохід}_{\text{грн}}$$

3.1.3. **Ціна для другої частини операції РЕПО** розраховується за наступною формулою:

$$\text{Ціна}_2 = \text{Сума}_2 / \text{Кількість}_{\text{шт}}$$

3.1.4. Зазначені формули визначення параметрів операції РЕПО використовуються торговельною системою під час укладання операції РЕПО, а також при достроковому виконанні другої частини операції РЕПО. При виконанні операції РЕПО пізніше, ніж дата виконання другої частини відповідно до умов укладеного договору РЕПО, параметри операції РЕПО розраховуються, виходячи з дати виконання другої частини операції РЕПО, встановленої умовами укладеного договору РЕПО.

3.2. Якщо операції здійснюються у режимах торгів «**РЕПО: Державні ЦП (за ціною)**», «**РЕПО: Корпоративні облігації**», «**РЕПО: Пайові ЦП**», «**РЕПО з контролем ризиків**» параметри операції РЕПО розраховуються, виходячи із вказаної учасником торгів інформації в заявці РЕПО, таким чином:

3.2.1. **Ціна для другої частини операції РЕПО** розраховується за наступною формулою:

$$\text{Ціна}_2 = \text{Ціна}_1 + \text{Ціна}_1 \cdot \text{Ставка}\% / 100 \cdot (\text{Термін}_{365\text{дн}}/365_{\text{дн}} + \text{Термін}_{366\text{дн}}/366_{\text{дн}})$$

3.2.2. **Сума другої частини операції РЕПО (сума зворотного викупу)** розраховується за формулою:

$$\text{Сума}_2 = \text{Кількість}_{\text{шт}} \cdot \text{Ціна}_2$$

3.2.3. **Сума процентного доходу (витрат) за операцією РЕПО** розраховується за формулою:

$$\text{Дохід}_{\text{грн}} = \text{Сума}_2 - \text{Сума}_1$$

3.2.4. Зазначені формули визначення параметрів операції РЕПО використовуються торговельною системою під час укладання операції РЕПО, а також при виконанні другої частини операції РЕПО в іншу дату, ніж передбачено умовами укладеного договору РЕПО.
