Торговля валютными производными через Рейтер

Виктор Рубцов

Коммерческий директор

РЕЙТЕР

14 сентября 2005 г.

Содержание

- информационное покрытие и аналитика по срочному рынку в Рейтер
- динамика изменения цен на рынке форвардов
- техника заключения сделок через Reuters Dealing
- новые возможности для сделок на CME по валютным фьючерсам через Reuters Dealing
- создание банковских торговых порталов для FX/MM

Общее информационное покрытие валютного рынка

RUBVIEW | REUTERS ROUBLE MONEY MARKETS MULTI CONTRIBUTOR OVERVIEW | MONEY

Guides <RUSSIA>, <RUB/1>-2, <0#RU-FXMM> MONEY NEWS [M-RU] DOMESTIC [RU]

VEKSEL YLDs		<MOSIBOR=> 1D,1W,1M,3M	STOCK & BOND INDICES				OIL
1 Month	6.78	1.14	RTRS MICEX INDEX	↑2315.56	-41.01	17:16	URL-E
3 Month	7.03	2.10	RTS INDEX	↓890.960	-19.180	17:15	59.52/9.54
6 Month	7.18	4.09	DJ INDU AVERAGE			00:02	
1 Year	7.76	4.78	RUS BONDS IDX	↓158.85	+8.00	17:10	

DEPOs & SWAPs			CTB SELT, CB Fix & Depo			SPOT, FRWD, CROSSes		
RUBOND=	1.00/2.00	12:20	ON	28.2275/28.2295	13:59	RIBER=	28.2224/28.2312	12:15
RUBTND=	0.50/1.50	11:38	TN	28.1925/28.1950	16:59	RUBONOR=	28.2000/28.2100	17:10
RUB1WD=	0.95/2.95	17:09	EUR ON	35.1300/35.2310	11:29	RUBTNOR=	28.1850/28.1925	17:09
RUBSWD=	1.00/2.80	:	EUR TN	35.1800/35.1945	13:58	RUB=	28.1850/28.1925	17:09
RUB2WD=	1.95/3.95	17:09	USDRUB	28.2108/	12:21	RUBSWOR=	28.19/28.20	17:15
RUB1MD=	2.00/5.00	17:02	EURRUB	35.2212/	12:21	RUB1MOR=	28.16/28.19	17:15
RUB2MD=	3.95/6.95	17:09	CHFRUB	22.8372/	12:21	RUB2MOR=	28.15/28.17	17:15
RUB3MD=	3.95/6.95	17:14	UAHRUB	55.8829/	12:21	RUB3MOR=	28.15/28.19	17:15
RUB6MD=	4.25/5.75	11:25	KZTRUB	21.0144/	12:21	RUB6MOR=	28.15/28.20	17:15
RUB1YD=	6.50/8.25	:	CB O/N	/	12:05	RUB1YOR=	28.27/28.34	17:15
RUBON=	-25/-15	11:44	CB T/N	0.5/	10:26	EURRUB=	35.2430/35.2530	17:16
RUBTN=	-25/-14	02:47	CB S/N	0.5/	10:26	JPYRUB=	0.2573/0.2576	17:16
RUBSW=	-15/-10	:	CB 1W	1.0/	10:26	GBPRUB=	51.96/52.00	17:16
RUB1M=	-376/94	17:14	CB 2W	/	12:02	CHFRUB=	22.8370/22.8470	17:16
RUB2M=	-550/-350	15:35	CB S2W	/	10:22	UAHRUB=	0.1767/0.1779	17:09
RUB3M=	-550/150	15:35	CB 1M	/	12:25	KZTRUB=	4.754/4.764	17:11
RUB6M=	-650/150	15:34	CB 3M	/	12:25		/	
RUB1Y=	550/1350	15:34	CBCALL	0.5/	10:26		/	

Котировки форвардных цен и расчетной доходности

0#RUBNDF=

Non-Deliverable Forwards View

28.222'12 RIBER TOM FIXING

Term	Bid	Offer	Source	Time	Start	Maturity	Outright
RUB1WID	3.80	7.50	DBMP	16:54			28.17/8.19
RUB2WID	3.80	5.60	DBMP	16:54			28.17/8.18
RUB1MID	3.40	4.20	DBMP	16:54			28.15/8.17
RUB2MID	3.60	4.00	DBMP	16:54			28.13/8.16
RUB3MID	3.70	4.00	DBMP	16:48			28.14/8.17
RUB6MID	4.10	4.30	DBMP	16:54			28.14/8.19
RUB9MID	4.30	4.50	DBMP	16:54			28.18/8.24
RUB1YID	4.50	4.70	DBMP	16:39			28.25/8.32
RUB18MI	4.70	5.20	DBMP	16:07			28.40/8.51
RUB2YID	5.00	5.30	DBMP	16:54			28.63/8.78
RUB3YID	5.30	5.80	DBMP	16:14			29.00/9.40
RUB4YID	5.90	6.20	DBMP	14:08			29.90/0.20
RUB5YID	6.30	6.50	DBMP	16:51			30.70/1.00

RELATED DATA

USD/RUB Forwards
<RUBF=>
<0#RUBF=>
<0#FWD-RUB>
<0#RUBID=>
Deposits
<RUBDEPO=>
<USDDEPORU=>
<EURDEPORU=>

RELATED VIEWS

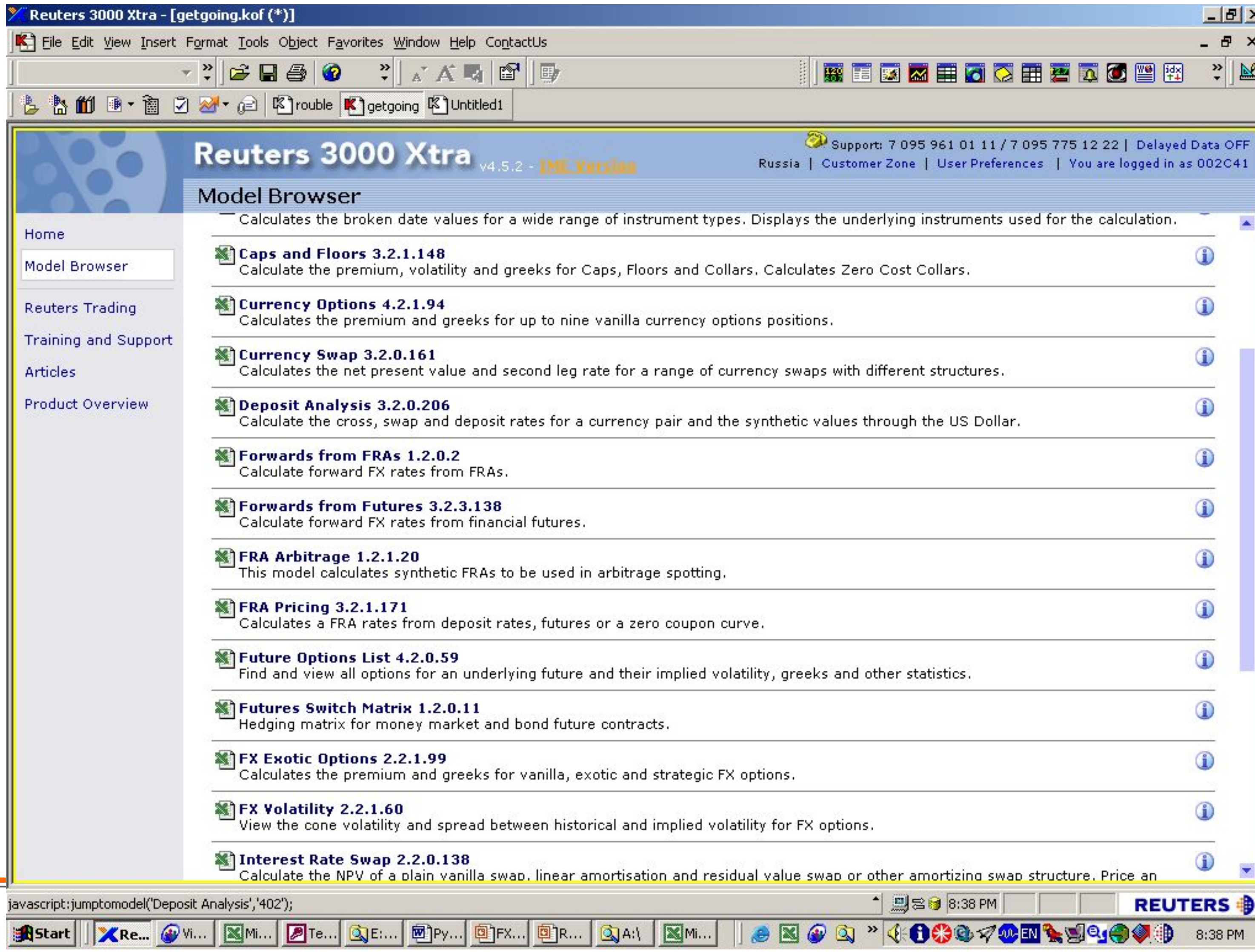
<RUBVIEW>
<RUSMKT=>
<0#RUB=>

INDICATORS

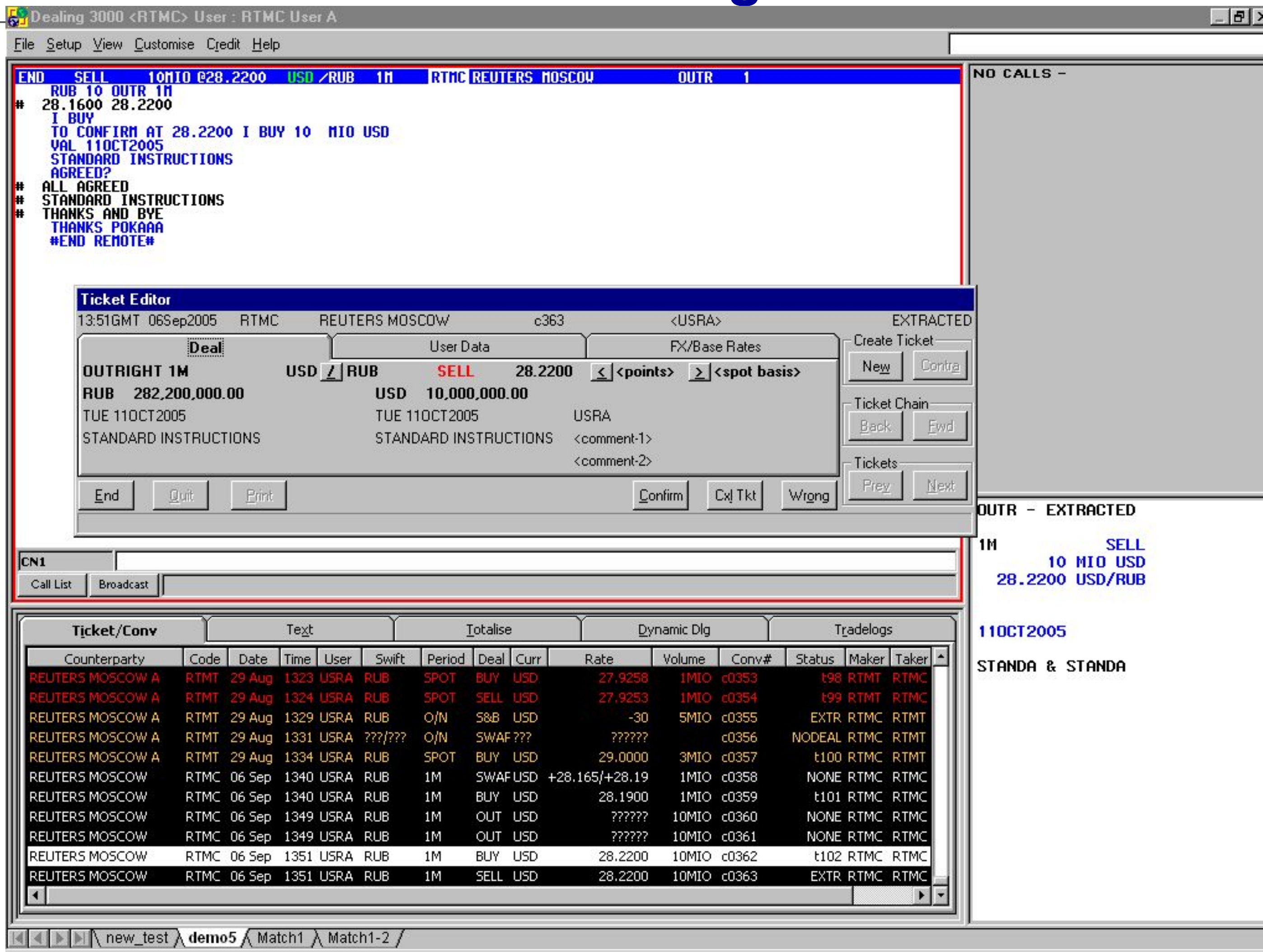
<RIBER=>
<USDRUBFIX=>
<RUBMCMEEMTA=>
<MOSIBOR=>
<MOSPRIME=>

Динамика изменения котировок по форвардам

Аналитические модели по валютному рынку в 3000Xtra



Заключение форвардных сделок через Reuters Dealing 3000

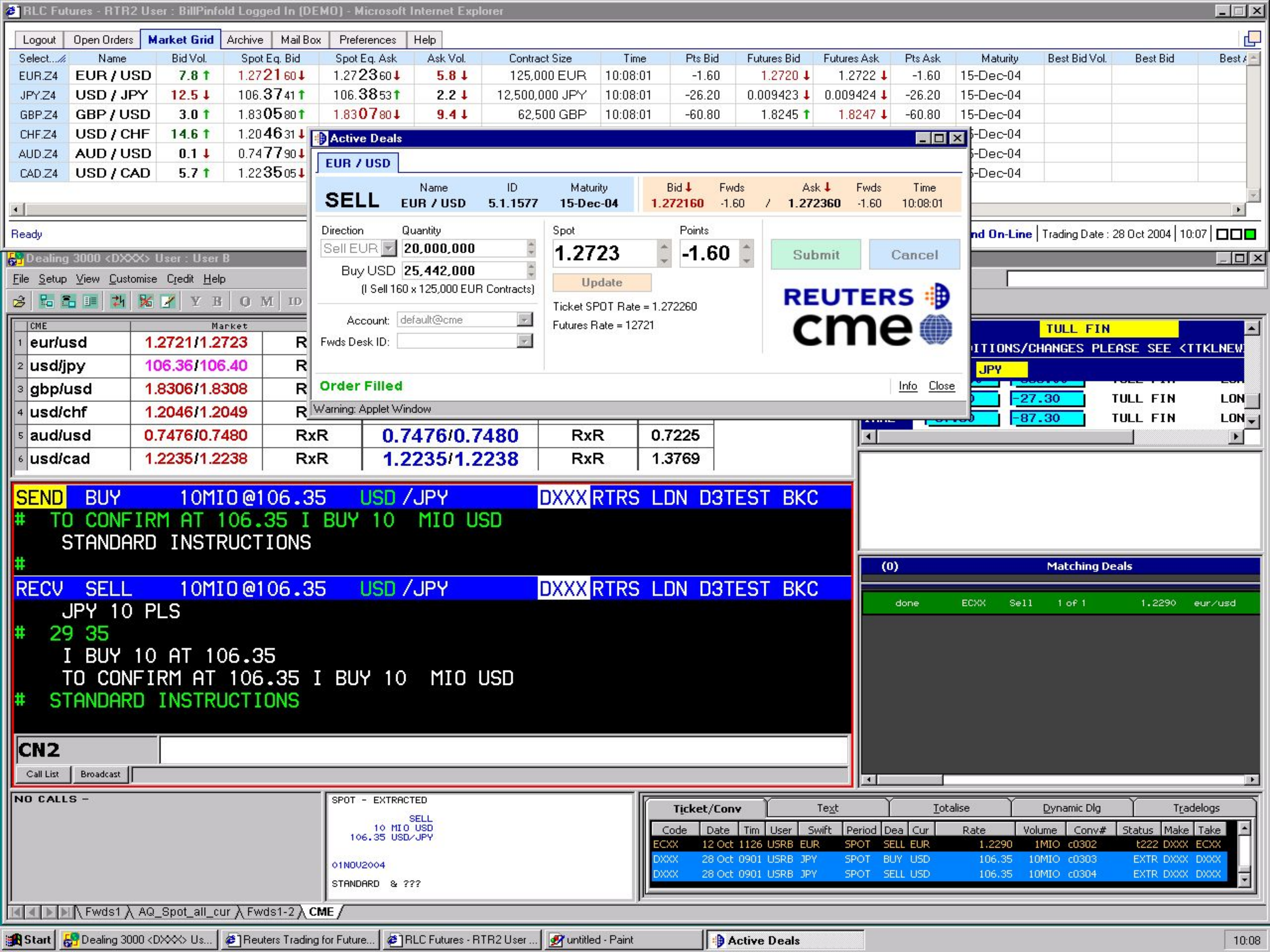


Новые возможности Рейтер – доступ к CME FX

Торговля на CME FX теперь также доступна через Reuters Dealing 3000

Ваш Reuters Dealing 3000 может включать панель цен с CME FX, где CME FX фьючерсы будут представлены в форме внебиржевой сделки

Сделки вводятся в форме внебиржевой – в пересчете стандартных контрактов в спот эквивалент (цены на фьючерсы за минусом форвардных пунктов)


RLC Futures - RTR2 User : BillPinfold Logged In (DEMO) - Microsoft Internet Explorer
Logout
Open Orders
Market Grid
Archive
Mail Box
Preferences
Help
Select... Name Bid Vol. Spot Eq. Bid Spot Eq. Ask Ask Vol. Contract Size Time Pts Bid Futures Bid Futures Ask Pts Ask Maturity Best Bid Vol. Best Bid
EUR.Z4 EUR / USD 7.8 1.272160 1.272360 5.8 125,000 EUR 10:08:01 -1.60 1.2720 1.2722 -1.60 15-Dec-04
JPY.Z4 USD / JPY 12.5 106.3741 106.3853 2.2 12,500,000 JPY 10:08:01 -26.20 0.009423 0.009424 -26.20 15-Dec-04
GBP.Z4 GBP / USD 3.0 1.830580 1.830780 9.4 62,500 GBP 10:08:01 -60.80 1.8245 1.8247 -60.80 15-Dec-04
CHF.Z4 USD / CHF 14.6 1.204631
AUD.Z4 AUD / USD 0.1 0.747790
CAD.Z4 USD / CAD 5.7 1.223505
Ready
Trading Date : 28 Oct 2004 10:07
Active Deals
EUR / USD
SELL
Name EUR / USD
ID 5.1.1577
Maturity 15-Dec-04
Bid 1.272160
Fwds -1.60
Ask 1.272360
Fwds -1.60
Time 10:08:01
Direction Sell EUR
Quantity 20,000,000
Buy USD 25,442,000
(I Sell 160 x 125,000 EUR Contracts)
Account: default@cme
Fwds Desk ID:
Spot 1.2723
Points -1.60
Update
Ticket SPOT Rate = 1.272260
Futures Rate = 12721
Submit
Cancel
REUTERS
cme
Order Filled
Info
Close
Warning: Applet Window
Dealing 3000 <DXXX> User : User B
File Setup View Customise Credit Help
CME Market
1 eur/usd 1.2721/1.2723
2 usd/jpy 106.36/106.40
3 gbp/usd 1.8306/1.8308
4 usd/chf 1.2046/1.2049
5 aud/usd 0.7476/0.7480 RxR 0.7476/0.7480 RxR 0.7225
6 usd/cad 1.2235/1.2238 RxR 1.2235/1.2238 RxR 1.3769
SEND BUY 10MIO @106.35 USD /JPY DXXX RTRS LDN D3TEST BKC
TO CONFIRM AT 106.35 I BUY 10 MIO USD
STANDARD INSTRUCTIONS
#
RECV SELL 10MIO @106.35 USD /JPY DXXX RTRS LDN D3TEST BKC
JPY 10 PLS
29 35
I BUY 10 AT 106.35
TO CONFIRM AT 106.35 I BUY 10 MIO USD
STANDARD INSTRUCTIONS
CN2
Call List
Broadcast
TULL FIN
JPY
-27.30 TULL FIN
-87.30 TULL FIN
(0) Matching Deals
done ECXX Sell 1 of 1 1.2290 eur/usd
NO CALLS –
SPOT - EXTRACTED
SELL
10 MIO USD
106.35 USD/JPY
01NOV2004
STANDARD & ???
Ticket/Conv
Text
Totalise
Dynamic Dlg
Tradelogs
Code Date Tim User Swift Period Dea Cur Rate Volume Conv# Status Make Take
ECXX 12 Oct 1126 USRB EUR SPOT SELL EUR 1.2290 1MIO c0302 t222 DXXX ECXX
DXXX 28 Oct 0901 USRB JPY SPOT BUY USD 106.35 10MIO c0303 EXTR DXXX DXXX
DXXX 28 Oct 0901 USRB JPY SPOT SELL USD 106.35 10MIO c0304 EXTR DXXX DXXX
Fwds1
AQ_Spot_all_cur
Fwds1-2
CME
Start
Dealing 3000 <DXXX> Us...
Reuters Trading for Future...
RLC Futures - RTR2 User ...
untitled - Paint
Active Deals
10:08

Подключение к CME FX через Рейтер

- Прямой электронный доступ к рынку CME FX осуществляется при помощи авторизованной клиринговой компании на CME через Рейтер

- Шаг 1
  - На сайте www.cmeonreuters.com находится список авторизованных клиринговых компаний

- Шаг 2
  - Открыть счет в клиринговой компании

- Шаг 3
  - Рейтер осуществит подключение к CME FX через Ваш Dealing 3000

Новые технологии – Reuters Electronic Trading

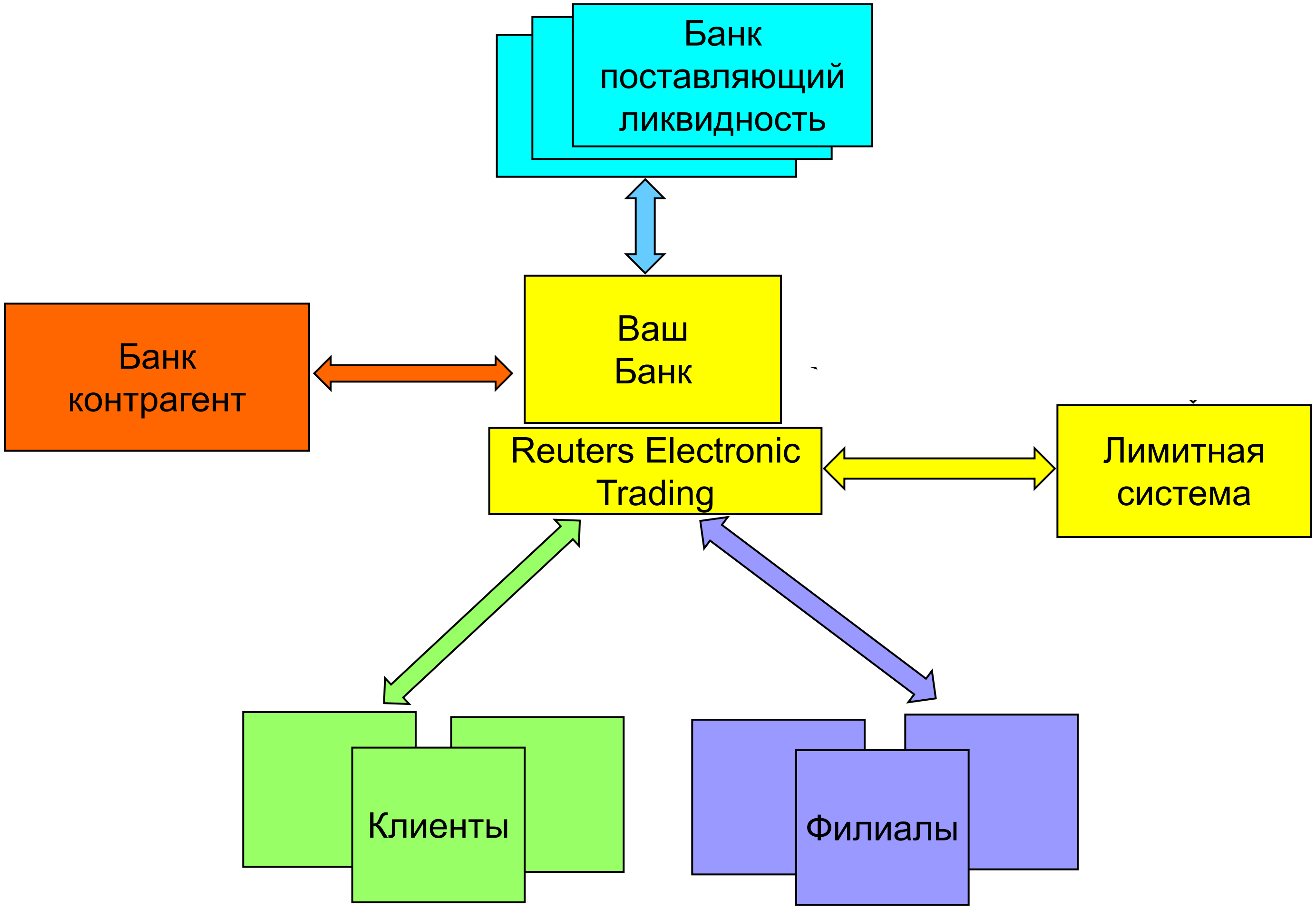
Создание банковских торговых порталов

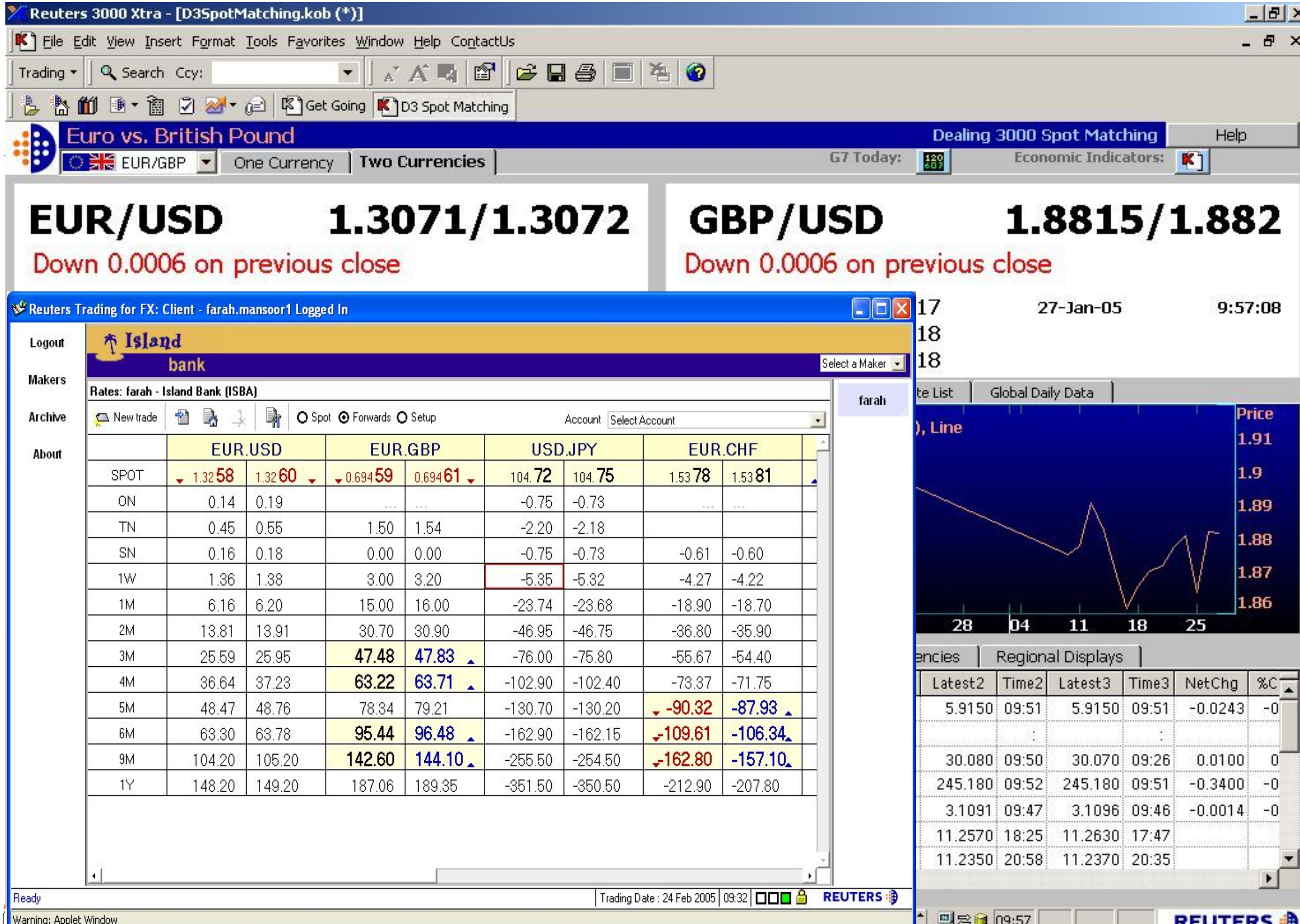
Интернет система для валютно-денежных операций клиентов банка

- Автоматизация FX/MM бизнеса с филиалами и клиентами
- Поддержка срочного рынка (валютные форварды)
- Автоматизация FX ценообразования и сделок
- Система управления лимитированными заявками от филиалов и клиентов
- Мониторинг заявок относительно рынка

RET использует более половины из 10 крупнейших FX порталов мира

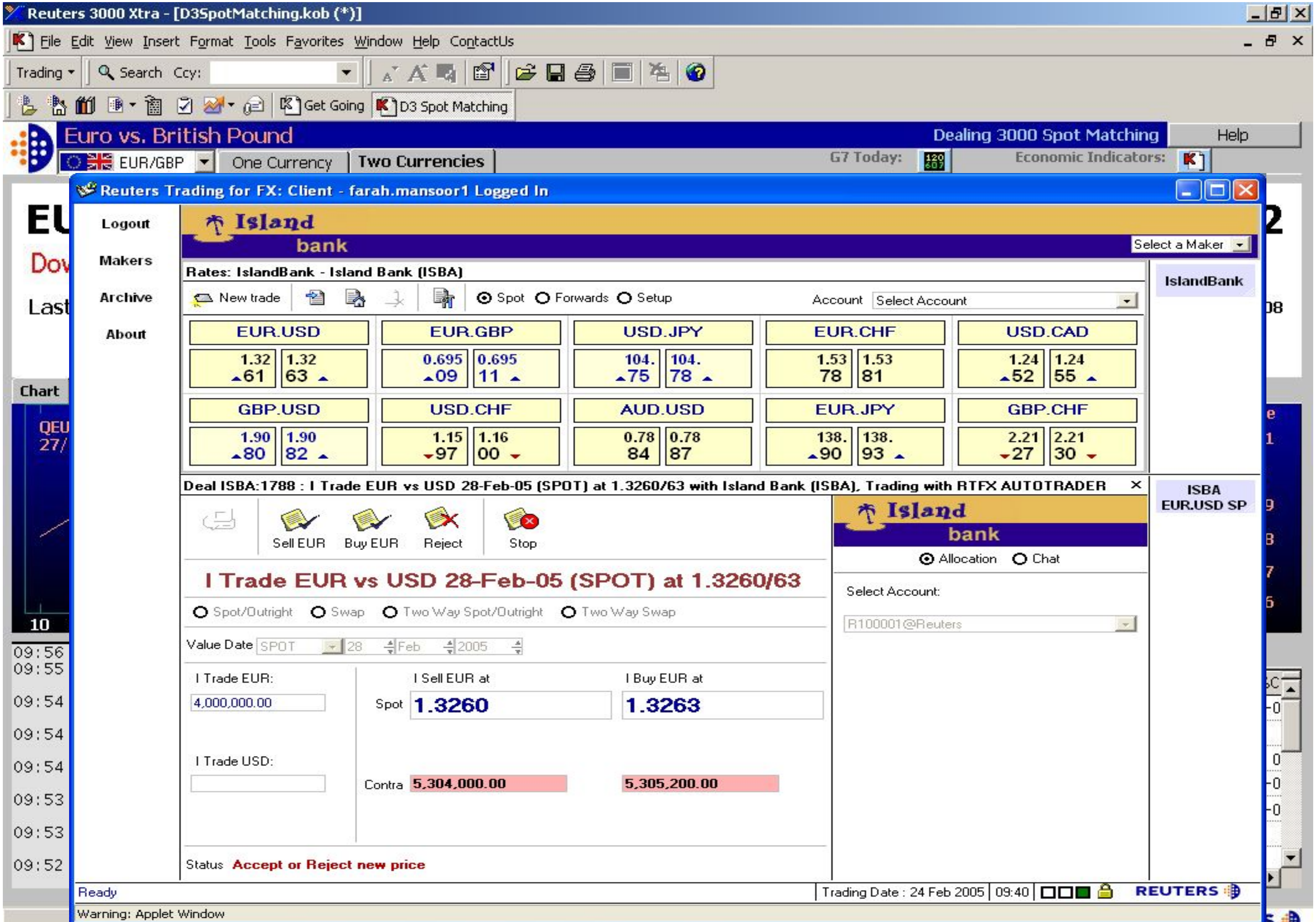
Модель работы через Reuters Electronic Trading





Деривативы на финансовом рынке России

REUTERS



Деривативы на финансовом рынке России

REUTERS

Что может предложить Рейтер?

- Информационное поддержка и аналитика срочного рынка в 3000Xtra
- Торговля через Reuters Dealing 3000 форвардными контрактами
- Доступ к торговле фьючерсами на CME FX через Reuters Dealing 3000
- Создание банковских порталов для торговли на рынке спот и форвард

Почему Рейтер?

- N1 поставщик для работы на валютно-денежном рынке
- Многолетний опыт и надежность
- Инновации и технологии
- Репутация