

Май, 2016



# Инструменты для управления рисками

- Risknet & Yield Manager NY4/LD4
- FXBenchmark.com
- Открытая валютная биржа ОСХ/Алготрейдинг
- FXInside/BankFX/FXCloud/FXCloud Watch
- Ретайл Gateways MT4/MT5



# Интернализация

## Yield Manager

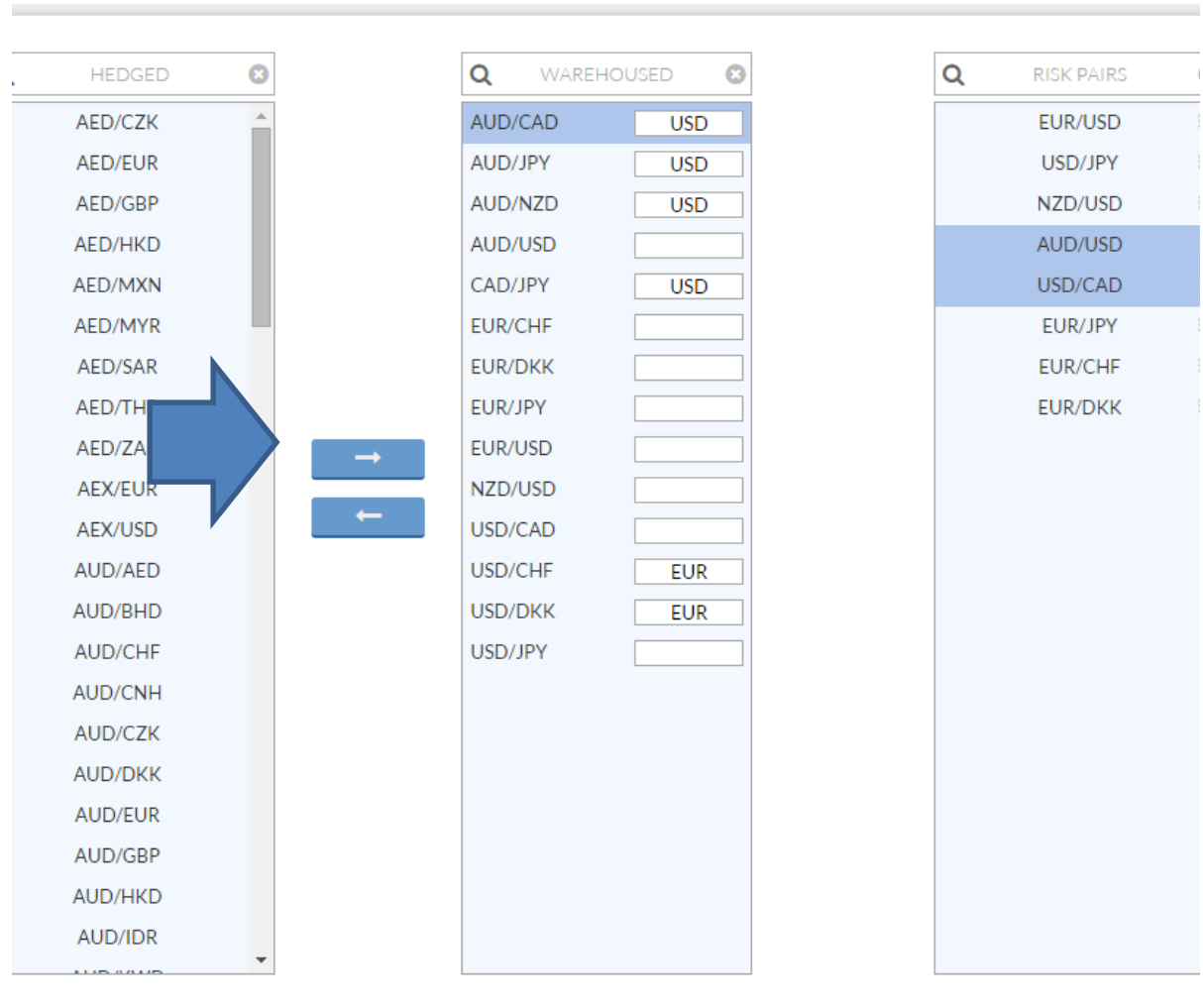
- Профайлинг клиента
- Следующее поколение интернализации
- Интернализация на основе валюты а не валютной пары



“shared wallet” - “общая прибыль”

Lit or un lit orders @ mid-rate

## Возможность нетинга синтетических кроссов в рисковые валютные пары

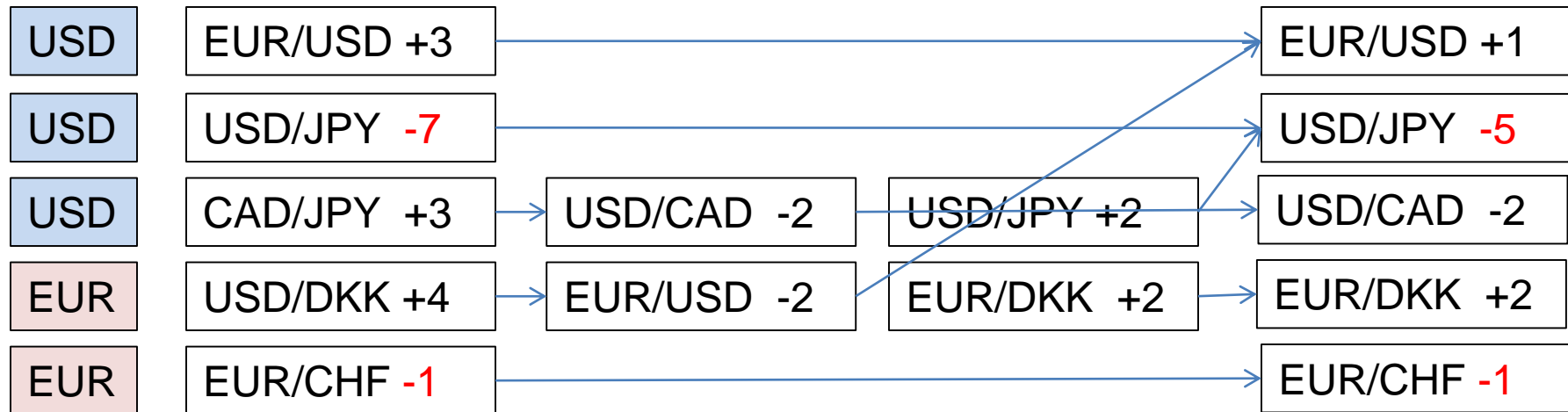


## Пример хеджа основанного на валюте

Currency Pair Method

Risk Currency Method

Split Currency



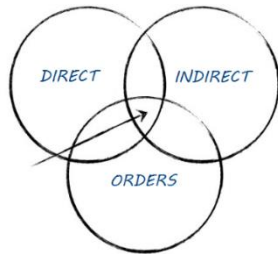
Cash Exposure

USD	EUR	JPY	CAD	DKK	CHF
-9	2	+500	+3	-16	+1.2

- Used Exchange Rates
- 1 USD=1.5 CAD
  - 1 USD=100 JPY
  - 1 EUR=2 USD
  - 1 EUR=8 DKK
  - 1 EUR=1.2 CHF

# ОСХ: Открытая Валютная Биржа

- Неограниченное количество торгов за \$ 275 в месяц, API \$3 per mio
- Современный пользовательский интерфейс на Windows, HTML5 веб-браузеров , Mac OS X и IOS.
- Центральный клиринг через банки первого звена или через брокеров



## RUB/Pairs LD4

8 + локальных маркет мейкеров  
5 + не локальных маркет мейкеров  
клиентские заявки

## Другие CCY LD4/NY4

22+ в LD4  
50+ в NY4

банки, хедж фонды, брокеры, клиентские заявки

## Spot/Swap/NDFs/Metals/CFDs

Orders

EUR/USD

Value Date: 09-Mar

1.09 **61** 1      1.09 **61** 3

LMT   MKT   STOP   TP/SL

OCX RiskNet   OCX Fixing   **TWAP**

Buy   100M   EUR

**Parameters**

Total Execution Time: 00 : 05 : 00

No Worse Than   1.09 **53** 9

Clip Details

Clip Size: 1.67M   20% (1.34M - 2.01M)    Randomize:

Range: 1.0

Clip Interval: 00 : 00 : 05   20% (4 - 6 sec)    Randomize:

Start Time: Start Now

Action At Expiry:  Cancel Balance    Fill Balance at Market

Notes

Order Summary

Place Order

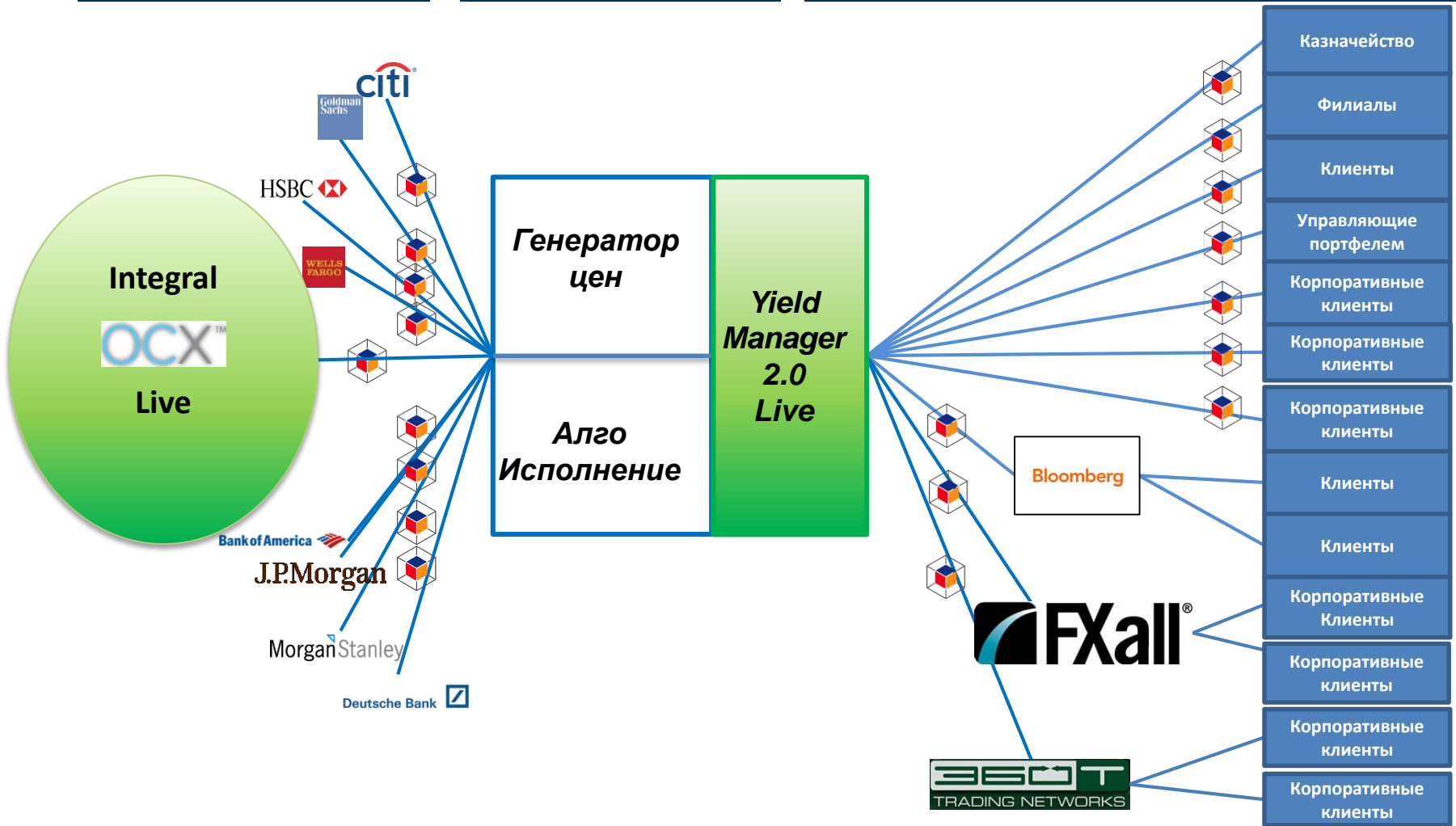
- Limit
- Market
- Stop
- TPSL
- If Done
- TWAP
- PEG
- Iceberg
- If done
- VWAP
- FOK
- IOC
- OCO

# Аналитика торговли клиента

## Price Improvement \$44794,73

CcyPair	Attempted/ Missed	TotalVolUSD	Orders	Trades	FilledAmount	Vol Fill Ratio	Avg Fill Ratio	Avg PI in Pips	Total PI in USD	PI as \$ Per Million	AvgSize	MedianSize	AvgMarket Shift
<b>Total</b>		<b>\$10,719,464,000</b>	<b>19398</b>	<b>19,655</b>	<b>\$7,563,257,630</b>	<b>0.71</b>	<b>0.67</b>	<b>0.10</b>	<b>\$44,794.73</b>	<b>\$5.9</b>	<b>473,828</b>	<b>500,000</b>	<b>0.77</b>
GBP/USD	Attempted	\$786,093,989	1114	1,422	\$717,241,771	0.91	0.90	0.14	\$5,153.51	\$7.2	464,365	500,000	0.96
GBP/USD	Missed	\$371,866,743	683	0	\$0	0.00	0.00	-	\$0.00	-	357,878	300,000	2.07
USD/CHF	Attempted	\$447,126,484	909	1,563	\$354,754,838	0.79	0.81	0.18	\$6,848.51	\$19.3	491,888	500,000	1.93
USD/CHF	Missed	\$91,059,640	231	0	\$0	0.00	0.00	-	\$0.00	-	394,198	500,000	2.62
EUR/CHF	Attempted	\$202,519,167	353	550	\$167,141,000	0.83	0.82	0.23	\$3,600.88	\$21.5	504,673	500,000	-
EUR/CHF	Missed	\$45,447,590	114	0	\$0	0.00	0.00	-	\$0.00	-	349,228	400,000	-
EUR/USD	Attempted	\$6,528,495,526	11199	14,664	\$5,934,635,289	0.91	0.91	0.05	\$25,044.89	\$4.2	506,855	500,000	0.44
EUR/USD	Missed	\$1,729,278,140	3659	0	\$0	0.00	0.00	-	\$0.00	-	410,874	300,000	1.08
GBP/JPY	Attempted	\$24,042,685	46	55	\$22,561,782	0.94	0.94	0.54	\$476.21	\$21.1	344,587	235,000	-
GBP/JPY	Missed	\$5,649,837	14	0	\$0	0.00	0.00	-	\$0.00	-	264,214	100,000	-
EUR/GBP	Attempted	\$34,904,985	130	145	\$30,194,008	0.87	0.87	0.03	\$220.12	\$7.3	233,962	131,000	-
EUR/GBP	Missed	\$18,133,295	58	0	\$0	0.00	0.00	-	\$0.00	-	272,793	184,000	-
EUR/NOK	Attempted	\$656,817	3	4	\$656,817	1.00	1.00	46.23	\$73.35	\$111.7	194,000	41,000	-
EUR/SEK	Attempted	\$1,745,441	11	11	\$1,599,305	0.92	0.90	0.10	\$1.23	\$0.8	139,909	128,000	-
EUR/SEK	Missed	\$854,804	6	0	\$0	0.00	0.00	-	\$0.00	-	125,833	114,500	-
USD/TRY	Attempted	\$341,570,849	721	1,191	\$297,356,499	0.87	0.88	0.31	\$3,334.78	\$11.2	473,746	500,000	-
USD/TRY	Missed	\$44,286,732	86	0	\$0	0.00	0.00	-	\$0.00	-	514,962	500,000	-
EUR/TRY	Attempted	\$37,694,723	50	50	\$37,116,323	0.98	0.98	0.02	\$41.26	\$1.1	646,700	785,000	-
EUR/TRY	Missed	\$8,036,553	11	0	\$0	0.00	0.00	-	\$0.00	-	629,545	700,000	-





# FXCloud Watch



# Знакомство с Integral

Банки используют Integral для	<ul style="list-style-type: none"><li>• <b>Создание</b></li><li>• <b>Доставка</b></li><li>• <b>Рост</b></li></ul> <p>} эл. ФХ бизнес в LD4/NY4</p>
Надежность	<p>500,000 торгов в день 10,000 пиковых торгов за минуту 1,000,000,000 рейтов в день объем торговли более 10 трл в год</p>
О нас	<ul style="list-style-type: none"><li>• <b>Опыт:</b> Основана в 1993 году,, регулируется в (Японии, Сингапуре, США, Европе)</li><li>• <b>Уважение:</b> сотни клиентов: институциональные и ритейловые, включая Wells Fargo Global, Mizuho Bank</li><li>• <b>Разработка:</b> более 300 профессионалов в Силиконовой долине, Нью-Йорке, Лондоне, Токио, Сингапуре и Бангалор</li></ul>