

5,062

R U T E R M I N A L

Передача Fx и FxSwap сделок на Клиринг

CPCL

ООО «СофтВел». 2023

RuTerminal расширяет ВОЗМОЖНОСТИ

В RuTerminal реализована передача OTC FX сделок на клиринг в режиме CPCL

Теперь при регистрации сделки по продуктам Fx и FxSwap пользователь сможет отправить сделку на Клиринг



Расширенный список контрагентов без подписания ISDA/RISDA и установки лимита



OTC сделка неттируется и попадает в единую позицию с биржевыми сделками



Гарантия исполнения, централизованный клиринг и расчеты



Отсутствие кредитного и расчетного рисков

Как реализовать передачу сделок Fx и FxSwap на Клиринг?

Для подключения к функционалу передачи сделок на CPCL необходимо выполнить следующие действия:

01

Получение доступа к борду CPCL

Заполнить анкету на подключение к Валютной секции, для передачи сделок на Клиринг.

■ [Подробная инструкция по заполнению анкеты](#)
[\(Приложение 1\)](#)

02

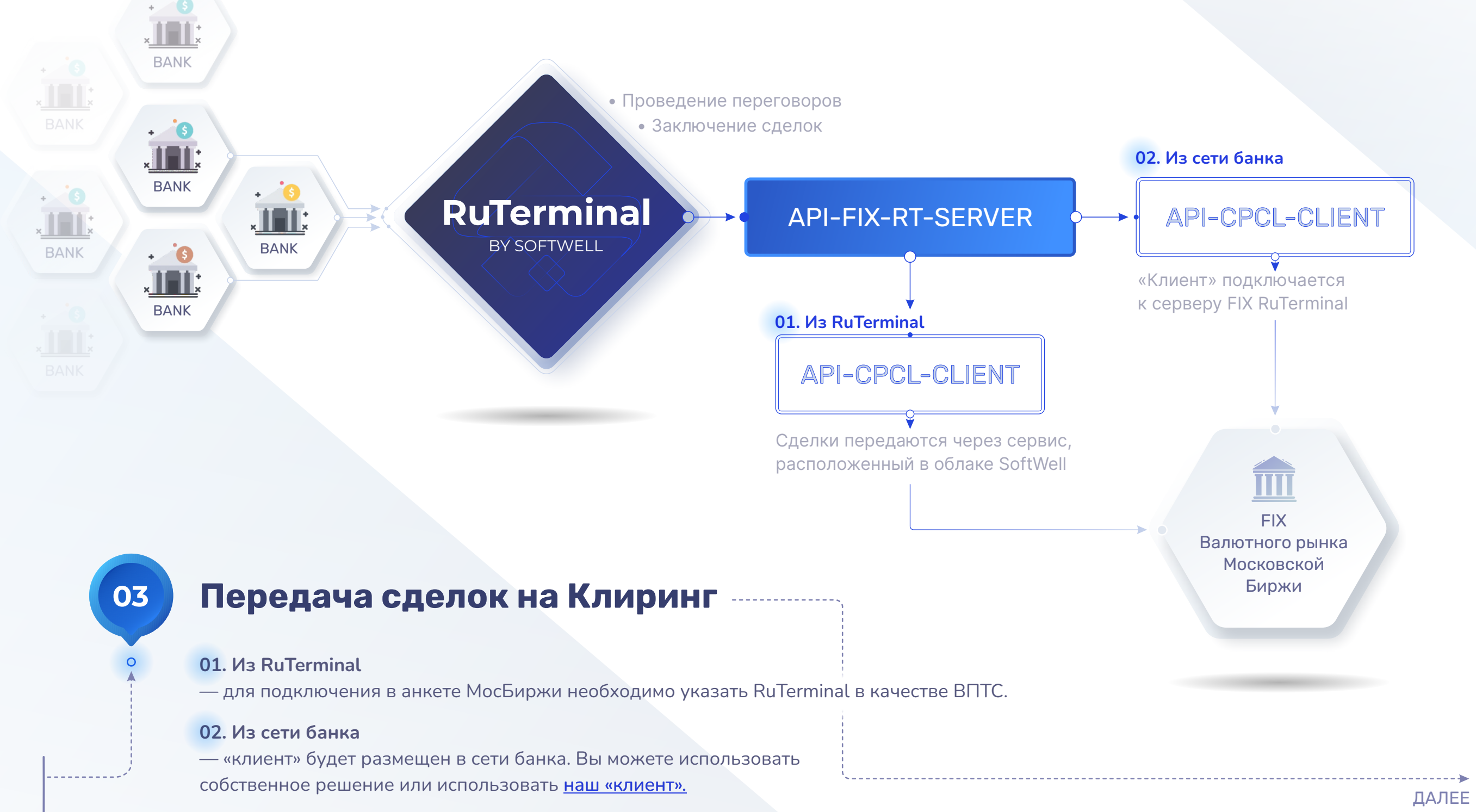
Получить доступ к клирингу в RuTerminal

В запросе указать инструменты, по которым вы готовы производить расчеты:

- USD/RUB
- EUR/USD
- USD/CNY
- USD/KZT
- ZAR/RUB
- AMD/RUB
- KGS/RUB
- TJS/RUB
- EUR/RUB
- CNY/RUB
- BYN/RUB
- KZT/RUB
- USD/ZAR
- USD/AMD
- USD/KGS
- USD/TJS

■ [Получить доступ: karpov@softwell.ru](mailto:karpov@softwell.ru)

ДАЛЕЕ



03

Передача сделок на Клиринг

- 01. Из RuTerminal**
— для подключения в анкете МосБиржи необходимо указать RuTerminal в качестве ВПТС.
- 02. Из сети банка**
— «клиент» будет размещен в сети банка. Вы можете использовать собственное решение или использовать [наш «клиент»](#).

ДАЛЕЕ

04

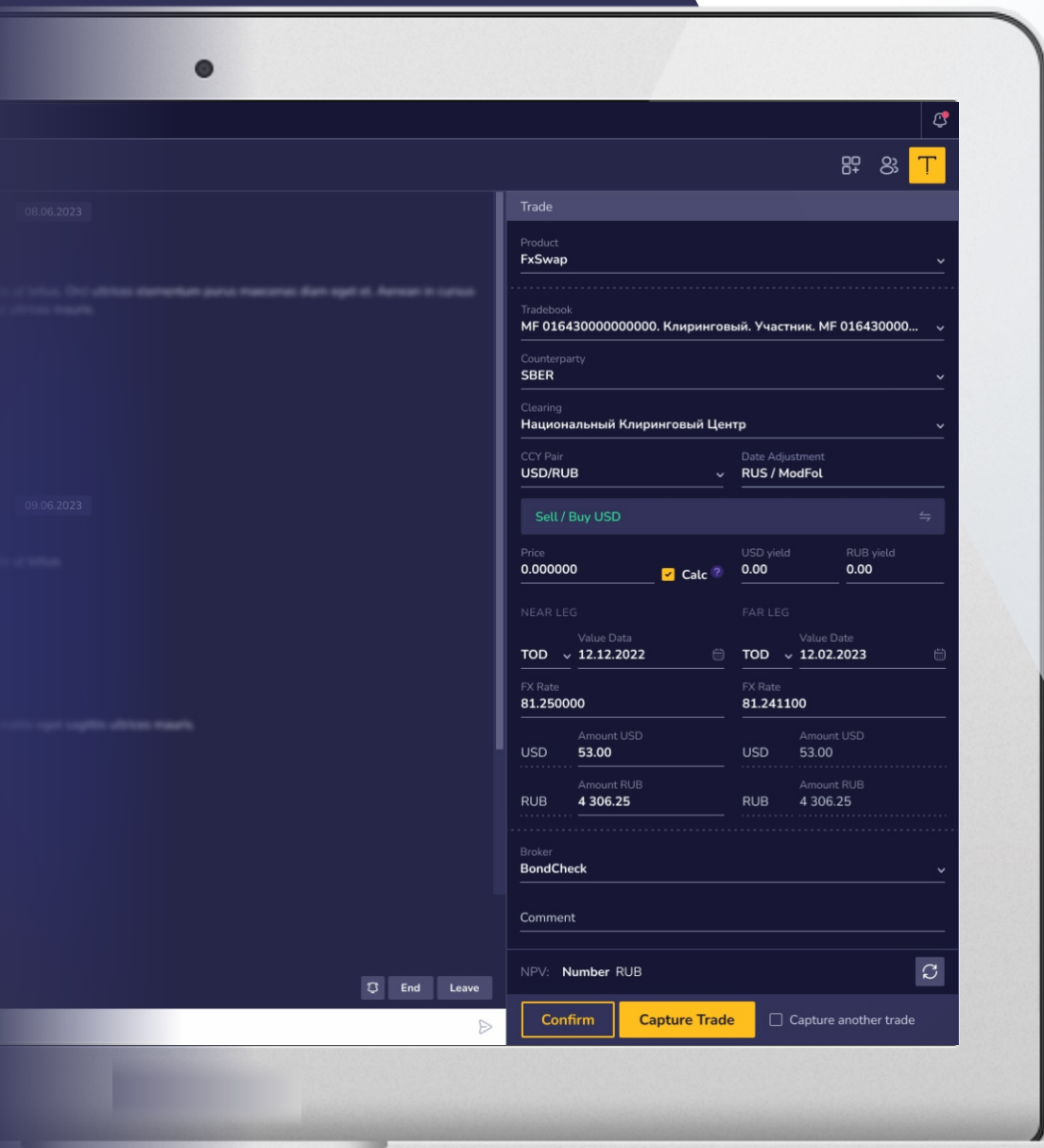
Укажите Клиринговую организацию на форме сделки

После выполнения всех настроек, на формах сделок Fx и FxSwap в RuTerminal Вам будет доступно поле «Клиринг»

При заключении сделки, Вам останется указать ее параметры и выбрать НКЦ в качестве клиринговой организации.

Сделка будет успешно зарегистрирована в режиме CPCL при выполнении следующих условий:

- Оба контрагента являются Участниками Клиринга НКЦ
- Оба контрагента передают сделки на обработку МосБиржи, из любого источника
- Средств единого лимита достаточно для исполнения обязательств по сделке



Ведение переговоров

Согласовывайте условия сделок
через функционал ведения переговоров

The screenshot shows the main trading application interface. At the top, there are tabs for 'Widget search', 'Chat', 'Fixing', and 'News'. Below this, there are sub-tabs for 'My requests', 'Monitored', 'Archive', and 'Missed'. A list of chat requests is visible on the left, including 'ALFT / RUB 10 TOM', 'GZPB / RUB 1 TOM', 'SBER / RUB 300 O/N DP', 'ALFT / RUB 10 TOM', 'OTKR / RUB 10...', and 'SBER / RUB 300 O...'. The main chat window is open for 'To: SBER / RUB 300 O/N DP' with 5 users. The chat history shows messages from 'SBER (ASTAHOV EVGENIY)', 'SOFT (SIDOROV SERGEY)', 'SOFT (PETROV ROMAN)', and 'SOFT (BORISOV NIKOLAY)' on 08.06.2023. A second chat window is open for 'To: ALFT / RUB 10 TOM' with 5 users, showing messages from 'SBER (ASTAHOV EVGENIY)', 'SOFT (SIDOROV SERGEY)', 'SBER (SEMENOV ANTON)', and 'SBER (ASTAHOV EVGENIY)' on 09.06.2023.

This close-up shows a chat input field with a typing indicator 'ALFT (UserName) is typing...'. To the right of the input field are three buttons: 'Interrupt', 'Capture Trade', and 'End'. Below the input field is a text box containing 'Your message' and a send button (a right-pointing triangle).

This close-up shows a chat input field with a 'Waiting for: ALFT (UserName)' indicator. To the right are buttons for 'Interrupt', 'Capture Trade', and 'End'. Below the input field is a text box containing 'Buy' and a send button.

This close-up shows a chat input field with a typing indicator 'ALFT (Frolov Anton), ALFT (Kolina Irina) is typing...'. To the right are buttons for 'Interrupt', 'Capture Trade', and 'End'. Below the input field is a text box containing 'Hello' and a send button. At the bottom, there is a note: 'ENTER — отправить сообщение / CTRL+ENTER — отправить сообщение и передать слово'.

The screenshot shows the trade details panel for an FxSwap trade. The product is 'FxSwap'. The tradebook is 'MF 01643000000000. Клиринговый. Участник. MF 016430000...'. The counterparty is 'SBER'. The clearing is 'Национальный Клиринговый Центр'. The CCY Pair is 'USD/RUB' and the Date Adjustment is 'RUS / ModFol'. The price is '0.000000' and the USD yield is '0.00'. The RUB yield is '0.00'. The NEAR LEG has a Value Date of '12.12.2022' and the FAR LEG has a Value Date of '12.02.2023'. The FX Rate is '81.250000' for both legs. The amount is '53.00' USD.



Подробнее о функции
переговоров

Платформу RuTerminal уже используют

Альфа Банк

 **Сбербанк**

 **АТБ** | Азиатско-Тихоокеанский Банк

 **УРАЛСИБ**

 **ГАЗПРОМБАНК**

ВЭБ | ДД

 **открытие**

 **ПСБ**

 **Уральский Банк**
реконструкции и развития

 **МКБ**

 **UNIBANK**

Ак Барс Банк 

и многие другие...



Карпов Анатолий

Генеральный директор SoftWell



+7 (495) 960-10-18



karpov@softwell.ru

МАТЕРИАЛЫ

- [Клиринг OTC Fx сделок с Центральным контрагентом](#)
- [Передача сделок в Клиринговую организацию. CPCL. Московская Биржа](#)
- [Исходный код нашего клиента на GitHub](#)