



ПРАВИТЕЛЬСТВО САНКТ-ПЕТЕРБУРГА
КОМИТЕТ ФИНАНСОВ САНКТ-ПЕТЕРБУРГА

Новгородская ул., д.20, литера А, Санкт-Петербург, 191144, телефон (812) 576-3529, телефакс (812) 246-1424
e-mail: kfin@kfin.gov.spb.ru, http://комфинспб.пф, https://fincom.gov.spb.ru

№ _____
На № _____ от _____

Объявление

о проведении отбора заявок кредитных организаций
на заключение договоров репо

Настоящим Комитет финансов Санкт-Петербурга (далее – Глобальный кредитор) объявляет о проведении **29.11.2021** на АО «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» отбора заявок (оферт) кредитных организаций на заключение договоров репо на следующих условиях:

1. Инициатор отбора заявок – Комитет финансов Санкт-Петербурга.
2. Дата отбора заявок – **29.11.2021**.
3. Уникальный идентификатор отбора заявок (оферт) (ID) – **21026**.
4. Максимальный объем средств **3 000,0** млн рублей.
5. Валюта – **RUB**.
6. Время начала сбора заявок (оферт) – **10:00**.
7. Время окончания сбора заявок (оферт) – **11:00**.
8. Срок договора репо – **21 день**.
9. Дата исполнения первой части репо – **30.11.2021**.
10. Дата исполнения второй части репо – **21.12.2021**.
11. Минимальная ставка репо (спред) – **0,0%** годовых.
12. Идентификатор инструмента репо (спецификация) – **SPRV021RS1**.
13. Дополнительная информация:
 - 13.1. Условия проведения отбора заявок (оферт) – на внебиржевом рынке.
 - 13.2. Код корзины репо – **GCSPPBONDS**.
 - 13.3. Перечень ценных бумаг, в отношении которых заключаются договоры репо (принимаемых в качестве обеспечения) – облигации федеральных займов, входящих в корзину ценных бумаг GCSPPBONDS, опубликованную на официальном сайте клиринговой организации, за исключением тех, по которым проводится фиксация списка владельцев для участия в запланированных корпоративных действиях и выплата купонного дохода.
 - 13.4. Стоимость ценных бумаг, в отношении которых заключаются договоры репо – стоимость ценной бумаги определяется как рыночная цена ценной бумаги по данным предыдущего торгового дня, опубликованная на сайте ПАО Московская Биржа в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», в соответствии с порядком определения рыночной цены, установленным пунктом 4 статьи 212 главы 23 Налогового кодекса Российской Федерации. В случае отсутствия рыночной цены, опубликованной на сайте ПАО Московская Биржа в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», стоимость ценной бумаги определяется документами клиринговой организации.
 - 13.5. Процентная ставка размещения средств (фиксированная или плавающая) – **FLOATING**.
 - 13.6. Базовая плавающая процентная ставка размещения средств – **RUONmDS**.
 - 13.7. Минимальный размер одной Заявки – **1,0** млн рублей.
 - 13.8. Начальный дисконт – **5,0%**.
 - 13.9. Допустимый уровень переоценки (трешхолд) – **0,05%**.

- 13.10. Условие о возможности замены ценных бумаг – **Да.**
13.11. Условие о внесении компенсационного вноса – **Да.**
13.12. Определение Глобальным кредитором процентной ставки отсечения (спреда) и направление на АО «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» реестра акцептованных заявок или признание отбора заявок не состоявшимся – **не позднее 14:00 29.11.2021.**
13.13. Время расчетов по второй части сделки репо – **до 16:00 21.12.2021.**
13.14. Тип (порядок) расчетов – **DVP3.**

Справочно:

$RUONmDS = RUONIA - DS,$

RUONIA - выраженное в сотых долях процентов значение индикативной взвешенной ставки однодневных рублевых кредитов (депозитов) RUONIA, опубликованной на официальном сайте Банка России в сети Интернет в день, предшествующий дню, за который начисляются проценты. В случае отсутствия в день, предшествующий дню, за который начисляются проценты, публикации значения ставки RUONIA, в расчет принимается последнее из опубликованных значений ставки RUONIA.

DS - выраженное в сотых долях процентов и округленное (по правилам математического округления) до двух знаков после запятой значение, рассчитываемое умножением значения Ключевой ставки Банка России на значение норматива обязательных резервов по иным обязательствам кредитных организаций для банков с универсальной лицензией, небанковских кредитных организаций (за исключением долгосрочных) в валюте Российской Федерации, действующих на дату, за которую начисляются проценты, и опубликованных на официальном сайте Банка России в сети Интернет.

Заместитель председателя

И.Н.Хафизова