

Здравствуйте и добро пожаловать на платформу! В этом выпуске мы рассмотрим, как настроить параметры нэттингов.

Эти настройки позволяют упростить транзакции, в которых участвуют несколько сторон.

Давайте начнем. Перейдите на страницу торговых настроек, затем нажмите на настройки нэттинга.

Нажмите ДОБАВИТЬ настройку нэттинга, чтобы создать новую настройку нэттинга.

Введите название настроек нэттинга, затем выберите базовую валюту - валюту, в которую по умолчанию устанавливаются все переоценки. Это не означает, что операции по вводу и выводу денежных средств могут осуществляться только в этой валюте. Счет может быть мультивалютным.

После этого выберите тип свопа

Закреть по AVP (средняя цена) - курс выбирается таким образом, чтобы происходило движение средств по фактической стоимости свопа

Открыть по AVP - курс выбирается таким образом, чтобы не было движения средств (при условии, что для обоих вариантов Закреть по AVP и Открыть по AVP в этот день не было сделок, закрывающих или уменьшающих позицию).

Или своп типа Закреть по рынку - здесь ставка открытия ролловера равна текущей ставке торгового инструмента). Используется верхняя цена книги.

Существуют и другие опции, доступные для нэттинга:

Авто-нэттинг обеспечивает мгновенный расчет и проведение нэттинга, независимо от фактической даты расчета. Это означает, что даже если дата валютирования реальна, деньги будут на счете мгновенно, и клиент сможет вывести их в любое время.

Продвинуть внешнюю комиссию - внешние комиссии могут поступать от поставщика ликвидности или задаваться вручную. Если флажок установлен - комиссия будет создаваться для клиента в двух отдельных сделках: с брокерской комиссией и внешней комиссией провайдера. Если флажок выключен, клиент получит все внешние и брокерские комиссии как одну транзакцию, то есть торговая комиссия будет создана при взаимозачете.

Конвертировать FX в CASH: Если эта настройка включена, сделки на FX-инструментах будут конвертироваться в сделки на соответствующих CASH-инструментах. В этом случае сделка по FX-инструменту не будет открыта, а средства будут немедленно переведены на баланс счета (раздел "Активы").

Конвертировать CFD FX в CASH - эта опция идентична опции Конвертировать FX в CASH, но применяется к CFD на валюту и CFD на криптовалюту.

Внутридневной своп - двусторонний своп всех или части ежедневных операций в течение одного дня.

Отложенные расчеты - эта опция позволяет отложить расчеты.

После выбора необходимых параметров настройки нэттинга установим правило клиентских конверсий.

Правило клиентских конверсий позволяет настроить правила перевода клиентских средств между вашими счетами.

Выберите Номинальный счет, затем выберите категорию для тарифов.
Теперь Установим Время жизни клиентского курса и Время жизни исходного курса

Отлично, теперь давайте создадим конверсии для настроек нэттинга.

Конверсия - это обмен конвертируемого типа актива на другой тип актива.

Нажмите кнопку ДОБАВИТЬ НОВУЮ КОНВЕРСИЮ, после чего появится окно добавления правила.

Сначала выберите категорию инструментов, для которых PL на сделках будет запускать автоконверсию.

Затем выберите тип нэттинга - PnL, комиссия, расчет.

После этого выберите нужный подтип и актив.

Важно отметить, что для работы автоконвертации необходимо иметь курс валютной пары, содержащей расчетную валюту сделки и Актив, который также указывается в правиле конвертации.

Категории для курсов могут быть наличными, Forex или CFD. Можно выбрать либо 1, либо 2, либо все сразу, в зависимости от того, какие инструменты есть у брокера. Если выбраны все три, система будет перебирать инструменты во всех категориях, пока не найдет подходящий.

Также вы можете задать время таймаута, по истечении которого последняя пришедшая котировка по CASH-инструменту будет действительна для автоконвертации.

Опция Использовать резервные ставки EOD позволяет системе, если по какой-то причине подходящий курс конвертации не найден, использовать курс закрытия предыдущего дня для данной валютной пары.

Наконец, при необходимости вы можете установить ставки, нажав на флажки:

Использовать средний курс - курс между курсами покупки и продажи актива.

Использовать курс времени торгов - курс на момент заключения сделки.

После завершения настроек конвертации нажмите кнопку Добавить правило, чтобы добавить созданную конвертацию в настройки нэттинга.

После завершения настроек нэттинга нажмите кнопку Создать.

Поздравляем, в этом эпизоде мы узнали, как установить настройки нэттинга на платформе.

До встречи в следующих выпусках!