

СПФФИ

РЫНОК

ПРЕИМУЩЕСТВА
ПРОДУКТЫ
ФАКТЫ

OTC@MOEX.COM

ЧЕМ **РЫНОК**
СПФИ ПОЛЕЗЕН
ДЛЯ
УЧАСТНИКОВ

ЛЮБОЙ ОТЛОЖЕННЫЙ
СТАРТ (ОТ 0 ДНЕЙ ДО 10
ЛЕТ)



БЕЗАДРЕСНЫЙ
РЕЖИМ ТОРГОВ

ГИБКИЕ СРОКИ ОТ
3 ДНЕЙ ДО 10 ЛЕТ
НОМИНАЛ ЛЮБОЙ



НАЧИСЛЕНИЕ ПРОЦЕНТОВ
НА ГАРАНТИЙНОЕ
ОБЕСПЕЧЕНИЕ

РЫНОЧНАЯ ЦЕНА
ПО ЗАКОНОДАТЕЛЬСТВУ



НАЧИСЛЕНИЕ
ПРОЦЕНТОВ НА
ПЕРЕОЦЕНКУ

RUONIA EONIA
FedFunds SARON

ТЕКУЩАЯ
СПРАВЕДЛИВАЯ
СТОИМОСТЬ (NPV)



50 УЧАСТНИКОВ
ПОДПИСАНИЕ ISDA
НЕ ТРЕБУЕТСЯ



ВАЛЮТА
ПЕРЕОЦЕНКИ И
ГАРАНТИЙНОЕ
ОБЕСПЕЧЕНИЕ

СНИЖЕНИЕ НАГРУЗКИ
НА H1 И H6 В 20 РАЗ



РАННИЕ
РАСЧЕТЫ



КРЕДИТНЫЕ
РИСКИ НА
НКЦ

РЫНОК СПФИ: ПРОДУКТЫ

ВАЛЮТНЫЕ
РИСКИ



FWD&NDF

3D

10Y



EURUSD
USDRUB
EURRUB
CHFRUB

ПРОЦЕНТНЫЕ
РИСКИ



IRS&XCCY

3D

10Y



OIS

3D

2Y



РИСК
ЛИКВИДНОСТИ



FXSWAP

3D

10Y



EURUSD
USDRUB
EURRUB
CHFRUB

РЫНОК СПФИ

ключевые факты

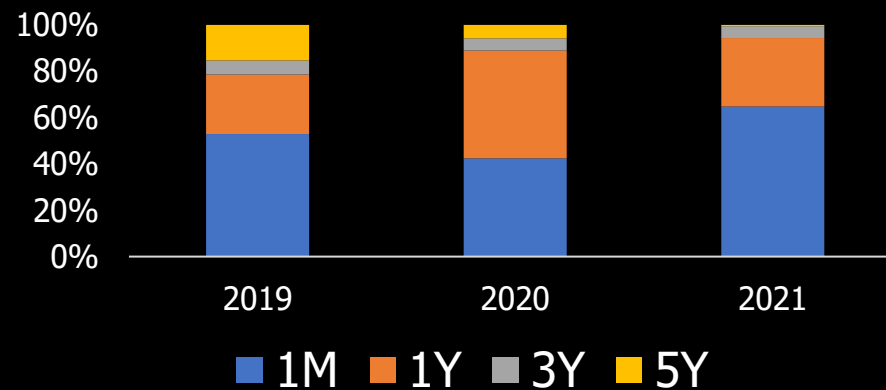
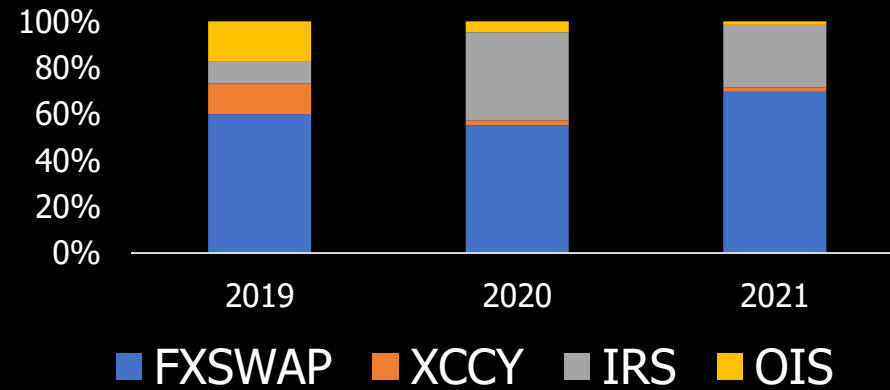
ДАТА

август '21

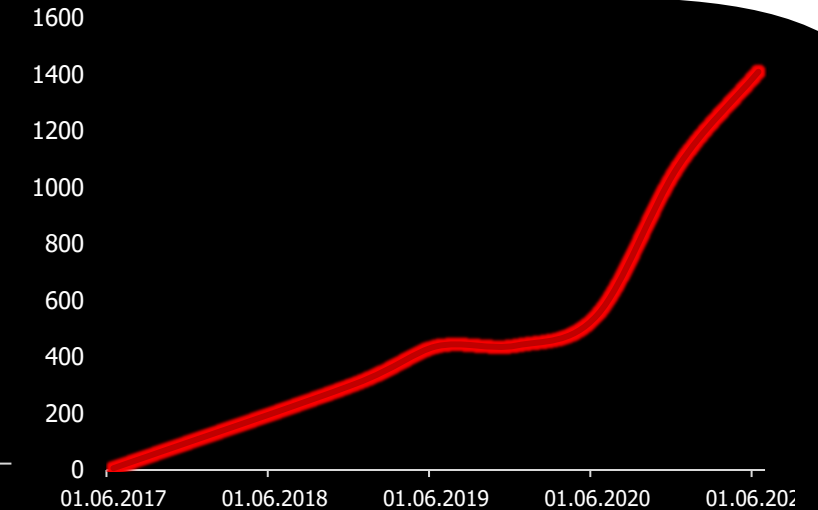
1,2

ТРЛН РУБ

ОБЪЕМ ОТКРЫТЫХ ПОЗИЦИЙ



МЛРД РУБ



ОБЪЕМ ОТКРЫТЫХ ПОЗИЦИЙ

РЫНОК СПФИ: КОНТАКТЫ



Александр Белов



+7 (495) 363-32-32, ext.5371



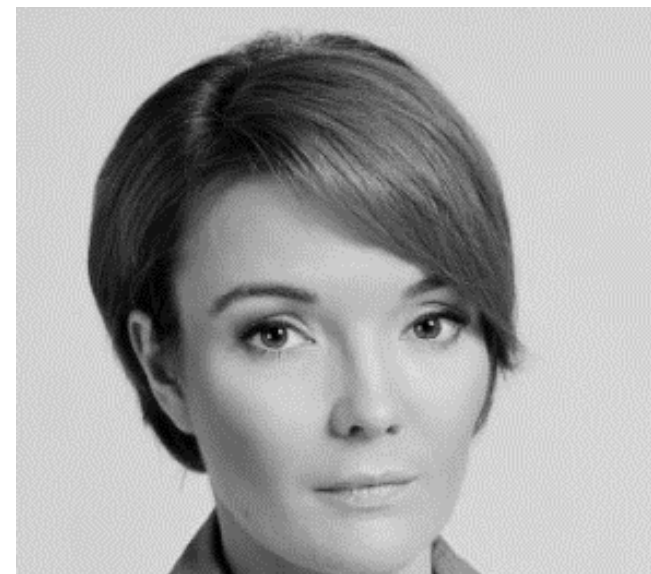
Aleksander.Belov@moex.com



Роман Локтионов

+7 (495) 363-32-32, ext.5372

Roman.Loktionov@moex.com



Наталья Зверева

+7 (495) 363-32-32, ext.5438

Natalia.Zvereva@moex.com