

Bloomberg

MICR<GO>

Монитор РЕПО с живыми и историческими котировками с ММВБ-РТС

Монитор MICR<GO> предоставляет уникальную информацию по российскому биржевому рынку РЕПО. С появлением этого монитора Вам стала доступна история котировок РЕПО по акциям и облигациям (корпоративным и ОФЗ) с возможностью фильтра по времени и дисконту.

<HELP> Справка.
95<Go> Сохр. текущ. настройки как вид по умолч.

97 Опции 98 Действия 99 Отзывы

Монитор репо ММВБ

Вид	Облиг.	Все	Гос.	Корп.	Сроки	Однов.	Ист. диапазон	Посл. 3 мес.		
Вид	Облиг.	Все	Гос.	Корп.	Сроки	Однов.	Ист. диапазон	Посл. 3 мес.		
Ис. диаг.	Ставка	Мин.	Диап.	Макс.	СрдСтвк	Об'м	Знач.↑	ОбщЗнач	НС	Врм
10) RFLB 6.9 08/16	4,750	7,000	6,850	5,707	4,2ММ	4МММ	13.8МММ	5%	13:46:09	
11) ROMNS 8.25 12/14	7,000	7,000	7,000	7,000	990М	918.8М	2.8МММ	7%	06/27/201	
12) NSGZ 8.25 11/14	7,000	7,000	7,000	7,000	990М	918.8М	2.8МММ	8%	06/27/201	
13) B 8.1 11/14	5,350	5,300	6,100	5,329	1.8ММ	650ММ	2.1МММ	63%	09/05/201	
14) B 6.45 07/15	5,600	5,600	5,550	5,727	1.2ММ	514ММ	1.3МММ	56%	09/06/201	
15) OSCOW 7 06/22	4,850	4,100	10,500	5,868	579.1М	500ММ	164.5МММ	5%	14:43:05	
16) RFLB 7 06/15	3,650	3,000	6,890	5,824	515.9М	500ММ	161.7МММ	5%	15:41:21	
17) RUSSIA 7.5 03/30	6,100	5,500	6,100	5,847	15ММ	450.7М	12.5МММ	NA	08/13/201	
18) MOBTEL 7 10/13	4,750	5,000	6,000	5,859	428.1М	400ММ	6.8МММ	8%	08/14/201	
19) CENTIN 10.4 06/14	5,400	5,250	5,900	5,402	446М	389.2М	2.2МММ	15%	08:54:43	
20) BNRM 7.9 07/13	5,100	4,900	6,550	5,363	425М	383.6М	2.3МММ	10%	09/10/201	
21) ATRS 9 12/13	5,500	5,250	6,800	5,806	350М	357.1М	19.1МММ	0%	13:56:09	
22) NIT 9.2 04/15	5,650	5,500	7,000	6,022	295М	290.2М	10.7МММ	5%	10:20:51	
23) PEIK 9 10/13	5,650	5,650	5,800	5,717	300М	289.2М	859.7ММ	5%	10:08:28	
24) LB 7.35 01/16	4,900	4,000	7,250	5,749	300М	282.3М	104.1МММ	7%	12:13:31	
25) MFRU 9.75 02/13	1,000	1,000	6,600	5,393	258М	262.6М	10.8МММ	0%	15:14:30	
26) MATRU 9.5 07/16	6,000	6,000	6,000	6,000	257М	261ММ	464.2ММ	0%	07/26/201	
27) ZTRU 8.6 04/16	5,200	3,000	6,700	6,006	300М	258.5М	2.2МММ	15%	09/04/201	
28) LB 7.6 04/21	4,850	4,000	7,500	6,017	255.9М	250ММ	1.7ММММ	5%	14:52:06	
29) B 7.95 09/15	1,000	1,200	6,100	4,402	277.2М	250ММ	7.6МММ	10%	15:35:09	
30) АКВНС 14.22 09/13	8,000	8,000	8,000	8,000	230М	241.7М	1.3МММ	2%	14:02:14	
31) ТМАТН 10 04/15	5,000	5,000	7,000	5,793	250М	239.7М	19МММ	5%	11:29:16	
32) EURDEV 7.5 10/16	6,000	4,100	6,700	5,742	256М	230.3М	14.8МММ	12%	09/10/201	

© Задерж. торговый отчет

Australia 61 2 9777 8600 Brazil 5511 3048 4500 Europe 44 20 7330 7500 Germany 49 69 9204 1210 Hong Kong 852 2977 6000
Japan 81 3 3201 8900 Singapore 65 6212 1000 U.S. 1 212 318 2000 Copyright 2012 Bloomberg Finance L.P.
SN 345676 BST GMT+1:00 H46-4566-3 11-Sep-2012 17:37:12

Выберете тип залога в левом углу: Акции или Облигации.

Выпадающий список в правом верхнем углу позволяет установить исторический промежуток времени для сделок.

<HELP> Справка.
95<Go> Сохр. текущ. настройки как вид по умолч.

97 Опции 98 Действия 99 Отзывы

Монитор репо ММВБ

Вид	Акции	Все	Сроки	Все сроки	Ист. диапазон	Посл. неделя				
Вид	Акции	Все	Сроки	Все сроки	Ист. диапазон	Посл. неделя				
Ис. диаг.	Ставка	Мин.	Диап.	Макс.	СрдСтвк	Об'м	Знач.↑	ОбщЗнач	НС	Врм
Внутридн.	1,000	1,000	1,000	10,000	5,08	6.6МММ	15:44:14			
Однов.	-19,000	-19,000	-19,000	18,250	4,822	411.9МММ	15:44:53			
Срок репо 2	-14,000	-14,000	-14,000	3,850	5,066	5МММ	11:55:21			
Срок репо 3	-19,000	-19,000	-19,000	10,000	4,691	100.4МММ	09/11/201			
Срок репо 4	-19,000	-19,000	-19,000	6,250	5,040	3.8МММ	09/11/201			
Срок репо 5	1,000	1,000	1,000	9,000	4,000	336.9ММ	11:32:14			
Срок репо 6	3,000	3,000	3,000	13,000	5,765	434.9ММ	15:17:12			
Срок репо 7	12,000	12,000	12,000	17,228	5,629	17.7МММ	15:33:27			
Срок репо 8	7,000	7,000	7,000	7,500	7,449	44.5ММ	09/06/201			
Срок репо 10	-1,000	-1,000	-1,000	5,750	4,837	68.1ММ	09/07/201			
20) Срок репо 11	10,000	10,000	10,000	10,000	10,000	1.9ММ	09/07/201			
21) Срок репо 13	10,000	10,000	10,000	10,000	10,000	563.5М	09/07/201			
22) Срок репо 14	4,400	4,400	4,400	16,000	7,205	4.6МММ	08:17:02			
23) Срок репо 28	-5,500	-5,500	-5,500	-5,500	-5,500	71.6М	09/06/201			
24) Срок репо 30	13,000	13,000	13,000	14,000	13,251	668.3М	12:52:36			
Срок репо 31	10,000	10,000	10,000	13,000	12,656	750М	09/07/201			
Срок репо 32	10,000	10,000	10,000	14,000	13,756	475М	09/07/201			
Срок репо 33	13,000	13,000	13,000	13,000	13,000	981.9М	09/06/201			
Срок репо 180	12,000	12,000	12,000	12,000	12,000	1.2ММ	09/07/201			

© Задерж. торговый отчет

Australia 61 2 9777 8600 Brazil 5511 3048 4500 Europe 44 20 7330 7500 Germany 49 69 9204 1210 Hong Kong 852 2977 6000
Japan 81 3 3201 8900 Singapore 65 6212 1000 U.S. 1 212 318 2000 Copyright 2012 Bloomberg Finance L.P.
SN 345676 BST GMT+1:00 H373-2948-2 12-Sep-2012 16:30:34

В выпадающем списке «Сроки» выберите срок репо, например, однодневное. «Все сроки» показывает среднюю ставку по каждому тенору за выбранный период.

Средняя ставка в данном случае рассчитывается как средневзвешенная по объему в денежном выражении.

<HELP> Справка.
<Menu> Закрыть

97) Опции 98 Действия 99 Отзывы

Монитор репо ММББ

Акции	Ставка	Мин.	Макс.	СрдСтвк	Об'м	Знач.	Ист. диапазон	Сегод.	Врм
10) P1KK RP Equity	6.150	6.150	7.000	6.266	5.4MM	370MM	676.5MM	5%	18:06:21
11) RTKM RP Equity	4.850	.000	5.900	5.368	1.5MM	182.4M	3MM	5%	17:46:10
12) TGNT RP Equity	5.400	1.000	5.550	5.127	33.6M	150MM	622.5MM	0%	17:22:09
13) GKE RP Equity	5.750	5.750	5.750	5.750	105MM	150MM	150MM	20%	11:09:49
14) PRAO RP Equity	1.000	.100	.100	.100	650MM	147.1M	1MM	0%	17:11:17
15) IBN RP Equity	5.400	.100	5.400	5.030	1MM	131.4M	142.4MM	15%	13:35:21
16) TKMP RP Equity	4.850	2.000	5.000	5.000	1.5MM	130.4M	428.2MM	5%	17:46:14
17) TLR RP Equity	7.000	.000	7.000	7.000	1MM	73.7MM	291.3MM	15%	17:18:50
18) KRN RP Equity	5.400	.000	5.400	5.400	1MM	61.7MM	82.3MM	15%	13:35:27
19) ONR RP Equity	5.000	.000	5.000	5.000	1MM	54MM	81.1MM	0%	17:28:20
20) MVID RP Equity	5.000	.000	5.000	5.000	1MM	53.9MM	1MM	90%	13:10:41
21) TNBP RP Equity	5.000	.000	5.000	5.000	1MM	35.4MM	327MM	20%	17:11:35
22) ALRS RP Equity	5.500	.000	5.500	5.500	1MM	35.1MM	35.1MM	10%	18:12:15
23) SBER RP Equity	8.500	.000	8.500	8.500	1MM	31.9MM	16MM	15%	18:44:50
24) TATNP RP Equity	5.500	.000	5.500	5.500	1MM	30.8MM	30.8MM	15%	14:14:45
25) BANE RP Equity	6.250	6.250	7.000	6.482	19.2M	30MM	254.8MM	15%	16:49:18
26) RASP RP Equity	5.500	.000	6.000	4.312	400M	27MM	150.8MM	10%	16:49:43
27) MTSS RP Equity	5.400	-2.000	7.000	5.111	120M	25.5MM	456.7MM	15%	17:28:45
28) AFLT RP Equity	5.500	5.500	7.000	6.564	500M	19.6MM	62.1MM	10%	16:49:36
29) MSRS RP Equity	.000	.000	.100	.043	20MM	19.6MM	37.1MM	20%	14:31:27
30) BANEP RP Equity	.000	.000	.000	.000	18M	18.5MM	18.5MM	20%	12:51:00
31) TNBPP RP Equity	-.100	-.100	5.400	3.061	300M	18.4MM	130.8MM	20%	15:56:20
32) URKA RP Equity	-4.000	1.500	7.000	5.753	50M	13.4MM	9.5MM	-5%	18:44:42

Опции

Время закрытия биржи: 06:45pm

Порог дисконта: 5% - 20%

OK Закрыть

Australia 61 2 9777 8600 Brazil 5511 3048 4500 Europe 44 20 7330 7500 Germany 49 69 9204 1210 Hong Kong 852 2977 6000
Japan 81 3 3201 8900 Singapore 65 6212 1000 U.S. 1 212 318 2000 Copyright 2012 Bloomberg Finance L.P.
GMT+4:00 H373-2948-2 12-Sep-2012 19:38:24 SN 345676

97)Опции – позволяет установить фильтр сделок, чтобы отсеять сделки по времени и/или с определенным дисконтом.

<HELP> Справка.
<Menu> Вернуться

97) Опции 98 Действия 99 Отзывы

Монитор репо ММББ

Ист. диапазон Сегод.

PIKK RP Equity, срок Однодн.	Ставка	Об'м	Знач.	НС	Врм
16.	.000	40.9M	3.5MM	-18%	17:47:57
17.	.000	40.9M	3.5MM	-18%	17:47:36
18.	8.250	2.5MM	100MM	45%	17:19:17
19.	8.250	2.5MM	100MM	45%	17:19:11
20.	8.250	1.8MM	72MM	45%	17:19:08
21.	6.350	400M	24.7MM	15%	14:32:54
22.	6.350	1MM	61.8MM	15%	14:32:47
23.	6.350	1MM	61.8MM	15%	14:32:42
24.	6.350	1MM	69.1MM	5%	14:26:27
25.	6.350	1MM	69.1MM	5%	14:26:26
26.	7.250	2.5MM	100MM	45%	13:50:02
27.	7.250	2.5MM	100MM	45%	13:49:59
28.	7.250	1.8MM	72MM	45%	13:49:55
29.	5.000	3MM	21.8MM	90%	13:16:14
30.	7.000	114.6M	6.7MM	20%	11:22:26
31.	7.000	114.6M	6.7MM	20%	11:22:20
32.	7.000	114.6M	6.7MM	20%	11:22:16
33.	7.250	2MM	80MM	45%	09:31:36
34.	7.250	2MM	80MM	45%	09:31:33
35.	7.250	2.5MM	100MM	45%	09:31:29
36.	7.250	2.5MM	100MM	45%	09:31:26
37.	7.250	2MM	80MM	45%	09:31:23

Знач репо Об'м репо

PIKK RP Equity - Repo Rate

PIKK RP Equity - Знач репо

GMT+4:00 H373-2948-2 12-Sep-2012 19:55:01 SN 345676

Нажмите на строчку с залоговым инструментом, чтобы увидеть все сделки внутри дня.

Сделки, не попадающие под фильтр, будут выделены серым цветом.



Выделите несколько серых значков с графиком, чтобы сравнить историю сделок по этим инструментам.

Колонки:

Бумага / Security

Ставка / Rate

Мин. / Low
времени

Диап. / Range

Макс. / High

СрдСтвк / Avg Rate

Об'м / Size

Знач. / Value

ОбщЗнач / Tot Value

НС / NS

Врм / Time

– Залоговый инструмент для сделок репо

– Ставка последней сделки репо

– Самая низкая ставка за выбранный промежуток

– Графическая иллюстрация соотношения средней ставки за период (оранжевый ромб) и последней ставки (голубая точка)

– Максимальное значение за выбранный период

– Средневзвешенное значение за выбранный период

– Размер последней сделки в акциях/облигациях

– Размер последней сделки в денежном выражении

– Общий объем в денежном выражении за выбранный период

– Дисконт (Haircut) по последней сделке

– Время последней сделки

RURE<GO>

Портал для работы с РЕПО на Блумберг

Все ссылки на самые необходимые для работы функции находятся на странице RURE<GO>. Она позволяет легко начать работу с рынком РЕПО на Блумберге, не запоминая множество разных экранов.

<HELP> Справка, <MENU> Другие функции N191

90 Запрос демонстрации

RUSSIAN REPO MARKET

RURE<GO> - Это новый портал, созданный для участников рынка РЕПО. Портал предоставляет доступ к страницам с биржевыми ценами и ставками, торговым билетам, данным Центрального банка, новостям и страницам брокеров.

Поиск и анализ цен

- 1) Монитор репо ММВБ

Анализ залоговых инструментов

- 2) Акции ММВБ
- 3) Депоз. расписки рос. компаний в Лондоне
- 4) Рублевые и еврооблигации

Торговый функционал

- 5) Торговый билет РЕПО
- 6) Журнал сделок
- 7) Документация и инструкции VCON

Центральный банк

- 8) Ломбардный список ЦБ России
- 9) Ставки РЕПО ЦБ России

Новости

- 10) Календ. событий Центральн. банка России
- 11) Новостная лента, сфокусир. на России
- 12) Новости о РЕПО в России
- 13) Результаты аукционов РЕПО

Ресурсы

- 14) Источники цен

Australia 61 2 9277 8600 Brazil 5511 3048 4500 Europe 44 20 7330 7500 Germany 49 69 9204 1210 Hong Kong 852 2977 6000
Japan 81 3 3201 8900 Singapore 65 6212 1000 U.S. 1 212 318 2000 Copyright 2012 Bloomberg Finance L.P.
SN 345676 GMT+4:00 H373-2948-2 12-Sep-2012 20:51:16

Монитор репо ММВБ – ссылка на MICR<GO>, экран, описанный выше в этой брошюре.

Анализ залоговых инструментов – списки тикеров акций с ММВБ и депозитарных расписок в Лондоне, а также ссылка на монитор цен по рублевым облигациям с ММВБ и российских еврооблигаций.

Торговый функционал – тикет RRRR<GO> - открывается для последнего инструмента, который Вы просматривали в этом экране.

VCON<GO> - журнал сделок с РЕПО, который хранит всю историю принятых и отправленных билетов. Вы можете выгрузить данные из журнала в эксель и настроить интеграцию с Вашей внутренней учетной системой.

