

РОЛЬФ

ВЕДУЩИЙ ДИЛЕРСКИЙ ХОЛДИНГ РОССИИ



Размещение свободной ликвидности

Капускин Алексей

Руководитель группы управления казначейскими продуктами
Департамент казначейства и управления рисками

1. Риск-менеджмент

2. Программа для размещения

3. Эффективность

40 банков-контрагентов

10 активных банков для размещения

Данные оборотной ведомости по счетам бухгалтерского учёта (101 ф.)

Расчёт собственных средств (капитала) («Базель III») (123 ф.)

Информация об обязательных нормативах
и о других показателях деятельности кредитной организации (135 ф.)

Отчёт о финансовых результатах (102 ф.)

Ежемесячно изучаем отчетность и меняем лимитную ведомость

№	Отчетность на: 01.09.2020 Название банка	Лимиты на: октябрь 2020			ОБ	ТЛ	БГ Капитал	Суборд Капитал	КП Просрочка	ПКЛ
		о/н	до 30 дн.	БГ						
5	ТОР-20	открыт	открыт	на 3 мес.	1,28	83,88	0,49	10,16	4,92	123,25
6	ТОР-20	открыт	открыт	открыт	1,36	111,47	0,71	-	11,87	114,87
7	ТОР-20	закрыт	закрыт	закрыт	1,91	75,34	0,88	33,91	2,12	75,14
9	ТОР-20	открыт	открыт	открыт	1,38	214,21	1,01	-	2,81	137,32
10	ТОР-20	открыт	закрыт	закрыт	1,25	83,40	1,04	9,44	1,90	151,17
11	ТОР-20	открыт	открыт	закрыт	1,38	99,38	1,22	13,18	3,10	140,26
12	ТОР-20	открыт	закрыт	закрыт	1,77	54,29	0,82	13,85	9,57	49,78
13	ТОР-20	открыт	закрыт	закрыт	1,62	79,46	0,91	17,20	4,62	61,78
14	ТОР-20	открыт	открыт	открыт	1,42	77,45	0,65	1,34	0,29	115,66
15	ТОР-20	открыт	открыт	открыт	1,47	147,28	0,97	0,17	10,81	122,49
16	ТОР-20	закрыт	закрыт	закрыт	1,23	109,35	-	-	8,43	204,40
17	ТОР-30	открыт	открыт	открыт	2,49	126,79	2,63	-	49,44	70,89
18	ТОР-30	открыт	открыт	открыт	1,51	93,85	0,26	-	16,09	74,92
19	ТОР-30	закрыт	закрыт	закрыт	2,04	95,47	0,07	78,67	48,68	50,52
20	ТОР-30	закрыт	закрыт	закрыт	1,58	164,08	0,66	-	15,34	195,46
21	ТОР-30	открыт	закрыт	закрыт	1,55	99,13	2,02	22,70	6,81	106,42
22	ТОР-30	открыт	закрыт	закрыт	1,72	96,03	0,32	33,08	6,50	168,25
23	ТОР-30	открыт	открыт	закрыт	1,49	107,59	0,60	18,96	9,45	161,65
24	ТОР-30	открыт	открыт	открыт	1,42	102,34	0,52	13,06	8,70	99,97

По итогам анализа определяется максимальный срок размещения

РОЛЬФ

КОРП-ДЕПО (программа для котирования)

+ Создать заявку

Лимит на размещение

000 000

Очередь заявок

ON

Все

Привлечение

Свои заявки

Доступно

Все заявки

Объем	Ставка ↓	Срок	Участник	Инфо	
000 000 Р	4.15 %	ON			• ↕
000 000 Р	4.00 %	ON			• ↕
000 000 Р	4.00 %	ON			• ↕
000 000 Р	3.90 %	ON			•
000 000 Р	3.80 %	ON			• ↕
000 000 Р	3.10 %	ON			• ↕

Размещение

Свои заявки

Доступно

Все заявки

Объем	Ставка ↑	Срок	Участник	Инфо	
000 000 Р	RFQ	ON	ROLF		🗑

Журнал заявок

☐ Сегодня

Исполненные

Все

Код	Участник	Срок	Объем	Ставка	Дата ↓	Статус	Отчет
Q		ON	000 000 Р	4. %	.20	Исполнена	📄
5		ON	000 000 Р	4. %	.20	Исполнена	📄

Участники

Код ↑	
A	
A	

Заявка на размещение

Сумма

000 000 Р

Ставка

RFQ

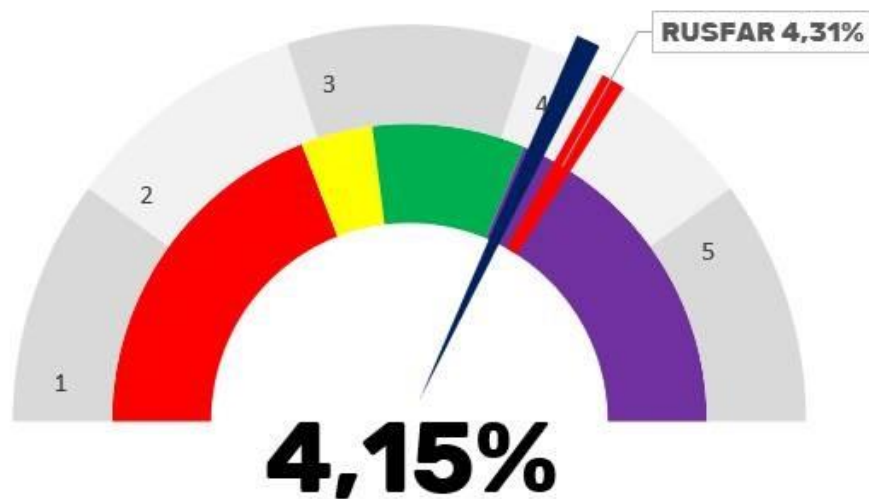
РЕДАКТИРОВАТЬ

Дата	Статус	Операция	Срок
12.11.20	Активная	Размещение	ON
Время снятия заявки	Участник	Код участника	Код заявки
12.11.20, 19:00	000 "РОЛЬФ"	ROLF	
Видимость	Видимая всем		

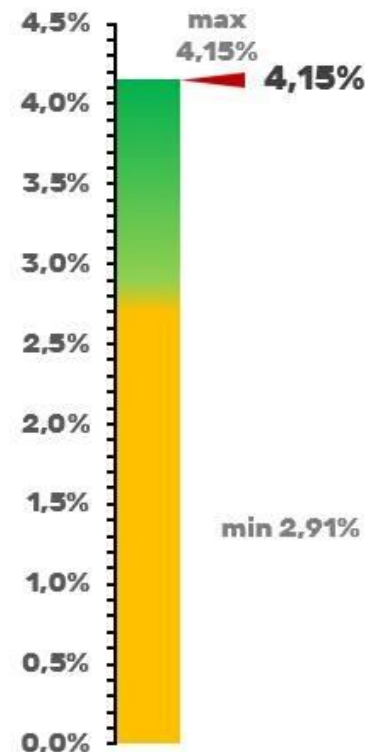
КОРП-ДЕПО

АНАЛИТИКА

Эффективность размещения



Рейтинг
КОРП-ДЕПО



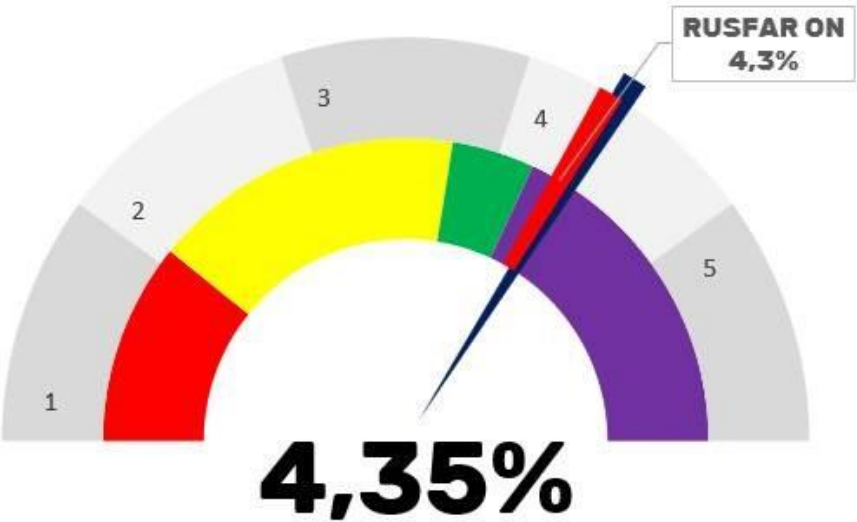
Журнал размещений

дата	срок	объём	ставка	комиссия
11.11.2020	ON	000 000	4,15%	0,00%

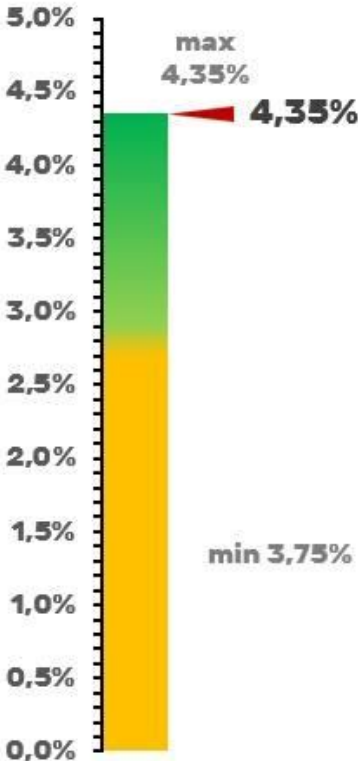
КОРП-ДЕПО

АНАЛИТИКА

Эффективность размещения



Рейтинг
КОРП-ДЕПО



Журнал размещений

дата	срок	объём	ставка	комиссия
14.10.2020	ON	000 000	4,35%	0,00%