

FxSwap Interest Rate Arbitrage Calculator

Виджет FxSwap Calculator предназначен для расчета

- 1. котировок на нестандартной дате: FxSwap points, Yield (валюты 1 и валюта 2), Implied Yield для слабой валюты и
- 2. Spread между Yield и Implied Yield (собственно Interest Rate Arbitrage)

- Внешний вид
- Расчет для нестандартных дат
- Вызов контрагента

Внешний вид

FxSwap Interest Rate Arbitrage

Instrument
USD RUB

Spot Source

Fwd Source
GAZPROMBANK

Auto Refresh

Direct Input

+ Broken Term

			Fx Swap		USD Yield		RUB Yield		RUB Implied Yield		Spread		Outright	
Term	Date	Days	Bid	Ask	Bid	Ask	Bid	Ask	Bid	Ask	Bid	Ask	Bid	Ask
O/N	16.12.2022	1	112	115	3.92269	3.92269	7.50003	7.50003	10.26381	10.43366	2.76378	2.93363	64.48620	64.48650
Tom	16.12.2022		64.475	64.475										
T/N	19.12.2022	3			3.92269	3.92269	7.50003	7.50003						
Tom/1W	23.12.2022	7	-148	81	3.92269	3.92269	7.50003	7.50003	2.72487	4.57825	-4.77516	-2.92178	64.46020	64.48310
Tom/2W	30.12.2022	14	386	446	3.92400	3.92400	7.50100	7.50100	5.48720	5.73018	-2.01380	-1.77082	64.51360	64.51960
Tom/3W	06.01.2023	21	600	700	4.05200	4.05200	7.50100	7.50100	5.67323	5.94344	-1.82777	-1.55756	64.53500	64.54500
Tom/1M	16.01.2023	31	2 511	3 662	4.26600	4.26600	7.50100	7.50100	8.86811	10.97764	1.36711	3.47664	64.72610	64.84120
Tom/2M	16.02.2023	62	8 089	8 122	4.41600	4.41600	7.50100	7.50100	11.85732	11.88768	4.35632	4.38668	65.28390	65.28720
Tom/3M	16.03.2023	90	12 202	12 426	4.48100	4.48100	7.58500	7.58500	12.24101	12.38346	4.65601	4.79846	65.69520	65.71760
Tom/6M	16.06.2023	182	24 668	25 198	4.67900	4.67900	7.81600	7.81600	12.53100	12.69970	4.71500	4.88370	66.94180	66.99480
267D	11.09.2023	267	35 286	35 953	4.74101	4.74101	7.95576	7.95576	12.42642	12.57170	4.47067	4.61594	68.00360	68.07030
Tom/9M	18.09.2023	276	36 411	37 092	4.74600	4.74600	7.96700	7.96700	12.48238	12.62707	4.51538	4.66007	68.11610	68.18420
Tom/1Y	18.12.2023	367	34 090	49 792	4.76900	4.76900	8.14600	8.14600	10.27966	12.81789	2.13366	4.67189	67.88400	69.45420
Tom/18M	17.06.2024	549	79 337	87 690	4.55800	4.55800	8.60500	8.60500	13.30668	14.22779	4.70168	5.62279	72.40870	73.24400
Tom/2Y	16.12.2024	731	116 008	121 451	4.34500	4.34500	9.06400	9.06400	14.12260	14.58136	5.05860	5.51736	76.07580	76.62010
Tom/3Y	16.12.2025	1 096	164 216	189 835	3.95200	3.95200	10.02200	10.02200	13.44847	14.92999	3.42647	4.90799	80.89660	83.45850
Tom/4Y	16.12.2026	1 461	226 972	232 867	3.80200	3.80200	11.19800	11.19800	13.94120	14.20454	2.74320	3.00654	87.17220	87.76170
Tom/5Y	16.12.2027	1 826	292 542	293 712	3.63700	3.63700	12.10000	12.10000	14.36180	14.40469	2.26180	2.30469	93.72920	93.84620

Рыночные данные

Первая группа полей содержит котировки FxSpot, FxSwap на глубину Forward tenors инструментов, доступных в RuTerminal.

Котировки могут обновляться онлайн при включении флага Auto Refresh

При включении флага Direct Input появится возможность ввода значений вручную: котировки FxSwap, FxSpot, Yield для обеих валют.

Опционально вы можете выбрать источники котировок для

- 1. FxSpot
- 2. FxSwap

В следующих версиях мы предоставим возможность выбора источника дисконтных кривых

Yield

В группах полей Yield (первой и второй валют пары - USD Yield, RUB Yield) отображаются данные дисконтных кривых.

Для целей расчета вы можете их менять.

В ближайшее время мы введем функционал кривых участников. Вы сможете выбрать свои кривые для целей оценки.

Implied Yield

В этой группе полей производится расчет Bid, Ask значений implied yield для второй валюты пары.

Spread

Здесь отображается спред между Implied Yield и Yield (bid, ask) - собственно Interest Rate Arbitrage

Outright

Здесь отображаются котировки Outright.

Расчет для нестандартных дат

Нажав кнопку Broker Term вы можете добавить в список требуемую дату.

Для нее будут рассчитаны все значения:

1. FxSwap points,
2. Yield валюты 1,
3. Yield валюты 2,
4. Implied Yield для слабой валюты и
5. Spread между Yield и Implied Yield (собственно Interest Rate Arbitrage)
6. Outright

Вызов контрагента

Рядом с котировкой FxSwap размещена кнопка вызова.

Нажав ее вы сможете начать переговоры с владельцем котировки или другим участником