# **Правила формирования наименования окна фильтра (далее – тикера) по ванильным процентным свопам на ставки:** [**KeyRate**](#_IRS_Key_Rate)**,** [**RusFar o/n**](#_OIS_Rusfar)**,** [**Ruonia**](#_OIS_Ruonia)**.**

Пример формирования тикера по инструменту:

**3Y IRS KEYRATE** - наименование отдельного окна – что значит, что в окне с применением фильтра можно выставлять заявки и заключать сделки процентного свопа сроком 3 года на KEYRATE-AVERAGE причем, часть параметров/конвенции предустановлены и описаны ниже:

Сделка, заключаемая в данном режиме, будет иметь статус безадресная.

Календарь сделки: Moscow, SPFI/Modified Following

Календарь процентных периодов: Moscow, SPFI/Modified Following

Календарь платежей: Moscow, SPFI/Modified Following

Валюта переоценки (CSA): RUB

Валюта сделки: RUB

Первая нога свопа (смещение): TOM

**Фиксированная ставка**

Конвенция дней по фиксированной ставке: ACT/ACT (ISDA)

Периодичность выплат фиксированной ставки: ежегодно

**Плавающая ставка**

Конвенция дней по плавающей ставке: ACT/ACT (ISDA)

Периодичность выплат плавающей ставки: ежеквартально

Индекс плавающей ставки: KEYRATE-AVERAGE

Спрэд: 0 бп

Фиксинг: 0В

Аналогичным образом формируются тикеры по другим процентным инструментам.

ВАЖНО!!! При заведении заявки с параметрами отличными от указанных Таблицах, заявка отобразится в таблицах «Входящие ордера. Безадресные» и «Активные ордера»

# **Описание доступных сроков и инструментов на ставки:**

# [**KeyRate**](#_IRS_Key_Rate)**,** [**RusFar o/n**](#_OIS_Rusfar)**,** [**Ruonia**](#_OIS_Ruonia)

# **OIS Ruonia**

|  |  |
| --- | --- |
| **Заявка** | **Безадресная** |
| **Календарь сделки** | **Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)** |
| **CSA** | **RUB** |
| **Валюта** | **RUB** |
| **Срок** | **1w, 2w, 1m, 2m, 3m, 6m, 9m, 1y, 2y, 3y, 4y, 5y, 6y, 7y, 8y, 9y, 10y** |
| **Смещение** | **Tom** |
| **Fixed** |  |
| **валюта** | **RUB** |
| **Номинальная сумма** | **Заполняется участником** |
| **Конвенция дней** | **Act/act (ISDA)** |
| **Периодичность выплат** | **В конце периода/ежегодно, если срок более 1 года** |
| **Ставка** | **Заполняется участником** |
| **Float** |  |
| **валюта** | **RUB** |
| **Номинальная сумма** | **Заполняется участником** |
| **Конвенция дней** | **Act/act (ISDA)** |
| **Периодичность выплат** | **В конце периода /ежегодно, если срок более 1 года** |
| **Индекс ставок** | **Ruonia Comp.** |
| **Капитализация** | **Ежедневно** |
| **Смена ставки** | **Ежедневно** |
| **Календари Pay** |  |
| **Платежи** | **Moscow, SPFI/Following (недоступно для изменения)** |
| **Процентные периоды** | **Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)** |
| **Количество дней** | **Пусто** |
| **Календари Receive** |  |
| **Платежи** | **Moscow, SPFI/Following (недоступно для изменения)** |
| **Процентные периоды** | **Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)** |
| **Календарь фиксинга** | **RUONIA/Following** |
| **Количество дней** | **Пусто** |
| **Дополнительные параметры** |  |
| **Спрэд** | **0** |
| **Сдвиг (Lookback/Shift)** | **Без сдвига** |
| **Конвенция Stub** | **Short initial** |
| **Доп платеж (премия)** | **0 (без премии)** |
| **Дата начала первого периода** | **Не указана** |
| **Ставка первого периода** | **Не указана** |

# **OIS Rusfar**

|  |  |
| --- | --- |
| **Заявка** | **Безадресная** |
| **Календарь сделки** | **Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)** |
| **CSA** | **RUB** |
| **Валюта** | **RUB** |
| **Срок** | **1w, 2w, 1m, 2m, 3m, 6m, 9m, 1y** |
| **Смещение** | **Tom** |
| **Fixed** |  |
| **валюта** | **RUB** |
| **Номинальная сумма** | **Заполняется участником** |
| **Конвенция дней** | **Act/act (ISDA)** |
| **Периодичность выплат** | **В конце периода** |
| **Ставка** | **Заполняется участником** |
| **Float** |  |
| **валюта** | **RUB** |
| **Номинальная сумма** | **Заполняется участником** |
| **Конвенция дней** | **Act/act (ISDA)** |
| **Периодичность выплат** | **В конце периода** |
| **Индекс ставок** | **RusFar RUB O/N** |
| **Капитализация** | **Ежедневно** |
| **Смена ставки** | **Ежедневно** |
| **Календари Pay** |  |
| **Платежи** | **Moscow, SPFI/Following** |
| **Процентные периоды** | **Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)** |
| **Количество дней** | **Пусто** |
| **Календари Receive** |  |
| **Платежи** | **Moscow, SPFI/Following** |
| **Процентные периоды** | **Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)** |
| **Календарь фиксинга** | **RUSFAR/Following** |
| **Количество дней** | **Пусто** |
| **Дополнительные параметры** |  |
| **Спрэд** | **0** |
| **Сдвиг (Lookback/Shift)** | **Без сдвига** |
| **Конвенция Stub** | **Short initial** |
| **Доп платеж (премия)** | **0 (без премии)** |
| **Дата начала первого периода** | **Не указана** |
| **Ставка первого периода** | **Не указана** |

# **OIS RUSFAR CNY**

|  |  |
| --- | --- |
| **Заявка** | **Безадресная** |
| **Календарь сделки** | **Beijing Moscow Modified Following (по ум.)** |
| **CSA** | **RUB** |
| **Валюта** | **RUB** |
| **Срок** | **1w, 2w, 1m, 2m, 3m, 6m, 9m, 1y, 2y, 3y, 4y, 5y** |
| **Смещение** | **Tom** |
| **Fixed** |  |
| **валюта** | **CNY** |
| **Номинальная сумма** | **Заполняется участником** |
| **Конвенция дней** | **Act/365 (ISDA)** |
| **Периодичность выплат** | **В конце периода/ежегодно, если срок более 1 года** |
| **Ставка** | **Заполняется участником** |
| **Float** |  |
| **валюта** | **CNY** |
| **Номинальная сумма** | **Заполняется участником** |
| **Конвенция дней** | **Act/365 (ISDA)** |
| **Периодичность выплат** | **В конце периода /ежегодно, если срок более 1 года** |
| **Индекс ставок** | **RUSFARCNY COMP** |
| **Капитализация** | **Ежедневно** |
| **Смена ставки** | **Ежедневно** |
| **Календари Pay** |  |
| **Платежи** | **Beijing Moscow, SPFI/Following (недоступно для изменения)** |
| **Процентные периоды** | **Beijing Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)** |
| **Количество дней** | **Пусто** |
| **Календари Receive** |  |
| **Платежи** | **Beijing Moscow, SPFI/Following (недоступно для изменения)** |
| **Процентные периоды** | **Beijing Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)** |
| **Количество дней** | **Пусто** |
| **Дополнительные параметры** |  |
| **Спрэд** | **0** |
| **Сдвиг (Lookback/Shift)** | **Без сдвига** |
| **Конвенция Stub** | **Short initial** |
| **Доп платеж (премия)** | **0 (без премии)** |
| **Дата начала первого периода** | **Не указана** |
| **Ставка первого периода** | **Не указана** |

# **IRS Key Rate**

|  |  |
| --- | --- |
| **Заявка** | **Безадресная** |
| **Календарь сделки** | **(синхронизирован с Процентными периодами)**  **Moscow, SPFI/Modified Following** |
| **CSA** | **RUB** |
| **Валюта** | **RUB** |
| **Срок** | **1y, 2y, 3y, 4y, 5y, 6y, 7y, 8y, 9y, 10y** |
| **Смещение** | **Tom** |
| **Fixed** |  |
| **Валюта** | **RUB** |
| **Номинальная сумма** | **Заполняется участником** |
| **Конвенция дней** | **Act/Act (ISDA)** |
| **Периодичность выплат** | **Ежегодно** |
| **Ставка** | **Заполняется участником** |
| **Float** |  |
| **валюта** | **RUB** |
| **Номинальная сумма** | **Заполняется участником** |
| **Конвенция дней** | **Act/Act (ISDA)** |
| **Периодичность выплат** | **Ежеквартально** |
| **Период капитализации** | **Ежеквартально** |
| **Индекс ставок** | **RUB KeyRate** |
| **Смена ставки** | **Ежедневно** |
| **Средняя ставка** | **Weighted** |
| **Спред (б.п.)** | **0** |
| **Фиксинг** | **0В** |
| **Reset** | **At end** |
| **Календари Pay** |  |
| **Платежи** | **(синхронизирован с Процентными периодами)**  **Moscow, SPFI/Modified Following** |
| **Процентные периоды** | **Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)** |
| **Количество дней** | **Пусто** |
| **Календари Receive** |  |
| **Платежи** | **(синхронизирован с Процентными периодами)**  **Moscow, SPFI/Modified Following** |
| **Процентные периоды** | **Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)** |
| **Календарь фиксинга** | **Moscow, SPFI/Preceding** |
| **Количество дней** | **Пусто** |
| **Дополнительные параметры** |  |
| **Спрэд** | **0** |
| **Сдвиг (Lookback/Shift)** | **Без сдвига** |
| **Конвенция Stub** | **Short initial** |
| **Доп платеж (премия)** | **0 (без премии)** |
| **Дата начала первого периода** | **Не указана** |
| **Ставка первого периода** | **Не указана** |

# **FX SWAP CNYRUB**

|  |  |
| --- | --- |
| **Заявка** | **Безадресная** |
| **Календарь сделки** | **Beijing Moscow, SPFI/Modified Following** |
| **CSA** | **RUB** |
| **Валюта** | **RUB** |
| **Срок** | **1w, 2w, 1m, 2m, 3m, 6m, 1y, 2y, 3y, 4y, 5y** |
| **Смещение** | **Tom** |
| **Номинальная сумма** | **Заполняется участником** |
| **Цена** | **Заполняется участником** |
| **Курс** | **Центральный курс НКЦ** |