



Октябрь 2015  
Москва

# Система электронного подтверждения договоров на рынке МБК

Некоммерческое партнерство развития финансового рынка НП РТС  
Голосовой брокер «Премекс»





**Рынок МБК:** решение проблем с кратко-, средне- и долгосрочной ликвидностью  
заимствование / предоставление рублевых или валютных средств  
двусторонние операции в пределах взаимных кредитных линий

**Жизненный цикл сделки на рынке МБК:**

Согласование экономических параметров: телефон, Thomson Reuters, индикативные системы

Заключение сделки: телефон, Thomson Reuters, индикативные системы

Выгрузка данных сделки во внутреннюю систему банка

Подтверждение заключенной сделки в SWIFT или иным методом (согласно генеральному соглашению)

# Электронный терминал для рынка МБК



## Электронный терминал PRICE

Междилерский терминал Голосового брокера Премекс для заключения сделок на рынке МБК  
Объединяет преимущества существующих систем рынка МБК, упрощает процесс подтверждения сделок  
Функционирует на базе платформы Информационной системы RTS Board

## Электронный терминал PRICE позволяет:

Получать рыночные данные по рынку МБК

Проводить переговоры между пользователями системы

Выставлять лимиты на контрагентов

Заключать сделки МБК в адресном и безадресном режимах

Подтверждать сделки в форме электронных договоров и выгружать в учетные системы банков

# Доступные инструменты рынка МБК



В электронной платформе клиенты могут заключать кредитные сделки в валютах:

- **RUB, USD, EUR**

Доступные сроки инструментов:

- в режиме акцепта котировок (в стакане и доске котировок, с контролем взаимных лимитов):
  - **Overnight**
  - **Tom/next**
- в режиме переговоров (из стакана и доски котировок) - стандартные сроки:
  - **1W, 2W**
  - **1M, 2M, 3M, 6M**
- адресные котировки (в доске котировок) - сделки **в любой валюте** на любой **произвольный срок**

Drag a column header here to group by that column

Id	Loan Term Id	Loan Term Ru
EUR_1M	1M	Один месяц
EUR_1W	1W	Одна неделя
EUR_2M	2M	Два месяца
EUR_2W	2W	Две недели
EUR_3M	3M	Три месяца
EUR_6M	6M	Шесть месяцев
EUR_ON	ON	Овернайт
EUR_TN	TN	Том некст
FT_LOAN	FT	Свободный период
▶ RUB_1M	1M	Один месяц
RUB_1W	1W	Одна неделя
RUB_2M	2M	Два месяца
RUB_2W	2W	Две недели
RUB_3M	3M	Три месяца
RUB_6M	6M	Шесть месяцев
RUB_ON	ON	Овернайт
RUB_TN	TN	Том некст
USD_1M	1M	Один месяц
USD_1W	1W	Одна неделя
USD_2M	2M	Два месяца
USD_2W	2W	Две недели
USD_3M	3M	Три месяца
USD_6M	6M	Шесть месяцев
USD_ON	ON	Овернайт

# Доступные инструменты рынка МБК



Инструменты МБК - OTC Terminal

Торговля Мидлл Подключение Службное Помощь

Котировки Заявки Рыночные сделки Заявки Сделки Свои котировки Свои сделки Создать Инструменты Участники Введите код

Рынок Переговор... Собственные Таблицы Котировка

### Инструменты МБК

Drag a column header here to group by that column

Id	Loan Term Id	Name En	Name Ru	Class Id	Product Type Id	Is Active	Loan Term En	Loan Term Ru
EUR_6M	6M	Interbank loan in EUR, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	<input checked="" type="checkbox"/>	Six months	Шесть месяцев
EUR_ON	ON	Interbank loan in EUR, ...	Межбанковский кред...	OvernightLoans	MoneyMarket:Overnig...	<input checked="" type="checkbox"/>	Overnight	Овернайт
EUR_TN	TN	Interbank loan in EUR, ...	Межбанковский кред...	OvernightLoans	MoneyMarket:Overnig...	<input checked="" type="checkbox"/>	Tom next	Том некст
FT_LOAD	FT	Flexible Terms Loans	Кредит с гибкими усл...	FlexibleTermsLoans	MoneyMarket:FlexibleT...	<input checked="" type="checkbox"/>	Free term	Свободный период
▶ RUB_1M	1M	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	<input checked="" type="checkbox"/>	One month	Один месяц
RUB_1W	1W	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	<input checked="" type="checkbox"/>	One week	Одна неделя
RUB_2M	2M	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	<input checked="" type="checkbox"/>	Two months	Два месяца
RUB_2W	2W	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	<input checked="" type="checkbox"/>	Two weeks	Две недели
RUB_3M	3M	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	<input checked="" type="checkbox"/>	Three months	Три месяца
RUB_6M	6M	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	<input checked="" type="checkbox"/>	Six months	Шесть месяцев
RUB_ON	ON	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	OvernightLoans	MoneyMarket:Overnig...	<input checked="" type="checkbox"/>	Overnight	Овернайт
RUB_TN	TN	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	OvernightLoans	MoneyMarket:Overnig...	<input checked="" type="checkbox"/>	Tom next	Том некст
USD_1M	1M	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	<input checked="" type="checkbox"/>	One month	Один месяц
USD_1W	1W	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	<input checked="" type="checkbox"/>	One week	Одна неделя
USD_2M	2M	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	<input checked="" type="checkbox"/>	Two months	Два месяца
USD_2W	2W	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	<input checked="" type="checkbox"/>	Two weeks	Две недели
USD_3M	3M	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	<input checked="" type="checkbox"/>	Three months	Три месяца
USD_6M	6M	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	<input checked="" type="checkbox"/>	Six months	Шесть месяцев
USD_ON	ON	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	OvernightLoans	MoneyMarket:Overnig...	<input checked="" type="checkbox"/>	Overnight	Овернайт
USD_TN	TN	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	OvernightLoans	MoneyMarket:Overnig...	<input checked="" type="checkbox"/>	Tom next	Том некст

# Функционал электронной платформы



Мульти-платформенное решение: **desktop**- и **web**-приложения

Система сквозной обработки:

- **Котировально-переговорный** модуль
- Бэк-офисный модуль для сверки и **оформления электронных договоров**

Котировально-переговорный модуль включает функционал:

- **Чат** между участниками системы
- Просмотр и подача **котировок**: стакан, котировальная доска, режим переговоров
- Заведение и корректировка **лимитов**
- Заключение **сделок**
- Формирование **тикета** сделки
- Система **алертов**
- **Логирование** операций

# Функционал: десктоп-версия терминала



Участники - OTC Terminal

Торговля Мидлл Подключение Службное Помощь

Котировки Заявки Рыночные сделки

Заявки Сделки

Свои котировки Свои сделки Создать

Инструменты Введите код

Участники Таблицы Котировка

Участники

Drag a column header here to group by that column									
Id	Full Na...	Full Na...	Country	Phone	Email	Organi...	Jurisdic...	Legal A...	Postal A...
ABSBM	Акцио...	Absolu...	RU	+7 (49...	cb@ab...	Other	RU	12705...	127051...
ABSIM	Закры...	ABSOL...	RU	+7 (49...	abs@a...	Other	RU	12725...	127254...
ALFCM	ОТКРЫ...	ALFA-B...	RU	+7 (49...	mail@a...	Other	RU	10707...	107078...
ALORM	Закры...	ALOR I...	RU	+7 (49...	info@a...	Other	RU	11516...	115162...
ALPLM	Общес...	ALOR ...	RU	+7 (49...	info@a...	Other	RU	11516...	115162...
ATLMM	Общес...	United	RU	+7 (49...	stan...	Other	RU	115025...	115025...

Инструменты МБК

Drag a column header here to group by that column									
Id	Loan Ter...	Name En	Name Ru	Class Id	Product ...	Is Active	Loan Ter...	Loan Ter...	
EUR_3M	3M	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Three m...	Три месяца	
EUR_6M	6M	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Six months	Шесть ме...	
EUR_ON	ON	Interban...	Межбан...	Overnig...	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Overnight	Овернайт	
EUR_TN	TN	Interban...	Межбан...	Overnig...	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Tom next	Том некст	
FT_LOAN	FT	Flexible ...	Кредит ...	FlexibleT...	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Free term	Свободн...	
RUB_1M	1M	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	One month	Один месяц	
RUB_1W	1W	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	One week	Одна не...	
RUB_2M	2M	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Two mon...	Два месяца	
RUB_2W	2W	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Two weeks	Две недели	
RUB_3M	3M	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Three m...	Три месяца	
RUB_6M	6M	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Six months	Шесть ме...	
RUB_ON	ON	Interban...	Межбан...	Overnig...	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Overnight	Овернайт	
RUB_TN	TN	Interban...	Межбан...	Overnig...	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Tom next	Том некст	
USD_1M	1M	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	One month	Один месяц	
USD_1W	1W	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	One week	Одна не...	
USD_2M	2M	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Two mon...	Два месяца	
USD_2W	2W	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Two weeks	Две недели	
USD_3M	3M	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Three m...	Три месяца	
USD_6M	6M	Interban...	Межбан...	TermLoans	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Six months	Шесть ме...	
USD_ON	ON	Interban...	Межбан...	Overnig...	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Overnight	Овернайт	
USD_TN	TN	Interban...	Межбан...	Overnig...	MoneyM...	<input checked="" type="checkbox"/>	Tom next	Том некст	

Заявка Исполнение

Параметры

Дата/время: 09.09.2015 15:50:51

Контрагент: [ ] [ ]

Сумма: [ ] Валюта: RUB

Ставка: [-10 -1 -1 :01] [+01 +1 +1 +10]

Период (дн): [ 1 ]

Borrow  Lend

Комментарий: [ ]

# Функционал: web-версия терминала



Торговля ▾ Миддл ▾ Настройки ▾ Документация ▾ Нужна помощь? — Звоните: +7 (495) 733-9523

P5\_trader1 OTC000000005 77 русский ▾ Выйти

Доска котировок × Собственные котировки / сделки × Книги × Лимиты × Доска и книги ×

### USD\_ON последние сделки — 1 / 2.4% / 7 сент. 2015 г.

Привлечение		Размещение		
Сторона	Объем, млн.	Цена	Объем, млн.	Сторона
OTCTESTAM2	2	2		
OTCTESTAM2	1	2.4		
	2	2		OTCTESTAM2
	2	1		OTCTESTAM2

### RUB\_ON последние сделки — 1000000 / 2% / 7 сент. 2015 г.

Привлечение		Размещение		
Сторона	Объем, млн.	Цена	Объем, млн.	Сторона
OTCTESTAM2	2	2		
OTCTESTAM2	0.5	3		
	1.75	10		OTC000000006
	2	1		OTCTESTAM2

### Денежный рынок — доска котировок

Фильтр | Кол-во: 21

Участник	Операция	Дата	Валюта	Объем, млн.	Срок	Ставка
OTC000000006	Размещение	2015-09-08 19:29	RUB	10	ON	1.75
OTCTESTAM2	Привлечение	2015-09-08 13:01	RUB	3	1M	2
OTCTESTAM2	Привлечение	2015-09-08 13:01	USD	3	1M	2
OTCTESTAM2	Размещение	2015-09-08 13:01	USD	2	1M	2
OTCTESTAM2	Привлечение	2015-09-08 10:58	RUB	3	1W	1
				5	1W	2
				3	1W	3
				3	1W	3
				5	TN	2
				1	TN	2

### USD\_TN последние сделки — 300000 / 3.5% / 28 авг. 2015 г.

Привлечение		Размещение		
Сторона	Объем, млн.	Цена	Объем, млн.	Сторона
OTCTESTAM2	2	1		
OTCTESTAM2	2	2		
OTCTESTAM2	2	1		OTCTESTAM2

### RUB\_TN последние сделки — 300000 / 3.5% / 28 авг. 2015 г.

Привлечение		Размещение		
Сторона	Объем, млн.	Цена	Объем, млн.	Сторона
OTCTESTAM2	5	2		
	2	1		OTCTESTAM2

### Создание котировки

Документ История

Код инструмента USD\_ON (Межбанковский кредит в долларах США. Овернайт)

Контрагент Пусто. [Нажмите, чтобы выбрать]

Дата экспирации

Код клиента

Комментарий

Операция  Размещение  Привлечение

Кредит

Идентификатор базового актива

Наименование актива

Срок кредита ON

Сумма кредита #1

Валюта суммы USD

Сумма 0 0 K 1

Ставка кредита

Условие движения денежных средств

Тип расчетов

Идентификатор исходной сделки

Создать и отправить Создать Закрыть

10 25 50 100

НП РТС © 2015

↑ RUB\_1W ↑ RUB\_1W ↑ USD\_1M ↑ USD\_1M ↑ RUB\_1M ↑ EUR\_ON ↑ EUR\_ON

07

Система электронного подтверждения договоров на рынке МБК  
Октябрь 2015, Москва



# Ведение переговоров и запросы котировок



RUB_ON 500000 / 11.44% /				
RUB_ON Межбанковски				
Привлечение		Размещение		
Сторона	Объем, млн.	Цена	Объем, млн.	Сторона
OTCTESTAM2	5	11.01		
OTCTESTAM1	5	11.04		
		11.24	1	
		11.27	5	OTCTESTAM
		11.29	1	OTCTESTAM

RUB_1W 5000 / 2% / 15 се				
RUB_1W Межбанковски				
Привлечение		Размещение		
Сторона	Объем, млн.	Цена	Объем, млн.	Сторона
OTCTESTAM2	5	11.1		
OTCTESTAM1	10	11.23		
		11.5	5	OTCTESTAM
		11.53	10	OTCTESTAM

RUB_1M				
RUB_1M Межбанковски				
Привлечение		Размещение		
Сторона	Объем, млн.	Цена	Объем, млн.	Сторона
OTCTESTAM2	5	11.36		
OTCTESTAM1	5	11.36		
		11.76	5	OTCTESTAM
		11.8	5	OTCTESTAM
		11.82	10	OTCTESTAM

RUB_2W				
RUB_2W Межбанковски				
Привлечение		Размещение		
Сторона	Объем, млн.	Цена	Объем, млн.	Сторона
OTCTESTAM1	5			
OTCTESTAM2	5			

Денежный рынок — доска котировок						
Кол-во: 22						
Участник	Операция	Дата	Валюта	Объем, млн.	Срок	Ставка
OTCTESTAM3	Размещение	2015-10-06 14:43	RUB	10	ON	11.34
OTCTESTAM2	Привлечение	2015-10-06 14:41	RUB	5	1W	11.1
		2015-10-06 14:41	RUB	5	2W	11.3
		2015-10-06 14:40	RUB	5	1M	11.36
		2015-10-06 14:40	RUB	5	1M	11.8
		2015-10-06 14:39	RUB	5	ON	11.01
		2015-10-06 14:38	RUB	1	ON	11.29
		2015-10-06 14:37	RUB	5	ON	11.31
		2015-10-06 14:35	RUB	10	1W	11.23
		2015-10-06 14:35	RUB	5	2W	11.28

6 окт. 2015 г. 18:57:52  
Уточни OFFER 10 MIO RUB 1M TOM?

6 окт. 2015 г. 18:58:08  
OFFER 10 MIO RUB 1M TOM @ 11,79

6 окт. 2015 г. 18:58:38  
A SPOT?

6 окт. 2015 г. 18:58:58  
OFFER 10 MIO RUB 1M SPT @ 11,77

6 окт. 2015 г. 18:59:11  
Есть лучше OFFER 10 MIO RUB 1M TOM?

6 окт. 2015 г. 18:59:44  
Mory OFFER 10 MIO RUB 1M TOM @ 11,78

6 окт. 2015 г. 18:59:51  
OK



При заключении дилером сделки в котировально-переговорном модуле тикет автоматически передается в бэк-офисный модуль платформы

Функционал бэк-офисного модуля включает:

- Ведение **справочника контрагентов**
- Формирование и редактирование расчетных схем (**платежных инструкций**)
- Сверка **черновиков** договоров
- **Подписание ЭП** договоров (с последующим заверением ЭП НП РТС)

**Экспорт данных:** возможность выгрузки подтверждений в формате xml (Рамочное соглашение НП РТС), а также в форматах других систем: SWIFT (MT320 Fixed Loan/Deposit Confirmation), др. (дополнение конвертеров по запросу клиентов)

**Интеграция:** многофункциональный API платформы позволяет клиентам настраивать автоматизированное взаимодействие АБС клиентов с фронт- и бэк-офисными модулями платформы для передачи данных в учетные системы банка



# Торговое соглашение на денежном рынке



## Ключевые характеристики:

- Стандартная документация, разрабатываемая совместно с участниками денежного рынка
- Дополнение двусторонних генеральных соглашений
- Стандартная форма подтверждения сделок в электронном и печатном форматах

# Преимущества интегрированной платформы для рынка МБК



## 1. **Скорость** принятия торгового решения

- Получение доступа к on-line котировкам и архиву рыночных данных
- On-line чат с участниками рынка, ведение адресных переговоров с «владельцами» конкретных котировок
- Мониторинг статуса совершенных транзакций
- Гибкий выбор из числа котируемых в системе инструментов

## 2. **Простота** процедур совершения и подтверждения сделки

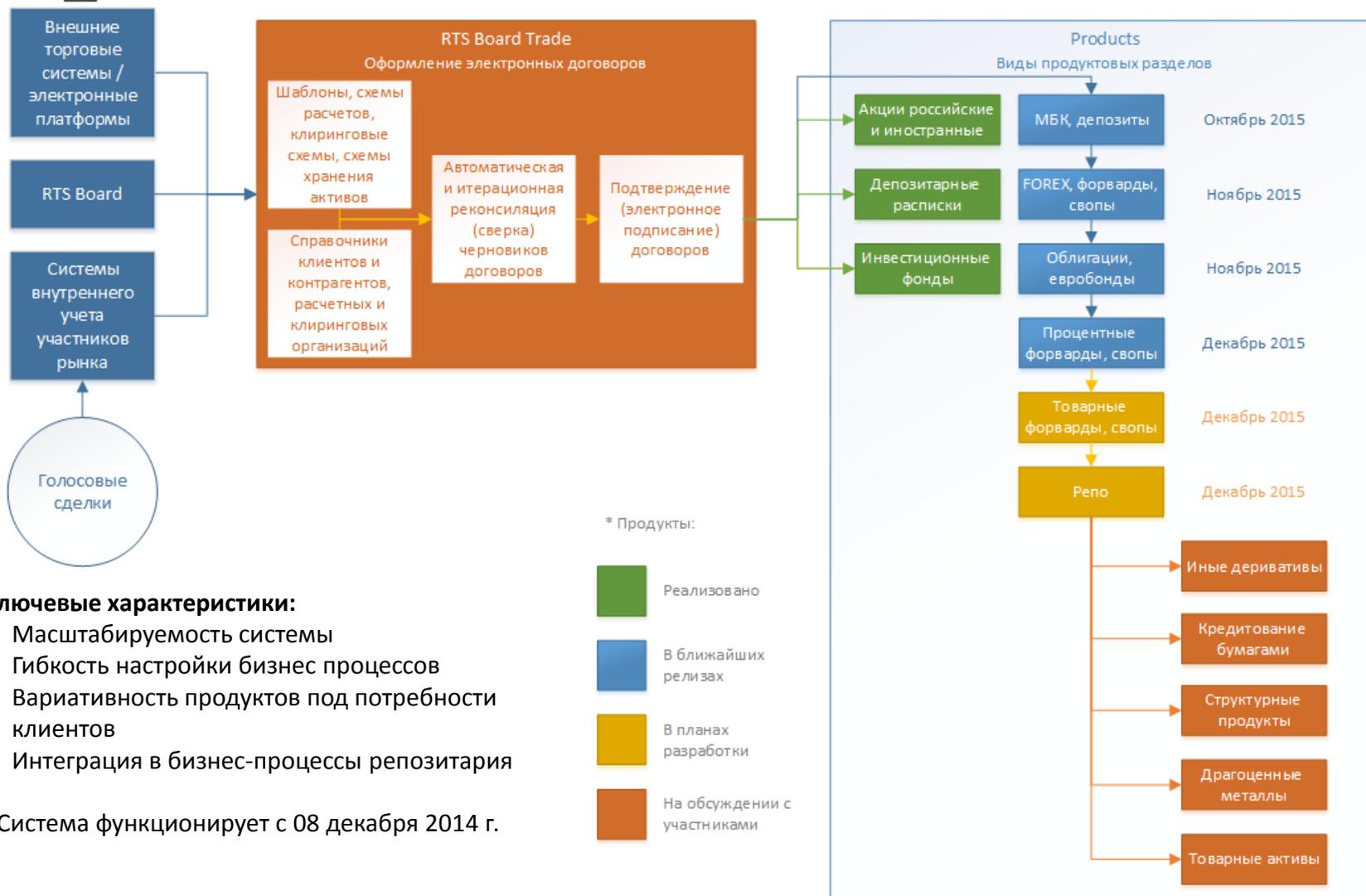
- Взаимные лимиты, корректируемые по результатам транзакций
- Заключение и подтверждение сделок в одной системе
- Подтверждение электронных договоров ЭП в соответствии с российским законодательством

## 3. **Удобство** работы

- Русскоязычный интерфейс
- Настраиваемый состав вкладок и окон терминала

## 4. **Автоматизация** работы за счет интеграции платформы с автоматизированными банковскими системами

# Расширение перечня типов договоров для электронного подтверждения



## Ключевые характеристики:

- Масштабируемость системы
- Гибкость настройки бизнес процессов
- Вариативность продуктов под потребности клиентов
- Интеграция в бизнес-процессы репозитария

! Система функционирует с 08 декабря 2014 г.



# Спасибо за внимание!

## Контакты:

### НП РТС

Москва, ул. Долгоруковская, 38, стр. 1

Телефон: +7 (495) 705 90 31

E-mail: [otcmarket@rts.ru](mailto:otcmarket@rts.ru)

Сайт: [www.nprts.ru](http://www.nprts.ru)

### ООО «Премекс»

Москва, Хорошевское шоссе, д. 32А

Телефон: +7 (495) 974 35 51

E-mail: [babaev@premex.su](mailto:babaev@premex.su)

Сайт: [www.premex.su](http://www.premex.su)

