

САПФИР: РУКОВОДСТВО ПОЛЬЗОВАТЕЛЯ



ОСНОВНЫЕ ФУНКЦИИ



Создание заявок



Обработка

МОДУЛИ СИСТЕМЫ



Стаканы



Позиции



Рыночные данные

Оглавление

1. О программе	3
1.1 Общая информация.....	3
1.2 Внешний вид.....	3
1.3. Стартовое меню программы	4
2. Первичная настройка Рабочего стола	5
3. Выставление и прием заявок.....	6
3.1 Сделки FX Fwd (Валютные форварды).....	7
3.2 Сделки FX Swap (Валютные свопы)	12
3.3 Сделки IRS/OIS (Процентные свопы)	18
3.4 Сделки XCCY (Кросс-валютные свопы)	30
3.5 Сделки BASIS Single Currency (Базисные свопы в одной валюте).....	41
3.6 Сделки BASIS XCCY (Кросс-валютные базисные свопы).....	41
3.7 Сделки Cap/Floor (Опционы на процентные ставки)	42
4. Работа с разделом "Ордера"	52
4.1 Стаканные инструменты.....	52
4.2 Активные Ордера	54
4.3 Входящие. Адресные	54
4.4 Входящие. Безадресные	55
4.5 Архив ордеров.....	56
5. Работа с разделом "Позиция".....	57
5.1 Балансы	57
5.2 Подраздел "Позиция. Все продукты"	57
5.3 Архив сделок	58
5.4 Платежи	58
5.5 Чувствительности	59
5.6 Внесение изменений в сделку.	60
5.7 Терминация открытой позиции.	60
6. Рыночные данные	62
7. Полезные ссылки.....	63

1. О программе

1.1 Общая информация

Торгово-Клиринговая система **Сапфир** — это платформа, разработанная для участников рынка стандартизованных производных финансовых инструментов (ПФИ) Московской биржи. Система обеспечивает полный цикл работы: от выставления и исполнения заявок до клиринга, расчётов и отчётности в рамках регламентов Группы Компаний Московской биржи.

Система предназначена для брокерских компаний, инвестиционных фондов, кредитных организаций и других участников, имеющих доступ к торговле на рынке ПФИ. Она интегрирована с инфраструктурой Московской биржи и обеспечивает соответствие требованиям регулятора.

Система **Сапфир** предоставляет следующие основные сервисы:

- выставление, изменение и отмена заявок на покупку/продажу стандартизованных ПФИ (форвардов, свопов и опционов);
- мониторинг статуса заявок и исполненных сделок в реальном времени; доступ к рыночной информации: стаканы ордеров, котировки, объёмы, исторические данные;
- автоматический клиринг и расчёт обязательств по сделкам; формирование и экспорт отчётов по операциям, позициям и лимитам; интеграция с системами внутреннего риск-менеджмента и бухгалтерии участников;
- уведомления о событиях рынка: изменениях маржинальных требований, сроках экспирации, корректировках контрактов;
- безопасный доступ через защищённые каналы связи с двухфакторной аутентификацией.

Система работает в режиме 24/5, с перерывами на техническое обслуживание, согласно расписанию ГК Московской биржи. Все операции проходят в соответствии с правилами клиринга, утверждёнными АО НКЦ.

1.2 Внешний вид

Система **Сапфир** предоставляет участникам рынка стандартизованных производных финансовых инструментов (ПФИ) Московской биржи несколько каналов взаимодействия. К ним относятся:

- **Веб-интерфейс (Web UI)** — графический интерфейс, доступный через браузер, позволяющий пользователям выставить заявки, отслеживать

статус сделок, просматривать рыночные данные и управлять позициями в режиме реального времени.

- **FIX API** — стандартизированный протокол для автоматизированной торговли, используемый профессиональными участниками для интеграции собственных торговых систем с платформой Сапфир. Позволяет отправлять заявки, получать рыночные данные и управлять клиринговыми обязательствами в автоматическом режиме.
- **REST API** — современный веб-интерфейс для программного доступа к функционалу системы, обеспечивающий обмен данными в формате JSON. Используется для построения специализированных решений, аналитических панелей и интеграции с внутренними системами риск-менеджмента.
- **Подача заявок через приложение «Трейд Радар»** — мобильное или десктопное приложение, разработанное для удобного доступа к рынку СПФИ. Позволяет трейдерам быстро выставять и отменять заявки, получать уведомления о рыночных событиях и отслеживать исполнение ордеров в режиме реального времени.

Все каналы взаимодействия поддерживают двухфакторную аутентификацию и соответствуют требованиям безопасности, установленным Московской биржей и Центральным банком РФ. Выбор способа подключения зависит от профиля участника.

1.3. Стартовое меню программы

После входа в систему «Сапфир» на экране отображается основной интерфейс с левой панелью навигации и центральной рабочей областью.

1. В левой панели навигации вы можете выбрать необходимый раздел: «Создать ордер», «Ордера», «Позиции» или «Рыночные данные».
2. В верхней части экрана убедитесь, что активна вкладка «Dashboard 1». Для добавления нового рабочего стола нажмите кнопку «+» рядом с названием вкладки.
3. В центральной области вы можете настроить рабочее пространство под свои нужды:
 - Перетаскивайте, закрывайте или добавляйте группы окон: «Активные ордера», «Балансы», «Входящие ордера. Адресные», «Позиция. Все продукты», «Фиксинги».
 - Изменяйте размеры окон, раздвигая их границы.
 - Убирайте ненужные блоки, если они не требуются для текущей работы.

4. В нижней левой части экрана найдите блок «Счета». Нажмите стрелку вниз рядом с надписью «Выбрано счетов: 0», чтобы развернуть список доступных счетов.
5. Установите галочку напротив нужного счёта (например, «MF1010000000»). Выбранные счета будут автоматически заранее заполняться в ордерах при их создании и приемке.
6. Для выбора всех счетов установите галочку напротив «Выбрать все».
7. Для скрытия или показа бокового меню используйте кнопку «...» под списком счетов.
8. В правом верхнем углу убедитесь, что отображается ваш идентификатор сессии (например, MT1010000000) и доступна иконка уведомлений (колокольчик).

2. Первичная настройка Рабочего стола

Настройка рабочего стола под свои нужды позволяет пользователю сосредоточиться на ключевых данных и сократить время на поиск необходимой информации. Правильно настроенный интерфейс снижает риск ошибок при работе с ордерами и позициями, так как отображает только релевантные блоки и заранее заполняет выбранные счета в нужные формы. Индивидуальная конфигурация повышает эффективность работы, особенно при одновременном мониторинге нескольких продуктов и инструментов.

1. Для очистки преднастроенного рабочего стола закройте все группы окон в центральной области, оставив пустое рабочее пространство.
2. Чтобы управлять текущим рабочим столом, нажмите правой кнопкой мыши на вкладку с названием (например, «Dashboard 1»). В открывшемся меню доступны следующие действия:
 - «Переименовать» — измените название рабочего стола.
 - «Экспортировать» — сохраните текущую конфигурацию рабочего стола для последующего использования.
 - «Удалить» — закройте текущий рабочий стол.
3. Для создания нового рабочего стола нажмите кнопку «+» рядом с названием текущей вкладки. В открывшемся меню выберите:
 - «Создать» — позволит начать настройку нового рабочего стола с нуля.
 - «Импортировать» — возможность загрузить заранее сохранённую конфигурацию рабочего стола.

Для вашего удобства рассмотрите возможность использования шаблонов рабочих столов. Они расположены на странице рынка СПФИ по ссылке – <https://fs.moex.com/f/22254/prednastroennye-rabochie-stoly-tks-sapfir.zip>

После создания нового рабочего стола добавьте необходимые группы окон: «Активные ордера», «Балансы», «Входящие ордера. Адресные», «Позиция. Все продукты», «Фиксинги» — перетаскивая их в центральную область или через меню добавления.

4. Настройте размеры и расположение окон, раздвигая их границы или перетаскивая в нужные позиции.
5. В левой панели навигации и в блоке «Счета» убедитесь, что выбраны нужные разделы и счёта для отображения в рабочем пространстве.

Эта настройка позволяет пользователю адаптировать интерфейс под свои задачи, начиная с пустого рабочего стола.

3. Выставление и прием заявок

- Для создания новой заявки перейдите в раздел соответствующего типа продукта (например, «FX Fwd», «FX Swap» и т.д.) и нажмите «Создать ордер». В открывшемся списке выберите тип инструмента:
 - Для валютных форвардов — «FX Fwd».
 - Для валютных свопов — «FX Swap».
 - Для процентных свопов — «IRS/OIS».
 - Для кросс-валютных свопов — «XCCY».
 - Для базисных свопов в одной валюте — «BASIS (Single Currency)».
 - Для базисных свопов в кросс-валюте — «BASIS (XCCY)».
 - Для капов и флоров — «Cap/Floor».

После выбора типа инструмента система откроет форму для заполнения параметров ордера. Для выставления заявки в стакан используйте предзаполненные стандартные параметры, описанные в соответствующем разделе инструкции.

3.1 Сделки FX Fwd (Валютные форварды)

Пример заполненной заявки для сделки валютный форвард.

The screenshot shows a web form titled 'FX Fwd' with four tabs: 'Основное' (Basic), 'Дополнительно' (Additional), 'Платежи' (Payments), and 'Чувствительности' (Sensitivities). The 'Основное' tab is active. The form contains the following fields and controls:

- Торговый счёт** (Trading account): MF1010000000.RK10100 (dropdown menu).
- Код клиента** (Client code): (empty field).
- Режим торгов** (Trading mode): Public (dropdown menu).
- Контрагент** (Counterparty): NCCB NCCB (dropdown menu).
- Валютная пара** (Currency pair): CNY/RUB (dropdown menu).
- CSA** (Credit Support Annex): RUB (dropdown menu).
- Direction**: Radio buttons for 'Buy CNY' and 'Sell CNY'. 'Sell CNY' is selected.
- Дата** (Date): 13 янв 2031 (calendar icon).
- Форвардный курс** (Forward rate): 14,05000.
- Currency 1**: CNY, **Сумма 1** (Sum 1): 100 000,00 (dropdown menu).
- Currency 2**: RUB, **Сумма 2** (Sum 2): 1 405 000,00 (dropdown menu).
- NDF**: ☐ NDF.
- Брокер** (Broker): (empty dropdown menu).
- Additional payment**: ☐ Дополнительный платеж.
- Summary table**:

NPV	Initial Margin	Market	Limit
---	---	---	---
- Buttons**: 'Пересчитать' (Recalculate), 'Создать ордер' (Create order), and 'Отменить' (Cancel).

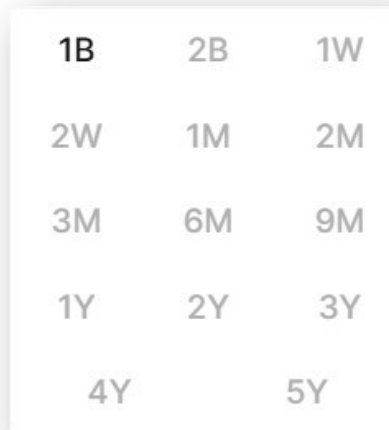
1. В окне «Создать FxForward» на вкладке «Основное» укажите: • Торговый счёт — выберите счёт из выпадающего списка (например, MF1010000000.RK10100).

- Поле «Код клиента» активно только при выборе брокерского торгового счёта. В этом случае выберите из списка бриф-код вашего клиента. Для собственных счетов поле недоступно.
- Режим торгов — при выборе опции «Public», заявка будет видна всем участникам рынка. В поле Контрагент автоматически проставится бриф-код АО НКЦ (NCCB). Любой участник рынка может полностью или частично принять ваш ордер. При выборе опции «Address» будет создана адресная заявка. Она будет видна только указанному в поле «Контрагент» участнику.
- Контрагент — укажите контрагента, если выбран режим «Address».
- Валютная пара — выберите из доступных: CNY/RUB, EUR/RUB, EUR/USD, USD/RUB.
- CSA — валюта обеспечения сделки. В настоящий момент доступна только опция RUB.

2. Установите направление сделки: выберите «Buy» или «Sell».

3. Укажите:

- Дату — выберите дату в будущем, когда произойдёт расчёт по контракту. Выбор можно осуществить в ручном режиме, указав конкретный день. Или в автоматическом режиме, через контекстное меню с символом «V». Система автоматически подберет срок через неделю, месяц, год и т.д.



- Форвардный курс — значение курса, по которому произойдет итоговый расчет по сделке. При выборе валютной пары система автоматически подставляет актуальное значение. Вы можете его поменять на необходимое.
- Сумма 1 — Вводится сумма в первой валюте.
- Сумма 2 — После ввода "Сумма 1" и "Форвардного курса", значение будет рассчитано автоматически. Если вы замените его, то автоматически поменяется значение форвардного курса на основании данных в полях "Сумма 1" и "Сумма 2"

4. При необходимости установите флажок «NDF» (беспоставочный форвард).

При включении опции "NDF" становятся доступны следующие поля:

- Курс спот — способ определения курса. Опция Market - рыночный курс. Опция CBR курс ЦБ РФ.
- Смещение даты курса спот — блок позволяет выбрать отклонение даты определения спотового курса относительно даты расчёта по контракту.

Доступные варианты:

«-2 рабочих дня» — курс спот определяется за два рабочих дня до даты расчёта

«-1 рабочий день» — курс спот определяется за один рабочий день до даты расчёта. «Не применять» — смещение не используется, курс спот определяется на дату расчёта.

«+1 рабочий день» — курс спот определяется на один рабочий день после даты расчёта.

- Валюта суммы платежа — валюта, в которой рассчитывается платеж по договору (например, USD). - Валюта платежа — валюта, в которой будет произведён фактический платёж по договору (например, RUB).

- Курс спот к валюте платежа — источник определения курса для "Валюты платежа".

- Опция Market - рыночный курс. Опция CBR - курс ЦБ РФ.

5. При необходимости выберите брокера из выпадающего списка, если сделка, которую вы совершаете, проходит с его участием.

6. При необходимости вы можете добавить Дополнительный платеж в ордер. В настоящий момент оплата всегда проходит в рублях в T0.

☒ Дополнительный платеж

☐ Receive ☒ Pay

Валюта

Сумма

Дата

7. На вкладке "Дополнительно" вы можете внести комментарии к ордеру. Они видны только вам и не доступны вашему контрагенту. Такие заметки могут быть полезными для внутренних подразделений или для автоматической маршрутизации сделки в нужный портфель. Поддерживается кодировка ASCII (русские символы вписать в поле нельзя).

Основное

Дополнительно

Платежи

Чувствительности

Комментарий

0/30

NPV

Initial Margin

Market

Limit

Пересчитать

Создать ордер

Отменить

8. На вкладке "Платежи" показывается сводная информация по всем запланированным платежам для данной сделки. Вы можете формировать порядок столбцов, перетаскивая их зажатием названия столбца левой кнопкой мыши

Создать FxForward

Основное Дополнительно **Платежи** Чувствительности

Дата пл... ↑	Сумма платежа	Валюта ...	Дисконт фактор	NPV	Курс	Стоимость	+
13.01.2031	100 000	CNY	0,647491793108805	64 749,18	11,1531	722 154,07	⋮
13.01.2031	-1 117 170	RUB	0,51514069370199	-575 499,73	1	-575 499,73	⋮

NPV

Initial Margin

Market

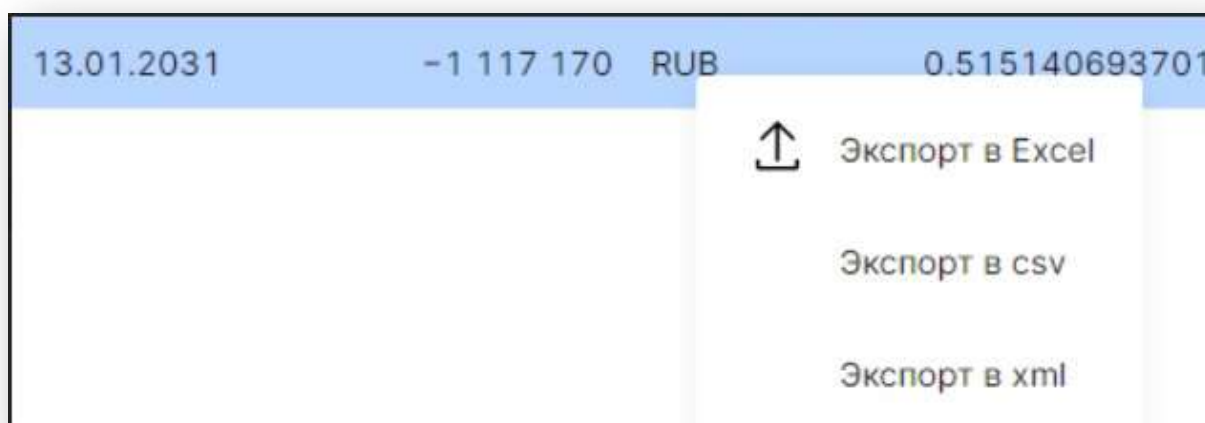
Limit

Пересчитать

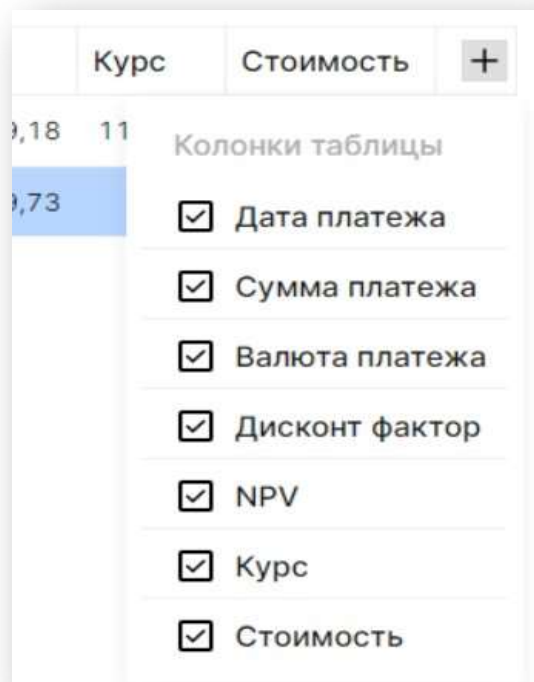
Создать ордер

Отменить

Вы можете выгрузить необходимую информацию в нужном формате, нажав правую кнопку мыши на любом из платежей.



С помощью кнопки "+" вы можете добавлять или убирать необходимую информацию из отчета.



9. Вкладка "Чувствительности" показывает, как поменяется стоимость сделки при изменении одного из представленных в списке сценариев на 0,0001%. Все значения можно выгрузить в нужный формат с помощью нажатия правой кнопки мыши и использовать для анализа заключаемой сделки.

Создать FxForward

Основное
Дополнительно
Платежи
Чувствительности

Сценарий	Чувствительности, RUB ↑
XCCY-CNY-RUB-5Y	-417,4
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-3Y	-26,03
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-4Y	-25,58
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-2Y	-14,16

Риск-фактор ↓	Значение	Сдвиг
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-4Y	0,142	0,0001

NPV
Initial Margin
Market
Limit

146 654,34
111 267,21

658 743 241 530,94

Пересчитать

Создать ордер

Отменить

10. Перед выставлением ордера важно проверить, что NPV (чистая приведенная стоимость) сделки находится в допустимых пределах. В противном случае такой ордер будет автоматически отклонен системой с соответствующим извещением пользователя. Провести расчет NPV и требуемого первоначального обеспечения можно, нажав кнопку "Пересчитать".

NPV	Initial Margin	Market	Limit	Пересчитать
1 856 537,35	244 654,26	---	658 649 515 730,5	
Создать ордер				Отменить

11. Для подачи заявки нажмите кнопку «Создать ордер». Для отмены — кнопку «Отменить».
12. Дополнительно у вас будет запрошено итоговое подтверждение перед выставлением ордера. В этот момент вам будут продемонстрированы все параметры будущего ордера. Нажатие кнопки "Подтвердить" приведет к выставлению заявки. Кнопка "Назад" вернет вас на страницу заполнения заявки.

Подтверждение заявки

×

Вы действительно хотите ввести заявку с данными параметрами?

Продукт	FX Fwd
Счет, на котором зарегистрирована сделка	MF1010000000.RK10100
Режим торгов	Public
Наименование контрагента	NCCB
Валютная пара	CNY/RUB
Валюта CSA	RUB
Направление сделки	Sell
Дата начала сделки	13.01.2031
Цена	50
Сумма 1	100 000
Сумма 2	5000000.00

Назад

Подтвердить

3.2 Сделки FX Swap (Валютные свопы)

Пример заполненной заявки для сделки валютный своп.

Создать FxSwap

Основное Дополнительно Платежи Чувствительности

Торговый счёт
MF1010000000.RK10100

Код клиента

Режим торгов
Public

Контрагент
NCCB NCCB

Валютная пара
USD/RUB

CSA
RUB

☒ Sell/Buy USD ☐ Buy/Sell USD

Цена (swap points)
67 750

Ставка доходности свопа
~8,7 %

Near Leg

Дата: 01 сен 2026 Курс: 77,8750

USD: Продажа 150 000,00

RUB: Покупка 11 681 250,00

Far Leg

Дата: 01 сен 2027 Курс: 84,6500

USD: Покупка 150 000,00

RUB: Продажа 12 697 500,00

Брокер

☐ Дополнительный платеж

NPV	Initial Margin	Market	Limit
2 174,22	260 041,76	---	658 742 971 969,99

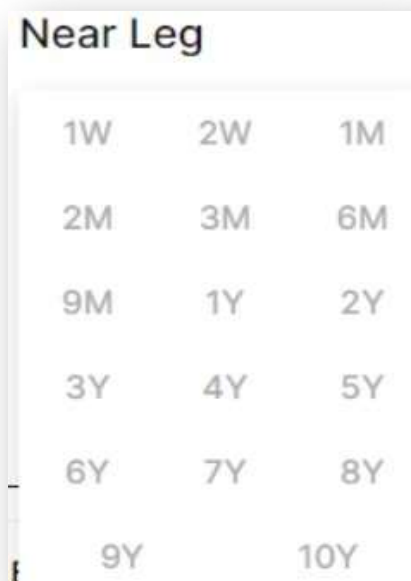
Пересчитать

Создать ордер Отменить

- В окне «Создать Fx Swar» на вкладке «Основное» укажите:
 - Торговый счёт — выберите счёт из выпадающего списка (например, MF1010000000.RK10100).
 - Поле «Код клиента» активно только при выборе брокерского торгового счёта. В этом случае выберите из списка бриф-код вашего клиента. Для собственных счетов поле недоступно.
 - Режим торгов — при выборе опции «Public», заявка будет видна всем участникам рынка. В поле Контрагент автоматически проставится бриф-код АО НКЦ (NCCB). Любой участник рынка может полностью или частично принять ваш ордер. При выборе опции «Address» будет создана адресная заявка. Она будет видна только указанному в поле «Контрагент» участнику.
 - Контрагент — укажите контрагента, если выбран режим «Address».
 - Валютная пара — выберите из доступных: CNY/RUB, EUR/RUB, EUR/USD, USD/RUB.
 - CSA — валюта обеспечения сделки. В настоящий момент доступна только опция RUB.
- Установите направление сделки: выберите очередность обмена денежными потоками «Buy/Sell» или «Sell/Buy».

3. Укажите:

- Цену в Swar пунктах - данная цена в зависимости от знака прибавляется или вычитается от валютного курса по ближней ноге и отражается в валютном курсе для дальней ноги. При использовании нулевого значения - валютные курсы по обеим ногам сделки будут совпадать.
- Дату обмена по ближней ноге — выберите дату в будущем, когда произойдёт первый расчёт по контракту. Выбор можно осуществить в ручном режиме, указав конкретный день. Или в автоматическом режиме, через контекстное меню с символом «V». Система автоматически подберет срок через неделю, месяц, год и т.д.



- Курс — значение курса, по которому произойдет расчет по сделке по ближней ноге. При выборе валютной пары система автоматически подставляет актуальное значение. Вы можете его поменять на необходимое.
 - Сумма Продажи — Вводится сумма в первой валюте, которая будет передана от вас в начале сделки.
 - Сумма Покупки — После ввода "Суммы Продажи" и "Валютного курса", значение будет рассчитано автоматически. Если вы замените его, то автоматически поменяется значение валютного курса на основании данных в полях "Сумма Покупки" и "Сумма Продажи"
 - Значения для дальней ноги автоматически рассчитываются в зависимости от Swar цены и параметров для ближней ноги сделки.
4. При необходимости выберите брокера из выпадающего списка, если сделка, которую вы совершаете, проходит с его участием.


5. При необходимости вы можете добавить Дополнительный платеж в ордер. В настоящий момент оплата всегда проходит в рублях в T0.

☒ Дополнительный платеж

☐ Receive ☒ Pay

Валюта ▼

Сумма

Дата 

6. На вкладке "Дополнительно" вы можете внести комментарии к ордеру. Они видны только вам и не доступны вашему контрагенту. Такие заметки могут быть полезными для внутренних подразделений или для автоматической маршрутизации сделки в нужный портфель. Поддерживается кодировка ASCII (русские символы вписать в поле нельзя).

Основное

Дополнительно

Платежи

Чувствительности

Комментарий

0/30

NPV

Initial Margin

Market

Limit

Пересчитать

Создать ордер

Отменить

7. На вкладке "Платежи" показывается сводная информация по всем запланированным платежам для данной сделки. Вы можете формировать порядок столбцов, перетаскивая их зажатием названия столбца левой кнопкой мыши.

Создать FxSwap

Основное
Дополнительно
Платежи
Чувствительности

Дата п... ↓	Сумма платежа	В...	Дисконт фактор	NPV	Курс	Стоимость	+
01.09.2027	150 000	USD	0,951419116311002	142 712,87	77,8332	11 107 799,15	⋮
01.09.2027	-12 697 500	RUB	0,805704592120538	-10 230 434,06	1	-10 230 434,06	⋮
01.09.2026	11 681 250	RUB	0,913799805311387	10 674 323,98	1	10 674 323,98	⋮
01.09.2026	-150 000	USD	0,989253502136206	-148 388,03	77,8332	-11 549 514,85	⋮

NPV
Initial Margin
Market
Limit

2 174,22
260 041,76

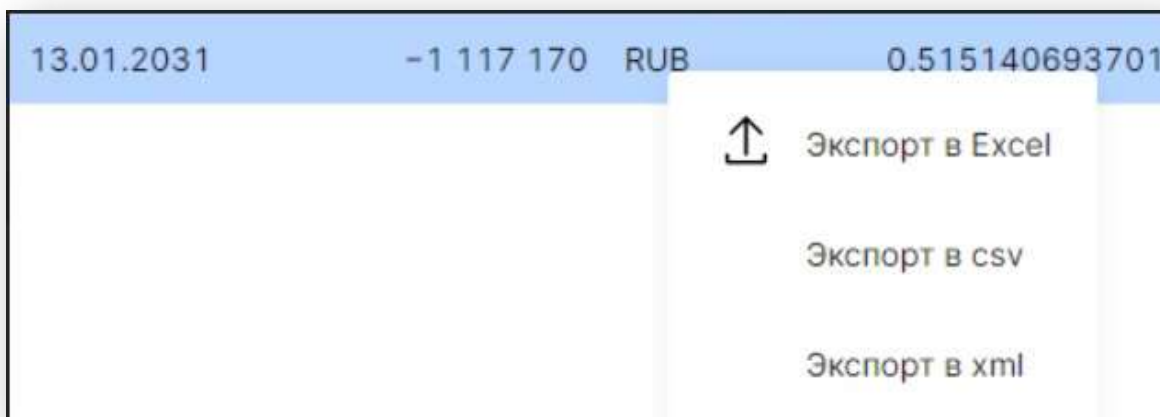
658 742 971 969,99

Пересчитать

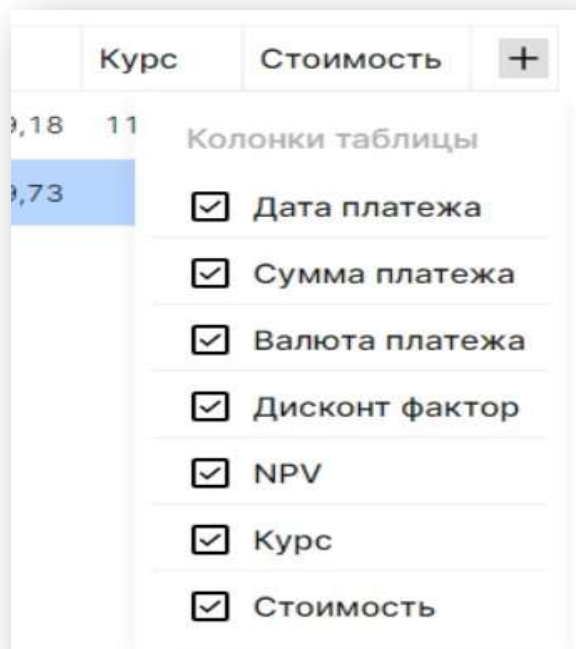
Создать ордер

Отменить

Вы можете выгрузить необходимую информацию в нужном формате, нажав правую кнопку мыши на любом из платежей.



С помощью кнопки "+" вы можете добавлять или убирать необходимую информацию из отчета.



8. Вкладка "Чувствительности" показывает, как поменяется стоимость сделки при изменении одного из представленных в списке сценариев на 0,0001%. Все значения можно выгрузить в нужный формат с помощью нажатия правой кнопки мыши и использовать для анализа заключаемой сделки.

Создать FxSwap

Основное
Дополнительно
Платежи
Чувствительности

Сценарий	Чувствительности, RUB ↑
USD-SOFR-2Y	-1 397,35
USD-SOFR-1Y	-447,66
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-1Y	-161,26
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-2Y	-24,98

Риск-фактор	Значение	Сдвиг
USD-SOFR-2Y	0,034167	0,0001

NPV	Initial Margin	Market	Limit
2 174,22	260 041,76	---	658 742 971 969,99

Создать ордер
Пересчитать
Отменить

9. Перед выставлением ордера важно проверить, что NPV сделки находится в допустимых пределах. В противном случае такой ордер будет автоматически отклонен системой с соответствующим извещением пользователя. Провести расчет NPV и требуемого первоначального обеспечения можно, нажав кнопку "Пересчитать"

NPV	Initial Margin	Market	Limit	
1 856 537,35	244 654,26	---	658 649 515 730,5	<button>Пересчитать</button>
<button>Создать ордер</button>				<button>Отменить</button>

10. Для подачи заявки нажмите кнопку «Создать ордер». Для отмены — кнопку «Отменить».
11. Дополнительно у вас будет запрошено итоговое подтверждение перед выставлением ордера. В этот момент вам будут продемонстрированы все параметры будущего ордера. Нажатие кнопки "Подтвердить" приведет к выставлению заявки. Кнопка "Назад" вернет вас на страницу заполнения заявки.

Подтверждение заявки ×

Вы действительно хотите ввести заявку с данными параметрами?

Продукт	FX Swap
Счет, на котором зарегистрирована сделка	MF1010000000.RK10100
Режим торгов	Public
Наименование контрагента	NCCB
Валютная пара	USD/RUB
Валюта CSA	RUB
Направление сделки	Sell/Buy
Дата начала сделки	01.09.2026
Цена	67 750
Курс	77,875
Сумма 1	150 000
Сумма 2	11 681 250
Дата окончания сделки	01.09.2027

НазадПодтвердить

3.3 Сделки IRS/OIS (Процентные свопы)

Пример заполненной заявки для сделки IRS

Создать IRS/OIS

Основное Дополнительно Платежи Периоды Чувствительности

Торговый счёт
MF1010000000.RK10100

Код клиента

Режим торгов
Public

Контрагент
NCCB NCCB

CSA
RUB

Валюта
RUB

Сумма
150 000 000,00

Начальная дата
20 янв 2026

Дата окончания
19 янв 2029

☒ Pay Fix/Receive Float ☐ Receive Fix/Pay Float

Основное Календари Дополнительно

Fixed Stream

Фиксированная ставка
13,4400 %

Конвенция
ACT/ACT (ISDA)

Выплаты
Ежеквартально (3M)

Смещение платежей
Не применять

Floating Stream

Индекс
RUB KeyRate

Спред (bp)

Конвенция
ACT/ACT (ISDA)

Выплаты
Ежеквартально (3M)

Смещение платежей
Не применять

Брокер

☐ Дополнительный платеж

NPV	Initial Margin	Market	Limit
25 406,48	43 617,38	---	658 743 013 083,96

Пересчитать

Создать ордер Отменить

1. В окне «Создать IRS/OIS» на вкладке «Основное» укажите:

- Торговый счёт — выберите счёт из выпадающего списка (например, MF1010000000.RK10100).
- Поле «Код клиента» активно только при выборе брокерского торгового счёта. В этом случае выберите из списка бриф-код вашего клиента. Для собственных счетов поле недоступно.
- Режим торгов — при выборе опции «Public», заявка будет видна всем участникам рынка. В поле Контрагент автоматически проставится бриф-код АО НКЦ (NCCB). Любой участник рынка может полностью или частично принять ваш ордер. При выборе опции «Address» будет создана адресная заявка. Она будет видна только указанному в поле «Контрагент» участнику.
- Контрагент — укажите контрагента, если выбран режим «Address».
- CSA — валюта обеспечения сделки. В настоящий момент доступна только опция RUB.
- Валюта — выберите из доступных: CNY, RUB, EUR, USD
- Сумма - номинал сделки, по которому будут рассчитываться значения всех денежных потоков. Обмен номиналами в сделках процентный своп не предусмотрен. Только денежные потоки, рассчитанные на его основе.
- Начальная дата - дата, с которой начинается расчет денежных потоков по сделке.

- Дата окончания - дата, в которую заканчивается расчет денежных потоков по сделке.

2. Установите направление сделки: выберите Pay Fix / Receive Float - по такой сделке вы будете платить фиксированную ставку и получать денежные потоки, рассчитанные по плавающей ставке. Если вы выберете опцию Receive Fix / Pay Float, то вы будете получать фиксированный денежный поток и при этом платить плавающие суммы, которые будут определяться на основе значений выбранной процентной ставки.

3. Укажите: для фиксированной ноги Fix Stream:

- Фиксированную ставку — на основе данной ставки рассчитываются платежи по фиксированной ноге. Ставка фиксируется на весь срок сделки.
- Конвенцию – параметр, отвечающий за определение количества дней в процентном периоде. Есть возможность выбора одной из четырех опций:
- 30E/360 - количество дней, истекшее в процентном периоде, рассчитывается на основе года, состоящего из 12 месяцев продолжительностью 30 дней каждый, разделенное на 360. В случае если последний день процентного периода приходится на последний день февраля, за количество дней, истекшее в этом месяце, принимается фактическое количество дней);
- act/360 - фактическое количество дней, истекшее в процентном периоде, разделенное на 360;
- act/365 (fixed) - фактическое количество дней, истекшее в процентном периоде, разделенное на 365;
- act/act (ISDA)
 - (i) фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на действительное число календарных дней в году (365 или 366 дней соответственно);
 - (ii) если части Процентного периода или Периода капитализации приходятся на календарные годы с различным количеством дней (365 и 366 дней соответственно), то начисление процентов за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 365, производится из расчета 365 календарных дней в году, а за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 366, производится из расчета 366 календарных дней в году.

- Выплаты (периодичность выплат) - данный параметр отвечает за периодичность выплат. Может принять значения: 1 раз в месяц (1M), 1 раз в квартал (3M), раз в полгода (6M), раз в год (1Y) или в конце сделки (1T)
- Смещение платежей - параметр сдвигает дату платежа на заданное количество рабочих дней в будущее.

4. Укажите: для фиксированной ноги Floating Stream:

- Индекс — на основе данной ставки рассчитываются платежи по плавающей ноге. Ставка рассчитывается в определенные дни (дни фиксинга ставки). Для разных валют на выбор доступны различные ставки.
- Спред - фиксированное значение в базисных пунктах, которое в зависимости от значения прибавляется или вычитается из зафиксированного значения плавающей ставки. Используется при расчете сумм платежей по плавающей ноге сделки.
- Конвенцию – параметр, отвечающий за определение количества дней в процентном периоде. Есть возможность выбора одной из четырех опций:
 - 30E/360 - количество дней, истекшее в процентном периоде, рассчитывается на основе года, состоящего из 12 месяцев продолжительностью 30 дней каждый, разделенное на 360. В случае если последний день процентного периода приходится на последний день февраля, за количество дней, истекшее в этом месяце, принимается фактическое количество дней);
 - act/360 - фактическое количество дней, истекшее в процентном периоде, разделенное на 360;
 - act/365 (fixed) - фактическое количество дней, истекшее в процентном периоде, разделенное на 365;
 - act/act (ISDA)
 - (i) фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на действительное число календарных дней в году (365 или 366 дней соответственно);
 - (ii) если части Процентного периода или Периода капитализации приходятся на календарные годы с различным количеством дней (365 и 366 дней соответственно), то начисление процентов за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 365, производится из расчета 365 календарных дней в году, а за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 366, производится из расчета 366 календарных дней в году


- Выплаты (периодичность выплат) - данный параметр отвечает за периодичность выплат. Может принять значения: 1 раз в месяц (1M), 1 раз в квартал (3M), раз в полгода (6M), раз в год (1Y) или в конце сделки (1T). Для рублевых процентных свопов на ключевую ставку доступна опция с еженедельной выплатой - 1W.
 - Смещение платежей - параметр сдвигает дату платежа на заданное количество рабочих дней в будущее.
5. При необходимости выберите брокера из выпадающего списка, если сделка, которую вы совершаете, проходит с его участием.
 6. При необходимости вы можете добавить Дополнительный платеж в ордер. В настоящий момент оплата всегда проходит в рублях в T0.

☒ Дополнительный платеж

☐ Receive
 ☒ Pay

Валюта ▼

Сумма

Дата


7. На вкладке "Календари" вы можете управлять смещением дат при выпадении какого-либо дня на выходной день. С ТКС Сапфир используются четыре опции:
 - Следующий рабочий день («Following») – в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день;
 - Предшествующий рабочий день («Preceding») – в этом случае днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день;
 - Рабочий день в отчетном периоде («Modified Following» или «Modified») – в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день, а если этот ближайший следующий Рабочий день является днем следующего месяца, то днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день;
 - Предыдущий рабочий день в отчетном периоде («Modified Preceding») – в этом случае днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день, а если этот ближайший предшествующий Рабочий день является днем предшествующего месяца, то днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день.

Effective - плановая дата начала сделки

Termination - плановая дата окончания сделки

Calculation - дата для расчета суммы платежа - эти даты определяют периоды расчета.

Payment - дата платежа

Reset - дата фиксации значений float ставки для процентного периода.

Fixing - дата расчета значения float ставки при расчете внутри итоговой ставки для процентного периода

☒ Pay Fix/Receive Float

☐ Receive Fix/Pay Float

Основное

Календари

Дополнительно

Effective

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
MODFOLLOWING

Termination

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
MODFOLLOWING

Calculation

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
MODFOLLOWING

Payment

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
FOLLOWING

FOLLOWING

MODFOLLOWING

Effective

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
MODFOLLOWING

Termination

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
MODFOLLOWING

Calculation

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
MODFOLLOWING

Payment

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
MODFOLLOWING

Reset

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
FOLLOWING

Fixing

Бизнес центры
MOSCOW

Конвенция
PRECEDING

Брокер

☐ Дополнительный платеж

Пересчитать

Создать ордер

Отменить

8. На вкладке "Дополнительно" могут быть заполнены опции для тонкой настройки: конвенция stub-период, начало первого процентного периода до даты начала в прошлом, сдвиги LookBack - описание данного функционала приводим в отдельном документе -

<https://fs.moex.com/files/25189/>

☒ Pay Fix/Receive Float
 ☐ Receive Fix/Pay Float

Основное
 Календари
 Дополнительно

Fixed Stream

☐ Начало в прошлом

Дата начала первого периода

Тип нестандартного периода
 Короткий нестандартный период в начале сдел...

Floating Stream

☐ Начало в прошлом

Дата начала первого периода

Сдвиг

Длина сдвига

Тип нестандартного периода
 Короткий нестандартный период в начале сдел...

Смещение фиксинга
 Не применять

Брокер

☐ Дополнительный платеж

NPV	Initial Margin	Market	Limit
25 406,48	43 617,38	---	658 743 013 083,96

Пересчитать

Создать ордер
 Отменить

9. На вкладке "Дополнительно" вы можете внести комментарии к ордеру. Они видны только вам и не доступны вашему контрагенту. Такие заметки могут быть полезными для внутренних подразделений или для автоматической маршрутизации сделки в нужный портфель. Поддерживается кодировка ASCII (русские символы вписать в поле нельзя).

Основное
 Дополнительно
 Платежи
 Чувствительности

Комментарий

0/30

NPV	Initial Margin	Market	Limit
---	---	---	---

Пересчитать

Создать ордер
 Отменить

10. На вкладке "Платежи" показывается сводная информация по всем запланированным платежам для данной сделки. Вы можете формировать порядок столбцов, перетаскивая их зажатием названия столбца левой кнопкой мыши

Создать IRS/OIS

Основное

Дополнительно

Платежи

Периоды

Чувствительности

Дата п... ↑	Сумма платежа	В...	Дисконт фактор	NPV	Курс	Стоимость	+
20.04.2026	-4 970 958,9	RUB	0,962539780522086	-4 784 745,69	1	-4 784 745,69	⋮
20.04.2026	5 762 816,02	RUB	0,962539780522086	5 546 939,67	1	5 546 939,67	⋮
20.07.2026	-5 026 191,78	RUB	0,928600954811606	-4 667 326,49	1	-4 667 326,49	⋮
20.07.2026	5 446 338,42	RUB	0,928600954811606	5 057 475,06	1	5 057 475,06	⋮
19.10.2026	-5 026 191,78	RUB	0,897556080980847	-4 511 289,00	1	-4 511 289,00	⋮
19.10.2026	5 216 447,05	RUB	0,897556080980847	4 682 053,77	1	4 682 053,77	⋮
19.01.2027	-5 081 424,66	RUB	0,869792125689469	-4 419 783,16	1	-4 419 783,16	⋮
19.01.2027	4 872 390,41	RUB	0,869792125689469	4 237 966,81	1	4 237 966,81	⋮
19.04.2027	-4 970 958,9	RUB	0,843567071041118	-4 193 337,24	1	-4 193 337,24	⋮

NPV

Initial Margin

Market

Limit

98 613,32

42 914,37

658 743 086 418,4

Пересчитать

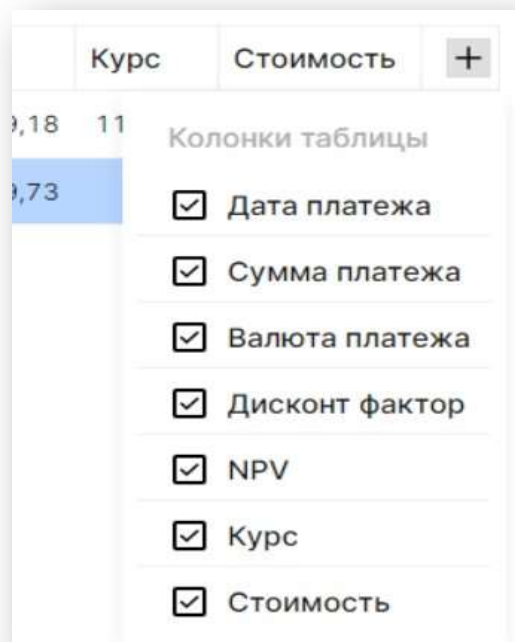
Создать ордер

Отменить

Вы можете выгрузить необходимую информацию в нужном формате, нажав правую кнопку мыши на любом из платежей.



С помощью кнопки "+" вы можете добавлять или убирать необходимую информацию из отчета.



9. На вкладке "Периоды" вы можете посмотреть ожидаемые суммы в разбивке по процентным периодам. Вкладка "We pay" показывает исходящие для вас платежи. Вкладка "We Receive" - входящие. Информация из данных вкладок доступна для загрузки в разные электронные таблицы (например, excel). С помощью кнопки "+" вы можете добавлять или убирать необходимую информацию из отчета. Положение столбцов можно менять с помощью перетаскивания при зажатой левой кнопке мыши.

Создать IRS/OIS

Основное
Дополнительно
Платежи
Периоды
Чувствительности

We Pay
We Receive

Дата	Сумма	Ва...	Ставка	Дата 1	Дата 2	Фиксинг	Доля года	Дней
20.04.2026	-4 970 958,9	RUB						
	-4 970 958,9	RUB	0,1344	20.01.2...	20.04.2026		0,246575	90
20.07.2026	-5 026 191,78	RUB						
	-5 026 191,78	RUB	0,1344	20.04.2...	20.07.2026		0,249315	91
19.10.2026	-5 026 191,78	RUB						
	-5 026 191,78	RUB	0,1344	20.07.2...	19.10.2026		0,249315	91
19.01.2027	-5 081 424,66	RUB						
	-5 081 424,66	RUB	0,1344	19.10.2...	19.01.2027		0,252055	92
19.04.2027	-4 970 958,9	RUB						

NPV
Initial Margin
Market
Limit

19 288,71
40 374,94

658 743 006 901,29

Пересчитать

Создать ордер

Отменить

10. Вкладка "Чувствительности" показывает, как поменяется стоимость сделки при изменении одного из представленных в списке сценариев на 0,0001%. Все значения можно выгрузить в нужный формат с помощью нажатия правой кнопки мыши и использовать для анализа заключаемой сделки.

Создать IRS/OIS

ОсновноеДополнительноПлатежиПериодыЧувствительности

Сценарий	Чувствительности, RUB ↑
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-3Y	-1 778,35
RUB-CBR-KEY-RATE-3M	-907,15
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-1Y	-624,04
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-2Y	-139,84

Риск-фактор	Значение	Сдвиг
CNY-REPO-RATE-1M	0,0004	0,0001

NPVInitial MarginMarketLimit

19 288,7140 374,94---658 743 006 901,29

Пересчитать

Создать ордерОтменить

10. Перед выставлением ордера важно проверить, что NPV (чистая приведенная стоимость) сделки находится в допустимых пределах. В противном случае такой ордер будет автоматически отклонен системой с соответствующим извещением пользователя. Провести расчет NPV и требуемого первоначального обеспечения можно, нажав кнопку "Пересчитать"

NPVInitial MarginMarketLimit

1 856 537,35244 654,26---658 649 515 730,5

Пересчитать

Создать ордерОтменить

11. Для подачи заявки нажмите кнопку «Создать ордер». Для отмены — кнопку «Отменить».
12. Дополнительно у вас будет запрошено итоговое подтверждение перед выставлением ордера. В этот момент вам будут продемонстрированы все параметры будущего ордера. Нажатие кнопки "Подтвердить" приведет к

выставлению заявки. Кнопка "Назад" вернет вас на страницу заполнения заявки.

(!) Обратите внимание. Из-за большого количества параметров, окно подтверждения заявки может не полностью размещаться на вашем рабочем мониторе.

Подтверждение заявки



Вы действительно хотите ввести заявку с данными параметрами?

Продукт	IRS
Счет, на котором зарегистрирована сделка	MF1010000000.RK10100
Режим торгов	Public
Наименование контрагента	NCCB
Валюта CSA	RUB
Направление сделки	Pay Fixed
Дата начала сделки	20.01.2026
Цена	13,44
Базовая валюта	RUB
Сумма	150 000 000
Дата окончания сделки	19.01.2029
Конвенция длительности периодов для первого потока	ACT/ACT (ISDA)
Частота выплат для первого потока	Ежеквартально (3M)
Смещение платежей для первого потока	Не применять
Тип нестандартного периода для первого потока	Короткий нестандартный период в начале сделки
Индекс ставок для второго потока	RUB KeyRate
Конвенция длительности периодов для второго потока	ACT/ACT (ISDA)
Частота выплат для второго потока	Ежеквартально (3M)
Смещение платежей для второго потока	Не применять
Тип нестандартного периода для второго потока	Короткий нестандартный период в начале сделки
Тип нестандартного периода для второго потока	Не применять
Effective конвенция 1 потока	MODFOLLOWING
Termination конвенция 1 потока	MODFOLLOWING
Calculation конвенция 1 потока	MODFOLLOWING
Payment конвенция 1 потока	FOLLOWING
Effective конвенция 2 потока	MODFOLLOWING
Termination конвенция 2 потока	MODFOLLOWING
Calculation конвенция 2 потока	MODFOLLOWING
Payment конвенция 2 потока	MODFOLLOWING
Reset конвенция 2 потока	FOLLOWING
Fixing конвенция 2 потока	PRECEDING

[Назад](#)[Подтвердить](#)

3.4 Сделки ХССУ (Кросс-валютные свопы)

Пример заполненной заявки для сделки Кросс-валютный своп.

Создать ХССУ

ОсновноеДополнительноПлатежиПериодыЧувствительности

Торговый счёт
MF1010000000.RK10100

Код клиента

Режим торгов
Public

Контрагент
NCCB NCCB

CSA
RUB

Валютная пара
CNY/RUB

Курс
11,750000

Начальная дата
26 янв 2026

Дата окончания
25 янв 2030

☒ Pay CNY/Receive RUB☐ Receive CNY/Pay RUB

ОсновноеКалендариДополнительно

CNY Stream

☒ FIXED☐ FLOAT

CNYСумма
1 000 000,00

Фиксированная ставка
8,2500 %

Конвенция
ACT/ACT (ISDA)

Выплаты
Ежеквартально (3М)

Смещение платежей
Не применять

RUB Stream

☒ FIXED☐ FLOAT

RUBСумма
11 750 000,00

Фиксированная ставка
13,0000 %

Конвенция
ACT/ACT (ISDA)

Выплаты
Ежеквартально (3М)

Смещение платежей
Не применять

Брокер

☐ Дополнительный платеж

Создать ордерОтменить

В окне «Создать ХССУ» на вкладке «Основное» укажите:

- Торговый счёт — выберите счёт из выпадающего списка (например, MF1010000000.RK10100).
- Поле «Код клиента» активно только при выборе брокерского торгового счёта. В этом случае выберите из списка бриф-код вашего клиента. Для собственных счетов поле недоступно.

- Режим торгов — при выборе опции «Public», заявка будет видна всем участникам рынка. В поле Контрагент автоматически проставится бриф-код АО НКЦ (NCCB). Любой участник рынка может полностью или частично принять ваш ордер. При выборе опции «Address» будет создана адресная заявка. Она будет видна только указанному в поле «Контрагент» участнику.
 - Контрагент — укажите контрагента, если выбран режим «Address».
 - CSA — валюта обеспечения сделки. В настоящий момент доступна только опция RUB.
 - Валютная пара — выберите из доступных сочетаний CNY, RUB, EUR, USD
 - Курс - отношение между двумя валютами по которому будут рассчитываться платежи на протяжении всей сделки.
 - Начальная дата - дата, с которой начинается расчет денежных потоков по сделке.
 - Дата окончания - дата, в которую заканчивается расчет денежных потоков по сделке.
2. Установите направление сделки в отношении валют выберите одну из двух опций Pay / Receive
3. Укажите для первой ноги:
- Тип ноги - фиксированная (платежи будут рассчитаны по зафиксированной ставке) или плавающая (платежи будут рассчитаны на основе индекса и спреда для данной валюты).
- (!) Обратите внимание.** Хотя бы одна из двух ног для сделки ХССУ должна быть на фиксированную ставку. При необходимости заключить сделку на два плавающих индекса для двух разных валют - необходимо выбрать сделку Basis (ХССУ)

CNY Stream

☐ FIXED
 ☒ FLOAT

CNY

Сумма
 1 000 000,00

Индекс
 RUSFARCNY Comp.

Спред (basis points)

- Номинал ноги - сумма в первой валюте, которая используется в расчете процентных платежей, а также обменивается в начале и конце сделки.
- Фиксированную ставку — на основе данной ставки рассчитываются платежи по фиксированной ноге. Ставка фиксируется на весь срок сделки.
- Или указать Индекс плавающей ставки и спред, при выборе опции Float.
- Конвенцию – параметр, отвечающий за определение количества дней в процентном периоде. Есть возможность выбора одной из четырех опций:
 - 30E/360 - количество дней, истекшее в процентном периоде, рассчитывается на основе года, состоящего из 12 месяцев продолжительностью 30 дней каждый, разделенное на 360. В случае если последний день процентного периода приходится на последний день февраля, за количество дней, истекшее в этом месяце, принимается фактическое количество дней);
 - act/360 - фактическое количество дней, истекшее в процентном периоде, разделенное на 360;
 - act/365 (fixed) - фактическое количество дней, истекшее в процентном периоде, разделенное на 365;
 - act/act (ISDA)
 - (i) фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на действительное число календарных дней в году (365 или 366 дней соответственно);
 - (ii) если части Процентного периода или Периода капитализации приходятся на календарные годы с различным количеством дней (365 и 366 дней соответственно), то начисление процентов за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 365, производится из расчета 365 календарных дней в году, а за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 366, производится из расчета 366 календарных дней в году
- Выплаты (периодичность выплат) - данный параметр отвечает за периодичность выплат. Может принять значения: 1 раз в месяц (1M), 1 раз в квартал (3M), раз в полгода (6M), раз в год (1Y) или в конце сделки (1T)
- Смещение платежей - параметр сдвигает дату платежа на заданное количество рабочих дней в будущее.

4. Укажите для второй ноги сделки:


- Тип ноги - фиксированная (платежи будут рассчитаны по зафиксированной ставке) или плавающая (платежи будут рассчитаны на основе индекса и спреда для данной валюты).
 - (!) **Обратите внимание** - минимум одна из двух ног для сделки ХССУ должна быть на фиксированную ставку. При необходимости заключить сделку на два плавающих индекса для двух разных валют - необходимо выбрать сделку Basis (ХССУ)
 - Конвенцию – параметр, отвечающий за определение количества дней в процентном периоде. Есть возможность выбора одной из четырех опций.
 - Выплаты (периодичность выплат) - данный параметр отвечает за периодичность выплат. Может принять значения: 1 раз в месяц (1M), 1 раз в квартал (3M), раз в полгода (6M), раз в год (1Y) или в конце сделки (1T). Для рублевых процентных свопов на ключевую ставку доступна опция с еженедельной выплатой - 1W.
 - Смещение платежей - параметр сдвигает дату платежа на заданное количество рабочих дней в будущее.
3. При необходимости выберите брокера из выпадающего списка, если сделка, которую вы совершаете, проходит с его участием.
 4. При необходимости вы можете добавить Дополнительный платеж в ордер. В настоящий момент оплата всегда проходит в рублях в T0.

☒ Дополнительный платеж

☐ Receive
 ☒ Pay

Валюта ▼

Сумма

Дата


На вкладке "Календари" вы можете управлять смещением дат при выпадении какого-либо дня на выходной день. С ТКС Сапфир используются четыре опции:

- Следующий рабочий день («Following») – в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день;
- Предшествующий рабочий день («Preceding») – в этом случае днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день;
- Рабочий день в отчетном периоде («Modified Following» или «Modified») – в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день, а если этот ближайший следующий Рабочий день

является днем следующего месяца, то днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день;

- Предыдущий рабочий день в отчетном периоде («Modified Preceding») – в этом случае днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день, а если этот ближайший предшествующий Рабочий день является днем предшествующего месяца, то днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день.

Effective - плановая дата начала сделки

Termination - плановая дата окончания сделки

Calculation - дата для расчета суммы платежа - эти даты определяют периоды расчета

Payment - дата платежа

Reset - дата фиксации значений float ставки для процентного периода.

Fixing - дата расчета значения float ставки при расчете внутри итоговой ставки для процентного периода

The screenshot shows a web interface for configuring a financial instrument. At the top, there are two radio buttons: "Pay CNY/Receive RUB" (selected) and "Receive CNY/Pay RUB". Below this are three tabs: "Основное" (Basic), "Календари" (Calendars), and "Дополнительно" (Additional). The "Календари" tab is active, showing a table with four rows: "Effective", "Termination", "Calculation", and "Payment". Each row has two columns: "Бизнес центры" (Business centers) with the value "Beijing, MOSCOW, SPFI" and "Конвенция" (Convention) with a dropdown menu showing "FOLLOWING". Below the table is a "Брокер" (Broker) dropdown menu. There is a checkbox for "Дополнительный платеж" (Additional payment) which is unchecked. At the bottom, there are four tabs: "NPV", "Initial Margin", "Market", and "Limit". To the right of these tabs are two buttons: "Пересчитать" (Recalculate) and "Создать ордер" (Create order). There is also an "Отменить" (Cancel) button at the bottom right.

8. На вкладке "Дополнительно" могут быть заполнены опции для тонкой настройки: конвенция stub-период, начало первого процентного периода

до даты начала в прошлом, сдвиги LookBack - описание данного функционала приводим в отдельном документе -

<https://fs.moex.com/files/25189/>

NPV	Initial Margin	Market	Limit
146,13	883 432,33	---	658 742 378 810,86

9. На вкладке "Дополнительно" вы можете внести комментарии к ордеру. Они видны только вам и не доступны вашему контрагенту. Такие заметки могут быть полезными для внутренних подразделений или для автоматической маршрутизации сделки в нужный портфель. Поддерживается кодировка ASCII (русские символы вписать в поле нельзя).

NPV	Initial Margin	Market	Limit
---	---	---	---

10. На вкладке "Платежи" показывается сводная информация по всем запланированным платежам для данной сделки. Вы можете формировать порядок столбцов, перетаскивая их зажатием названия столбца левой кнопкой мыши

Создать ХССУ

Основное
Дополнительно
Платежи
Периоды
Чувствительности

Дата п... ↑	Сумма платежа	В...	Дисконт фактор	NPV	Курс	Стоимость	+
26.01.2026	1 000 000	CNY	1,00000830419825	1 000 008,30	11,1531	11 153 192,62	⋮
26.01.2026	-11 750 000	RUB	0,996998084309042	-11 714 727,49	1	-11 714 727,49	⋮
27.04.2026	-20 568,49	CNY	0,994551738044818	-20 456,43	11,1531	-228 152,58	⋮
27.04.2026	380 828,77	RUB	0,959885630526679	365 552,06	1	365 552,06	⋮
27.07.2026	-20 568,49	CNY	0,984379755738861	-20 247,21	11,1531	-225 819,10	⋮
27.07.2026	380 828,77	RUB	0,926175229990267	352 714,17	1	352 714,17	⋮
26.10.2026	-20 568,49	CNY	0,965723774381152	-19 863,48	11,1531	-221 539,38	⋮
26.10.2026	380 828,77	RUB	0,895412806949862	340 998,96	1	340 998,96	⋮
25.01.2027	-20 568,49	CNY	0,936753355300012	-19 267,60	11,1531	-214 893,49	⋮

NPV
Initial Margin
Market
Limit

146,13
883 432,33

658 742 378 810,86

Пересчитать

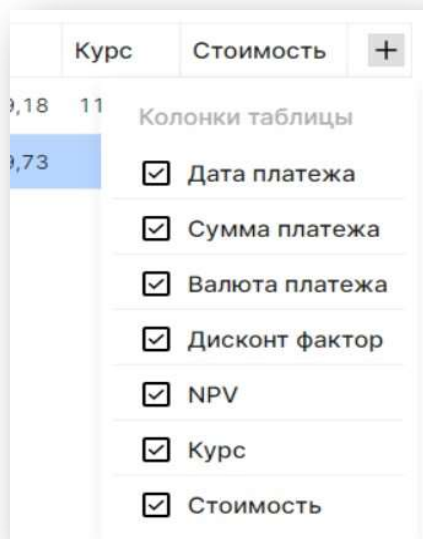
Создать ордер

Отменить

Вы можете выгрузить необходимую информацию в нужном формате, нажав правую кнопку мыши на любом из платежей.



С помощью кнопки "+" вы можете добавлять или убирать необходимую информацию из отчета.



9. На вкладке "Периоды" вы можете посмотреть ожидаемые суммы в разбивке по процентным периодам. Вкладка "We pay" показывает исходящие для вас платежи. Вкладка "We Receive" - входящие. Информация из данных вкладок доступна для загрузки в разные электронные таблицы (например, excel). С помощью кнопки "+" вы можете добавлять или убирать необходимую информацию из отчета. Положение столбцов можно менять с помощью перетаскивания при зажатой левой кнопке мыши.

Создать ХССУ

Основное
Дополнительно
Платежи
Периоды
Чувствительности

We Pay
We Receive

Payment	Дата	Сумма	Валюта	Ставка	Дата 1	Дата 2	Reset	Фиксинг	Др +
Payment	27.04.2026	-20 568,49	CNY						⋮
Calculation		-20 568,49	CNY	0,0825	26.01.2026	27.04.2026			⋮
Payment	27.07.2026	-20 568,49	CNY						⋮
Calculation		-20 568,49	CNY	0,0825	27.04.2026	27.07.2026			⋮
Payment	26.10.2026	-20 568,49	CNY						⋮
Calculation		-20 568,49	CNY	0,0825	27.07.2026	26.10.2026			⋮
Payment	25.01.2027	-20 568,49	CNY						⋮
Calculation		-20 568,49	CNY	0,0825	26.10.2026	25.01.2027			⋮
Payment	26.04.2027	-20 568,49	CNY						⋮

NPV
Initial Margin
Market
Limit

146,13
883 432,33

658 742 378 810,86

Пересчитать

Создать ордер

Отменить

10. Вкладка "Чувствительности" показывает, как поменяется стоимость сделки при изменении одного из представленных в списке сценариев на 0,0001%. Все значения можно выгрузить в нужный формат с помощью нажатия правой кнопки мыши и использовать для анализа заключаемой сделки.

Создать ХССУ

ОсновноеДополнительноПлатежиПериодыЧувствительности

Сценарий	Чувствительности, RUB ↑
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-4Y	-3 123,82
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-6M	-71,53
XCCY-CNY-RUB-1Y	-44,98
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-5Y	-39,74

Риск-фактор	Значение	Сдвиг
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-4Y	0,142	0,0001

NPVInitial MarginMarketLimit

146,13883 432,33---658 742 378 810,86

Пересчитать

Создать ордерОтменить

10. Перед выставлением ордера важно проверить, что NPV (чистая приведенная стоимость) сделки находится в допустимых пределах. В противном случае такой ордер будет автоматически отклонен системой с соответствующим извещением пользователя. Провести расчет NPV и требуемого первоначального обеспечения можно, нажав кнопку "Пересчитать"

NPVInitial MarginMarketLimit

1 856 537,35244 654,26---658 649 515 730,5

Пересчитать

Создать ордерОтменить

11. Для подачи заявки нажмите кнопку «Создать ордер». Для отмены — кнопку «Отменить».
12. Дополнительно у вас будет запрошено итоговое подтверждение перед выставлением ордера. В этот момент вам будут продемонстрированы все параметры будущего ордера. Нажатие кнопки "Подтвердить" приведет к

выставлению заявки. Кнопка "Назад" вернет вас на страницу заполнения заявки.

(!) Обратите внимание. Из-за большого количества параметров, окно подтверждения заявки может не полностью размещаться на вашем рабочем мониторе - попробуйте прокрутить страницу вниз, чтобы точно увидеть весь список параметров будущего ордера.

Подтверждение заявки



Вы действительно хотите ввести заявку с данными параметрами?

Продукт	XCCY
Счет, на котором зарегистрирована сделка	MF1010000000.RK10100
Режим торгов	Public
Наименование контрагента	NCCB
Валютная пара	CNY/RUB
Валюта CSA	RUB
Направление сделки	Buy
Дата начала сделки	26.01.2026
Курс	11,75
Сумма 1	1 000 000
Сумма 2	11 750 000
Дата окончания сделки	25.01.2030
Конвенция длительности периодов для первого потока	ACT/ACT (ISDA)
Частота выплат для первого потока	Ежеквартально (3M)
Смещение платежей для первого потока	+1 рабочий день
Тип нестандартного периода для первого потока	Короткий нестандартный период в начале сделки
Конвенция длительности периодов для второго потока	ACT/ACT (ISDA)
Частота выплат для второго потока	Ежеквартально (3M)
Смещение платежей для второго потока	Не применять
Тип нестандартного периода для второго потока	Короткий нестандартный период в начале сделки
Цена для второго потока	1?
Спред для первого потока	5
Индекс ставок для первого потока	RUSFARCNY Comp.
Тип нестандартного периода для первого потока	Не применять
Effective конвенция 1 потока	FOLLOWING
Termination конвенция 1 потока	FOLLOWING
Calculation конвенция 1 потока	MODFOLLOWING
Payment конвенция 1 потока	FOLLOWING
Reset конвенция 1 потока	MODFOLLOWING
Fixing конвенция 1 потока	PRECEDING
Effective конвенция 2 потока	FOLLOWING
Termination конвенция 2 потока	FOLLOWING
Calculation конвенция 2 потока	FOLLOWING
Payment конвенция 2 потока	FOLLOWING
Сдвиг	4
Идентификатор типа сдвига	Lookback

Назад

Подтвердить

3.5 Сделки BASIS Single Currency (Базисные свопы в одной валюте)

Выставление ордеров по данному продукту возможно для RUB и EUR.

Заполнение заявки аналогично блоку 3.3 данного руководства.

Отличием является возможность указать два плавающих индекса для сделки процентный своп.

Пример заполненной заявки для сделки базисный своп в одной валюте.

Создать BASIS (Single Currency)

Основное

Дополнительно

Платежи

Периоды

Чувствительности

Торговый счёт
MF10100000000.RK10100

Код клиента

Режим торгов
Public

Контрагент
NCCB · NCCB

CSA
RUB

Валюта
RUB

Сумма
15 000 000,00

Начальная дата
20 янв 2026

Дата окончания
20 янв 2031

☐ Pay RusFar RUB O/N/Receive RUSFAR RUB 3m

☒ Receive RusFar RUB O/N/Pay RUSFAR RUB 3m

Основное

Календари

Дополнительно

Floating Stream

Индекс
RusFar RUB O/N

Спред (basis points)

Конвенция
ACT/ACT (ISDA)

Выплаты
Ежемесячно (1M)

Смещение платежей
+1 рабочий день

Floating Stream

Индекс
RUSFAR RUB 3m

Спред (basis points)

Конвенция
ACT/ACT (ISDA)

Выплаты
Ежеквартально (3M)

Смещение платежей
+1 рабочий день

Брокер

☐ Дополнительный платеж

NPV	Initial Margin	Market	Limit
171 813,78	1 973 218,01	---	658 759 745 462,84

Пересчитать

Создать ордер

Отменить

3.6 Сделки BASIS XCCY (Кросс-валютные базисные свопы)

Заполнение заявки аналогично блоку 3.4 данного руководства пользователя.

Отличием является возможность указать два плавающих индекса для сделки кросс-валютный своп.

Пример заполненной заявки для сделки кросс-валютный базисный своп.

Создать BASIS (XCCY)

Основное

Дополнительно

Платежи

Периоды

Чувствительности

Торговый счёт

MF1010000000.RK10100

▼

Код клиента

Режим торгов

Public

▼

Контрагент

NCCB NCCB

▼

CSA

RUB

▼

Валютная пара

CNY/RUB

▼

Курс

11,070000

▼

Начальная дата

20 янв 2026

▼

Дата окончания

29 мая 2030

▼

☒ Pay CNY/Receive RUB
 ☐ Receive CNY/Pay RUB

Основное

Календари

Дополнительно

CNY Floating Stream

CNY

Сумма

1 500 000,00

▼

Индекс

RUSFARCNY Comp.

▼

Спред (basis points)

-15

▼

Конвенция

ACT/ACT (ISDA)

▼

Выплаты

Ежемесячно (1M)

▼

Смещение платежей

+1 рабочий день

▼

RUB Floating Stream

RUB

Сумма

16 605 000,00

▼

Индекс

RUB KeyRate

▼

Спред (basis points)

550

▼

Конвенция

ACT/ACT (ISDA)

▼

Выплаты

Каждые полгода (6M)

▼

Смещение платежей

+1 рабочий день

▼

Брокер

▼

☐ Дополнительный платеж

NPV	Initial Margin	Market	Limit
2 833 801,71	4 451 674,38	---	658 761 560 379,53

Пересчитать

Создать ордер

Отменить

3.7 Сделки Cap/Floor (Опционы на процентные ставки)

Пример заполненной заявки для опционной сделки на процентные ставки

Создать CAP / Floor

Основное Дополнительно Платежи Периоды Чувствительности

Торговый счёт
MF1010000000.RK10100

Код клиента

Режим торгов
Address

Контрагент
MF1330000000 MF1330000000

CSA
RUB

Валюта
RUB

Сумма
150 000 000,00

Начальная дата
20 янв 2026

Дата окончания
20 окт 2026

Тип сделки
Floor

Значение минимальной ставки
14,7500 %

☒ Buy ☐ Sell

Основное Календари Дополнительно

Тип премии

Running-премия

Фиксированная ставка
0,2070 %

Конвенция
ACT/ACT (ISDA)

Выплаты
В конце периода (1T)

Смещение платежей
Не применять

Floating Stream

Индекс
RUB KeyRate

Спред (bp)

Конвенция
ACT/ACT (ISDA)

Выплаты
Ежегодно (1Y)

Смещение платежей
Не применять

Брокер

☐ Дополнительный платеж

NPV	Initial Margin	Market	Limit
708,46	149 379,3	---	658 775 591 156,32

Пересчитать

Создать ордер Отменить

В окне «Создать Cap/Floor» на вкладке «Основное» укажите:

- Торговый счёт — выберите счёт из выпадающего списка (например, MF1010000000.RK10100).
- Поле «Код клиента» активно только при выборе брокерского торгового счёта. В этом случае выберите из списка бриф-код вашего клиента. Для собственных счетов поле недоступно.
- Режим торгов — при выборе опции «Public», заявка будет видна всем участникам рынка. В поле Контрагент автоматически проставится бриф-код АО НКЦ (NCCB). Любой участник рынка может полностью или частично принять ваш ордер. При выборе опции «Address» будет создана адресная заявка. Она будет видна только указанному в поле «Контрагент» участнику.
- Контрагент — укажите контрагента, если выбран режим «Address».
- CSA — валюта обеспечения сделки. В настоящий момент доступна только опция RUB.
- Валюта — в настоящий момент доступны сделки в рублях РФ.

- Сумма - номинал сделки, по которому будут рассчитываться значения всех денежных потоков. Обмен номиналами в сделках Cap/Floor не предусмотрен. Только денежные потоки, рассчитанные на его основе.
- Начальная дата - дата, с которой начинается расчет денежных потоков по сделке.
- Дата окончания - дата, в которую заканчивается расчет денежных потоков по сделке.
- Тип сделки - Cap (оплата по опционной ноге происходит при превышении значения страйка) или Floor (оплата по опционной ноге происходит, если ставка уходит ниже страйка).
- Значение максимальной / минимальной ставки - страйк для сделки, выраженный в процентах.

2. Установите направление сделки: выберите Buy/Sell. Покупатель опциона платит второй стороне премии и получает платежи в случаях превышения (для сделок Cap) или при значениях ниже (для сделок Floor) установленного страйка

3. Укажите для премиальной ноги:

- Фиксированную ставку Running-премии — на основе данной ставки рассчитываются платежи по премиальной ноге. Данное значение %-ставки фиксируется на весь срок сделки.
- Конвенцию – параметр, отвечающий за определение количества дней в процентном периоде.
- Выплаты (периодичность выплат) - данный параметр отвечает за периодичность выплат премии. Может принять значения: 1 раз в месяц (1M), 1 раз в квартал (3M), раз в полгода (6M), раз в год (1Y) или в конце сделки (1T)
- Смещение платежей - параметр сдвигает дату платежа на заданное количество рабочих дней в будущее.

4. Укажите для опционной ноги (Floating Stream):

- Индекс — на основе данной ставки рассчитываются платежи по плавающей ноге. Ставка рассчитывается в определенные дни (дни фиксинга ставки) и сравнивается со значением страйка. Выплата происходит при превышении зафиксированного значения над заданным страйком для сделок Cap. Или при зафиксированном значении меньше страйка для сделок Floor/
- Спред - фиксированное значение в базисных пунктах, которое в зависимости от значения прибавляется или вычитается из зафиксированного значения плавающей ставки. Используется при расчете сумм платежей по плавающей ноге сделки.

- Конвенцию – параметр, отвечающий за определение количества дней в процентном периоде. Есть возможность выбора одной из четырех опций
 - Выплаты (периодичность выплат) - данный параметр отвечает за периодичность выплат. Может принять значения: 1 раз в месяц (1M), 1 раз в квартал (3M), раз в полгода (6M), раз в год (1Y) или в конце сделки (1T). Для рублевых процентных свопов на ключевую ставку доступна опция с еженедельной выплатой - 1W.
 - Смещение платежей - параметр сдвигает дату платежа на заданное количество рабочих дней в будущее.
5. При необходимости выберите брокера из выпадающего списка, если сделка, которую вы совершаете, проходит с его участием.
6. При необходимости вы можете добавить Дополнительный платеж в ордер. В настоящий момент оплата всегда проходит в рублях в T0.

☒ Дополнительный платеж

☐ Receive
 ☒ Pay

Валюта

Сумма

Дата

7. На вкладке "Календари" вы можете управлять смещением дат при выпадении какого-либо дня на выходной день. В ТКС Сапфир используются четыре опции:
- Следующий рабочий день («Following») – в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день;
 - Предшествующий рабочий день («Preceding») – в этом случае днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день;
 - Рабочий день в отчетном периоде («Modified Following» или «Modified») – в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день, а если этот ближайший следующий Рабочий день является днем следующего месяца, то днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день;
 - Предыдущий рабочий день в отчетном периоде («Modified Preceding») – в этом случае днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день, а если этот ближайший предшествующий Рабочий день является днем предшествующего месяца, то днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день.

Effective - плановая дата начала сделки

Termination - плановая дата окончания сделки

Calculation - дата для расчета суммы платежа - эти даты определяют периоды расчета

Payment - дата платежа

Reset - дата фиксации значений float ставки для процентного периода.

Fixing - дата расчета значения float ставки при расчете внутри итоговой ставки для процентного периода

☒ Buy

☐ Sell

Основное

Календари

Дополнительно

Effective

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
FOLLOWING

Termination

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
FOLLOWING

Calculation

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
FOLLOWING

Payment

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
FOLLOWING

Effective

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
FOLLOWING

Termination

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
FOLLOWING

Calculation

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
MODFOLLOWING

Payment

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
FOLLOWING

Reset

Бизнес центры
MOSCOW, SPFI

Конвенция
MODFOLLOWING

Fixing

Бизнес центры
MOSCOW

Конвенция
PRECEDING

Брокер

☐ Дополнительный платеж

NPV	Initial Margin	Market	Limit	
708,46	149 379,3	---	658 775 591 156,32	Пересчитать

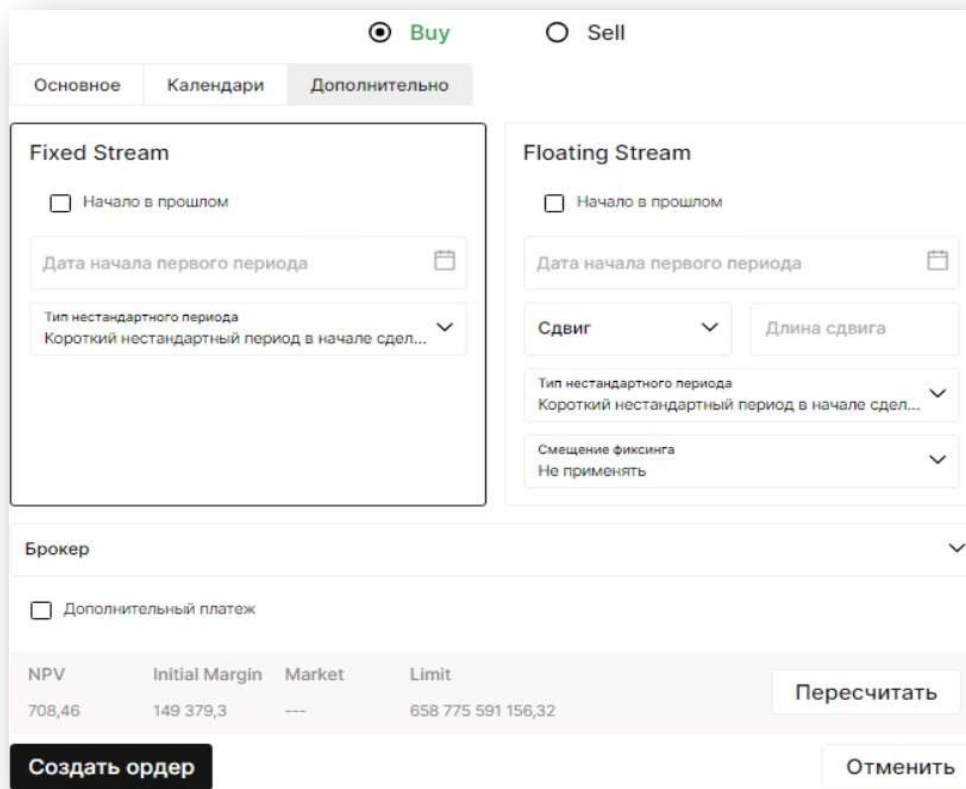
Создать ордер

Отменить

8. На вкладке "Дополнительно" могут быть заполнены опции для тонкой настройки: конвенция stub-период, начало первого процентного периода

до даты начала в прошлом, сдвиги LookBack - описание данного функционала приводим в отдельном документе -

<https://fs.moex.com/files/25189/>



Buy Sell

Основное Календари **Дополнительно**

Fixed Stream

☐ Начало в прошлом

Дата начала первого периода

Тип нестандартного периода
Короткий нестандартный период в начале сдел...

Floating Stream

☐ Начало в прошлом

Дата начала первого периода

Сдвиг Длина сдвига

Тип нестандартного периода
Короткий нестандартный период в начале сдел...

Смещение фиксинга
Не применять

Брокер

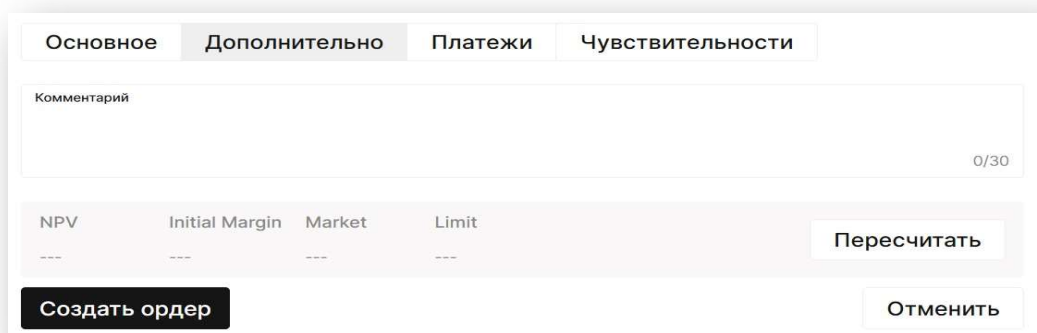
☐ Дополнительный платеж

NPV	Initial Margin	Market	Limit
708,46	149 379,3	---	658 775 591 156,32

Пересчитать

Создать ордер Отменить

9. На вкладке "Дополнительно" вы можете внести комментарии к ордеру. Они видны только вам и не доступны вашему контрагенту. Такие заметки могут быть полезными для внутренних подразделений или для автоматической маршрутизации сделки в нужный портфель. Поддерживается кодировка ASCII (русские символы вписать в поле нельзя).



Основное **Дополнительно** Платежи Чувствительности

Комментарий

0/30

NPV	Initial Margin	Market	Limit
---	---	---	---

Пересчитать

Создать ордер Отменить

10. На вкладке "Платежи" показывается сводная информация по всем запланированным платежам для данной сделки. Платежи по плавающей

ноге рассчитываются с учетом вероятности превышения / значений ниже в сравнении со страйком.

Вы можете формировать порядок столбцов перетаскивая их зажатием названия столбца левой кнопкой мыши

Создать CAP / Floor

Основное	Дополнительно	Платежи	Периоды	Чувствительности
----------	---------------	---------	---------	------------------

Дата п... ↑	Сумма платежа	В...	Дисконт фактор	NPV	Курс	Стоимость	+
20.10.2026	-232 236,99	RUB	0,897616480718219	-208 459,75	1	-208 459,75	⋮
20.10.2026	233 026,26	RUB	0,897616480718219	209 168,21	1	209 168,21	⋮

NPV	Initial Margin	Market	Limit
708,46	149 379,3	---	658 775 591 156,32

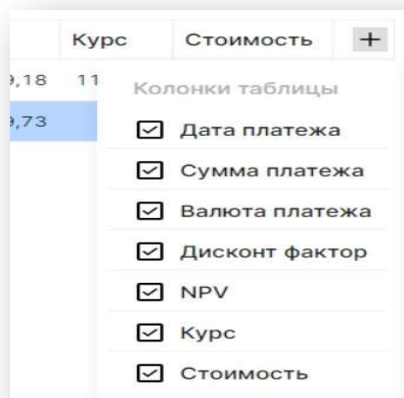
Создать ордер **Пересчитать** **Отменить**

Вы можете выгрузить необходимую информацию в нужном формате, нажав правую кнопку мыши на любом из платежей.

13.01.2031	-1 117 170	RUB	0.515140693701
------------	------------	-----	----------------

 **Экспорт в Excel**
Экспорт в csv
Экспорт в xml

С помощью кнопки "+" вы можете добавлять или убирать необходимую информацию из отчета.



9. На вкладке "Периоды" вы можете посмотреть ожидаемые суммы в разбивке по процентным периодам. Вкладка "We pay" показывает исходящие для вас платежи. Вкладка "We Receive" - входящие. Информация из данных вкладок доступна для загрузки в разные электронные таблицы (например, excel). С помощью кнопки "+" вы можете добавлять или убирать необходимую информацию из отчета. Положение столбцов можно менять с помощью перетаскивания при зажатой левой кнопке мыши.

Создать CAP / Floor

Основное
Дополнительно
Платежи
Периоды
Чувствительности

We Pay
We Receive

Payment	Дата	Сумма	Валюта	Ставка	Дата 1	Дата 2	Reset	Фикс
Payment	20.10.2026	-232 236,99	RUB					
Calculation		-232 236,99	RUB	0,00207	20.01.2026	20.10.2026		

NPV
708,46

Initial Margin
149 379,3

Market

Limit
658 775 591 156,32

Пересчитать

Создать ордер

Отменить

10. Вкладка "Чувствительности" показывает, как поменяется стоимость сделки при изменении одного из представленных в списке сценариев на 0,0001%.

Все значения можно выгрузить в нужный формат с помощью нажатия правой кнопки мыши и использовать для анализа заключаемой сделки.

The screenshot shows the 'Создать CAP / Floor' form with the 'Чувствительности' (Sensitivities) tab selected. The form includes a table for sensitivities, a risk factor table, and a summary table at the bottom.

Сценарий	Чувствительности, RUB ↑
RUB-CBR-KEY-RATE-9M	-95,84
RUB-CBR-KEY-RATE-6M	-7,33
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-3M	-3,39
RUB-CBR-KEY-RATE-1Y	-2,42

Риск-фактор	Значение	Сдвиг
CNY-REPO-RATE-1M	0,0004	0,0001

NPV	Initial Margin	Market	Limit
708,46	149 379,3	---	658 775 591 156,32

Buttons: **Создать ордер**, **Пересчитать**, **Отменить**

10. Перед выставлением ордера важно проверить, что NPV (чистая приведенная стоимость) сделки находится в допустимых пределах. В противном случае такой ордер будет автоматически отклонен системой с соответствующим извещением пользователя. Провести расчет NPV и требуемого первоначального обеспечения можно, нажав кнопку "Пересчитать"

This is a close-up of the bottom section of the form, showing the NPV and Initial Margin values, and the buttons to calculate or create the order.

NPV	Initial Margin	Market	Limit
708,46	149 379,3	---	658 775 591 156,32

Buttons: **Создать ордер**, **Пересчитать**, **Отменить**

11. Для подачи заявки нажмите кнопку «Создать ордер». Для отмены — кнопку «Отменить».
12. Дополнительно у вас будет запрошено итоговое подтверждение перед выставлением ордера. В этот момент вам будут продемонстрированы все параметры будущего ордера. Нажатие кнопки "Подтвердить" приведет к выставлению заявки. Кнопка "Назад" вернет вас на страницу заполнения заявки.

(!) Обратите внимание. Из-за большого количества параметров, окно подтверждения заявки может не полностью размещаться на вашем рабочем мониторе

Подтверждение заявки



Вы действительно хотите ввести заявку с данными параметрами?

Продукт	Floor
Счет, на котором зарегистрирована сделка	MF1010000000.RK10100
Режим торгов	Address
Наименование контрагента	MF1330000000
Валюта CSA	RUB
Направление сделки	Pay Fixed
Дата начала сделки	20.01.2026
Цена	0.207
Базовая валюта	RUB
Сумма 1	150 000 000
Дата окончания сделки	20.10.2026
Конвенция длительности периодов для первого потока	ACT/ACT (ISDA)
Частота выплат для первого потока	В конце периода (1T)
Смещение платежей для первого потока	Не применять
Тип нестандартного периода для первого потока	Короткий нестандартный период в начале сделки
Индекс ставок для второго потока	RUB KeyRate
Конвенция длительности периодов для второго потока	ACT/ACT (ISDA)
Частота выплат для второго потока	Ежегодно (1Y)
Смещение платежей для второго потока	Не применять
Тип нестандартного периода для второго потока	Короткий нестандартный период в начале сделки
Тип нестандартного периода для второго потока	Не применять
Effective конвенция 1 потока	FOLLOWING
Termination конвенция 1 потока	FOLLOWING
Calculation конвенция 1 потока	FOLLOWING
Payment конвенция 1 потока	FOLLOWING
Effective конвенция 2 потока	FOLLOWING
Termination конвенция 2 потока	FOLLOWING
Calculation конвенция 2 потока	MODFOLLOWING
Payment конвенция 2 потока	FOLLOWING
Reset конвенция 2 потока	MODFOLLOWING
Fixing конвенция 2 потока	PRECEDING
Страйк	14.7500 %

Назад

Подтвердить

4. Работа с разделом "Ордера"

4.1 Стаканные инструменты

Стаканные инструменты предназначены для торговли стандартизированными контрактами в безадресном режиме.

Каждый стакан представляет собой инструмент с заранее определенным набором параметров (срок, базовый актив, валюта и т.д.).

Более подробно с зафиксированными параметрами можно ознакомиться в специальной памятке - <https://www.moex.com/ru/documents/21628>

- Просмотр списка стаканов инструментов

1. В левой панели навигации в блоке «Ордера» выберите раздел «Стаканы».
2. Откроется окно «Стаканы», в котором отображается перечень доступных инструментов. *

- **Тикер:** Краткое описание инструмента.
- **Продукт:** Тип инструмента (например, FX Swap или Cap).
- **Покупка / Продажа:** Лучшая цена на покупку и продажу, если в стакане есть активные заявки.

- Фильтр списка

Для фильтрации списка инструментов по значениям в колонке, нажмите на иконку в ее заголовке, выберите условие (например, «равно», «больше») и введите значение для сравнения.

Стаканы			
Тикер	Продукт	Покупка	Продажа
FX SWAP 2W CNYRUB	FX Swap	равно ✓ 1	110
FX SWAP 1M CNYRUB	FX Swap	не равно	
FX SWAP 2M CNYRUB	FX Swap	больше	
FX SWAP 3M CNYRUB	FX Swap	не меньше	
CAP 1W RUONIA R 10	Cap	меньше	
CAP 1W RUONIA R 10.25	Cap	не больше	
CAP 1W RUONIA R 10.5	Cap		
CAP 1W RUONIA R 10.75	Cap		

- Работа в стакане

1. Для перехода в конкретный стакан, дважды нажмите левой кнопкой мыши на строку с нужным инструментом.
2. Откроется окно, заголовок которого соответствует тикеру инструмента. В окне отображаются два списка ордеров: на покупку (Bid) и на продажу (Ask). Каждый список содержит колонки «Цена» и «Объем».

Для валютных (FX) инструментов цена указывается в пунктах.

FX SWAP 2W CNYRUB

Bid	Цена	↓	Ask	+
		110	120 000	⋮
1 000 000	11			⋮

Для процентных (IR) инструментов цена указывается в процентах.

OIS 6M RUONIA				
Bid	Цена	↓	Ask	+
		15.8800%	1 000 000	⋮
		15.8690%	1 000 000	⋮
1 000 000	15.8000%			⋮

Выставление заявки в стакан

1. В окне стакана нажмите правой кнопкой мыши на пустом месте и в контекстном меню выберите «Создать».
2. В открывшемся окне «Создать [Название инструмента]» укажите направление, цену и объем в поле «Сумма». Все остальные параметры для стаканых заявок зафиксированы.
3. Нажмите кнопку «Создать ордер». Заявка будет размещена в стакане.

Прием заявки из стакана

1. В окне стакана нажмите правой кнопкой мыши на заявке, которую хотите принять, и в контекстном меню выберите «Принять».
2. Откроется окно для ввода параметров сделки. Вы можете:
 - **Принять заявку полностью.** Для этого нужно оставить объем в поле «Сумма» без изменений.
 - **Принять заявку частично.** Для этого нужно указать в поле «Сумма» объем, который меньше объема выбранной заявки.
 - **Выставить встречную заявку с частичным исполнением.** Для этого указать в поле «Сумма» объем, превышающий объем выбранной заявки. В

этом случае сделка будет заключена на объем исходной заявки, а превышение будет выставлено в стакан как новая заявка с вашей стороны.

3. Нажмите кнопку «Принять ордер».
4. Откроется окно для итогового *подтверждения со всеми параметрами будущей сделки*. Для завершения операции нажмите «Подтвердить». * Для отмены и возврата в предыдущее окно нажмите «Назад».

(!) Обратите внимание. Каждая сделка, включая частичное исполнение одного ордера, тарифицируется отдельно.

Пример: если вы исполните одну заявку на 50 000 руб. пятью заявками по 10 000 руб., комиссия будет списана за пять отдельных сделок.

4.2 Активные Ордера

В блоке «Ордера» на левой панели навигации находятся разделы для просмотра и управления всеми типами заявок.

В разделе Активные ордера отображаются все ваши заявки, которые в данный момент активны на рынке.

1. В левой панели навигации в блоке «Ордера» выберите раздел «Активные».
2. Откроется окно «Ордера» со списком ваших заявок. В таблице указаны: тикер, продукт, направление, цена, сумма и статус ордера.

Действия с активным ордером:

- **Изменение ордера:** не предусмотрено. Для внесения правок в выставленную заявку вам необходимо отменить ее и далее выставить ордер с нужными параметрами.
- **Снятие ордера:**
 1. Нажмите правой кнопкой мыши на ордере, который хотите отменить, и выберите «Снять».
 2. В окне подтверждения «Снятие ордера» нажмите «Да».

4.3 Входящие. Адресные

В этом разделе отображаются заявки, направленные другими участниками торгов непосредственно вам.

1. В левой панели навигации в блоке «Ордера» выберите раздел «Входящие.Адресные».
2. Откроется окно «Входящие ордера» со списком заявок. В таблице дополнительно указывается контрагент, выставивший ордер.

Действия с входящим адресным ордером:

- **Принятие ордера:**

1. Нажмите правой кнопкой мыши на ордере и выберите «Принять».
2. Дальнейший процесс полностью аналогичен приему заявки из стакана (см. п. 5.2).

Вы можете принять заявку полностью или частично.

- **Отклонение входящего ордера не предусмотрено.**

Входящие ордера. Адресные									
Ордер	Дата регистрации	Контрагент	Продукт	Инструмент	Направление	Цена	Курс	Срок	+
15 433	20.01.2026 15:41:37	MF1920000000	OIS	OIS TOM/52D RUSFARCNY Comp.	Receive Fixed	2.0000%		51D	⋮
15 432	20.01.2026 15:36:37	MF1920000000	XCCY	XCCY TOM/3M CNY/RUONIA Comp.	Buy	1.0000%	11,160000	3M	⋮
15 419	20.01.2026 14:25:29	MF2222200000	FX Fwd	FX Fwd CNY/RUB 9D	Buy	11.14578		9D	⋮

4.4 Входящие. Безадресные

В этом разделе отображается единый список всех обезличенных заявок, активных в данный момент на рынке по всем инструментам.

1. В левой панели навигации в блоке «Ордера» выберите раздел «Входящие.Безадресные».
2. Откроется окно «Входящие ордера» со списком всех безадресных заявок.
3. Для заключения сделки нажмите правой кнопкой мыши на интересующей вас заявке и выберите «Принять». Процесс принятия заявки полностью аналогичен описанному в п. 5.2.

Пример вкладки.

Входящие ордера. Безадресные										
Ордер	Дата регистрации	Продукт	Инструмент	Направление	Цена	Курс	Срок	Дата 1	Дата 2	+
15 431	20.01.2026 14:59:32	FX Swap	FX Swap CNY/RUB TOM/35D	Sell/Buy	100	11,145780	1M	21.01.2026	24.02.2026	⋮
15 430	20.01.2026 14:59:09	FX Swap	FX Swap CNY/RUB TOM/35D	Sell/Buy	100	11,145780	1M	21.01.2026	24.02.2026	⋮
15 417	20.01.2026 13:13:38	OIS	OIS TOM/6M RUONIA Comp.	Pay Fixed	15.8000%		6M	21.01.2026	21.07.2026	⋮
15 416	20.01.2026 13:13:28	OIS	OIS TOM/6M RUONIA Comp.	Receive Fixed	15.8690%		6M	21.01.2026	21.07.2026	⋮
15 415	20.01.2026 13:09:12	FX Swap	FX Swap CNY/RUB TOM/2W	Buy/Sell	110	11,145780	2W	21.01.2026	04.02.2026	⋮
15 413	20.01.2026 13:08:51	FX Swap	FX Swap CNY/RUB TOM/2W	Sell/Buy	11	11,145780	2W	21.01.2026	04.02.2026	⋮

4.5 Архив заказов

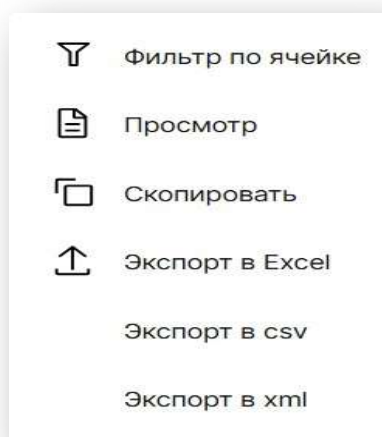
Архив заказов содержит в себе полный перечень заказов, которые были выставлены вами и их текущий статус (в данный раздел в том числе попадают заказы в активном статусе).




Наверху экрана находится фильтр по датам, который можно использовать для загрузки нужной информации. Все данные из этого представления можно загрузить в электронную таблицу, нажав правой кнопкой мыши на любой строке.

Двукратное нажатие на любой из строк позволит вам перейти внутрь конкретного заказа.

Из данного представления можно снимать активные заказы и создавать копии необходимых заявок с помощью контекстного меню, вызываемого правой кнопкой мыши.

Примеры вкладок.



Архив заказов 							
С даты 05 янв 2026 		До даты 20 янв 2026 					
Заказ	Дата регистрации	Владелец	Клиент	Контрагент	Продукт	Инструмент	Направление
15 411	19.01.2026 13:29:13	MF1010000000		MF1020000000	OIS	OIS TOD/3M RUONIA Avg.	Receive Fixed
15 410	19.01.2026 13:28:28	MF1010000000		MF1020000000	OIS	OIS TOD/2M RUONIA Avg.	Receive Fixed
15 409	19.01.2026 13:27:50	MF1010000000		MF1020000000	OIS	OIS TOD/2M RUONIA Avg.	Receive Fixed
15 408	19.01.2026 13:27:11	MF1010000000		MF1020000000	IRS	IRS TOD/3M RUB KeyRate	Pay Fixed
15 407	19.01.2026 13:26:33	MF1010000000		MF1020000000	IRS	IRS TOD/3M RUB KeyRate	Pay Fixed
15 406	19.01.2026 13:25:57	MF1010000000		MF1020000000	OIS	OIS TOD/3M RUONIA Avg.	Pay Fixed
15 405	19.01.2026 13:25:16	MF1010000000		MF1020000000	OIS	OIS TOD/3M RUONIA Avg.	Pay Fixed
15 404	19.01.2026 13:24:33	MF1010000000		MF1020000000	OIS	OIS TOD/2M RUONIA Avg.	Pay Fixed
15 403	19.01.2026 13:23:26	MF1010000000		MF1020000000	IRS	IRS TOD/1M RUB KeyRate	Pay Fixed
15 402	19.01.2026 13:22:22	MF1010000000		MF1020000000	IRS	IRS TOD/2M RUB KeyRate	Pay Fixed
15 401	19.01.2026 12:57:42	MF1010000000		MF1020000000	IRS	IRS TOD/2M RUB KeyRate	Pay Fixed
15 400	19.01.2026 12:56:51	MF1010000000		MF1020000000	IRS	IRS TOD/2M RUB KeyRate	Pay Fixed

5. Работа с разделом "Позиция"

5.1 Балансы

В таблице отображаются остатки по каждому из выбранных счетов, а также плановые значения платежей, ожидаемых в текущий день. Для выгрузки данных нажмите правой кнопкой мыши на любую строку таблицы и выберите пункт «Экспорт». Данные будут сохранены в формате, совместимом с электронными таблицами.

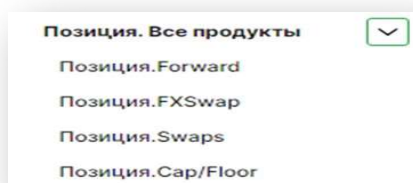
Балансы											
Расчётные коды											
Участник	Расчётный код	Входный	Текущий	Единый лимит	Требования к обеспечению	Платежи сегодня	Исходящий	Плановая ДМ	Ввод/вывод средств	Текущая переоценка	Риск-неттинг
MF1010000000	10100	659 938 835 266,12	659 938 684 096,04	0,00	0,00	0,00	659 937 737 696,41	-946 399,63	-151 170,08	-946 399,61	0,00
		659 938 835 266,12	659 938 684 096,04	0,00	0,00	0,00	659 937 737 696,41	-946 399,63	-151 170,08	-946 399,61	0,00
Активы											
Актив	Входный	Зачисления/списания	Текущий	Цена	Оценка	Плановая ДМ	Планируемые платежи	Баланс по итогам клиринга	Макс. сумма вывода		
	0,00	0,00	0,00	98,450000	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		
RUB	668 078 230 453,29	-151 170,08	668 078 079 283,21	1,000000	-3 887 872,07	-946 399,63	0,00	668 078 079 283,21	0,00		
CNY	-31 156 219,98	0,00	-31 156 219,98	11,147610	0,00	0,00	0,00	-31 156 219,98	0,00		
USD	-99 817 089,17	0,00	-99 817 089,17	77,919200	0,00	0,00	0,00	-99 817 089,17	0,00		
EUR	-158 013,05	0,00	-158 013,05	91,195400	0,00	0,00	0,00	-158 013,05	0,00		
KZT	0,00	0,00	0,00	0,150915	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		

5.2 Подраздел "Позиция. Все продукты"

В подразделе «Позиция. Все продукты» отображаются все открытые позиции по всем типам инструментов. Для фильтрации по конкретному продукту нажмите стрелку вправо рядом с названием раздела. Откроется список доступных инструментов: FX Fwd, FX Swap, IRS/OIS, XCCY, BASIS (Single Currency), BASIS (XCCY), Cap/Floor. Выберите нужный инструмент, чтобы отобразить только позиции по нему. Таблица содержит столбцы: инструмент, направление, номинал, валюта, валюта расчета, статус, накопленная сумма и текущая рыночная стоимость. Данные обновляются в реальном времени.

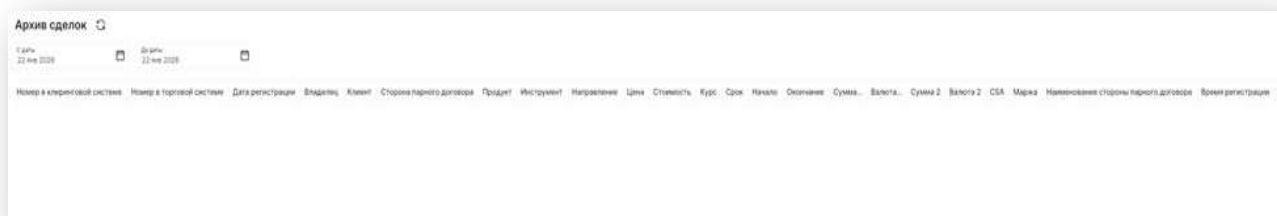
Позиция. Все продукты																
Номер в клиентской системе	Номер в торговой системе	Дата регистрации	Владелец	Клиент	Статус	Направление	Продукт	Направление	Цена	Стоимость	Валюта	Срок	Начало	Окончание	Сумма 1	Сумма 2
4 538	4 538	21.01.2028	MF1010000000	MF1020000000	ИССУ	ИССУ	ИССУ	ИССУ	1,000000	-1 911 831,870000	USD	480	22.01.2028	12.02.2028	100 000 000,00	CNY
4 575	4 575	19.10.2025	MF1010000000	ИССУ	ИССУ	ИССУ	ИССУ	ИССУ	5,000000	-183 696,190000	USD	1080	19.10.2025	12.04.2028	150 000,00	CNY
3 844	3 844	24.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	2,800000	1 864,180000	USD	101	24.10.2025	24.10.2025	15 000,00	RUB
3 824	3 824	24.10.2025	MF1010000000	Фью	Фью	Фью	Фью	Фью	2,800000	46,180000	USD	31	27.10.2025	27.10.2025	1 000,00	RUB
3 831	3 831	24.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	0,00825	-138,870000	USD	91	27.10.2025	27.10.2025	1 000 000,00	RUB
3 888	3 888	26.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	0,27045	-229 086,190000	USD	10280	26.10.2025	26.10.2025	120 000 000,00	RUB
3 906	3 906	24.10.2025	MF1010000000	Фью	Фью	Фью	Фью	Фью	2,800000	46,180000	USD	11270	27.10.2025	27.10.2025	1 000,00	RUB
3 905	3 905	24.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	0,00825	-138,870000	USD	91	27.10.2025	27.10.2025	1 000 000,00	RUB
3 488	3 488	23.10.2025	MF1010000000	ИССУ	ИССУ	ИССУ	ИССУ	ИССУ	15,000000	84 912,780000	USD	884	24.10.2025	24.04.2028	11 000 000,00	RUB
3 880	3 880	26.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	0,27045	-229 086,190000	USD	81	26.10.2025	26.10.2025	1 000 000,00	RUB
4 598	4 598	14.11.2025	MF1010000000	Фью	Фью	Фью	Фью	Фью	6,82225	-160,820000	USD	384	17.11.2025	17.02.2026	500 000,00	RUB
3 294	3 294	23.10.2025	MF1010000000	ИССУ	ИССУ	ИССУ	ИССУ	ИССУ	15,000000	7 289 163,890000	USD	384	24.10.2025	24.01.2028	3 000 000,00	CNY
3 876	3 876	24.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	0,000000	-11,450000	USD	31	26.10.2025	26.10.2025	10 000,00	RUB
3 247	3 247	21.10.2025	MF1010000000	Фью	Фью	Фью	Фью	Фью	6,000000	-12 184 272,760000	USD	41	22.10.2025	22.10.2025	8 000 000,00	RUB
3 295	3 295	21.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	6,000000	100,780000	USD	384	22.10.2025	22.01.2026	9 000,00	RUB
3 244	3 244	21.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	6,000000	2 287,780000	USD	384	22.10.2025	22.01.2026	114 000,00	RUB
3 243	3 243	21.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	6,000000	2 000,880000	USD	384	22.10.2025	22.01.2026	102 000,00	RUB
3 240	3 240	21.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	6,000000	16 802,870000	USD	384	22.10.2025	22.01.2026	784 000,00	RUB
3 236	3 236	20.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	10,16795	-11 874,870000	USD	384	21.10.2025	21.01.2026	77 000,00	RUB
3 230	3 230	20.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	10,16795	6,000000	USD	384	21.10.2025	21.01.2026	131 312,37	RUB
3 231	3 231	20.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	10,16795	-22 284,110000	USD	384	21.10.2025	21.01.2026	868 919,19	RUB
3 228	3 228	20.10.2025	MF1010000000	Сар	Сар	Сар	Сар	Сар	10,16795	6,000000	USD	384	21.10.2025	21.01.2026	63 542,21	RUB

В ТКС Сапфир есть возможность настраивать отдельные представления для конкретных инструментов. Для этого нужно нажать на стрелочку рядом с названием подраздела меню – это действие раскроет меню с разбивкой на конкретные инструменты. В каждой из таких областей можно создать удобное пространство.






5.3 Архив сделок

Здесь отображается полный список всех заключенных сделок, отсортированный по дате заключения. Для фильтрации по дате используйте поля ввода в верхней части окна: укажите начальную и конечную даты. Для просмотра деталей сделки дважды щелкните левой кнопкой мыши по строке. Для выгрузки данных нажмите правой кнопкой мыши на любую строку и выберите «Экспорт». В выгружаемом файле содержатся все параметры сделки, включая контрагента, валютную пару, сумму, курс, дату исполнения и статус.




5.4 Платежи

В подразделе «Платежи» отображаются все денежные потоки, запланированные на текущий рабочий день, с привязкой к конкретным сделкам. Столбцы таблицы включают: дату платежа, тип платежа (получение/платеж), сумму, валюту, номер сделки, инструмент и контрагента. В настоящий момент данные по платежам на будущие и прошлые даты в этом разделе не отображаются. Эта информация скоро будет доступной для вас. Для выгрузки списка платежей нажмите правой кнопкой мыши на любую строку и выберите «Экспорт».

Платежи 							
С даты 22 янв 2026 		До даты 23 янв 2026 					
Тикет	Сумма платежа	Валюта платежа	Тип платежа	Дата	Исполнен	Счет	Комментарий
4 339	-1 110 000 000	RUB	Кредит	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
4 339	100 000 000	CNY	Депозит	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 270	0	RUB	Депозит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 242	2 056,77	RUB	Кредит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 258	15 728,22	RUB	Кредит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 258	0	RUB	Депозит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 244	2 298,74	RUB	Кредит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 240	0	RUB	Депозит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 270	100,82	RUB	Кредит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 268	0	RUB	Депозит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 246	0	RUB	Депозит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 244	0	RUB	Депозит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 240	15 808,88	RUB	Кредит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
4 055	4,01	RUB	Кредит - проценты	23.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 268	15 728,22	RUB	Кредит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 246	100,82	RUB	Кредит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	
3 242	0	RUB	Депозит - проценты	22.01.2026	Плановый платеж	MF1010000000.RK10100	

5.5 Чувствительности

В верхней части окна выберите нужный торговый счет из выпадающего списка. В таблице отображаются значения чувствительности портфеля к ключевым риск-факторам: изменение процентных ставок, изменение валютных курсов, изменение волатильности. Для каждого фактора указано изменение стоимости портфеля при сдвиге на 0,0001%. Для выгрузки данных нажмите правой кнопкой мыши на любую строку и выберите «Экспорт». Данные можно использовать для анализа рыночного риска и управления лимитами.

Чувствительности 			
Счёт MF1010000000.RK10100			
Расчетный код	Сценарий	Чувствительности, RUB ↑	
10100	RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-4Y	-21 932,7	
10100	USD-RUB-TOM-CENTRAL	-9 981,88	
10100	RUB-RUSFAR-OIS-COMPOUND-6M	-8 774,24	
10100	RUB-CBR-KEY-RATE-1Y	-5 543,26	
10100	RUB-CBR-KEY-RATE-2Y	-3 367,33	
10100	CNY-RUB-TOM-CENTRAL	-3 193,59	
10100	RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-2Y	-3 007,13	
10100	RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-3Y	-2 017,45	
10100	RUB-RUSFAR-OIS-COMPOUND-2M	-445,19	
10100	XCCY-CNY-RUB-2W	-439,84	
10100	RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-8Y	-430,84	
10100	RUB-RUSFAR-OIS-COMPOUND-1M	-380,16	
10100	RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-3M	-295,66	
10100	XCCY-CNY-RUB-3M	-223,44	
10100	RUB-CBR-KEY-RATE-5Y	-175,21	
10100	FXS-EUR-USD-3M	-59,45	
10100	RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND-9Y	-58,45	
Риск-фактор	Значение	Сдвиг	
USD-RUB-TOM-CENTRAL	82,9664	0,0001	
USD-CHF-TOM-CENTRAL		0,0001	
EUR-USD-TOM-CENTRAL	1,167514	-0,00009999000099990002	
USD-CNY-TOM-CENTRAL	7,220748	0,0001	

5.6 Внесение изменений в сделку.

Отдельного функционала для внесения изменений в сделку в ТКС Сапфир не предусмотрено. Порядок внесения изменений описан в статье 13 Правил клиринга НКЦ - <https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/020415/104>

Список параметров, которые можно поменять, уникален для каждого инструмента и отражен в его спецификации.

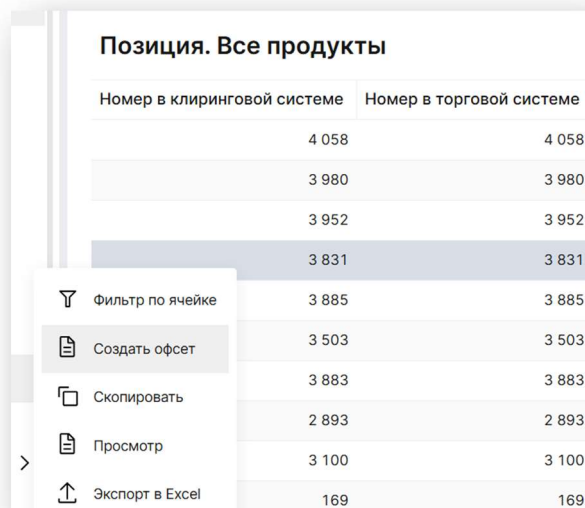
5.7 Терминация открытой позиции.

Выход из открытой позиции на рынке СПФИ осуществляется через механизм офсетных сделок (сделки, условия которых являются идентичными (за исключением условий по Дополнительному платежу), но разнонаправленными

по сравнению друг с другом, дата исполнения которых еще не наступила, и при этом обе сделки учитываются на одном регистре учета позиций).

Для заведения офсетной заявки:

- Перейдите в раздел «Позиция»;
- Выберите в списке позицию, которую необходимо закрыть;
- Нажмите правой кнопкой мыши на этой позиции. В контекстном меню выберите опцию «Создать офсет».



Номер в клиринговой системе	Номер в торговой системе
4 058	4 058
3 980	3 980
3 952	3 952
3 831	3 831
3 885	3 885
3 503	3 503
3 883	3 883
2 893	2 893
3 100	3 100
169	169

- В ТКС Сапфир автоматически создастся заявка, зеркальная существующей.
- Вам необходимо только выбрать способ размещения заявки: адресный или безадресный. И (при необходимости) указать «Дополнительный платеж».
- После этого заявка будет размещена в системе.

(!) Обратите внимание. Офсетная сделка будет заключена только после того, как контрагент примет ваш выставленный ордер.

Далее обе сделки (изначальная и офсетная) будут видны в отчете. Обе позиции будут существовать до взаимозачета. Здесь есть две ключевых даты:

- По итогу клиринга в T0 выплачивается премия за офсет (при наличии такого Дополнительного платежа).
- Вторая ключевая дата – это T+3. В этот день сделки терминируются. В дату терминирования сделки, которые ранее были в обычном блоке отчета со сделками <trade>, перестают там отображаться, а включаются в специальный блок <termination> клирингового отчета. А на следующий день они уже полностью перестают включаться в отчет.

Ссылка на описание процедуры (описание приведено в разделе 14) –

<https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/020415/104>

По закрывающей сделке в первый день отражается депозитная маржа (далее – ДМ) и справедливая стоимость (+ если был указан Дополнительный платеж), на 2-ой день - изменение ДМ и % на ДМ. Эти проценты начисляются со следующего рабочего дня после начала сделки.

По закрываемой сделке 3 дня будут отражаться изменение ДМ и % на ДМ.

Ссылка на порядок учета НКЦ (описание приведено в разделе 5) –

<https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/0203>

6. Рыночные данные

В данном разделе для вас доступны следующие блоки: «Форвардные кривые», «Дисконтные кривые», «Валютные курсы», «Калибровочные инструменты», «Фиксинги». Для просмотра данных по выбранному блоку нажмите на его название. В центральной области отобразится таблица с рыночной информацией.

Укажите дату, на которую требуется получить значение показателя.

Для этого в поле «Дата» введите или выберите из календаря нужную дату.

В таблице отобразятся значения целевого показателя на указанную дату. Для блока

«Форвардные кривые» — это форвардные курсы по валютным парам на разные сроки.

Для блока «Дисконтные кривые» — ставки дисконтирования по срокам. Для

блока «Валютные курсы» — спотовые курсы валютных пар. Для блока

«Калибровочные инструменты» — параметры инструментов, используемых для построения кривых. Для блока «Фиксинги» — зафиксированные значения ставок на указанные даты.

Для загрузки данных нажмите правой кнопкой мыши на любую строку таблицы и выберите «Экспорт». Данные будут сохранены в формате, совместимом с электронными таблицами.

Для возврата к общему списку блоков нажмите на стрелку влево в верхней части окна или выберите другой блок из списка.

Калибровочные инструменты						Дисконтные кривые						Фиксинги					
Калибровочные инструменты						Дисконтные кривые						Фиксинги					
Инструмент	Продукт	Срок	Котировка	Дата		Дата	Кривая	Тип	Дисконт фактор ↑	Тенор	Ставка		Индекс	Фиксинг	Дата		
ОIS Tom/10Y, RuFar RUB O/N	OIS	10Y	0,1426000	19.01.2026		21.01.2026	RUB-DISCOUNT-RUB-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	0,9999885473721933		RUB KeyRate	0,1600000	21.01.2026		
ОIS Tom/5Y, RuFar RUB O/N	OIS	5Y	0,1425000	19.01.2026		21.01.2026	EUR-DISCOUNT-EUR-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	0,9999628619292265		RUSFAR RUB 3m	0,1563000	21.01.2026		
ОIS Tom/8Y, RuFar RUB O/N	OIS	8Y	0,1425000	19.01.2026		21.01.2026	USD-DISCOUNT-RUB-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	0,999932832260188		RuFar RUB O/N	0,1570000	21.01.2026		
ОIS Tom/7Y, RuFar RUB O/N	OIS	7Y	0,1426000	19.01.2026		21.01.2026	RUB-DISCOUNT-USD-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	0,999358269397929		RUSFAR O/N Comp.	0,0098000	21.01.2026		
ОIS Tom/6Y, RuFar RUB O/N	OIS	6Y	0,1424000	19.01.2026		21.01.2026	USD-DISCOUNT-EUR-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	0,999341709309248						
ОIS Tom/5Y, RuFar RUB O/N	OIS	5Y	0,1422000	19.01.2026		21.01.2026	RUB-DISCOUNT-EUR-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	0,99939912588352						
ОIS Tom/4Y, RuFar RUB O/N	OIS	4Y	0,1420000	19.01.2026		21.01.2026	EUR-DISCOUNT-USD-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	0,99956765468024						
ОIS Tom/3Y, RuFar RUB O/N	OIS	3Y	0,1412000	19.01.2026		21.01.2026	EUR-DISCOUNT-RUB-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	1,00021799402233						
ОIS Tom/2Y, RuFar RUB O/N	OIS	2Y	0,1411000	19.01.2026		21.01.2026	CNY-DISCOUNT-RUB-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	0,999904733660954						
Fra. RUSFAR RUB 3m 3M/6M	FRA	3M	0,1508000	19.01.2026		21.01.2026	CNY-DISCOUNT-USD-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	0,999713726560693						
Fra. RUSFAR RUB 3m 6M/9M	FRA	3M	0,1492000	19.01.2026		21.01.2026	CNY-DISCOUNT-EUR-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	0,99975470440553						
Fra. Euribor EUR 3m 6M/9M	FRA	3M	0,0221130	19.01.2026		21.01.2026	RUB-DISCOUNT-CNY-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	0,996815240439759						
Fra. Euribor EUR 3m 3M/6M	FRA	3M	0,0225310	19.01.2026		21.01.2026	USD-DISCOUNT-CNY-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	0,999317945750929						
XCCY Tom/1W, CNY / RUONIA Comp.	XCCY	1W	0,0002000	19.01.2026		21.01.2026	EUR-DISCOUNT-CNY-CSA	Дисконтная	1W	0,0192	0,999604860709105						
XCCY 1M RUONIA CNYRUB	XCCY	1M	0,0051000	19.01.2026		21.01.2026	USD-DISCOUNT-USD-CSA	Дисконтная	2W	0,0384	0,998601067850376						
XCCY 9M RUONIA CNYRUB	XCCY	9M	0,0413000	19.01.2026													
XCCY 6M RUONIA CNYRUB	XCCY	6M	0,0300000	19.01.2026													
XCCY 3M RUONIA CNYRUB	XCCY	3M	0,0180000	19.01.2026													
XCCY Tom/2M, CNY / RUONIA Comp.	XCCY	2M	0,0097000	19.01.2026													
XCCY Tom/2W, CNY / RUONIA Comp.	XCCY	2W	-0,0025000	19.01.2026													
ОIS Tom/5Y, RUSFAR O/N Comp.	OIS	5Y	0,0686000	19.01.2026													
ОIS Tom/4Y, RUSFAR O/N Comp.	OIS	4Y	0,0647000	19.01.2026													
ОIS Tom/2Y, RUSFAR O/N Comp.	OIS	2Y	0,0642000	19.01.2026													
ОIS Tom/3Y, RUSFAR O/N Comp.	OIS	3Y	0,0748000	19.01.2026													
ОIS Tom/9M, RUSFAR O/N Comp.	OIS	9M	0,0348000	19.01.2026													
ОIS Tom/2W, RUSFAR O/N Comp.	OIS	2W	0,0100000	19.01.2026													
ОIS Tom/2M, RUSFAR O/N Comp.	OIS	2M	-0,0015000	19.01.2026													
ОIS Tom/1W, RUSFAR O/N Comp.	OIS	1W	0,0100000	19.01.2026													
ОIS Tom/1M, RUSFAR O/N Comp.	OIS	1M	0,0100000	19.01.2026													

7. Полезные ссылки

Раздел рынка СПФИ на сайте ГК Московской Биржи -

<https://www.moex.com/ru/spfi>

Правила клиринга на рынке СПФИ -

<https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/020415/104>

Кейс бук рынка СПФИ - <https://www.moex.com/media/kejsbuk.pdf>

Демо-стенд ТКС Сапфир - <https://www.moex.com/s1233>

И ещё много-много всего - <https://www.moex.com/s3784>

Ваши пожелания и комментарии к данному Руководству пользователя
направляйте по электронной почте на адрес: otc@moex.com

ЕСТЬ ВОПРОСЫ? МЫ ПОМОЖЕМ!



СВЯЖИТЕСЬ С НАМИ: otc@moex.com