

РЕПО ТА ВАЛЮТНИЙ СВОП

З ЦЕНТРАЛЬНИМ КОНТРАГЕНТОМ



СИСТЕМА ГАРАНТІЙ

Центральний контрагент гарантує виконання угоди або виплату добросовісній стороні компенсації

Центральний контрагент:



«отримує» гарантійне забезпечення



проводить процедуру Mark-to-market (щоденна переоцінка зобов'язань та гарантійного забезпечення)



виставляє маржинальну вимогу



проводить розрахунки

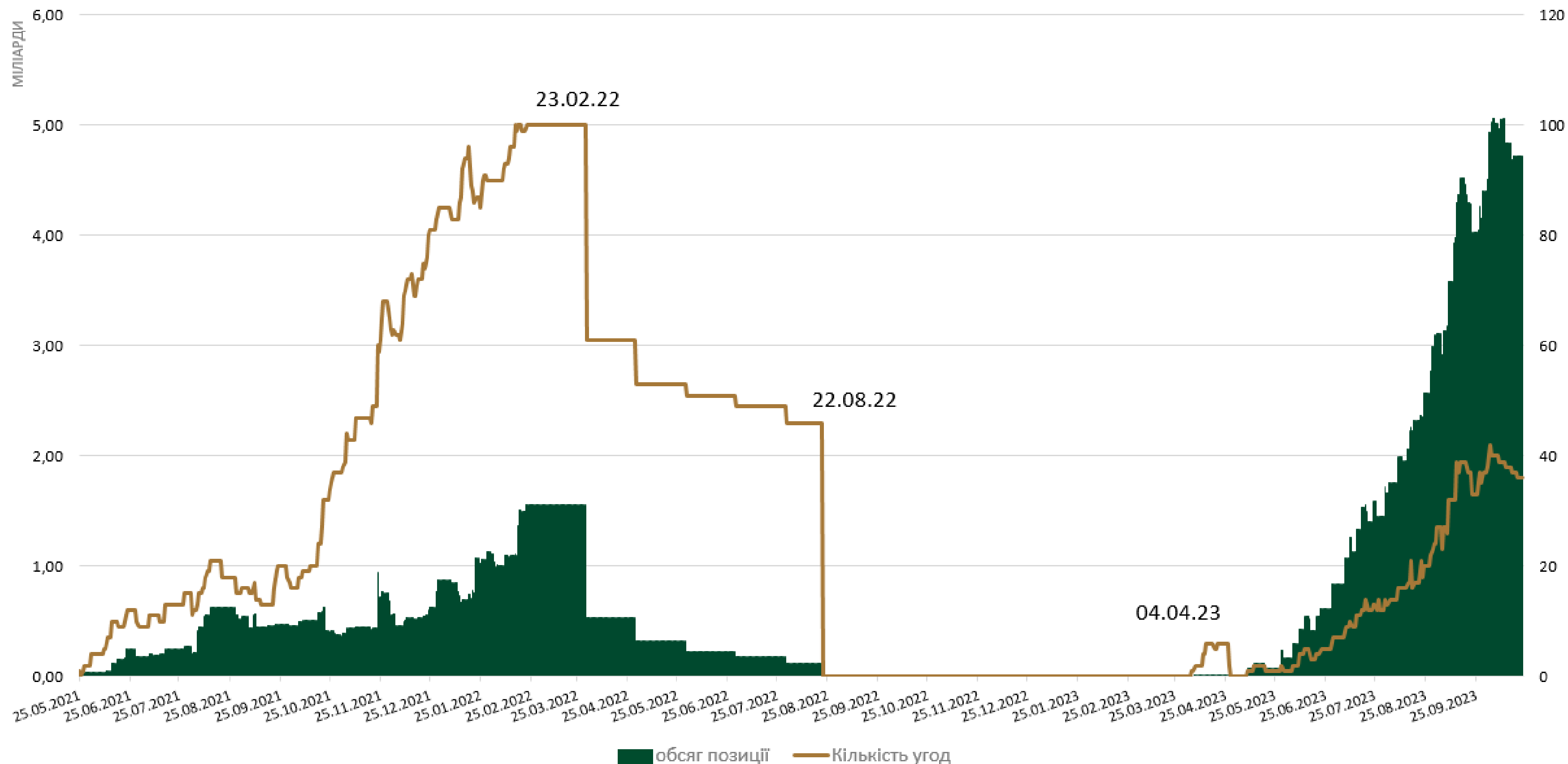


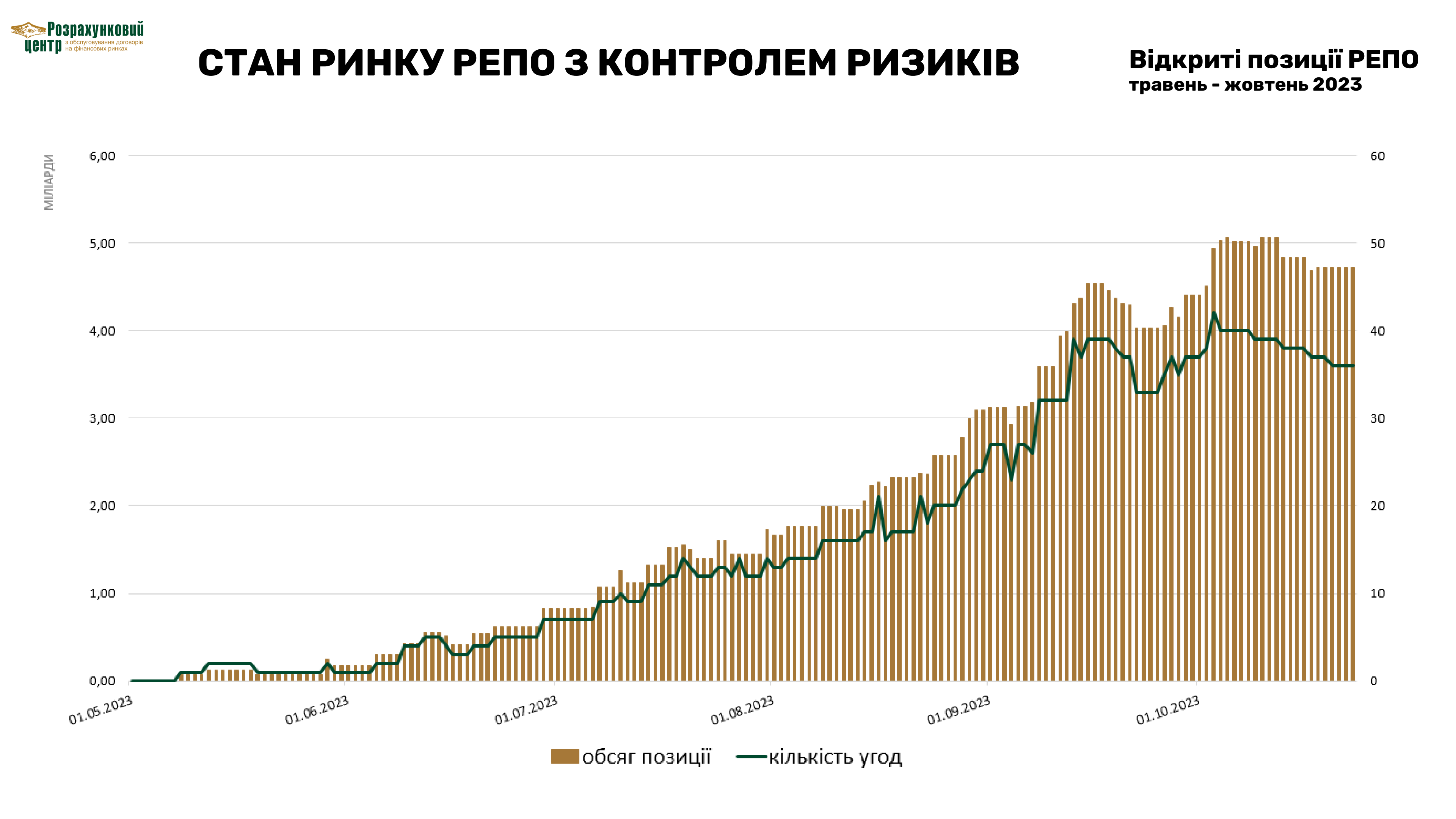
в разі невиконання зобов'язань або маржинальної вимоги примусово припиняє зобов'язання та передає добросовісній стороні гарантійне забезпечення винної сторони



СТАНОВЛЕННЯ РИНКУ РЕПО

Відкриті позиції РЕПО
травень 2021 - жовтень 2023





ПЕРЕВАГИ ВАЛЮТНИХ СВОПІВ З ЦЕНТРАЛЬНИМ КОНТРАГЕНТОМ



- ✓ **Єдиний контрагент** для всіх учасників ринку – центральний контрагент
- ✓ **Необхідний один ліміт** – на центрального контрагента (без взаємних лімітів)
- ✓ Єдиний для всіх бірж **кліринговий пул**
- ✓ **Неттінг зобов'язань** (мінімізує вимоги до кількості активів)
- ✓ Розрахунки здійснюються за принципом **«поставка проти оплати»**
- ✓ Можливі **негайні розрахунки**
- ✓ **«Роловер»** позиції
- ✓ **Гарантія розрахунків** або отримання компенсації

ПАРАМЕТРИ ВАЛЮТНОГО СВОПУ



До клірингу допущені такі інструменти:

Гривня – долар США

Гривня – євро



Бенчмарк – **офіційний курс**



Оператор організованого ринку – **ПАТ «Українська біржа»**



Мінімальний розмір угоди – **1 млн. грн.**



Розмір базового забезпечення учасників клірингу – **10% від суми першої частини свопу**



Проміжні клірингові сесії о **11-00, 13-00, 15-00**

Основна клірингова сесія о **16-30**



До складу гарантійного забезпечення приймаються:

- гривня
- долари США, євро
- ринкові випуски гривневих ОВДП з датою погашення до 31.12.2027



Контакти



Публічне акціонерне товариство «Розрахунковий центр з обслуговування договорів на фінансових ринках»

Телефон

+380 44 585 42 42

+380 44 481 00 99

Вебсайт / імейл

settlement.com.ua

repo@settlement.com.ua

Місцезнаходження

04107, Україна, м. Київ, вул. Якубенківська 7-Г