**＜Sample Email 1＞**

|  |  |
| --- | --- |
| **件名** | **[FinBot Complete] R00363, T0 Check ABC COunterparty, TOKWV403448, V328005P** |
| **差出人** | RPAG\_P, FXMO(Robot) |
| **宛先** | Region1-MO-FX |
| **送信日時** | 2025年4月30日 16:07 |

The details are as follows :

|  |  |
| --- | --- |
| **Robot:** | R00363\_Email\_Monitoring |
| **Process:** | Library051\_T0 Check ABCD |
| **Machine:** | TOKWV403448 |
| **Account:** | V328005P |
| **Time:** | 2025/04/30 (Tue) 16:07 |

確認結果は下記の通りです。ご確認してください。

04/30/2025 16:00:00 - 【NEW TRADE】通貨オプション付定期預金　約定連絡 TS ID TS53458862

TS53458862

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **【Precon-Opt】** | 権利行使タイプ | 通貨ペア | 方向 | Call / Put | 基軸通貨金額 | 権利行使レート | 決済通貨金額 |
| **TRUE** | ﾌﾟﾚｰﾝﾊﾞﾆﾗ（ﾖｰﾛﾋﾟｱﾝ） | AUDUSD | 売り | AUD Call USD Put | **3,114,450.55** | 0.657 | **2,046,194.01** |
|  | プレミアム受渡日 | プレミアム通貨 | プレミアム単価【b | プレミアム金額（対N | 権利行使日 | 権利行使期限 | 行使為替受渡日 |
|  | 2025/5/2 | AUD | 14.29249474 | 8,106.44 | 2025/5/21 | TKY15:00 | 2025/5/23 |
|  | TD | CCY pair | B/S | Call/Put | Base CCY Amt | Expiry | Delivery |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |
|  | Premium Date | Premium CCY | Premium Amt | Product = CFLW | Premium B/S | Strike | Settle Type |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |
|  |  |  |  |  |  |  | Cutoff |
| **【Precon-FXswap】** | 約定日時 | 基軸通貨 | 相手通貨 |  |  |  | **TRUE** |
| **TRUE** | 2025/4/30 | AUD | JPY |  |  |  |  |
|  | 売買区分（期近） | 基軸通貨金額 | 受渡日（期近） | 約定レート（期近） | 相手通貨金額（期近） |  |  |
|  | SELL | 3,122,556.99 | 2025/5/2 | 102.18 | 319,062,873 |  |  |
|  | 売買区分（期先） | 基軸通貨金額 | 受渡日（期先） | 約定レート（期先） | 相手通貨金額（期先） |  |  |
|  | BUY | 3,122,556.99 | 2025/5/23 | 101.9198 | 318,250,383 |  |  |
|  | TD | CCY1 | CCY2 |  |  |  |  |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |  |  |
| NearLeg | B/S | CCY1 Amt | VD | Rate | Product = FX |  |  |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |
| FarLeg | B/S | CCY1 Amt | VD | Rate | Product = FX |  |  |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |

04/30/2025 15:59:04 - 【NEW TRADE】通貨オプション付定期預金　約定連絡 TS ID TS53458921

TS53458921

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **【Precon-Opt】** | 権利行使タイプ | 通貨ペア | 方向 | Call / Put | 基軸通貨金額 | 権利行使レート | 決済通貨金額 |
| **FALSE** | ﾌﾟﾚｰﾝﾊﾞﾆﾗ（ﾖｰﾛﾋﾟｱﾝ） | AUDUSD | 売り | AUD Call USD Put | **3,107,257.21** | 0.658 | **2,044,575.24** |
|  | プレミアム受渡日 | プレミアム通貨 | プレミアム単価【b | プレミアム金額（対N | 権利行使日 | 権利行使期限 | 行使為替受渡日 |
|  | 2025/5/2 | AUD | 14.29249474 | 7,068.64 | 2025/5/21 | TKY15:00 | 2025/5/23 |
|  | TD | CCY pair | B/S | Call/Put | Base CCY Amt | Expiry | Delivery |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |
|  | Premium Date | Premium CCY | Premium Amt | Product = CFLW | Premium B/S | Strike | Settle Type |
|  | **TRUE** | **FALSE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |
|  |  |  |  |  |  |  | Cutoff |
| **【Precon-FXswap】** | 約定日時 | 基軸通貨 | 相手通貨 |  |  |  | **TRUE** |
| **TRUE** | 2025/4/30 | AUD | JPY |  |  |  |  |
|  | 売買区分（期近） | 基軸通貨金額 | 受渡日（期近） | 約定レート（期近） | 相手通貨金額（期近） |  |  |
|  | SELL | 3,114,325.85 | 2025/5/2 | 102.18 | 318,221,815 |  |  |
|  | 売買区分（期先） | 基軸通貨金額 | 受渡日（期先） | 約定レート（期先） | 相手通貨金額（期先） |  |  |
|  | BUY | 3,114,325.85 | 2025/5/23 | 101.9198 | 317,411,467 |  |  |
|  | TD | CCY1 | CCY2 |  |  |  |  |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |  |  |
| NearLeg | B/S | CCY1 Amt | VD | Rate | Product = FX |  |  |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |
| FarLeg | B/S | CCY1 Amt | VD | Rate | Product = FX |  |  |
|  | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** | **TRUE** |  |  |

**＜Sample Email 2>**

|  |  |
| --- | --- |
| **件名** | **RE: (2/2)【Confidential】【Done】ABC AUD Call USD Put 21May/23May24 TOK 0.658 in 3.10725721mio AUD** |
| **差出人** | Region1-MO-Person10 |
| **宛先** | Region1-FO-Tradrer2;Region1-FO-SPGroup-Person5; Region1-FO-Tradrer1; Region1-MO-FX |
| **CC** | Region1-FO-SPGroup |
| **送信日時** | 2025年4月30日 16:27 |

Hi Region1-FO-Tradrer2,

Premium ccy is booked with USD but seems should be AUD.

Could you please check?

Regards,

Region1-MO-Person10

**From:** Region1-FO-Tradrer2

**Sent:** Tuesday, April 30, 2025 3:41 PM

**To:** Region1-FO-Tradrer2;Region1-FO-SPGroup-Person5; Region1-FO-Tradrer1; Region1-MO-FX

**Cc:** Region1-FO-SPGroup

**Subject:** RE: (2/2)【Confidential】【Done】ABC AUD Call USD Put 21May/23May24 TOK 0.658 in 3.10725721mio AUD

Deal ID 4548081.

**From:** Region1-FO-SPGroup-Person5

**Sent:** Tuesday, April 30, 2025 3:23 PM

**To:** Region1-FO-Tradrer1; Region1-FO-Tradrer2; Region1-MO-FX

**Cc:** Region1-FO-SPGroup

**Subject:** (2/2)【Confidential】【Done】ABC AUD Call USD Put 21May/23May24 TOK 0.658 in 3.10725721mio AUD

FX Desk buys AUD Call USD Put 21May/23May24 TOK 0.658 in 3.10725721mio AUD From ABC（ABCD-TKY-NSC）

Trader premium amount 13,113.00 AUD

Sales Premium Amount 7,068.64 AUD

Fixing Page BFIX(TOKYO)@15:00

Commission -617,613

Commission Ccy  JPY

For CFLW,

FX Desk pays 617,613 JPY to INT:LOTC031 for UF

Both Premium and CFLW V/D 02May24

For FX Swap,

FX Desk buys 3,114,325.85 AUDJPY at 102.18 V/D 02May24

FX Desk sells 3,114,325.85 AUDJPY at 101.9198 V/D 23May24

Please let us know when you booked.

Regards,

**<SOP>**

|  |
| --- |
| **概要** |

ABCDの行う Dual Ccy取引はSWIFTだがMO Approve前にBookingを確認する。

|  |
| --- |
| **プロセス by RPA** |

Run time: Daily 9:00 / 9:40 / 10:10 / 12:00 / 13:00 / 14:00 / 15:00 / 15:30 / 16:00 / 17:10 / 17:25

 ABCD -TKY-NSC(DUAL CURRENCY DEPOSIT ABCD BK)のバニラオプションは RPAが自動で約定照合し、照合結果をメールで送付してくれる。

※ FOからのPreconfirmationが届いたら、FX MO NSCの受信トレイ　02.Viper - Preconfirmation フォルダーに移しておく必要がある。

Not MO approvedにCounterpartyがABCD、Counterparty NameがDual Currency Depositであるlegがある時に

上記のメールを見てPrecon‐OptとPrecon‐Fxswap両方**TRUE**になったらMO Approve

TRUEではない場合はPrecon又はBookingが間違っているので、TraderとStructured Product部（プレコンを送ってくださった部署）へ連絡

確認結果がOKなら、MO Approveする。（Mo Approveタブを参照）

|  |
| --- |
| **プロセス by manual** |

使用するExcel:　\\japan.our\data\GMO\03\_Ops\Macro BUC\FX MO\02System2\ABCD 約定check-OPT&Fxswap.xlsx

①　【NEW TRADE】通貨ｵﾌﾟｼｮﾝ付定期預金約定連絡TS ID TSxxxxxxxxメールに添付されている《約定連絡票TS ID TSxxxxxxxx.xls》のexcelシートをそのまま[約定連絡票]シートにシートごとcopy & paste

②　Viper BlotterよりCPTY: ABCD-TKY-NSCの取引データをexcelに落とし、[viper]シートにcopy & paste

　　（viperには、Option本体、CFLW、swapがある時は、Swap nearleg-farlegの順にbookされているはずである。）

③　数式の計算方法が自動になっていることを確認し、[check]シートにて照合する。

Excel保存先：　\\japan.our\data\GMO\03\_Ops\Macro BUC\FX MO\02System2\ABCD booking check

該当年月日のフォルダーにTSIDを名前につけて保存する。

確認が取れたらMO Approveする (1st Checkのみ）