

R U T E R M I N A L

ООО «СофтВел». Август 2023



# ONLINE ПОЗИЦИИ КАЗНАЧЕЙСТВА

# Насколько удобна сложившаяся практика мониторинга позиций казначейства?

---

В настоящее время трейдерам приходится использовать сразу несколько систем для отслеживания интересующих позиций.

В связи с этим возникает ряд недостатков

01

**Расфокусировка внимания,**

которая приводит к дополнительному напряжению и трате сил трейдера

02

**Неудобство при расчете интересующих показателей,**

которое связано с необходимостью **вручную** сводить данные из нескольких систем

03

**Потеря времени**

из-за отсутствия автоматизации рутинных процессов

04

**Возникновение ошибок**

из-за человеческого фактора

# Онлайн позиции в RuTerminal – повышают скорость и эффективность работы трейдера

## Удобный мониторинг информации

Отслеживайте данные о позиции казначейства и текущих котировках, собранные в единый отчет

## Торговые позиции по Вашим книгам

Загружайте в RuTerminal данные из любых торговых книг. И на их основании система автоматически рассчитает все нужные показатели с учетом значения котировок на данный момент

## Доступная система администрирования данными

Скачивайте все полученные отчеты, которые будут содержать и сделки, загруженные из системы казначейства, и заключенные в RuTerminal



# RuTerminal рассчитывает торговые позиции по вашим книгам

## 01. Валютные позиции (Fx Positon Pairs, Fx Position Scies):

- ОВП с онлайн переоценкой
- Расчет стоимости ПФИ
- Расчет NPV в валютах и парах

Pair	NPV 1	Rate	PL USD	Bid	Ask	NPV 2	Amount 1	Amount 2
KZTRUB	1 520 000	9.16000	-1 819	0	0	-139 235	1 520 000	-247 760
EURCNY	-5 987	7.87992	373	7.4488	7.4513	47 179	-6 000	47 179.2
EURUSD	52 497	2.58493	-78 854	1.0829	1.0829	-135 700	68 600	-135 700.05
EURRUB	914 644	1 154.91266	-12 812 445	82.8850	82.9100	-1 056 334 159	1 948 976.54	-1 305 472 998.59
USDCNY	-2 222	6.97380	30	6.8796	6.8806	15 496	-2 222	15 495.78
EURCHF	10 459	0.98924	11 326	0.9934	0.9941	-10 347	10 501	-10 346.51
			-12 881 389					

Date	Product	NPV 1	Rate	PL USD	NPV 2	DF 1	DF 2	
30.03.2023				-3 000	60.98329	-859	-3 000	0.99987
31.03.2023				-4 499	60.97494	-1 290	-4 499	0.9998
03.04.2023				-7 497	60.94991	-2 151	-7 497	0.9996
04.04.2023				-1 499	60.94158	-430	-1 499	0.99953
05.04.2023				-28 019 450	60.93324	-8 046 882	-28 019 450	0.99946

RuTerminal рассчитывает торговые позиции по вашим книгам

## 02. Денежные позиции (*Treasury.Average*):

- ALM gaps
- Cumulative gaps
- Переоценка по кривым рынка
- Чувствительность BPV01
- Ставки теноров
- Доходы теноров

The screenshot shows the RuTerminal interface for the 'Treasury.Average' window. The date is set to 27.03.2023, and the 'By Tradedate' checkbox is checked. The main table displays the following data:

Position	Term	Date 1	Date 2	Amount	Rate	Term	Cn
OVERNIGHT		27.03.2023	28.03.2023	4 153 178 781	6.44009	1	
TOM/NEXT		28.03.2023	29.03.2023	4 153 377 281	6.44116	2	
SPOT/NEXT		29.03.2023	30.03.2023	4 153 377 281	6.44116	3	
1W		28.03.2023	04.04.2023	4 153 375 852	6.44062	8	
2W		04.04.2023	11.04.2023	4 153 325 852	6.44080	15	
3W		11.04.2023	18.04.2023	4 151 230 852	6.43902	22	
1M		18.04.2023	28.04.2023	4 150 801 277	6.43861	32	
2M		28.04.2023	29.05.2023	4 149 736 463	6.43783	63	
3M		29.05.2023	28.06.2023	4 149 837 349	6.43831	93	

Below this table, a detailed view of 'Deposit Fixed' instruments is shown:

Product	End	Counterparty	Interests	Instrument	
Deposit Fixed	020	05.08.2050	Roxyash CHГ	-0.05	RUB
Deposit Fixed	021	13.09.2023	BANK	-110 332.88	RUB
Deposit Fixed	021	13.09.2023	BANK	-110 332.88	RUB
Deposit Fixed	021	13.09.2023	BANK	110 332.88	RUB
Deposit Fixed	021	13.09.2023	BANK	110 332.88	RUB
Deposit Fixed	021	13.09.2023	Morgan Stanley	-80 684.93	RUB
Deposit Fixed	021	13.09.2023	Morgan Stanley	-80 684.93	RUB
Deposit Fixed	021	10.02.2026	ROSEVROBANK	-13.70	RUB
Deposit Fixed	021	18.08.2023	ROSEVROBANK	-156 164.38	RUB
Deposit Fixed	021	18.07.2025	Morgan Stanley	-0.15	RUB

On the right side of the interface, there are filters for Instrument (RUB), Products (Deposit Fixed), Convention (Act/Act (ISDA)), Rate curve (RUB DiscCurve (...)), and Risk factor (Funding, Mio).

Portfolio	ROR	P&L Total	P&L Coupon	BPV	YTM	CY	CY Mod	Dur	Dur Mod	Convxy	Value
Sec.Aggressive	31.502	1 779	245								
Sec.Conservative	6.201	642	730	-12	8.576	6.993	8.807	2.745	2.630	9.945	
Sec.Aggressive.Mod	41.037	2 869	272	-1	8.149	5.711	8.179	0.474	0.456	0.452	
Sec.Conservative.Mod	6.466	671	772	-11	7.375	6.020	7.573	2.454	2.414	11.123	
		5 961	2 018	-23							

Issue	Instrument	ISIN	Maturity	FaceVal	Ccy	ROR Portfolio	Market	Spread	P&L Total	Coupon	YTM
ГазпромКРЗ		RU000A101QM3	27.05.2025	1 000	RUB	4.459	4.459		80	110	9.945
Роснфт1Р4		RU000A0JXQK2	22.04.2027	1 000	RUB	8.088	8.088		125	146	0.09
ВЭБ 1Р-21		RU000A101WF5	21.07.2023	1							
МТС-001Р-21		RU000A104WJ1	22.06.2026	1							
СФО ВТБ РКС-1-01-о6		RU000A1032P1	01.12.2030	1							
Сбербанк-001Р-SBER19		RU000A102CU4	17.11.2023	1							

Step	ROR Step	ROR Cuml	P&L Step	P&L Cuml	Value	Value Chng %
30.12.2022	39.590	39.590	41	41	44 395	0.09
13.01.2023	-22.426	8.286	105	145	44 452	0.13
20.01.2023	-0.031	8.252	67	212	44 291	-0.36
27.01.2023	0.349	8.630	80	292	44 370	0.18
03.02.2023	-1.330	7.186	12	304	44 334	-0.08
10.02.2023	-0.842	6.284	15	318	44 349	0.03
17.02.2023	-0.107	6.170	45	364	44 394	0.10
24.02.2023	0.642	6.851	96	459	44 490	0.21
03.03.2023	-0.377	6.449	27	486	44 474	-0.04
10.03.2023	0.164	6.623	68	554	44 542	0.15
17.03.2023	-0.302	6.301	26	580	44 568	0.06
23.03.2023	-0.251	6.034	19	599	44 586	0.04
27.03.2023	0.408	6.466	73	671	44 491	-0.21

RuTerminal рассчитает торговые позиции по вашим книгам

### 03. Доходность портфеля бумаг (Portfolio ROR):

- RoR
- Profit & Loss
- Dur, YTM, BPV01, CY, Convexity, ...

# RuTerminal прост и удобен в использовании

01

## Гибкое рабочее пространство

Можно настраивать размер и расположение виджетов и полей отчета под себя

02

## Понятный и простой интерфейс

03

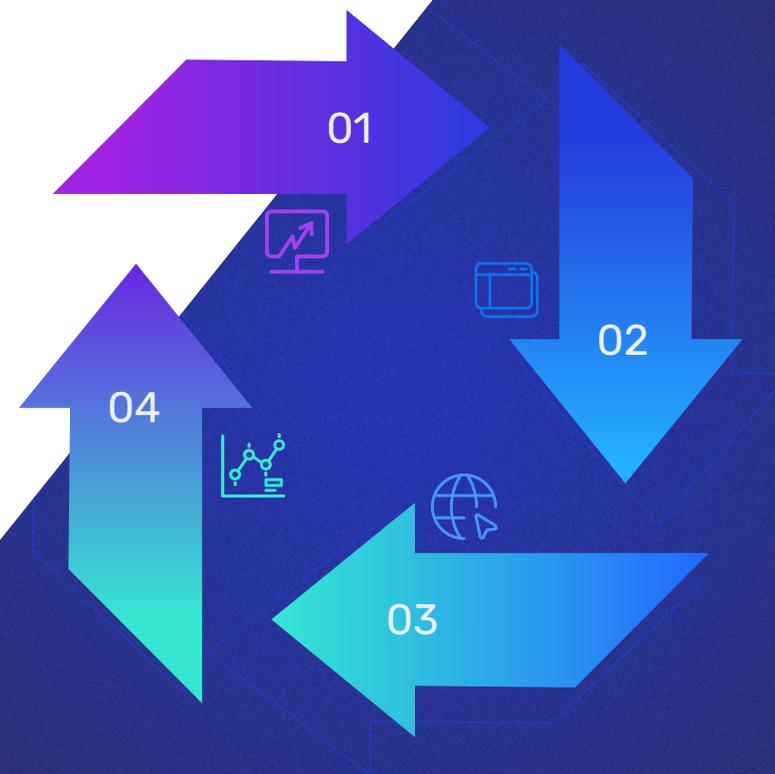
## Тонкий клиент

Для работы в RuTerminal нужен только браузер

04

## Доступная система администрирования данными

Для повышения производительности и эффективности в работе в RuTerminal встроен механизм экспорта и импорта данных, что позволяет объединять информацию из разных систем в единый отчет





## **RuTerminal** заменяет собой все системы трейдера

---

-  Есть все необходимые отчеты по позициям: Fx, Securities, Treasury
-  Отчет содержит как сделки, загруженные из системы казначейства, так и заключенные в RuTerminal
-  В отчете представлены позиции казначейства, рыночные котировки и другие показатели, которые рассчитываются автоматически
-  Котировки и зависящие от них показатели обновляются в реальном времени

# Уже используют RuTerminal

---



и многие другие...



## К О Н Т А К Т Ы

# Карпов Анатолий

Генеральный директор SoftWell

 +7 (495) 960-10-18

 karpov@softwell.ru