

БИРЖА ДЛЯ КОРПОРАТИВНОГО КАЗНАЧЕЯ

БИРЖЕВОЙ РЫНОК ДЛЯ КОРПОРАЦИЙ

180

Корпораций
и страховых компаний
на рынке Депозитов с ЦК



180

млрд руб.
Среднедневная открытая
позиция по депозитам (март 23)

50+

Корпораций
и страховых компаний
на Валютном рынке

ОТРАСЛИ



Страхование



Металлы и горная
добыча



Электроэнергетика



Нефть и газ



Химия и
нефтехимия



Торговля



Девелопмент и
строительство



Сельское хозяйство



Логистика и
грузоперевозки



Фармацевтика

РЫНОК ДЕПОЗИТОВ С ЦЕНТРАЛЬНЫМ КОНТРАГЕНТОМ (ЦК)

Размещение свободной ликвидности через
Депозиты с ЦК

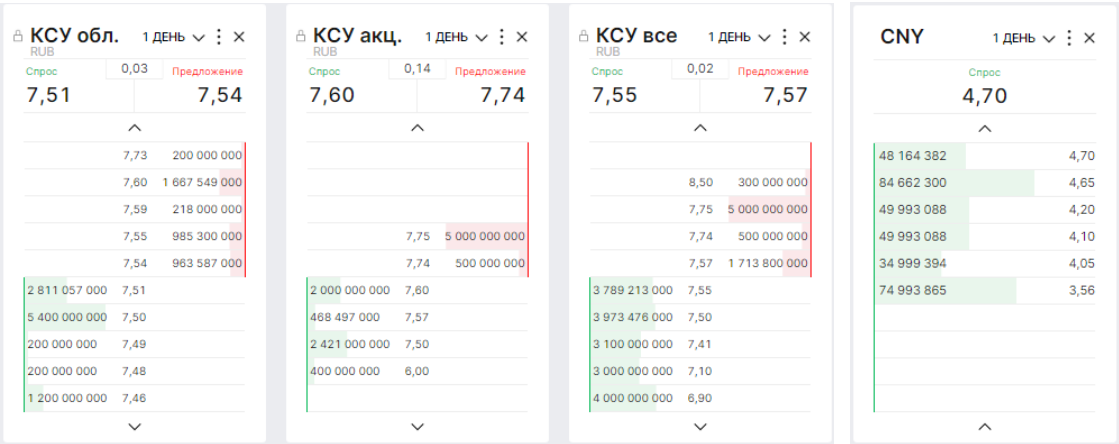
Валюта: **рубли** (от 1 дня до 1 года), **юани** (1 день)

Удобство заключения сделок

с 10:00 до 19:00

6 секунд!

Заключение сделок на рыночных условиях

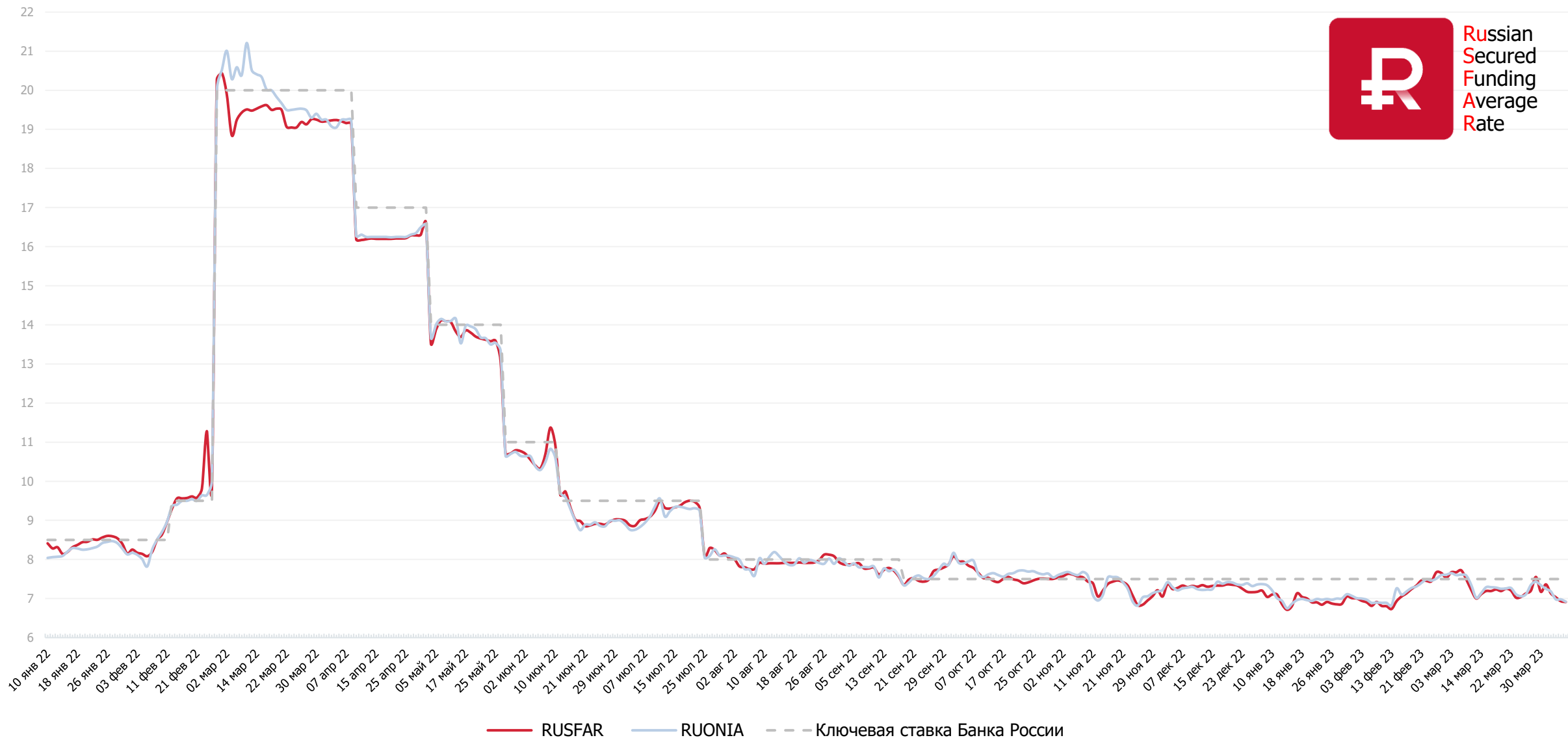


Все сделки заключаются с Центральным контрагентом (НКЦ)

- ✓ НКЦ входит в Группу Московская Биржа
- ✓ Банк России присвоил НКЦ статус квалифицированного Центрального контрагента 18 октября 2013 года.
- ✓ 11 октября 2022 года Рейтинговое агентство **АКРА** подтвердило рейтинг НКЦ на уровне AAA(RU), прогноз «Стабильный».



ИНДИКАТОР ДЕНЕЖНОГО РЫНКА RUSFAR



СЕРВИСЫ ДЛЯ ЭФФЕКТИВНОГО УПРАВЛЕНИЯ ЛИКВИДНОСТЬЮ

Возможность **досрочного изъятия части депозита:**

- Оперативное управление ликвидностью
- Рыночные условия при изъятии
- Повышение привлекательности заключения депозитных сделок с длинными сроками (от недели и более)



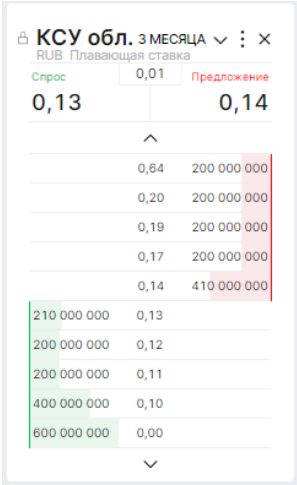
Алгоритмический модуль для размещения доступных на счете средств:

- **Размещение** средств алгоритмическим модулем **по заданным параметрам (ставка, объем, время, неснижаемый остаток)**



Депозиты с плавающими ставками:

Удобство размещения на длинные сроки при расчете на рост процентных ставок

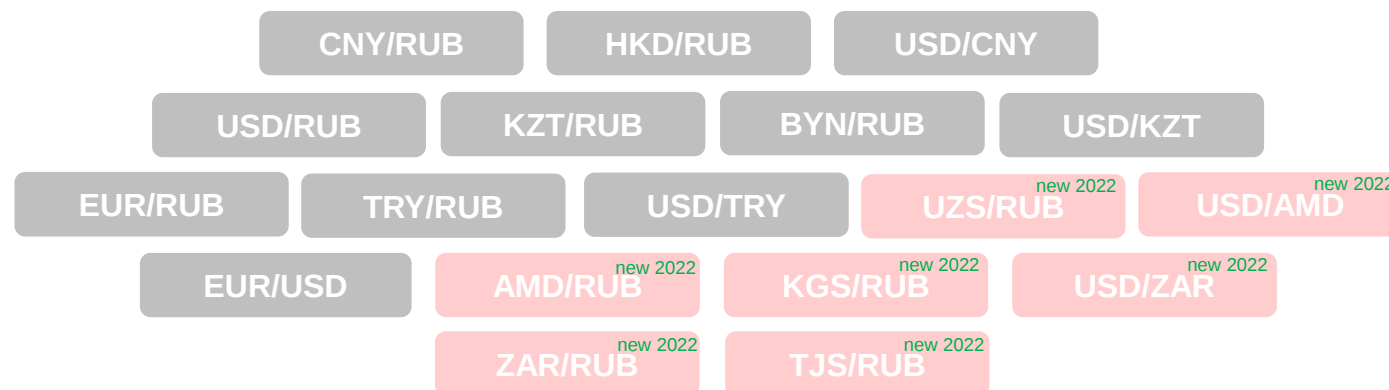


БИРЖЕВЫЕ СЕРВИСЫ ДЛЯ КОНВЕРСИИ

КОНВЕРСИОННЫЕ ОПЕРАЦИИ НА **ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ**

- Валютный рынок MOEX – **центр курсообразования** по RUB
- Банк России определяет офиц. курс USD/RUB, EUR/RUB, CNY/RUB на основе биржевых торгов

18 валютных пар:



Заключение сделок **с 07:00 до 19:00**

Инструменты TOD, TOM, SPT и свопы O/N

Сервисы для работы с крупными и мелкими лотами

Алгоритмические заявки TWAP

СЕРВИСЫ ДЛЯ ЭФФЕКТИВНОГО УПРАВЛЕНИЯ ЛИКВИДНОСТЬЮ



Единый логин +
Рабочие экраны для
каждого рынка



Web формат +
всегда актуальная
версия



Торговые операции
из любой точки
мира



Адаптированный
интерфейс для
казначеев

Возможность одновременной работы на **нескольких рынках**

Депозиты
с ЦК

Валютный
Рынок

Кредиты

М-Депозиты

Драгоценные
металлы

Срочный
Рынок

Просмотровый режим

Работа от нескольких компаний в Группе под одним логином

Управление обеспечением (интеграция с клиринговым терминалом)

Интеграция с **Транзит 2.0**

Интеграция с **Личным Кабинетом Участника** (ЛКУ)

Чат Московской Биржи



+ Добавить виджет

Алго-пакет заявок

Адресная заявка

Irina.Bukharina@moex....
MOEX Просмотр



КСУ обл. 1 ДЕНЬ

RUB

Спрос

0,03

Предложение

7,42

7,45



7,60 200 000 000

7,55 5 000 000

7,48 350 000 000

7,47 503 000 000

7,45 52 470 000

5 000 000 000 7,42

2 200 000 000 7,41

5 000 000 000 7,35

1 200 000 000 7,31

5 000 000 000 7,30



КСУ акц. 1 ДЕНЬ

RUB

Спрос

0,02

Предложение

7,30

7,32



7,45 4 995 000 000

7,36 89 000 000

7,35 1 000 000 000

7,32 295 000 000

3 767 285 000 7,30

400 000 000 6,00



КСУ все 1 ДЕНЬ

RUB

Спрос

0,08

Предложение

7,42

7,50



7,90 300 000 000

7,89 300 000 000

7,50 100 000 000

3 776 812 000 7,42

800 000 000 7,41

200 000 000 7,01

3 000 000 000 7,00



RUB 1 ДЕНЬ

Спрос

7,42



8 776 812 000 7,42

3 000 000 000 7,41

5 000 000 000 7,35

1 200 000 000 7,31

5 000 000 000 7,30



CNY 1 ДЕНЬ

Спрос

5,20



50 637 000 5,20

15 191 100 5,15

55 185 890 5,05

54 814 552 4,91

168 790 000 4,79



Кривая RUSFAR

18.04.2023



Все сделки

RUB 1 день

+	Время	Название инструмента	Ставка, %	Сумма / Сумма РЕПО
	17:26:11	RUB 1D ксу обл	7,42	1 002 000
	17:26:03	RUB 1D ксу обл	7,42	2 060 000
	17:25:15	RUB 1D ксу обл	7,42	23 658 000
	17:24:15	RUB 1D ксу обл	7,42	107 600 000
	17:24:05	RUB 1D ксу обл	7,42	44 008 000
	17:23:08	RUB 1D ксу все	7,42	63 930 000
	17:22:16	RUB 1D ксу обл	7,43	100 000 000
	17:22:00	RUB 1D ксу обл	7,42	51 570 000
	17:20:12	RUB 1D ксу обл	7,42	51 822 000
	17:19:35	RUB 1D ксу обл	7,46	150 000 000
	17:19:20	RUB 1D ксу обл	7,47	500 000 000
	17:05:41	RUB 1D ксу все	7,46	288 000 000
	17:04:48	RUB 1D ксу все	7,5	83 057 000
	17:03:19	RUB 1D ксу все	7,5	318 500 000
	17:02:57	RUB 1D ксу все	7,5	17 200 000

Кривая КСУ RUB обл

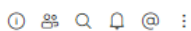
18.04.2023



Чат Московской Биржи



МОЕХ чат



Каналы

МОЕХ чат

МОЕХ_DEPO

Личная переписка

- Освер Илья (РОСБАНК) @595910

Присоединился к каналу

17:17
- Освер Илья (РОСБАНК) @595910

Hello, everyone!

17:57
- Лукьянов Павел @136585

Привет, Илья, что торгуешь?

17:58
- Освер Илья (РОСБАНК) @595910

Я супорчу наших трейдеров) Решил посмотреть, как "боевой" чат выглядит)

18:02
- Лукьянов Павел @136585

понял)

18:02
- Вдовин Максим (ФК ОТКРЫТИЕ) @196650

Присоединился к каналу

16:36

Сообщение



MOEX TREASURY. ИНТЕГРАЦИЯ с ТРАНЗИТ 2.0

1.

MOEX TREASURY

Счета в банках

Сегодня

	Входящие	Текущий остаток	Платежи в обработке	Ожидают отправки
RUB				
ЮниКредит Банк	86 153.01	86 153.01	200.00	0.00
... 6587 Публичное акционер...	0.00	0.00		
... 3115 АО "ОЗМК"	0.00	0.00		
... 7314 АО "ОЗМК"	86 153.01	86 153.01		
Росбанк	0.00	0.00	0.00	0.00
... 6772 АО "ДИКСИ Юг"	0.00	0.00		
Банк Открытие	82 787.08	82 787.08	0.00	0.00
... 0038 АО "ОЗМК"	82 787.08	82 787.08		
USD				
МКБ	150 000.00	144 351.50	100.00	0.00
... 3605 АО "ОЗМК"	150 000.00	144 351.50		

2.

Счета в банках

Пополнить счет на Бирже

RUB

Перевод из Банка

Банк Открытие

Организация

АО "ОЗМК"

Сумма перевода

82787

Перевод со счета

40702810701700000038

Номер платежного поручения

Шаблон

Тестовый ФР МХТ. Банк Открытие

Отмена

Создать

3.

Уведомление

Запрос на перевод денежных средств будет отправлен в НРД. Вы действительно хотите отправить сообщение с данными параметрами?

Валюта

USD

Перевод из Банка

Московский Кредитный Банк

Перевод со счета

40702840000760013605

Сумма перевода

123.45

Перевод на Расчетный код

Оплата товаров, по дорогову_перделали шаблон, НДС: 100 (20%)

Дождитесь обработки сообщения со стороны ответственного сотрудника за денежные переводы

Назад

Подтвердить

4.

Запросы Транзит 2.0

Дата	Сумма перевода	Статус	Перевод со счета	Банк	Назначение
20.04.2023	123.45 RUB	Черновик	40702840000760013605	ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИ...	Оплата товаров, по доро
21.03.2023	2.45 RUB	Ошибка доставки	40702840000760013605	ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИ...	Перечисление средств
21.03.2023	1.25 RUB	Ошибка доставки	40702840000760013605	ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИ...	Перечисление средств
13.12.2022	5 RUB	Ошибка доставки	40702840000760013605	ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИ...	Перечисление средств
13.12.2022	12 RUB	Ошибка доставки	40702840000760013605	ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИ...	Оплата товаров, по доро

Сумма на 20.04.2023: 123.45

ТРАНЗИТ 2.0

Реестр	Банк плате...	Номер счета	Номер ПП	Дата импорта	Отправитель	Получатель	Банк получ...	Назначение	Дата	Сумма	Статус	Срочно	Получатель...	Получатель...	Тип ошибки	Группа	Код сообще...	Тип создания	Фазы
	Выб...	Выб...		ДД.ММ.ГГ	Выб...				ДД.ММ.ГГ		Выб...	Все			Выб...		Выб...	Выб...	☐
Нет	ПАО БАНК "...	4070281070...	19	15.09.2022 1...	АКЦИОНЕР...	НКО НКЦ (А...	КО АО НРД	Перечислен...	17.10.2022	50 000.00	Черновик	Нет	7750004023	3041481000...	Нет	Нет	Не задан	МХТ	☐
Нет	ЮниКредит ...	4070281050...	5	15.09.2022 1...	ПАО "Моско...	НКО НКЦ (А...	КО АО НРД	Перечис...					7750004023	3041481000...	Нет	Нет	Не задан	МХТ	☐

6 ЛЕТ: РАЗВИВАЕМСЯ ВМЕСТЕ С ВАМИ



СПАСИБО
ЗА ВНИМАНИЕ