Декабрь 2015

Система электронного подтверждения договоров на денежном рынке

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

Рынок МБК: предпосылки для новой платформы

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)

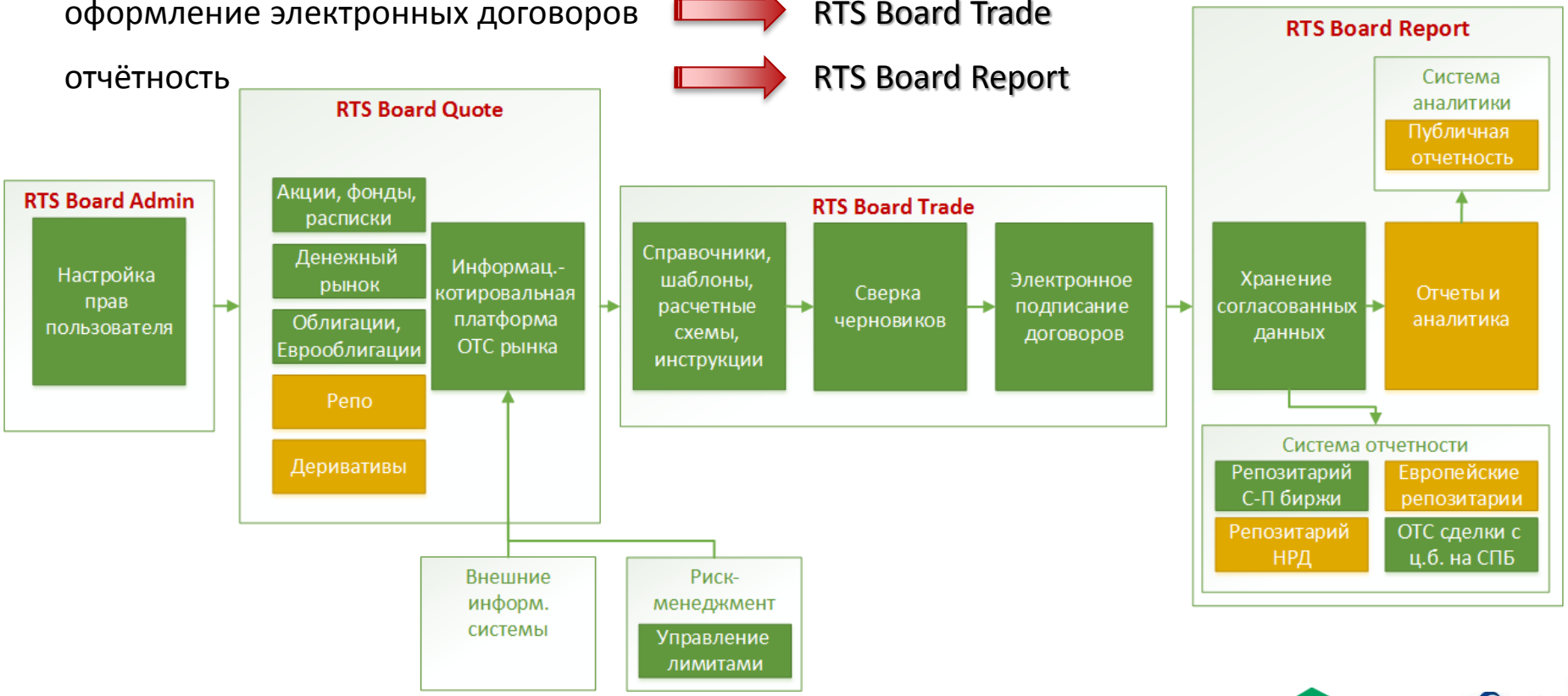
Электронная система RTS Board

настройка прав → RTS Board Admin

информация и котировки → RTS Board Quote

оформление электронных договоров → RTS Board Trade

отчётность → RTS Board Report



Единая архитектура – разные рынки – гибкость развития – свобода сотрудничества

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

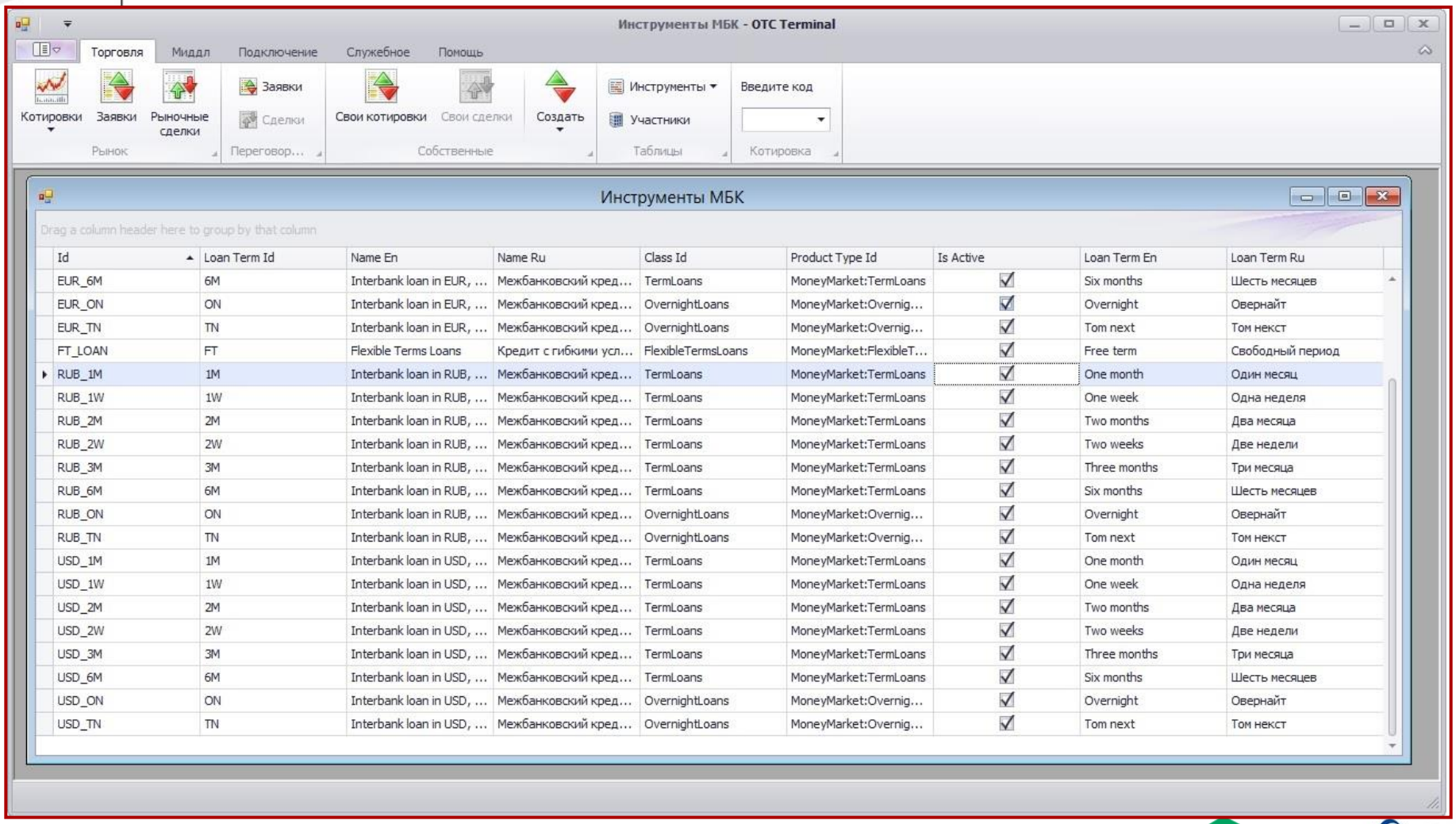
Доступные сроки инструментов:

- 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



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	☑	Six months	Шесть месяцев
EUR_ON	ON	Interbank loan in EUR, ...	Межбанковский кред...	OvernightLoans	MoneyMarket:Overnig...	☑	Overnight	Овернайт
EUR_TN	TN	Interbank loan in EUR, ...	Межбанковский кред...	OvernightLoans	MoneyMarket:Overnig...	☑	Tom next	Том некст
FT_LOAN	FT	Flexible Terms Loans	Кредит с гибкими усл...	FlexibleTermsLoans	MoneyMarket:FlexibleT...	☑	Free term	Свободный период
RUB_1M	1M	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	☑	One month	Один месяц
RUB_1W	1W	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	☑	One week	Одна неделя
RUB_2M	2M	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	☑	Two months	Два месяца
RUB_2W	2W	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	☑	Two weeks	Две недели
RUB_3M	3M	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	☑	Three months	Три месяца
RUB_6M	6M	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	☑	Six months	Шесть месяцев
RUB_ON	ON	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	OvernightLoans	MoneyMarket:Overnig...	☑	Overnight	Овернайт
RUB_TN	TN	Interbank loan in RUB, ...	Межбанковский кред...	OvernightLoans	MoneyMarket:Overnig...	☑	Tom next	Том некст
USD_1M	1M	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	☑	One month	Один месяц
USD_1W	1W	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	☑	One week	Одна неделя
USD_2M	2M	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	☑	Two months	Два месяца
USD_2W	2W	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	☑	Two weeks	Две недели
USD_3M	3M	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	☑	Three months	Три месяца
USD_6M	6M	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	TermLoans	MoneyMarket:TermLoans	☑	Six months	Шесть месяцев
USD_ON	ON	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	OvernightLoans	MoneyMarket:Overnig...	☑	Overnight	Овернайт
USD_TN	TN	Interbank loan in USD, ...	Межбанковский кред...	OvernightLoans	MoneyMarket:Overnig...	☑	Tom next	Том некст

Функционал электронной платформы

Мульти-платформенное решение: desktop- и web-приложения

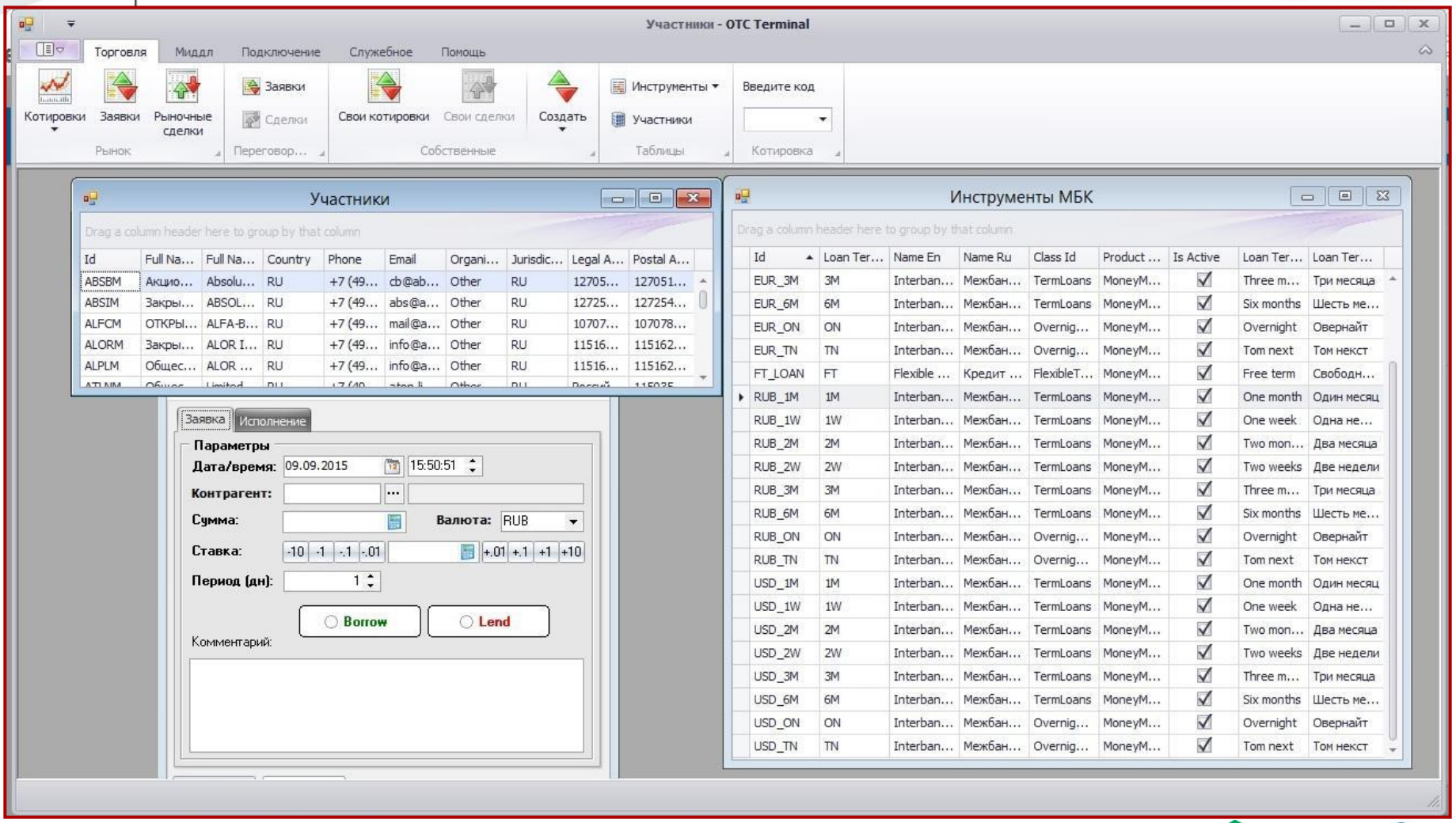
Система сквозной обработки:

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

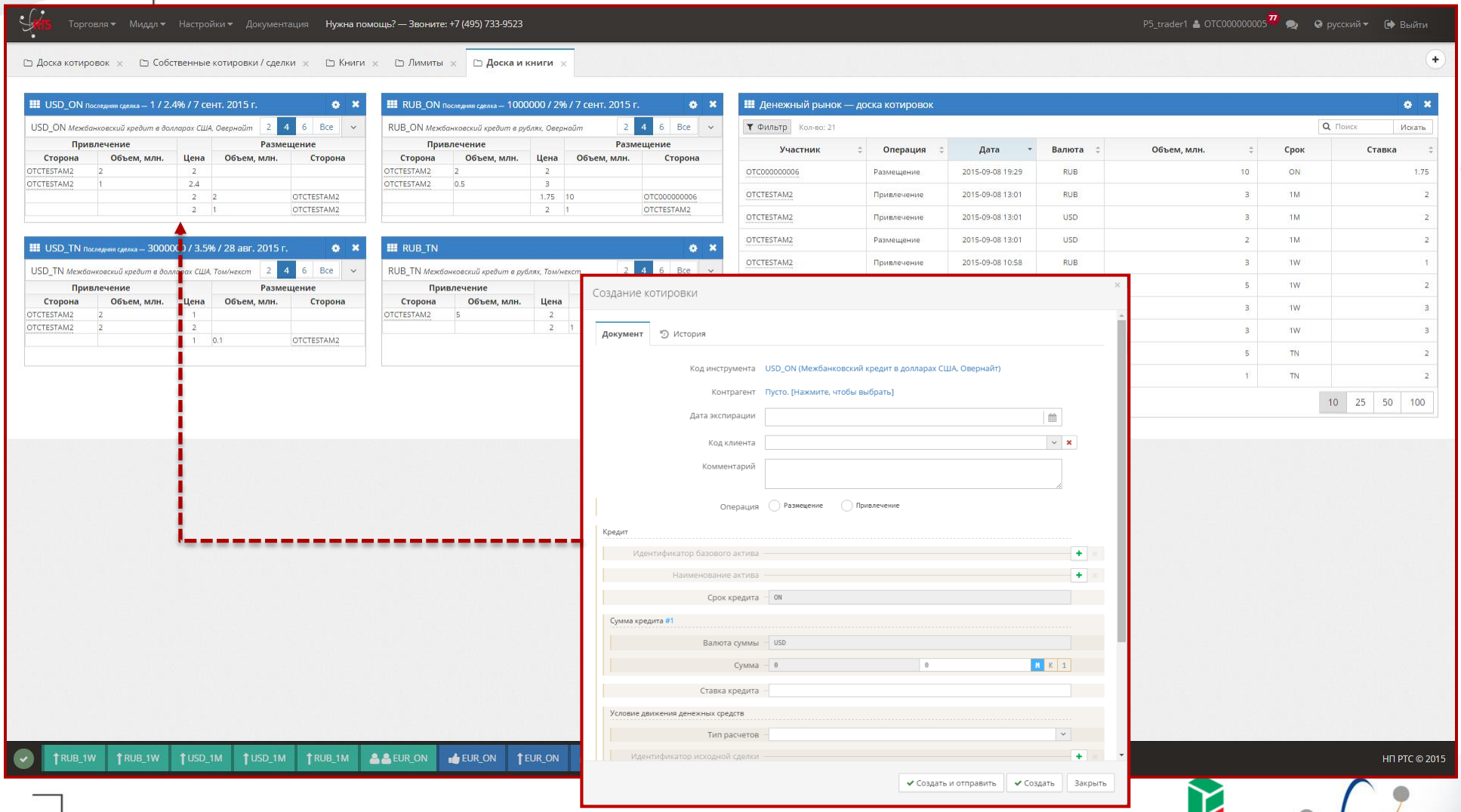
Котировально-переговорный модуль включает функционал:

- 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: desktop-версия терминала



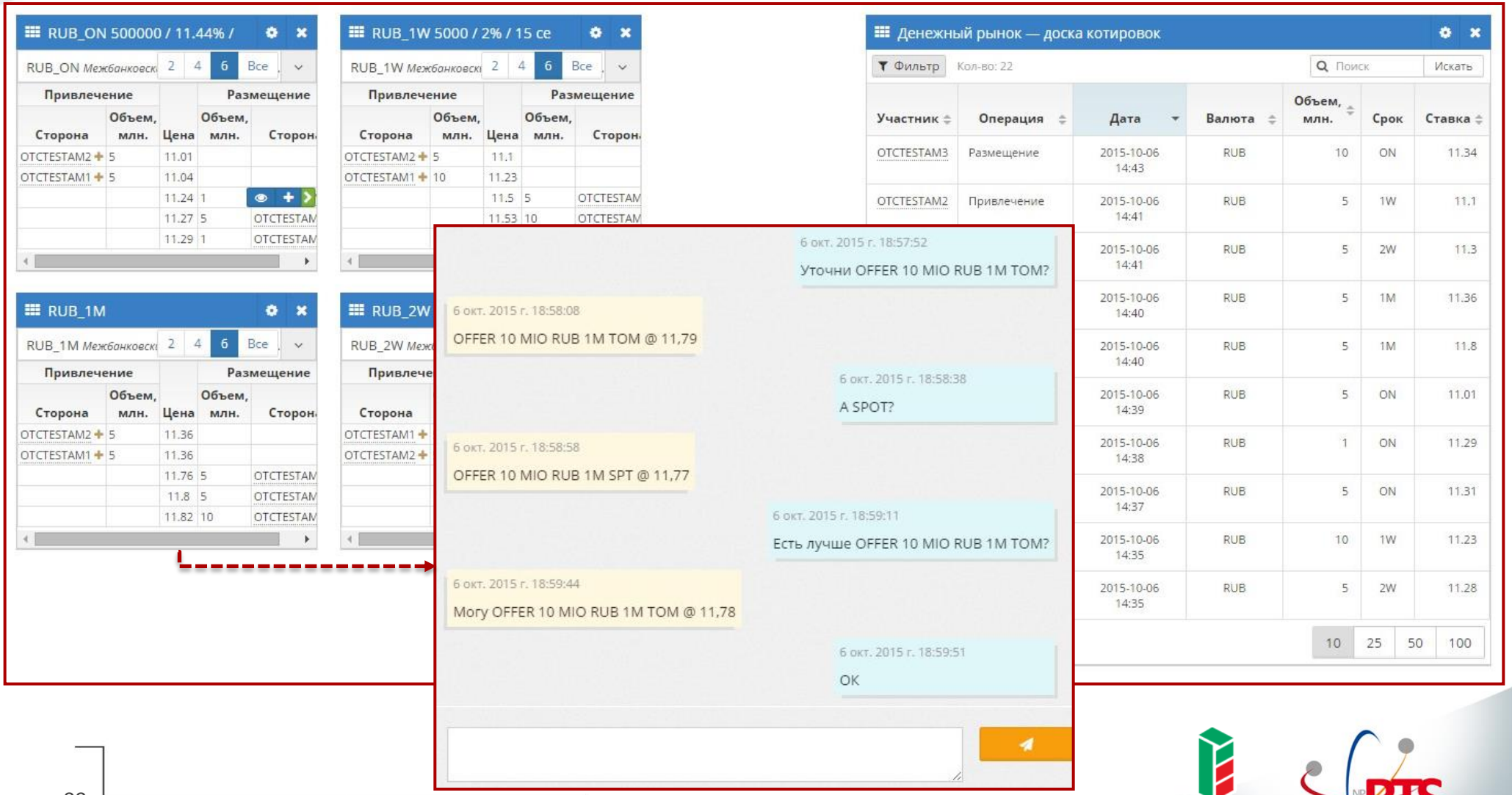
Функционал: web-версия терминала



Система электронного подтверждения договоров на денежном рынке

Декабрь 2015

Ведение переговоров и запросы котировок



Электронное подтверждение ОТС договоров

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

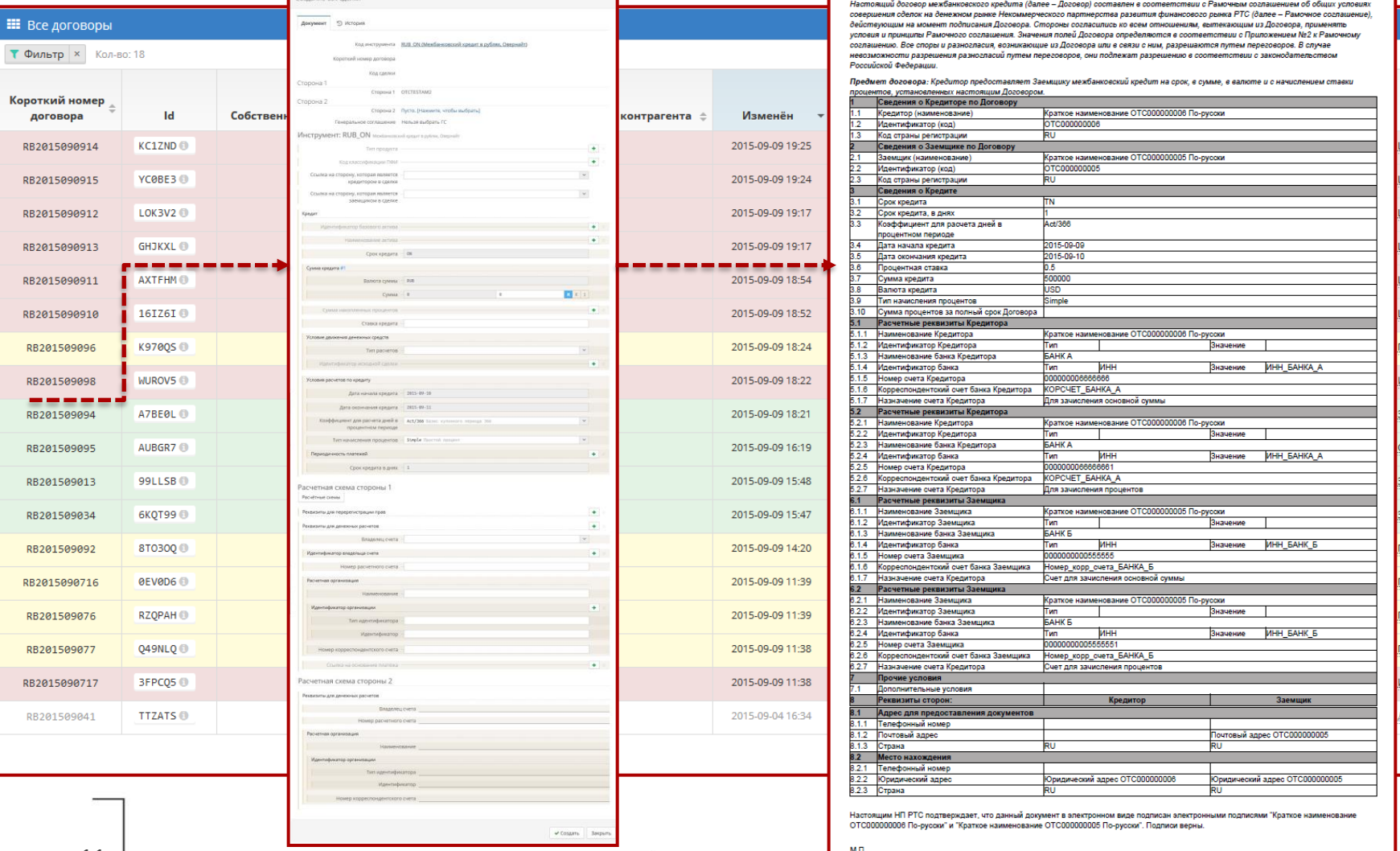
Функционал бэк-офисного модуля включает:

- 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

Электронные договоры и печатные копии



Система электронного подтверждения договоров на денежном рынке

Декабрь 2015

Торговое соглашение на денежном рынке

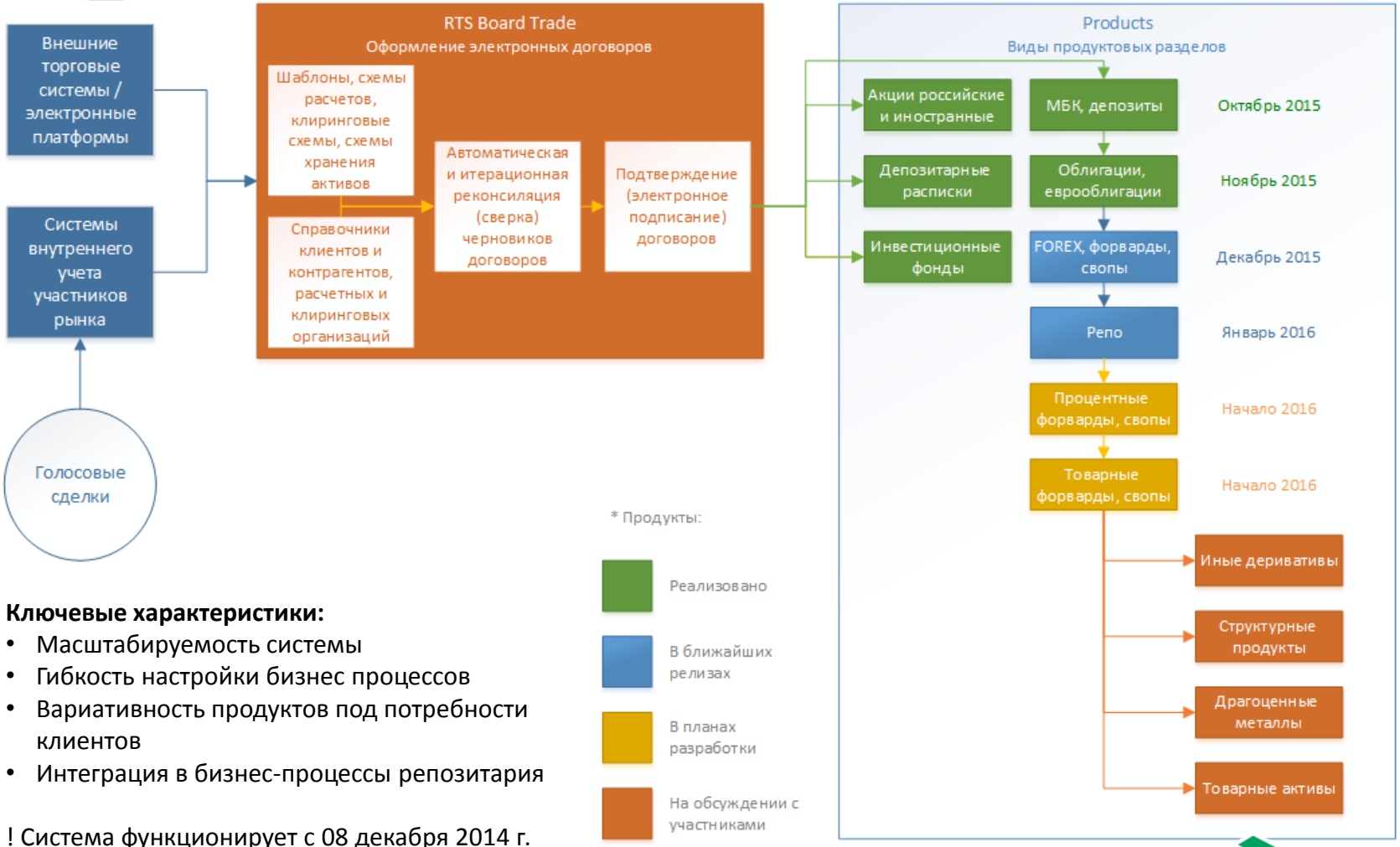
Ключевые характеристики:

- 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
Сайт: www.nprts.ru

ООО «Премекс»
Москва, Хорошевское шоссе, д. 32А
Телефон: +7 (495) 974 35 51
E-mail: babaev@premex.su
Сайт: www.premex.su