

ПРЯМОЙ ДОСТУП НА ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК ОАО «МОСКОВСКАЯ БИРЖА»

С ПРАЙМ-БРОКЕРОМ

ФИНАНСОВОЕ АТЕЛЬЕ



30 мая 2013 года, г. Екатеринбург



ВИЗИТНАЯ КАРТОЧКА «GROTTBJORN»:

О КОМПАНИИ



- ◆ Компания на фондовом рынке России работает с 1995-го года
- ◆ Единственная Уральская компания – Профессиональный Участник рынка ценных бумаг (РЦБ) РФ, имеющая прямые договорные отношения с ОАО «Московская биржа» и ЗАО АКБ «Национальный клиринговый центр» в секции Валютного рынка
- ◆ Компания является Прайм-брокером на Валютном рынке (1 из 17 в России)
- ◆ Финансовое ателье не аффилировано с каким-либо банком, и не является частью финансовой группы, где есть банк, что исключает возможный конфликт интересов по конверсионным операциям
- ◆ С 2012 года Компания работает под торговой маркой Финансовое ателье «GrottBjorn»

ВИЗИТНАЯ КАРТОЧКА «GROTTBJORN»:

ЛИЦЕНЗИИ



Лицензия №166-02695-010000 на осуществление **дилерской** деятельности, выданной ФКЦБ России 01.11.2000. Без ограничения срока действия.



Лицензия №166-02672-100000 на осуществление **брокерской** деятельности, выданной ФКЦБ России 01.11.2000. Без ограничения срока действия.



Лицензия №066-13299-000100 на осуществление **депозитарной** деятельности, выданной ФСФР России 02.09.2010. Без ограничения срока действия.



Лицензия №066-13298-001000 на осуществление деятельности по **управлению** ценными бумагами, выданной ФСФР России 02.09.2010. Без ограничения срока действия.

ЧТО ТАКОЕ ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК:

ОБЩАЯ ИНФОРМАЦИЯ



- ❖ **Валютный рынок** – это секция торгов в ОАО «Московская биржа», на которой происходит организованная купля-продажа иностранной валюты по стандартизированным правилам
- ❖ Уникальная секция торгов, где можно «увидеть» заявки порядка 600 Участников, как правило банков и профессиональных участников рынка ценных бумаг, которые они подают от своего имени или **от лица тысяч своих клиентов**
- ❖ Заявки подаются анонимно, т.е. только биржа видит Участника, который подал заявку
- ❖ Торги происходят в режиме реального времени, а заявки на куплю-продажу иностранной валюты подаются электронным способом через торговые терминалы
- ❖ Центральный Банк РФ определяет свои курсы по наиболее востребованным валютам именно по результатам торгов на Валютном рынке
- ❖ **Работая на Валютном рынке, Вы автоматически участвуете в формировании рыночного курса иностранной валюты**

ЮРИДИЧЕСКИЕ АСПЕКТЫ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ:

ИЗМЕНЕНИЯ В ЗАКОНОДАТЕЛЬСТВЕ

В 2012 году вступили в силу изменения законодательства, позволившие компаниям – Профессиональным Участникам РЦБ и их клиентам получить прямой доступ к валютному рынку, который ранее был доступен только банкам:



№325-ФЗ от 21.11.2011 «Об организованных торгах»

Пункт 3 статьи 16: «К участию в организованных торгах иностранной валютой могут быть допущены кредитные организации, имеющие право на основании лицензий Банка России осуществлять банковские операции со средствами в иностранной валюте, центральный контрагент, Банк России, а также иные юридические лица, которые вправе осуществлять куплю-продажу иностранной валюты в силу федерального закона. Если договоры купли-продажи иностранной валюты на организованных торгах заключаются с центральным контрагентом, являющимся уполномоченным банком, к участию в этих организованных торгах могут быть допущены иные юридические лица, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации»

№173-ФЗ от 10.12.2003 «О валютном регулировании и валютном контроле»

Подпункт 22 Пункта 1 Статьи 9: «Операций между комиссионерами (агентами, поверенными) и комитентами (принципалами, доверителями) при оказании комиссионерами (агентами, поверенными) услуг, связанных с заключением и исполнением договоров, обязательства по которым подлежат исполнению по итогам клиринга, осуществляемого в соответствии с Федеральным законом «О клиринге и клиринговой деятельности», в том числе возвратом комитентам (принципалам, доверителям) денежных сумм (иного имущества)»

ЮРИДИЧЕСКИЕ АСПЕКТЫ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ:

КУПЛЯ-ПРОДАЖА ВАЛЮТЫ И ВАЛЮТНЫЕ ПЕРЕВОДЫ

Валютный рынок ОАО «Московская биржа» построен таким образом, чтобы при работе на нём соблюдалось валютное законодательство РФ, и обеспечивалась высокая надёжность при расчётах по заключённым сделкам:



ЗАО АКЦ «Национальный клиринговый центр» <http://nkcbank.ru/>

- ◆ **Уполномоченная кредитная организация (УКО)** на Валютном рынке ОАО «Московская биржа», авторизованная для проведения клиринга и расчётов по заключённым сделкам в соответствии с Федеральным законом от 07 февраля 2011 №7-ФЗ «О Клиринге и клиринговой деятельности»
- ◆ ЗАО АКБ «НКЦ» является центральным контрагентом по сделкам, заключённым в секции валютного рынка ОАО «Московская биржа», таким образом, УКО в сделках купли-продажи иностранной валюты выступает, де-юре, покупателем для продавца и продавцом для покупателя, чем обеспечивается выполнение требования Пункта 1 Статьи 11 от 10 декабря 2003 года №173-ФЗ «О валютном регулировании и валютном контроле»

Центральным банком РФ предусмотрены операции по расчётам между Профессиональным участником РЦБ и Клиринговой организацией, а также между Профессиональным участником и Клиентом, даже если обе стороны являются резидентами:

Инструкция ЦБ РФ от 04 июня 2012 года №138-И

- ◆ Код валютной операции при перечислении иностранной валюты между Брокером и УКО – 61160 и 61161
- ◆ Код валютной операции при перечислении иностранной валюты между Брокером и Клиентом – 61162
- ◆ Паспорт сделки по данным операциям не составляется

ПРЕИМУЩЕСТВА ПРЯМОГО ДОСТУПА:

ПРОЗРАЧНОСТЬ (1/4)

Работая с нами, Вы «видите» рынок, а значит: Знаете текущий рыночный курс

Вы имеете возможность наблюдать за динамикой цены и изменением текущего курса в режиме реального времени, используя предоставленный GrottBjorn торговый терминал

И всегда будете «держать руку на пульсе», поэтому у вас не будет необходимости постоянно звонить в свой банк и уточнять текущий курс валюты

Цена	Объем	Сумма	Цена	Объем	Сумма
31,4000	100	46 479	31,3950	5 010	31 475
31,3995	1	46 379	31,3940	700	26 465
31,3990	5 000	46 378	31,3935	64	25 765
31,3980	1	41 378	31,3905	1 000	25 701
31,3950	5 502	41 377	31,3900	32	24 701
31,3910	1	35 875	31,3890	1 000	24 669
31,3900	5 100	35 874	31,3885	1 000	23 669
31,3885	5 000	30 774	31,3875	1 000	22 669
31,3880	1 631	25 774	31,3865	1 000	21 669
31,3850	1 000	24 143	31,3860	1 000	20 669
31,3840	1	23 143	31,3850	3 000	19 669
31,3825	1 000	23 142	31,3845	1 000	16 669
31,3815	1 000	22 142	31,3840	200	15 669
31,3805	1 000	21 142	31,3830	1 000	15 469
31,3800	5 000	20 142	31,3825	1 028	14 469
31,3770	501	15 142	31,3815	500	13 441
31,3760	2 000	14 641	31,3805	500	12 941
31,3750	4 649	12 641	31,3800	9 625	12 441
31,3745	3 347	7 992	31,3795	74	2 816
31,3725	4 645	4 645	31,3775	2 742	2 742
31,3705	1 000	1 000	31,3760	2	2
31,3700	787	1 787	31,3755	164	166
31,3690	150	1 937	31,3750	1 250	1 416
31,3680	120	2 057	31,3740	91	1 507
31,3675	2 700	4 757	31,3735	1 500	3 007
31,3665	1 000	5 757	31,3730	1 000	4 007
31,3650	1 117	6 874	31,3725	950	4 957
31,3645	1 000	7 874	31,3720	200	5 157
31,3635	1 000	8 874	31,3705	1 001	6 158
31,3625	5 703	14 577	31,3700	4 100	10 258
31,3610	300	14 877	31,3695	1 255	11 513
31,3605	100	14 977	31,3685	1 006	12 519
31,3600	4 156	19 133	31,3680	1 500	14 019
31,3570	3 800	22 933	31,3675	267	14 286
31,3555	240	23 173	31,3670	91	14 377
31,3550	2 807	25 980	31,3650	440	14 817
31,3545	100	26 080	31,3640	64	14 881
31,3510	100	26 180	31,3635	1 000	15 881
31,3505	310	26 490	31,3630	1	15 882
31,3500	11 235	37 725	31,3615	80	15 962



Продавцы

**СТАКАН
КОТИРОВОК**

Покупатели

ПРЕИМУЩЕСТВА ПРЯМОГО ДОСТУПА:

ПРОЗРАЧНОСТЬ (2/4)

*Работая с нами, Вы «видите» рынок, а значит: **Заклучаете сделки на Бирже по рыночным ценам***

Вы можете быть уверены, что не переплачиваете, даже если банк предлагает «дружественный» курс, потому что банки приобретают валюту на этом же рынке

31,3770	501	15 142
31,3760	2 000	14 641
31,3750	4 649	12 641
31,3745	3 341	3 992
31,3725	4 645	4 645
31,3705	1 000	1 000
31,3700	307	1 787
31,3690	150	1 937
31,3680	120	2 057



MMVB Валюта: ETC Ввод заявки

Инструмент USDRUB_TOD	Торговый Счет MB0276603423	В поле "Цена": <input checked="" type="radio"/> Цена <input type="radio"/> Доходность <input type="radio"/> Срвзв.цена
<input checked="" type="radio"/> Покупка <input type="radio"/> Продажа	Цена 31,3770 <input type="checkbox"/> Рыночная	Кол-во (лот 1000) 3000 max: 0
Объем и комиссия 94131000,00 0,00 Задать количество	Код Клиента	Поручение
Условие исполнения Поставить в очередь	Да	Отмена <<



ПРЕИМУЩЕСТВА ПРЯМОГО ДОСТУПА:

ПРОЗРАЧНОСТЬ (3/4)

Работая с нами, Вы «видите» рынок, а значит: **Выбираете самостоятельно момент заключения сделки**

Вы можете немедленно купить/продать валюту по текущему курсу, а можете выставить заявку на покупку-продажу по приемлемому для вас курсу, однако, в этом случае нет гарантии, что рыночная цена достигнет заданного уровня



31,3770	501	15 142
31,3760	2 000	14 641
31,3750	4 649	12 641
31,3740	3 341	7 992
31,3725	4 645	4 645
31,3705	1 000	1 000
31,3700	787	1 787
31,3690	150	1 937
31,3680	120	2 057

ММВБ Валюта: ETC Ввод заявки

Инструмент: USDRUB_TOD | Торговый Счет: MB0276605766

Покупка | Продажа

Цена: 31,25 | Кол-во (лот 1000): 300

Объем и комиссия: 9375000,00 | 0,00

Код Клиента: | Поручение: | Условие исполнения: Поставить в очередь

Да | Отмена <<

Валюта - Таблица заявок												
	Номер	Выставл	Снята (в	Бумага	Операци	Счет	Цена	Кол-во	Видимое	Остаток	Объем	Состояние
1	5135205713	10:58:17		USDRUB_TOD	Купля	MB0276603423	31,2500	300		300	9 375 000,00	Активна

ПРЕИМУЩЕСТВА ПРЯМОГО ДОСТУПА:

ПРОЗРАЧНОСТЬ (4/4)

Работая с нами, Вы «видите» рынок, а значит: Получаете Отчёт брокера об операциях, предусмотренный законодательством

В отличие от банка, мы предоставляем отчёт о проведённых операциях, в котором в явном виде указаны параметры совершенных сделок по купле-продаже иностранной валюты, включая номера сделок на Бирже. Таким образом, Вы можете проверить, а была ли действительно заключена именно эта сделка и именно с такими параметрами



**Просто и
понятно!!!**

1.6. Инструменты валютного рынка:

Дата совершения сделки	Время совершения сделки	Биржевой номер сделки	Инструмент	Тип сделки	Вид сделки (покупка, продажа, иной вид)	Курс сделки	Валюта лота	Объем в валюте лота, лот	Сопряженная валюта	Объем в сопряженной валюте	Место заключения сделки
17.05.2013	17:49:26	77 910 477	USDRUB_TOD	T	K	31.3680000000	USD	10000.00	RUR	313680.00	Валютный рынок (ETC)
17.05.2013	17:50:11	77 910 480	USDRUB_TOD	T	K	31.3685000000	USD	10000.00	RUR	313685.00	Валютный рынок (ETC)
17.05.2013	17:50:43	77 910 496	USDRUB_TOD	T	K	31.3675000000	USD	10000.00	RUR	313675.00	Валютный рынок (ETC)
17.05.2013	17:51:48	77 910 519	USDRUB_TOD	T	P	31.3710000000	USD	5000.00	RUR	156855.00	Валютный рынок (ETC)
17.05.2013	17:51:48	77 910 520	USDRUB_TOD	T	P	31.3705000000	USD	5000.00	RUR	156852.50	Валютный рынок (ETC)
17.05.2013	17:53:48	77 910 568	USDRUB_TOD	T	P	31.3800000000	USD	10000.00	RUR	313800.00	Валютный рынок (ETC)
17.05.2013	17:54:11	77 910 577	USDRUB_TOD	T	P	31.3800000000	USD	10000.00	RUR	313800.00	Валютный рынок (ETC)

Итого: Количество сделок = 7

1.7. Информация о незавершенной покупке / продаже инструментов валютного рынка :

Дата совершения сделки	Время совершения сделки	Биржевой номер сделки	Дата исполнения сделки	Инструмент	Тип сделки	Вид сделки (покупка, продажа, иной вид)	Курс сделки	Валюта лота	Объем в валюте лота, лот	Сопряженная валюта	Объем в сопряженной валюте	Место заключения сделки
17.05.2013	17:49:45	77 910 478	20.05.2013	USDRUB_TOM	T	P	31.3800000000	USD	10000.00	RUR	313800.00	Валютный рынок (ETC)
17.05.2013	17:50:18	77 910 481	20.05.2013	USDRUB_TOM	T	P	31.3800000000	USD	10000.00	RUR	313800.00	Валютный рынок (ETC)
17.05.2013	17:50:46	77 910 501	20.05.2013	USDRUB_TOM	T	P	31.3800000000	USD	10000.00	RUR	313800.00	Валютный рынок (ETC)
17.05.2013	17:53:09	77 910 564	20.05.2013	USDRUB_TOM	T	K	31.3790000000	USD	10000.00	RUR	313790.00	Валютный рынок (ETC)
17.05.2013	17:53:57	77 910 569	20.05.2013	USDRUB_TOM	T	K	31.3780000000	USD	10000.00	RUR	313780.00	Валютный рынок (ETC)
17.05.2013	17:54:17	77 910 580	20.05.2013	USDRUB_TOM	T	K	31.3750000000	USD	10000.00	RUR	313750.00	Валютный рынок (ETC)

Итого: Количество сделок = 6

ПРЕИМУЩЕСТВА ПРЯМОГО ДОСТУПА:

ПОНЯТНЫЕ ЗАТРАТЫ ПО ОПЕРАЦИЯМ

Структура Ваших затрат:

- ◆ Биржевая комиссия 0,0015% от сделки
- ◆ Брокерская комиссия 0,015% от сделки
- ◆ Комиссия за вывод валюты на банковский счёт - \$100 / €120 / 5 000 рублей (для китайских юаней)



Таким образом, Вы получаете экспоненциальную выгоду при увеличении объёма купли-продажи:

Затраты на \$1 в копейках



* \$1 = 31,3 рублей

ПРЕИМУЩЕСТВА ПРЯМОГО ДОСТУПА:

НИЗКИЕ РИСКИ



- ◆ **Высокая надёжность расчётов обеспечивается ЗАО АКБ «НКЦ»**
 - ◆ Расчёты по сделкам ведутся на счетах Уполномоченной кредитной организации (УКО) – Клиринговым банком, авторизованным ОАО «Московская биржа»
 - ◆ УКО имеет существенные собственные средства, страховые фонды и значительный кредитный лимит в ЦБ РФ
 - ◆ По всем заключенным сделкам, де-юре, контрагентом любой стороны выступает УКО, а значит, перед добросовестной стороной по сделке всегда будут исполнены обязательства за счёт средств УКО

- ◆ **Защита средств от возможных претензий**
 - ◆ Денежные средства клиентов хранятся на специальных брокерских счетах, открытых GrottBjörn в соответствии с законодательством РФ
 - ◆ На эти счета не распространяются возможные претензии по обязательствам брокера

ПРЕИМУЩЕСТВА ПРЯМОГО ДОСТУПА:

УДОБСТВО ЗАКЛЮЧЕНИЯ СДЕЛОК И РАСЧЁТА ПО НИМ (1/3)



◆ Вы можете совершать сделки в режиме «СЕГОДНЯ»

В режиме реального времени вы можете заключить сделку, и произвести расчёты по ней в этот же день в удобное для вас время:

- ◆ 12:00 (время московское)
- ◆ 15:00 (время московское)
- ◆ По регламентному времени УКО

СЕГОДНЯ

- ◆ Заключение сделки (на счёте 5-10% от суммы сделки)



СЕГОДНЯ

- ◆ Расчёт по сегодняшней сделке (на счёте 100% от суммы сделки)
- ◆ Перенос даты расчёта на последующие дни (на счёте 5-10% от суммы сделки)

ПРЕИМУЩЕСТВА ПРЯМОГО ДОСТУПА:

УДОБСТВО ЗАКЛЮЧЕНИЯ СДЕЛОК И РАСЧЁТА ПО НИМ (2/3)



- ◆ **Вы можете совершать сделки СЕГОДНЯ по курсу, который Вас устраивает, а рассчитываться на СЛЕДУЮЩИЙ день**
 - ◆ Вы можете работать на бирже даже если у Вас на счёте имеется не вся сумма для исполнения обязательств по заключенным сделкам. Для заключения сделок Вам необходимо иметь на брокерском счёте гарантийное обеспечение в размере порядка 5-10% от общей суммы сделок, тем самым
 - ◆ «Зафиксировать» курс и обезопасить себя от изменений курса не в вашу пользу

СЕГОДНЯ

- ◆ Заключение сделки (на счёте 5-10% от суммы сделки)



ЗАВТРА

- ◆ Расчёт по вчерашней сделке (на счёте 100% от суммы сделки)
- ◆ Перенос даты расчёта на последующие дни (на счёте 5-10% от суммы сделки)

ПРЕИМУЩЕСТВА ПРЯМОГО ДОСТУПА:

УДОБСТВО ЗАКЛЮЧЕНИЯ СДЕЛОК И РАСЧЁТА ПО НИМ (3/3)



❖ Вы можете перенести обязанность по исполнению сделок на СЛЕДУЮЩИЙ день

- ❖ Если в текущий день у вас не хватает денежных средств для исполнения своих обязательств по исполнению ранее заключенных сделок, Вы можете перенести обязательства по исполнению на следующий торговый день, понеся небольшие затраты, а в ряде случаев, даже и заработав на этом!

СЕГОДНЯ

- ❖ Расчёт по сделке (необходимо иметь на счёте 100% суммы)
- ❖ Есть понимание, что денег поставить, по какой-либо причине, не удастся



СЕГОДНЯ

- ❖ Перенос даты расчёта на последующие дни (на счёте необходимо иметь 5-10% от суммы сделки) путём:
 - ❖ Заключение сделки типа SWAP
 - ❖ Одновременная купля/продажа недостающего инструмента с расчётом «СЕГОДНЯ» и продажа/купля аналогичного инструмента с расчётом «ЗАВТРА»

ПРЕИМУЩЕСТВА ПРЯМОГО ДОСТУПА:

дополнительный доход



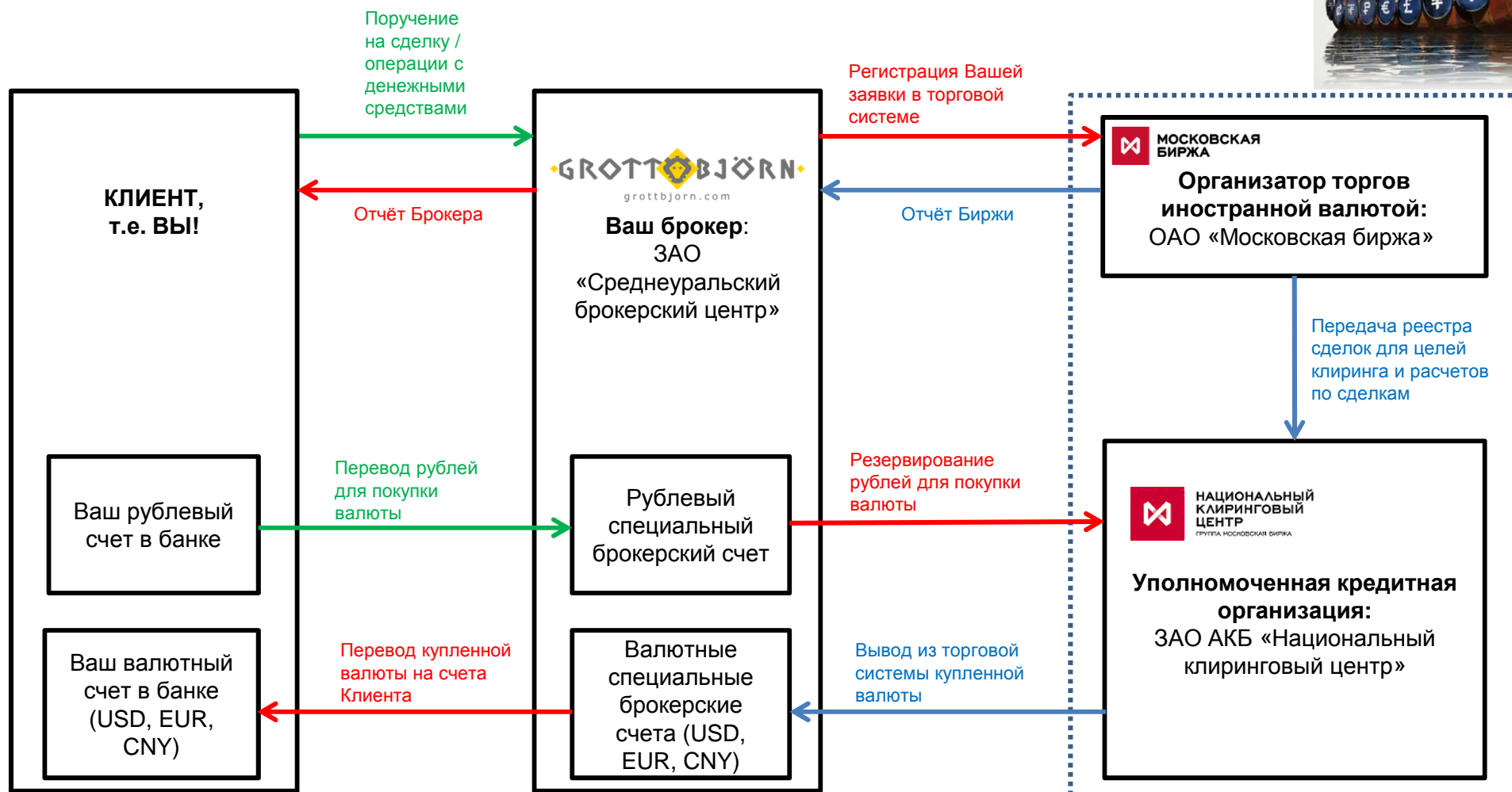
Работая с нами, Вы имеете возможность получать дополнительный доход:

- ◆ **Вы можете воспользоваться стандартными инструментами срочного, фондового и валютного рынков для получения дополнительной прибыли**
 - ◆ Вы получите возможность совершать арбитражные операции в разных сегментах рынка
 - ◆ А также заключать сделки РЕПО

- ◆ **И получаете возможность зарабатывать «безрисковую ставку»**
 - ◆ Вы можете направить свои денежные средства на операции, по которым будете получать доход, сопоставимый по размеру с банковским овернайтотом. Однако деньги банку вы даёте «под честное слово», а на валютном рынке вы получаете ликвидный залог, который, к тому же, можно использовать для своей деятельности, в том числе для расчётом по договорам с нерезидентами
 - ◆ Кроме того, используя систему «безрисковой ставки» клиент с объёмом сделки около \$500 000 за два дня полностью компенсирует комиссию брокера за вывод денежных средств, то есть, по сути, мы работаем для Вас «бесплатно»!

ЭТАПЫ И ФИЗИЧЕСКИЕ ДЕЙСТВИЯ:

ОРГАНИЗАЦИЯ ПРЯМОГО ДОСТУПА К СЕКЦИИ ВАЛЮТНОГО РЫНКА (ETC)



* Схема по деньгам работает и в обратную сторону, то есть Вы можете перевести иностранную валюту на специальный брокерский счёт для целей покупки российских рублей

Клиент →
Брокер →
Биржа →

ЭТАПЫ И ФИЗИЧЕСКИЕ ДЕЙСТВИЯ:

СХЕМА РАБОТЫ В СВЯЗКЕ БРОКЕР-КЛИЕНТ

Работа с нами строится по принципу классического брокерского обслуживания:

- ◆ **Заключение Договора на Брокерское обслуживание (один раз)**
 - ◆ Оформление договора
 - ◆ GrottBjorn регистрирует Вас в секции Валютного рынка (ETC) ОАО «Московская биржа»

- ◆ **Зачисление денежных средств (рубли или иностранной валюта)**
 - ◆ Вы зачисляете денежные средства на специальные брокерские счета GrottBjorn, которые открыты в соответствии с законодательством для учёта денежных средств Клиентов
 - ◆ Полученные денежные средства GrottBjorn резервирует на счетах УКО (ЗАО АКБ «НКЦ») для целей расчётов по сделкам по результатам клиринга

- ◆ **Заключение сделок и расчёты по ним**
 - ◆ Вы подаёте поручения на сделки самостоятельно через предоставленный торговый терминал, либо через трейдера по телефону и/или в офисе
 - ◆ На Бирже заключаются сделки, расчёт по которым проводит УКО по закону «О Клиринге и клиринговой деятельности»

- ◆ **Вывод денежных средств**
 - ◆ По результатам сделок Вы подаёте поручение на вывод денежных средств (рублей и/или иностранной валюты) на свои банковские счета
 - ◆ GrottBjorn выводит денежные средства со счетов УКО на свои специальные брокерские счета, после чего перечисляет их на Ваши банковские счета, указанные в поручении на вывод

- ◆ **По результатам операций GrottBjorn предоставляет Вам отчёт Брокера об операциях**



СТРАТЕГИИ РАБОТЫ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ:

КУПИЛ ВАЛЮТУ – ВЫВЕЛ НА БАНКОВСКИЙ СЧЁТ

Ситуация:

Вы ведёте ВЭД, и вам нужна иностранная валюта для расчётов по контрактам с нерезидентами

Затраты:

1. Зачисление рублей на счёт GrottBjorn: бесплатно
2. Комиссия биржи по операции: 0,0015% от оборота
3. Комиссия GrottBjorn: 0,015% от оборота
4. Плата за вывод иностранной валюты:
 - 100 USD / 120 EUR
 - 5 000 рублей за Китайские юани

Действия:

1. Перевести российские рубли на специальный брокерский счёт GrottBjorn
2. Приобрести иностранную валюту самостоятельно через предоставленный торговый терминал QUIK, либо подав заявку трейдеру в офисе по телефону
3. Подать поручение на вывод денежных средств на свой банковский валютный счёт

Пример:

Действия		Затраты
Зачислено:	3 400 000 рублей	0 рублей
Куплено:	100 000 USD	516,45 рублей
Зачислено:	6 000 000 рублей	0 рублей
Куплено:	200 000 USD	1 032,90 рублей
Выведено:	300 000 USD	3 130 рублей
ИТОГО:		4 679,35 рублей или 1,56 копейки на 1 USD

* \$1 = 31,3 рублей



СТРАТЕГИИ РАБОТЫ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ:

ПРОДАЛ ВАЛЮТУ – ВЫВЕЛ РУБЛИ НА БАНКОВСКИЙ СЧЁТ

Ситуация:

Вы ведёте ВЭД, и получаете иностранную валюту по контрактам с нерезидентами

Затраты:

1. Плата за зачисление валюты:
 - 100 USD / 120 EUR
 - 5 000 рублей за Китайские юани
2. Комиссия биржи по операции: 0,0015% от оборота
3. Комиссия GrottBjorn: 0,015% от оборота
4. Вывод рублей на банковский счёт: 50 рублей

Действия:

1. Перевести иностранную валюту на специальный брокерский счёт GrottBjorn
2. Продать иностранную валюту самостоятельно через предоставленный торговый терминал QUIK, либо подав заявку трейдеру в офисе по телефону
3. Подать поручение на вывод денежных средств на свой рублёвый банковский счёт

Пример:

Действия		Затраты
Зачислено	300 000 USD	3 130 рублей
Продано	300 000 USD	1 549,35 рублей
Выведено	9 390 000 рублей	50 рублей
ИТОГО:		4 729,35 рублей или 1,57 копейки на 1 USD

* \$1 = 31,3 рублей



СТРАТЕГИИ РАБОТЫ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ:

СТРАХОВАНИЕ ВАЛЮТНЫХ РИСКОВ ПРИ РАБОТЕ С РУБЛЯМИ



Ситуация:

Вы ведёте ВЭД, оплачиваете счета в рублях по ценам, выставленным в иностранной валюте

Затраты:

1. Зачисление рублей на счёт GrottBjorn: бесплатно
2. Комиссия биржи по операции: 0,0015% от оборота
3. Комиссия GrottBjorn: 0,015% от оборота
4. Плата за вывод российский рублей: 50 рублей

Действия:

1. Перевести российские рубли на специальный брокерский счёт GrottBjorn
2. Приобрести иностранную валюту самостоятельно через предоставленный торговый терминал QUIK, либо подав заявку трейдеру в офисе по телефону
3. Продать иностранную валюту аналогичным образом
4. Подать поручение на вывод денежных средств на свой банковский рублёвый счёт

Пример:

Действия		Затраты
Зачислено	3 130 000 рублей	0 рублей
Куплено	100 000 USD	516,45 рублей
Продано	100 000 USD	519,75 рублей
Выведено	3 150 000 рублей	50 рублей
ИТОГО:		1 086,20 рублей или 1,1 копейки на 1 застрахованный USD, при этом Вы не потеряли на росте курса USD

* \$1 = 31,3 рублей

** при продаже курс вырос и составил \$1 = 31,5 рублей

СТРАТЕГИИ РАБОТЫ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ:

ПОЛУЧЕНИЕ «RISK FREE» СТАВКИ

Ситуация:

Вы желаете получать безрисковую ставку, которую даёт валютный рынок

Затраты:

1. Зачисление рублей на счёт GrottBjorn: бесплатно
2. Комиссия биржи по операции: 0,0005% от оборота
3. Комиссия GrottBjorn: 0,005% от оборота
4. Плата за вывод российский рублей: 50 рублей



Действия:

1. Перевести российские рубли на специальный брокерский счёт GrottBjorn
2. Подать поручение на сделку типа валютный SWAP (купить/продать)
3. Подать поручение на вывод денежных средств на свой банковский рублёвый счёт

Пример:

Действия		Затраты
Зачислено	12 600 000 рублей	0 рублей
Куплено SWAP	400 000 USD	688,60 рублей
Выведено	12 600 000 рублей	50 рублей
ИТОГО:		738,60 рублей или 2,15% годовых, при получаемых 6,41% годовых по «безрисковой ставке»

* \$1 = 31,3 рублей

** курс сделки SWAP равен 0,0055 рублей на 1 USD

СТРАТЕГИИ РАБОТЫ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ:

SWAP (1/3)

ШАГ 1: Зачисление рублей на брокерский счет

Зачислено 12 600 000 рублей



ШАГ 2: Заключение сделки типа SWAP*

Куплено 4 лота (400 000 USD)

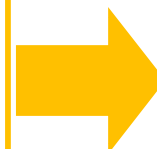


Возникли обязательства/требования с расчётом «СЕГОДНЯ»*

- 12 520 000 рублей
+ 400 000 USD

Возникли обязательства/требования с расчётом «ЗАВТРА»*

+ 12 522 200 рублей
- 400 000 USD



ШАГ 3: Расчёт по сделке

- Зачислено 400 000 USD
- Остаток на счёте без USD 80 000 рублей (без учёта комиссий)
- Обязательства с расчётом «ЗАВТРА»:
 - + 12 522 200 рублей
 - 400 000 USD
- Гарантийное обеспечение около 880 000 рублей**



Появилась возможность вывести с биржи полученные USD, но необходимо поддерживать минимальную сумму под гарантийное обеспечение**



* курс сделки SWAP равен 0,0055 рублей на 1 USD, центральный курс в системе равен 31,3 рублей за 1\$

** Гарантийное обеспечение составляет порядка 7% в рублёвом эквиваленте от обязательств по сделкам, и устанавливается в зависимости от центрального курса биржи и коэффициента дисконта/премии валюты

СТРАТЕГИИ РАБОТЫ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ:

SWAP (2/3)



Полный расчёт

На момент расчётов на счёте **12 602 200 рублей*** (без учёта комиссий)



Можно вывести в полном объёме рублевую сумму на счёте, и/или совершать новые сделки

ШАГ 4: Закрытие сделки



Перенос позиции на следующий день (полностью или частично)

Открытие новой сделки SWAP, которая закроет сальдированием обязательства/требования по расчёту «СЕГОДНЯ», перенеся их на «ЗАВТРА»



ШАГ 2: Заключение сделки типа SWAP*

Куплено 1-4 лота (100 000 – 400 000 USD)



Можно вывести в полном объёме рублевую сумму на счёте, и/или совершать новые сделки

* курс сделки SWAP равен 0.0055 рублей на 1 USD, центральный курс в системе равен 31,3 рублей за 1\$

** Гарантийное обеспечение составляет порядка 7% в рублёвом эквиваленте от обязательств по сделкам, и устанавливается в зависимости от центрального курса биржи и коэффициента дисконта/премии валюты

СТРАТЕГИИ РАБОТЫ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ:

SWAP (3/3)



Дата	Курс USD	На счёте		Требования/Обязательства - СЕГОДНЯ		Требования/Обязательства - ЗАВТРА		Гарантийное обеспечение (рублёвый эквивалент) Рубли (на конец дня)
		Рубли	USD	Рубли	USD	Рубли	USD	
28.05.2013	31,30	12 600 000	0	- 12 520 000	400 000	12 522 200	- 400 000	- 876 400
29.05.2013	31,15	80 000	400 000	12 522 200 (со вчера) - 12 460 000 (сегодня)	- 400 000 (со вчера) 400 000 (сегодня)	12 462 200	- 400 000	- 872 200
30.05.2013 (на утро)		142 200	400 000	12 462 200 (со вчера)	- 400 000 (со вчера)			
30.05.2013 (конец дня)		12 604 200	0					
ИТОГО:		+ 4 400						

* курс сделки SWAP равен 0,0055 рублей на 1 USD

** Гарантийное обеспечение составляет порядка 7% от обязательств по сделкам, и устанавливается в зависимости от центрального курса биржи и коэффициента дисконта/премии валюты

СТРАТЕГИИ РАБОТЫ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ:

ПОКУПКА ВАЛЮТЫ БЕЗ ФИКСАЦИИ КУРСА

Ситуация:

Вы ведёте ВЭД, и вам нужна иностранная валюта для расчётов по контрактам с нерезидентами, однако, вы считаете, что текущий курс иностранной валюты завышен, и вы хотели бы получить валюту «сейчас», а зафиксировать курс покупки «потом»

Действия:

1. Перевести российские рубли на специальный брокерский счёт GrottBjorn
2. Подать поручение на сделку типа валютный SWAP (купить/продать)
3. Подать поручение на вывод денежных средств на свой банковский валютный счёт
4. Приобрести иностранную валюту самостоятельно через предоставленный торговый терминал QUIK, либо подав заявку трейдеру в офисе по телефону

Затраты:

1. Зачисление рублей на счёт GrottBjorn: бесплатно
2. Комиссия биржи по SWAP: 0,0015% от оборота
3. Комиссия GrottBjorn по SWAP: 0,005% от оборота
4. Плата за вывод иностранной валюты:
 - 100 USD / 120 EUR
 - 5 000 рублей за Китайские юани
5. Комиссия биржи по покупке: 0,0015% от оборота
6. Комиссия GrottBjorn по покупке: 0,015% от оборота

Пример:

Действия		Затраты
Зачислено	10 000 000 рублей	0 рублей
Куплено SWAP	300 000 USD	516,45 рублей (каждый день)
Выведено	300 000 USD	3 130 рублей
Куплено	300 000 USD	1 549,35 рублей
ИТОГО:		Если SWAP продолжается 14 дней, то комиссии составят 11 909,65, при полученных по сделке SWAP 23 100 рублей или 6,41% годовых и возможности «бесплатно» использовать USD

* \$1 = 31,3 рублей

** курс сделки SWAP равен 0,0055 рублей на 1 USD

*** при условии, что курс валюты не меняется



СТРАТЕГИИ РАБОТЫ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ:

ПРОДАЖА ВАЛЮТЫ БЕЗ ФИКСАЦИИ КУРСА

Ситуация:

Вы ведёте ВЭД, и получаете иностранную валюту по контрактам с нерезидентами, и вам нужны рубли для работы, но текущий курс валюты кажется вам слишком низким

Действия:

1. Перевести иностранную валюту на специальный брокерский счёт GrottBjorn
2. Подать поручение на сделку типа валютный SWAP (продать/купить)
3. Подать поручение на вывод денежных средств на свой рублёвый банковский счёт
4. Продать иностранную валюту самостоятельно через предоставленный торговый терминал QUIK, либо подав заявку трейдеру в офисе по телефону

Затраты:

1. Плата за зачисление валюты:
 - 100 USD / 120 EUR
 - 5 000 рублей за Китайские юани
2. Комиссия биржи по SWAP: 0,0015% от оборота
3. Комиссия GrottBjorn по SWAP: 0,005% от оборота
4. Плата за вывод российский рублей: 50 рублей
5. Комиссия биржи по покупке: 0,0015% от оборота
6. Комиссия GrottBjorn по покупке: 0,015% от оборота

Пример:

Действия		Затраты
Зачислено	300 000 USD	3 130 рублей
Продано SWAP	300 000 USD	516,45 рублей (каждый день)
Выведено	9 000 000 рублей	50 рублей
Продано	300 000 USD	1 549,35 рублей
ИТОГО:		Если SWAP продолжается 14 дней, то комиссии составят 11 959,65, при плате по сделке SWAP 23 100 рублей или 6,41% годовых и возможности использовать полученные рубли

* \$1 = 31,3 рублей

** курс сделки SWAP равен 0,0055 рублей на 1 USD

*** при условии, что курс валюты не меняется



СТРАТЕГИИ РАБОТЫ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ:

ПРОДАЖА ВАЛЮТЫ С ФИКСАЦИЕЙ КУРСА + SWAP



Ситуация:

Вы ведёте ВЭД, и получаете иностранную валюту по контрактам с нерезидентами, и вам хочется зафиксировать курс, но валюта еще не поступила от контрагентов на ваш банковский счёт

Действия:

1. Обеспечить достаточность Гарантийного обеспечения на счёте (ГО)
2. Продать иностранную валюту самостоятельно через предоставленный торговый терминал QUIK, либо подав заявку трейдеру в офисе по телефону
3. Подать поручение на сделку типа валютный SWAP (купить/продать)
4. Перевести иностранную валюту на специальный брокерский счёт GrottBjorn, когда она поступит от контрагентов
5. Подать поручение на вывод денежных средств на свой рублёвый банковский счёт

Затраты:

1. Плата за зачисление валюты:
 - 100 USD / 120 EUR
 - 5 000 рублей за Китайские юани
2. Комиссия биржи по SWAP: 0,0015% от оборота
3. Комиссия GrottBjorn по SWAP: 0,005% от оборота
4. Комиссия биржи по покупке: 0,0015% от оборота
5. Комиссия GrottBjorn по покупке: 0,015% от оборота
6. Плата за вывод российский рублей: 50 рублей

Пример:

Действия		Затраты
Продано	300 000 USD	1 549,35 рублей
Куплено SWAP	300 000 USD	516,45 рублей (каждый день)
Зачислено	300 000 USD	3 130 рублей
Выведено	9 390 000 рублей	50 рублей
ИТОГО:		Если SWAP продолжается 14 дней, то комиссии составят 11 959,65, при полученных по сделке SWAP 23 100 рублей или 6,41% годовых и возможности зафиксировать курс задолго до фактической поставки валюты

* \$1 = 31,3 рублей, при этом необходимо обеспечить на счете достаточность ГО

** курс сделки SWAP равен 0,0055 рублей на 1 USD

*** при условии, что курс валюты не меняется

ЧТО НУЖНО ИМЕТЬ В ВИДУ:



- ◆ Реализация схемы занимает одни сутки: сегодня утром вы переводите денежные средства на специальные брокерские счета – завтра получаете купленную валюту (российские рубли), при условии, что денежные средства будут зачислены на специальные брокерские счета до начала клиринга (расчётов по сделкам)
- ◆ Банками за перевод рублей/валюты взимается плата (по тарифам банка)
- ◆ Некоторые банки взимают плату за зачисление иностранной валюты на счета клиента, а также плату за валютный контроль при зачислении/списании иностранной валюты на счета клиента, **НО**:
 - ◆ Не все банки делают это, а если и делают, то даже при этом выгоднее работать с GrottBjorn;
 - ◆ Иногда банки устанавливают «потолочные» значения сумм, которые обязан уплатить клиент за валютный контроль, поэтому работа с GrottBjorn не потребует дополнительных затрат клиента со стороны банковской комиссии
 - ◆ Есть «Клуб дружественных банков»
- ◆ При использовании иностранной валюты (рублей), полученной по сделке SWAP, хотя вы и получаете «безрисковую ставку», вы берёте на себя дополнительные риски, связанные с возможным изменением курса валюты
- ◆ При использовании иностранной валюты (рублей), полученной по сделке SWAP, вам необходимо держать на счёте гарантийное обеспечение (как правило около 7% от центрального курса торговой системы) для поддержания открытой позиции и возможности ежедневного покрытия разницы в изменении курса валюты

КАК ПОСЧИТАТЬ СВОЮ ВЫГОДУ:

КАЛЬКУЛЯТОР НА НАШЕМ САЙТЕ

Используя калькулятор на нашем сайте, Вы всегда сможете рассчитать свои затраты на конверсионные операции, а также заказать консультацию специалиста!



КУПИТЬ ПРОДАТЬ

Валюта:

\$ € ¥

Желаемая сумма:

Допускается только сумма, кратная 1000 (например 100 000)

Курс валюты:

по заданному курсу по курсу ЦБ

Вывести валюту/рубли на банковский счет:

ДА НЕТ

4 679.35 РУБ.
или
0.01559 РУБЛЕЙ НА 1 \$

КОММИССИЯ БИРЖИ	140.85 руб.
КОММИССИЯ БРОКЕРА	1 408.5 руб.
ПЛАТА ЗА ЗАЧИСЛЕНИЕ	0 руб.
ПЛАТА ЗА ВЫВОД	3 130 руб.

Заказать консультацию специалиста

<http://grottbjorn.com/calc>

РЕЗЮМЕ:

ПОДВЕДЕМ ИТОГИ



- ◆ **Появилась новая законная схема приобретения валюты для ВЭД, альтернативная той, что предлагают банки**
- ◆ **Система имеет ряд преимуществ:**
 - ◆ **Купля/Продажа иностранной валюты по «чистому» рыночному курсу**
 - ◆ **Частичное депонирование**
 - ◆ **Расчёт по сделкам «СЕГОДНЯ» или «ЗАВТРА»**
 - ◆ **Возможность получения дополнительного дохода**
- ◆ **Экономический эффект начинается при объеме транзакций от 25 000 у.е.**

КОНТАКТНАЯ ИНФОРМАЦИЯ:



Приходите: Екатеринбург, Проспект Ленина 101/2
Звоните: +7 (343) 365-44-11

Пишите: client@grottbjorn.com
Заходите: grottbjorn.com



- ◆ Услуги предоставляет ЗАО «СБЦ»
- ◆ «GROTTBJÖRN» является зарегистрированной товарной маркой
- ◆ Данная информация предоставляется по состоянию на дату настоящего документа и может быть изменена без какого-либо уведомления
- ◆ В Настоящей презентации приведены только основные факты. За более подробной информацией необходимо обращаться к специалистам ЗАО «СБЦ»