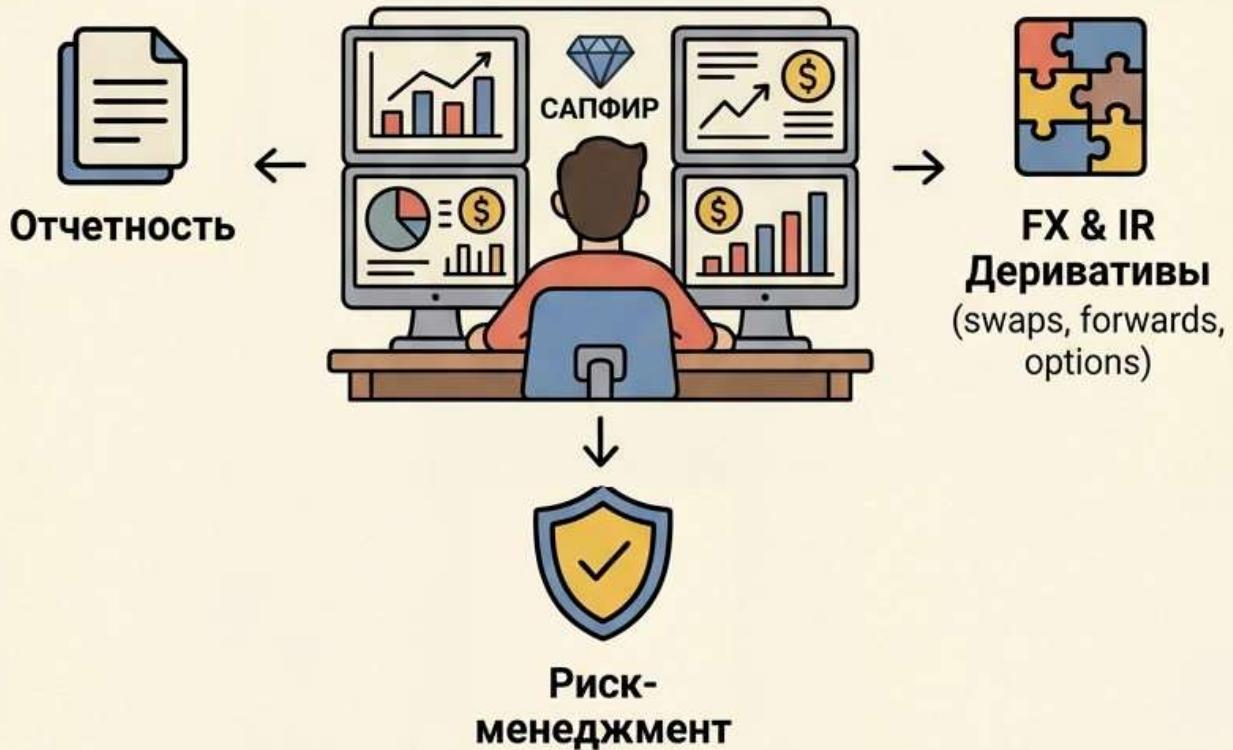


# САПФИР: РУКОВОДСТВО ПОЛЬЗОВАТЕЛЯ



## Оглавление

1. О программе .....	3
1.1 Общая информация .....	3
1.2 Внешний вид .....	3
1.3. Стартовое меню программы .....	4
2. Первоначальная 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 выставлять заявки, отслеживать

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

- **FIX API** — стандартизованный 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 выставлять 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.

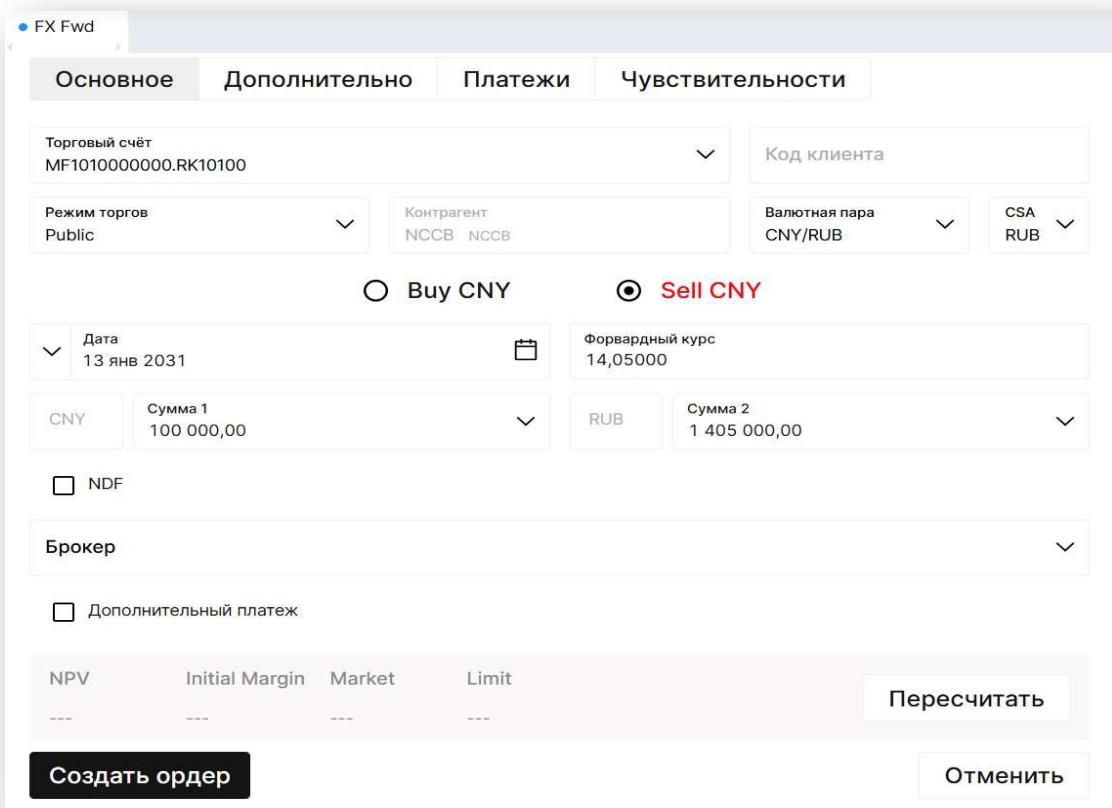
### **3. Выставление и прием заявок**

- 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.



FX Fwd

Основное Дополнительно Платежи Чувствительности

Торговый счёт  
MF1010000000.RK10100

Код клиента

Режим торгов  
Public

Контрагент  
NCCB NCCB

Валютная пара  
CNY/RUB

CSA  
RUB

Buy CNY Sell CNY

Дата  
13 янв 2031

Форвардный курс  
14,05000

CNY Сумма 1  
100 000,00

RUB Сумма 2  
1 405 000,00

NDF

Брокер

Дополнительный платеж

NPV Initial Margin Market Limit

--- --- --- ---

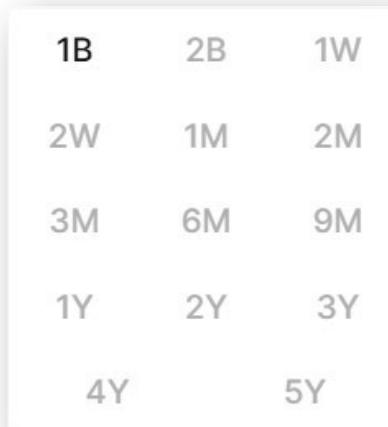
Пересчитать

Создать ордер Отменить

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 произведен 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 Т0.

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.

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.

Курс	Стоимость	+
9,18 11	Колонки таблицы	
9,73	<input checked="" type="checkbox"/> Дата платежа <input checked="" type="checkbox"/> Сумма платежа <input checked="" type="checkbox"/> Валюта платежа <input checked="" type="checkbox"/> Дисконт фактор <input checked="" type="checkbox"/> NPV <input checked="" type="checkbox"/> Курс <input checked="" type="checkbox"/> Стоимость	

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
<a href="#">Создать ордер</a>			<a href="#">Пересчитать</a>
			<a href="#">Отменить</a>

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	
1 856 537,35	244 654,26	---	658 649 515 730,5	<b>Пересчитать</b>
<b>Создать ордер</b>				<b>Отменить</b>

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

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

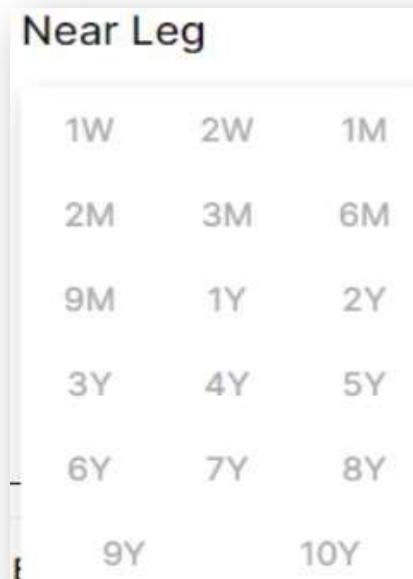
1. В окне «Создать Fx Swap» на вкладке «Основное» укажите:

- 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 очередность обмена денежными потоками «Buy/Sell» или «Sell/Buy».

3. Укажите:

- Цену в Swap 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 Swap 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 Т0.

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).

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	Пересчитать
2 174,22	260 041,76	---	658 742 971 969,99	

**Создать ордер**

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
<a href="#">Экспорт в Excel</a>		
<a href="#">Экспорт в CSV</a>		
<a href="#">Экспорт в XML</a>		

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

Курс	Стоимость	+
9,18	11	Колонки таблицы
9,73		<input checked="" type="checkbox"/> Дата платежа <input checked="" type="checkbox"/> Сумма платежа <input checked="" type="checkbox"/> Валюта платежа <input checked="" type="checkbox"/> Дисконт фактор <input checked="" type="checkbox"/> NPV <input checked="" type="checkbox"/> Курс <input checked="" type="checkbox"/> Стоимость

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
<b>Создать ордер</b>		<b>Пересчитать</b>	
		<b>Отменить</b>	

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	<b>Пересчитать</b>
1 856 537,35	244 654,26	---	658 649 515 730,5	

**Создать ордер** **Отменить**

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

**Назад** **Подтвердить**

### 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 (3М)

Смещение платежей  
Не применять

**Floating Stream**

Индекс  
RUB KeyRate

Спред (bp)

Конвенция  
ACT/ACT (ISDA)

Выплаты  
Ежеквартально (3М)

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 Т0.

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

ОсновноеКалендариДополнительно

**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

NPV      Initial Margin      Market      Limit

25 406,48      43 617,38      ---      658 743 013 083,96

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

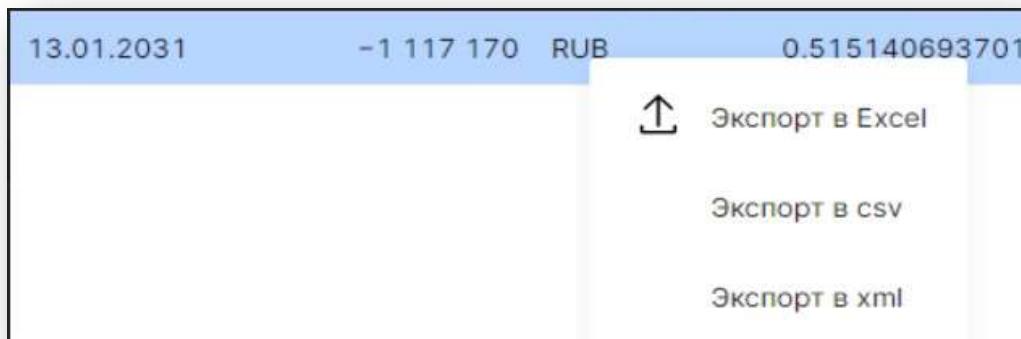
### Создать IRS/OIS

Основное		Дополнительно		Платежи		Периоды		Чувствительности	
Дата п... ↑	Сумма платежа	В...	Дисконкт 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					Пересчитать	
98 613,32	42 914,37	---		658 743 086 418,4					

**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.

Курс	Стоимость	+
9,18	11	Колонки таблицы
9,73		<input checked="" type="checkbox"/> Дата платежа
		<input checked="" type="checkbox"/> Сумма платежа
		<input checked="" type="checkbox"/> Валюта платежа
		<input checked="" type="checkbox"/> Дисконт фактор
		<input checked="" type="checkbox"/> NPV
		<input checked="" type="checkbox"/> Курс
		<input checked="" type="checkbox"/> Стоимость

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 выгрузки 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								
<b>Создать ордер</b>					<b>Пересчитать</b>						
					<b>Отменить</b>						

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**

Основное	Дополнительно	Платежи	Периоды	Чувствительности
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		

NPV      Initial Margin      Market      Limit      **Пересчитать**

19 288,71      40 374,94      ---      658 743 006 901,29

**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	<b>Пересчитать</b>
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.

**(!) 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 ХССY (Кросс-валютные свопы)

Пример заполненной заявки для сделки Кросс-валютный своп.

#### Создать ХССY

Основное Дополнительно Платежи Периоды Чувствительности

Торговый счёт  
MF1010000000.RK10100

Код клиента

Режим торгов  
Public

Контрагент  
NCCB- NCCB

CSA  
RUB

Валютная пара  
CNY/RUB

Курс  
11,750000

Начальная дата  
26 янв 2026

Дата окончания  
25 янв 2030

Pay CNY/Receive RUB       Receive CNY/Pay RUB

Основное Календари Дополнительно

**CNY Stream**

FIXED       FLOAT

CNY      Сумма  
1 000 000,00

Фиксированная ставка  
8,2500 %

Конвенция  
ACT/ACT (ISDA)

Выплаты  
Ежеквартально (3M)

Смещение платежей  
Не применять

**RUB Stream**

FIXED       FLOAT

RUB      Сумма  
11 750 000,00

Фиксированная ставка  
13,0000 %

Конвенция  
ACT/ACT (ISDA)

Выплаты  
Ежеквартально (3M)

Смещение платежей  
Не применять

Брокер

Дополнительный платеж

**Создать ордер**      **Отменить**

В окне «Создать ХССY» 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 XCCY должна быть на фиксированную ставку. При необходимости заключить сделку на два плавающих индекса для двух разных валют - необходимо выбрать сделку Basis (XCCY)

**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 XCCY должна быть на фиксированную ставку. При необходимости заключить сделку на два плавающих индекса для двух разных валют - необходимо выбрать сделку Basis (XCCY)
- 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 принимать 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 Т0.

Дополнительный платеж

Receive       Pay

Валюта	Сумма	Дата	<input style="border: 1px solid #ccc; padding: 2px;" type="button" value="..."/>
--------	-------	------	--

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 CNY/Receive RUB○ Receive CNY/Pay RUB

ОсновноеКалендариДополнительно

**Effective**

Бизнес центры	Beijing, MOSCOW, SPFI	Конвенция	FOLLOWING
---------------	-----------------------	-----------	-----------

**Termination**

Бизнес центры	Beijing, MOSCOW, SPFI	Конвенция	FOLLOWING
---------------	-----------------------	-----------	-----------

**Calculation**

Бизнес центры	Beijing, MOSCOW, SPFI	Конвенция	FOLLOWING
---------------	-----------------------	-----------	-----------

**Payment**

Бизнес центры	Beijing, MOSCOW, SPFI	Конвенция	FOLLOWING
---------------	-----------------------	-----------	-----------

**Effective**

Бизнес центры	Beijing, MOSCOW, SPFI	Конвенция	FOLLOWING
---------------	-----------------------	-----------	-----------

**Termination**

Бизнес центры	Beijing, MOSCOW, SPFI	Конвенция	FOLLOWING
---------------	-----------------------	-----------	-----------

**Calculation**

Бизнес центры	Beijing, MOSCOW, SPFI	Конвенция	FOLLOWING
---------------	-----------------------	-----------	-----------

**Payment**

Бизнес центры	Beijing, MOSCOW, SPFI	Конвенция	FOLLOWING
---------------	-----------------------	-----------	-----------

Брокер▼

Дополнительный платеж

NPVInitial MarginMarketLimitПересчитать

Создать ордерОтменить

- 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).

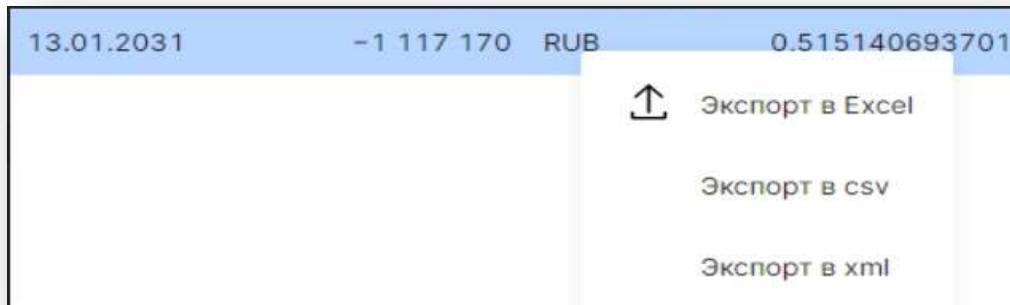
NPV	Initial Margin	Market	Limit
---	---	---	---

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
26.01.2026	1 000 000	CNY	1,00000830419825	1 000 008,30
26.01.2026	-11 750 000	RUB	0,996998084309042	-11 714 727,49
27.04.2026	-20 568,49	CNY	0,994551738044818	-20 456,43
27.04.2026	380 828,77	RUB	0,959885630526679	365 552,06
27.07.2026	-20 568,49	CNY	0,984379755738861	-20 247,21
27.07.2026	380 828,77	RUB	0,926175229990267	352 714,17
26.10.2026	-20 568,49	CNY	0,965723774381152	-19 863,48
26.10.2026	380 828,77	RUB	0,895412806949862	340 998,96
25.01.2027	-20 568,49	CNY	0,936753355300012	-19 267,60
				11 153 192,62
				-11 714 727,49
				-228 152,58
				365 552,06
				-225 819,10
				352 714,17
				-221 539,38
				340 998,96
				-214 893,49
NPV	Initial Margin	Market	Limit	<button>Пересчитать</button>
146,13	883 432,33	---	658 742 378 810,86	
<a href="#">Создать ордер</a>				<a href="#">Отменить</a>

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.

Курс	Стоимость	+
9,18	11	Колонки таблицы
9,73		<input checked="" type="checkbox"/> Дата платежа
		<input checked="" type="checkbox"/> Сумма платежа
		<input checked="" type="checkbox"/> Валюта платежа
		<input checked="" type="checkbox"/> Дисконт фактор
		<input checked="" type="checkbox"/> NPV
		<input checked="" type="checkbox"/> Курс
		<input checked="" type="checkbox"/> Стоимость

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 выгрузки 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							
<b>Пересчитать</b>										
<b>Создать ордер</b>										<b>Отменить</b>

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 XCCY

Основное Дополнительно Платежи Периоды Чувствительности

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

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

**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.

**(!) 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	НССБ
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	17
Спред для первого потока	5
Индекс ставок для первого потока	RUSFACNY Сотр.
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 MF1010000000.RK10100	Код клиента		
Режим торгов Public	Контрагент NCCB : nccb		
Валюта RUB	Сумма 15 000 000,00	Начальная дата 20 янв 2026	Дата окончания 20 янв 2031
<input type="radio"/> Pay RusFar RUB O/N/Receive RUSFAR RUB 3m		<input checked="" type="radio"/> Receive RusFar RUB O/N/Pay RUSFAR RUB 3m	
<b>Основное</b>	<b>Календари</b>	<b>Дополнительно</b>	
<b>Floating Stream</b>		<b>Floating Stream</b>	
Индекс RusFar RUB O/N	Спред (basis points)	Индекс RUSFAR RUB 3m	Спред (basis points)
Конвенция ACT/ACT (ISDA)		Конвенция ACT/ACT (ISDA)	
Выплаты Ежемесячно (1M)		Выплаты Ежеквартально (3M)	
Смещение платежей +1 рабочий день		Смещение платежей +1 рабочий день	
Брокер			
<input type="checkbox"/> Дополнительный платеж			
NPV 171 813,78	Initial Margin 1 973 218,01	Market ---	Limit 658 759 745 462,84
<b>Создать ордер</b>		<b>Пересчитать</b>	
		<b>Отменить</b>	

### 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 %			
<input checked="" type="radio"/> <b>Buy</b> <input type="radio"/> <b>Sell</b>				
<input type="radio"/> Основное <input type="radio"/> Календари <input type="radio"/> Дополнительно				
<b>Тип премии</b> Running-премия Фиксированная ставка 0,2070 %		<b>Floating Stream</b> Индекс RUB KeyRate    Спред (bp) Конвенция ACT/ACT (ISDA) Выплаты Ежегодно (1Y) Смещение платежей Не применять		
<b>Брокер</b> <input type="checkbox"/> Дополнительный платеж				
NPV	Initial Margin	Market	Limit	<input type="button" value="Пересчитать"/>
708,46	149 379,3	---	658 775 591 156,32	
<input type="button" value="Создать ордер"/> <input type="button" value="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 Т0.

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

ОсновноеКалендариДополнительно

**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

**Создать ордер****Пересчитать****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...	Дисконкт 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	⋮

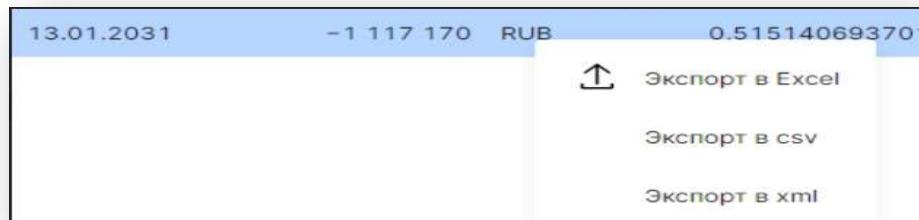
NPV Initial Margin Market Limit

708,46 149 379,3 --- 658 775 591 156,32

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.

Курс	Стоимость	+
9,18	11	Колонки таблицы
9,73		<input checked="" type="checkbox"/> Дата платежа
		<input checked="" type="checkbox"/> Сумма платежа
		<input checked="" type="checkbox"/> Валюта платежа
		<input checked="" type="checkbox"/> Дисконт фактор
		<input checked="" type="checkbox"/> NPV
		<input checked="" type="checkbox"/> Курс
		<input checked="" type="checkbox"/> Стоимость

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 выгрузки 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 Initial Margin Market Limit

708,46 149 379,3 --- 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.

**Создать CAP / Floor**

Основное	Дополнительно	Платежи	Периоды	Чувствительности
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	Пересчитать
708,46	149 379,3	---	658 775 591 156,32	

**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
708,46	149 379,3	---	658 775 591 156,32	

**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.

**(!) 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 (TT)
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 (TY)
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 стандартизованными 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 стаканных 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 стаканных 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

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	24.02.20	:
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	24.02.20	:
15 417	20.01.2026 13:13:38	OIS	OIS TOM/6M RUONIA Comp.	Pay Fixed	15.8000%		6M	21.01.2026	21.07.20	:
15 416	20.01.2026 13:13:28	OIS	OIS TOM/6M RUONIA Comp.	Receive Fixed	15.8690%		6M	21.01.2026	21.07.20	:
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	04.02.20	:
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	04.02.20	:

## 4.5 Архив ордеров

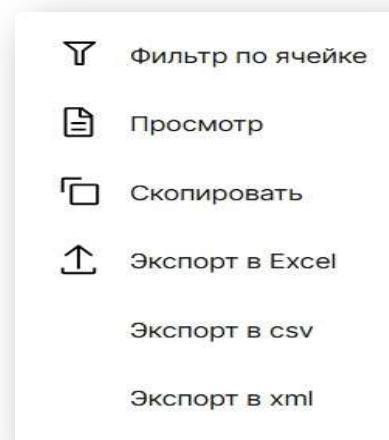
Архив ордеров содержит в себе полный перечень ордеров, которые были выставлены вами и их текущий статус (в данный раздел в том числе попадают ордера в активном статусе).

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

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

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

Примеры вкладок.



Архив ордеров								
С даты	05 янв 2026	Do даты	20 янв 2026					
Ордер	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												
Расчетные коды												
Участник	Расчетный код	Входящий	Текущий	Единичный лимит	Требования к обеспечению	Платежи сегодня	Исходящий	Плановая ДМ	Ввод/вывод средств	Текущая переоценка	Риск-неттинг	ID
МР1010000000	10100	659 938 835 286,12	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	186
Активы												
Актив	Входящий	Зачисления/ списания	Текущий	Цена	Оценка	Плановая ДМ	Планируемые платежи	Баланс по итогам клиринга	Макс. сумма вывода			
RUB	668 078 220 453,29	-31 156 219,98	668 078 098 283,21	1,000000	-3 697 572,07	-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	61,195400	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 клиринговой системе	Номер в Торговой системе	Дата регистрации	Владелец	Клиент	Страница первого договора	Продукт	Инструмент	Направление	Цена	Стоимость	Курс	Срок	Начало	Окончание	Сумма 1	Валюта	Сумма 2	Валюта 2	СДА	Маржа	Наименование
4 239	4 239	31.07.2028	МР1010000000	МР1010000000		ИСДЦ	ISDC 40517020 DZYRURUOMA Comp	Входящий	5,0000%	-183 458,140000	10,000000	1000	22.01.2028	12.03.2028	1000 000,000,00	CHF	1 300 000,00	руб	0,00	МР1010000000	
4 275	4 275	18.12.2025	МР1010000000	МР1010000000		ИСДЦ	ISDC 40517020 DZYRURUOMA Exp	Выходящий	5,0000%	-183 458,140000	10,000000	1000	25.12.2025	26.12.2025	1 300 000,00	CHF	1 300 000,00	руб	0,00	МР1010000000	
5 644	5 644	24.10.2028	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	24.10.2028	24.10.2028	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
5 624	5 624	24.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	24.10.2025	24.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
5 624	5 624	24.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	24.10.2025	24.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
5 631	5 631	24.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	24.10.2025	24.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
5 681	5 681	28.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	28.10.2025	28.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
5 696	5 696	28.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	28.10.2025	28.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
5 706	5 706	24.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	27.10.2025	27.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
5 703	5 703	24.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	27.10.2025	27.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
5 688	5 688	23.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	27.10.2025	27.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
5 688	5 688	23.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	27.10.2025	27.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
4 098	4 098	14.11.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	17.11.2025	17.11.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
3 294	3 294	25.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	24.10.2025	24.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
3 875	3 875	28.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	28.10.2025	28.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
3 247	3 247	21.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	22.10.2025	22.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
3 249	3 249	21.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	22.10.2025	22.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
3 244	3 244	21.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	22.10.2025	22.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
3 242	3 242	21.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	22.10.2025	22.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
3 140	3 140	21.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	22.10.2025	22.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
3 238	3 238	20.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	21.10.2025	21.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
3 239	3 239	20.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	21.10.2025	21.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
3 231	3 231	20.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	21.10.2025	21.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		
3 239	3 239	20.10.2025	МР1010000000	МР1010000000		Долг	Cap T0010701 RUB KeyRate 8 15,17	Расчетная	2,9900%	1 994,190000	1000	21.10.2025	21.10.2025	1 995,000,00	RUB	1 995,00	руб	0,00	МР1010000000		

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 выгруженном 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	Сумма платежа	Валюта платежа	Тип платежа	Дата	Исполнен	Счет	Комментарий
22 янв 2026	-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.

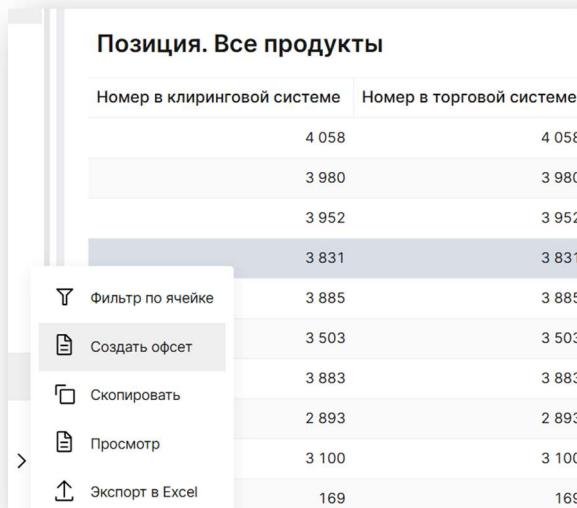
## 5.7 Терминация открытой позиции.

Выход из открытой позиции на рынке СПФИ осуществляется через механизм оффсетных 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 оффсетной 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 оффсет».



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.** Оффсетная сделка будет заключена только после того, как контрагент примет ваш выставленный ордер.

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

- По итогу клиринга в Т0 выплачивается премия за оффсет (при наличии такого Дополнительного платежа).

- Вторая ключевая дата – это Т+3. В этот день сделки терминируются.

В дату терминации 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 выгрузки 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				Дисконты кривые				Фиксации			
Дата	Срок	Котировка	Дата	Дата	Кривая	Тип	Дисконт фактор	Тенор	Ставка	Дата	Срок
OIS Tom/1Y, RusFar RUB O/N	OIS 1Y	0,1426000	19.01.2026	21.01.2026	REF-DISCOUNT-CNY-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	0,999989544372153	21.01.2026	Дисконты
OIS Tom/9Y, RusFar RUB O/N	OIS 9Y	0,1425000	19.01.2026	21.01.2026	EUR-DISCOUNT-EUR-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	0,999928619292265	21.01.2026	Дисконты
OIS Tom/8Y, RusFar RUB O/N	OIS 8Y	0,1425000	19.01.2026	21.01.2026	USD-DISCOUNT-RUB-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	0,999932832260188	21.01.2026	Дисконты
OIS Tom/7Y, RusFar RUB O/N	OIS 7Y	0,1426000	19.01.2026	21.01.2026	USD-DISCOUNT-USD-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	0,99538269397929	21.01.2026	Дисконты
OIS Tom/6Y, RusFar RUB O/N	OIS 6Y	0,1424000	19.01.2026	21.01.2026	USD-DISCOUNT-EUR-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	0,999341769309248	21.01.2026	Дисконты
OIS Tom/5Y, RusFar RUB O/N	OIS 5Y	0,1422000	19.01.2026	21.01.2026	RUE-DISCOUNT-EUR-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	0,99639912588352	21.01.2026	Дисконты
OIS Tom/4Y, RusFar RUB O/N	OIS 4Y	0,1420000	19.01.2026	21.01.2026	EUR-DISCOUNT-USD-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	0,999587654488024	21.01.2026	Дисконты
OIS Tom/3Y, RusFar RUB O/N	OIS 3Y	0,1412000	19.01.2026	21.01.2026	EUR-DISCOUNT-RUB-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	1,00021799402323	21.01.2026	Дисконты
OIS Tom/2Y, RusFar RUB O/N	OIS 2Y	0,1411000	19.01.2026	21.01.2026	CNY-DISCOUNT-RUB-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	0,9999473860954	21.01.2026	Дисконты
Fra. RUSFAR RUB 3m 3M/6M	FRA 3M	0,1508000	19.01.2026	21.01.2026	CNY-DISCOUNT-USD-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	0,999713726566063	21.01.2026	Дисконты
Fra. RUSFAR RUB 3m 6M/9M	FRA 3M	0,1492000	19.01.2026	21.01.2026	CNY-DISCOUNT-EUR-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	0,99975470440553	21.01.2026	Дисконты
Fra. Euribor EUR 3m 6M/9M	FRA 3M	0,0221130	19.01.2026	21.01.2026	RUE-DISCOUNT-CNY-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	0,996815240439759	21.01.2026	Дисконты
Fra. Euribor EUR 3m 9M/6M	FRA 3M	0,0225310	19.01.2026	21.01.2026	USD-DISCOUNT-CNY-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	0,999317945750929	21.01.2026	Дисконты
XCCY Tom/1W, CNY / RUONA Comp.	XCCY 1W	0,0002000	19.01.2026	21.01.2026	EUR-DISCOUNT-CNY-CSA	Дисконтиная	1W	0,0192	0,999604860709105	21.01.2026	Дисконты
XCCY 1M RUONA CNVRUB	XCCY 1M	0,0051000	19.01.2026	21.01.2026	USD-DISCOUNT-USD-CSA	Дисконтиная	2W	0,0384	0,98861067850376	21.01.2026	Дисконты
XCCY 9M RUONA CNVRUB	XCCY 9M	0,0413000	19.01.2026	XCCY 6M RUONA CNVRUB	XCCY 6M	0,0300000	19.01.2026	XCCY 3M RUONA CNVRUB	XCCY 3M	0,0180000	19.01.2026
XCCY 3M RUONA CNVRUB	XCCY 3M	0,0180000	19.01.2026	XCCY Tom/2M, CNY / RUONA Comp.	XCCY 2M	0,0097000	19.01.2026	XCCY Tom/2W, CNY / RUONA Comp.	XCCY 2W	-0,0250000	19.01.2026
OIS Tom/5Y, RUSFAR Comp.	OIS 5Y	0,0866000	19.01.2026	OIS Tom/4Y, RUSFAR Comp.	OIS 4Y	0,0847000	19.01.2026	OIS Tom/2Y, RUSFAR Comp.	OIS 2Y	0,0642000	19.01.2026
OIS Tom/3Y, RUSFAR Comp.	OIS 3Y	0,0748000	19.01.2026	OIS Tom/3M, RUSFAR Comp.	OIS 3M	0,0225310	19.01.2026	OIS Tom/9M, RUSFAR Comp.	OIS 9M	0,0349000	19.01.2026
OIS Tom/2M, RUSFAR Comp.	OIS 2M	0,0100000	19.01.2026	OIS Tom/1W, RUSFAR Comp.	OIS 1W	0,0100000	19.01.2026	OIS Tom/1M, RUSFAR Comp.	OIS 1M	0,0100000	19.01.2026
OIS Tom/2Y, RUSFAR Comp.	OIS 2Y	-0,0151000	19.01.2026	OIS Tom/1M, RUSFAR Comp.	OIS 1M	0,0100000	19.01.2026	OIS Tom/1M, RUSFAR Comp.	OIS 1M	0,0100000	19.01.2026
Форвардные кривые				Валютные курсы				Валютные курсы			
Дата	Кривая	Тип	Срок ↑	Тенор	Ставка	Дата	Валютная пара	Источник	Курс	Дата	Валютные курсы
21.01.2026	RUE-CBR-KEY-RATE	Форвардная	0D	0	0,16	21.01.2026	EUR/USD	CENTRAL	1,168341	12.01.2026	EUR/USD
21.01.2026	RUE-RUSFAR-0IS-COMPOUND	Форвардная	0D	0	0,157	21.01.2026	USD/RUB	CBR_TOM	78,791300	12.01.2026	USD/RUB
21.01.2026	RUE-RUSFAR-3M	Форвардная	0D	0	0,1563	21.01.2026	EUR/RUB	CBR_TOM	91,966800	12.01.2026	EUR/RUB
21.01.2026	CNY-REPO-RATE	Форвардная	0D	0	0,0154	21.01.2026	CNY/RUB	CBR_TOM	11,285600	12.01.2026	CNY/RUB
21.01.2026	CNY-RUSFAR-CNY-0IS-COMPOUND	Форвардная	0D	0	0,0098	21.01.2026	USD/RUB	CENTRAL	78,850700	12.01.2026	USD/RUB
21.01.2026	USD-SDFR	Форвардная	1W	0,0192	0,9364749081116322	21.01.2026	KZT/RUB	CENTRAL	0,153434	12.01.2026	KZT/RUB
21.01.2026	RUE-RUONA-0IS-COMPOUND	Форвардная	1W	0,0192	0,157295541409703	21.01.2026	EUR/RUB	CENTRAL	91,966800	12.01.2026	EUR/RUB
21.01.2026	EUR-ESTR	Форвардная	1W	0,0192	0,019688762102617	21.01.2026	CNY/RUB	CENTRAL	11,271200	12.01.2026	CNY/RUB

## 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 ёщё 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](mailto:otc@moex.com)

**ЕСТЬ ВОПРОСЫ? МЫ ПОМОЖЕМ!**



**СВЯЖИТЕСЬ С НАМИ: [otc@moex.com](mailto:otc@moex.com)**