

FraudDetect:

Выявление потенциально договорных сделок

Для публичного распространения
ПАО «Московская биржа»

При сотрудничестве с ООО «Прокомплаенс»

2023 год

Пример договорной стратегии

Сторона А торгует **в убыток** и обеспечивает **прибыль** стороне В, за счет:

Сторона А и сторона В выставляют заявки **схожего объема**

Заявка стороны **В почти полностью удовлетворяется** стороной А

Сделка совершается **по выгодной** для стороны **В цене**

Сторона **В** получает **прибыль**



Сторона А,
Обычно выступающая
как сотрудник
финансовой
организации или клиент
финансовой
организации



Сторона В
соучастник,
использующий личный
счет в другой
организации

FraudDetect выделяет сделки, которые могут быть договорными, то есть сделками с возможным использованием инсайдерской информации сотрудниками финансовой организации в рамках исполнения собственных сделок или сделок по договору доверительного управления, а также возможные договорные сделки клиентов финансовой организации.

Зачем нужен сервис?

01

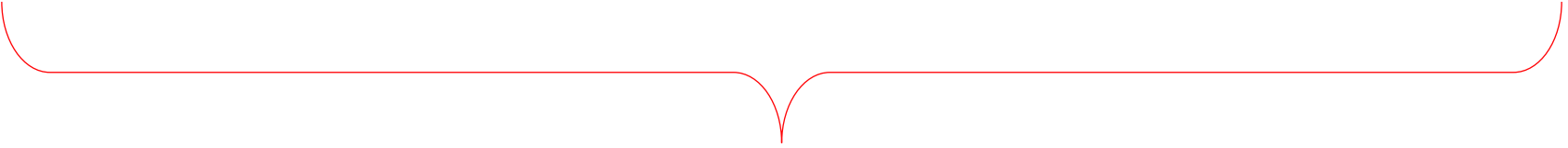
Выявление неправомерных практик, когда трейдер обогащается за счет клиента или работодателя

02

Выявление сделок клиентов, на которые вероятно обратит внимание регулятор и организатор торгов для организации превентивного расследования

03

Проактивное выявление риска участия брокера или управляющей компании в цепочке отмыwania доходов, полученных преступным путем



**СОКРАЩЕНИЕ РЕГУЛЯТОРНОГО РИСКА И
ПРЯМЫХ ФИНАНСОВЫХ ПОТЕРЬ**

FraudDetect выявляет цепочки договорных сделок, анализируя поведение участников торгов с учетом истории их взаимных торгов, результативности и частотности.

Как работает?

01

Сервис анализирует полные данные рынка, учитывая все парные торги участников с точностью до конечных клиентов или трейдеров

02

Сервис оценивает насколько парные торги двух или более лиц аномальны и встречаются в окрестности существенных изменений цен

03

Учитывается историческая ретроспектива парных торгов, в том числе, частотность и результативность (или ущерб) торгов

04

Основываясь на данных рынка, сервис подсвечивает неслучайные парные торги, которые имеют признаки регулярной договорной стратегии

Результат работы сервиса – ежедневный отчет

Данные доступны ежедневно в формате CSV. Файл можно получить через Универсальный файловый шлюз Московской биржи.

CSV файл содержит информацию о сделках прошедшего дня, участвовавших в потенциально договорных стратегиях

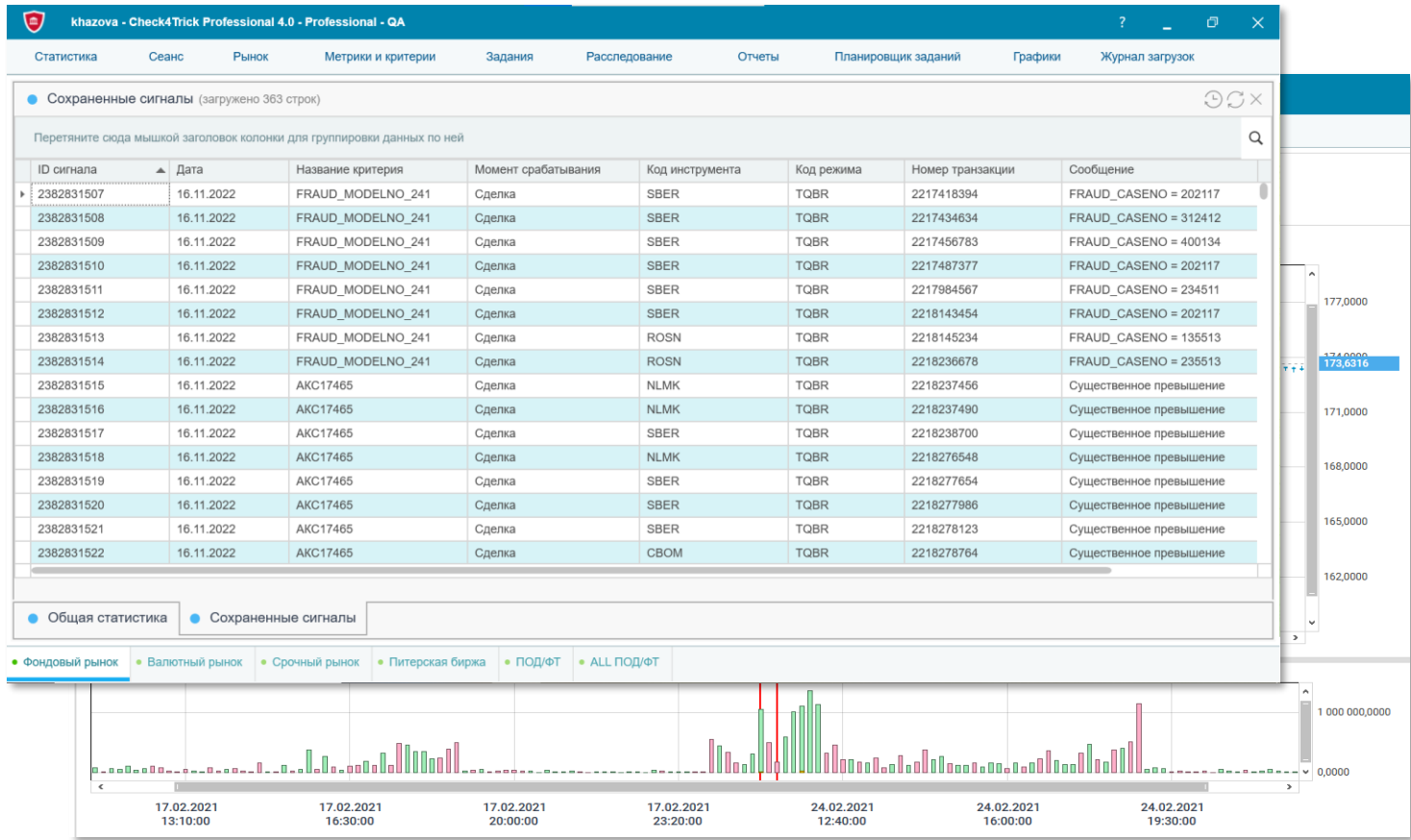
TRADENO – номер сделки. По номеру сделки участник торгов может восстановить информацию о том, кто участвовал в договорной стратегии и с каким результатом.

CASENO – идентификатор кейса. По номеру кейса участник может объединять в одну стратегию несколько сделок. Участнику не передается информация о другой стороне, только лишь информация, что сделки объединены одной потенциально противоправной стратегией. При этом, номер кейса является сквозным по торговым дням, позволяет участнику объединять сделки из разных дней в один кейс.

MODELNO – номер сработавшей модели.

TRADENO	CASENO	MODELNO
4341643606	110	130
4341643613	112	130
4341643615	109	130
4341643668	109	130
4341643670	112	130
4341643679	112	130
4341643684	112	130
4341643685	109	130
4341643687	112	130
4341643691	110	130
4341643693	111	130
4341643695	112	130
4341643697	112	130
4341643708	109	130
4341643716	112	130

Check4Trick 4.0



Результаты работы сервиса вы можете анализировать вручную или с помощью автоматизированных систем. FraudDetect может работать с системами любых вендоров, в том числе, с системой компании «Прокомплаенс» – Check4Trick версии 4.0 и выше.

Если у вас установлена система Check4Trick и вы подписаны на сервис FraudDetect вы можете обратиться к вендору для бесплатной интеграции сервиса в систему.

После бесплатной настройки данные из УФС Московской биржи могут автоматизировано поступать в систему Check4Trick ежедневно и отображаться в системе наравне с сигналами, сформированными самой системой.

При этом информация из FraudDetect будет учитываться в работе риск-модели Check4Trick при анализе клиентов и/или трейдеров, при выводе сигналов, в том числе в графическом модуле расследований.

НАЧАЛО РАБОТЫ С СЕРВИСОМ

ПЕРВЫЕ ШАГИ

01

Необходимо обратиться в
Управление прямых продаж
Московской Биржи по адресу
itsales@moex.com

02

Сотрудники Московской
биржи свяжутся с вами и
договорятся о проведении
презентации и пилотного
проекта

03

На пилотном проекте сервис
произведет анализ деятельность ваших
клиентов\трейдеров на историческом
временном интервале. В результате
анализа будет сформирован набор
подозрительных кейсов и предоставлен
вам для изучения и принятия решения.

04

По результат пилота будет
определен подходящий для
вас тарифный план

05

Сотрудники Управления
прямых продаж Московской
Биржи помогут оформить
необходимые документы для
заказа услуги, после чего
будет предоставлен доступ

06

В течение первого месяца
работы сервиса
предоставляется скидка 75%
от абонентской платы

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ!

СПРАВОЧНЫЙ РАЗДЕЛ

Контакты для связи:

ПАО Московская Биржа
Управление прямых продаж
Тел.: +7 495 363-3232 доб. 5656
Эл. почта: itsales@moex.com

ООО «Прокомплаенс»
Вербицкий Александр
Тел.: +79602783971
Эл. почта: verbitsky_alexander@forecsys.ru