

Импортозамещение в процессах по управлению процентным риском

Ноябрь 2023 г.

A decorative graphic at the bottom of the slide consisting of glowing white and blue lines and dots, resembling a circuit board or data network, extending across the width of the page.

Зависимость и уход от иностранных ПО создают риск для финансового рынка в России

⊗ Bloomberg

⊗ Reuters

⊗ Numerix

Murex

⊗ Ушли из России

Для чего применяются эти ПО?

- Аналитика
- Общение между банком и клиентом
- Маркировка рыночных данных
- Модельное ценообразование
- Маркетмейкинг

Сбер создал комплекс собственных решений для каждого этапа создания ПФИ

Разработали аналоги иностранных продуктов

- Информационно-торговый терминал для клиента
- Визуализация и маркировка рыночных данных
- Ценообразование ПФИ
- Маркетмейкинг на Мосбирже через API
- Чат для общения с клиентом

SberCIB Terminal

AC FI trading platform

Робот-маркетмейкер

Pricing Service

Создали собственную систему по сбору и анализу рыночных данных

AC FI trading platform



Прогноз

Маркировка рыночных данных помогает оценить траекторию ключевой ставки

Моделирование

Построение поверхности волатильности %ПФИ для ценообразования экзотических продуктов

Аналитика

Гибкая система построения кривой ОФЗ для установления ставок долгосрочных свопов на ключевую ставку

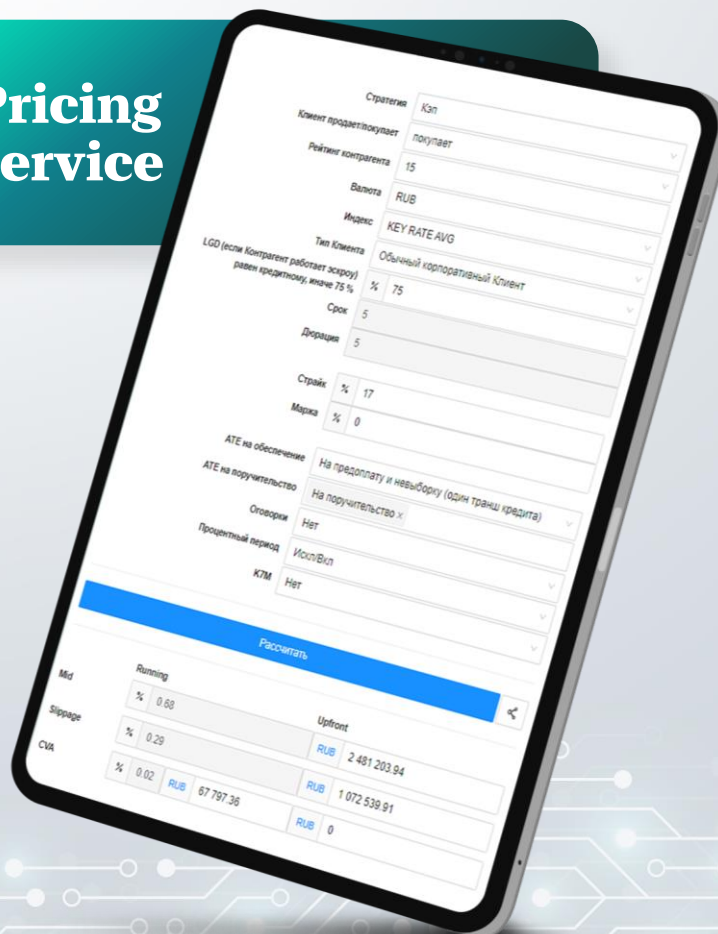
Собственный сервис по ценообразованию со встроенными моделями используется всеми сотрудниками для диалога с клиентом



Ценообразование

- Расчет справедливой стоимости ПФИ
- Построение кривых доходностей
- Моделирование поверхности волатильности

Pricing Service



Модель Cheyette

Модель ценообразования экзотических деривативов (TARN, Autocallable caps)

Модель Hyperbolic-Hyperbolic

- Модель стохастической волатильности
- Модель ценообразования ванильных и барьерных опционов

WEB UI

Сейлз помощник с AI аналитикой

Робот-маркетмейкер позволяет масштабировать бизнес без дополнительных затрат

Робот-маркетмейкер



Маркетмейкинг

- API-подключение к бирже
- Алгоритмическое совершение сделок

74%

Доля Сбера на рынке %ПФИ

900 млрд руб.

Объем торгов %ПФИ через биржу

Общение с клиентом и предоставление котировок и аналитики через терминал

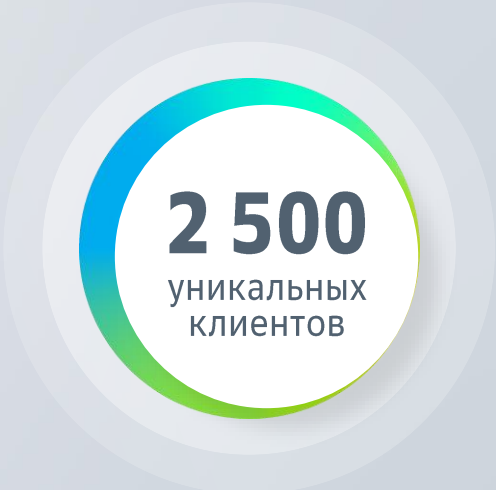
SberCIB Terminal

Актуальные индикативные котировки

- Процентные свопы RUB до 10 лет
- Кэп/Флор RUB до 5 лет
- FX свопы CNYRUB до 5 лет

Аналитика и комментарии трейдинга

- Комментарии трейдинга
- Анализ ликвидности
- Публикации СберИндекса
- Прогнозы валютных курсов и ставок



Заместили внешние системы на ключевых этапах процесса для закрытия любых потребностей клиента



Взаимодействие с рынком

- Получение рыночных данных
- Маркетмейкинг

Обработка

- Маркировка рыночных данных
- Ценообразование ПФИ

Решение под потребность

- ПФИ под любые потребности клиента
- Профессиональная аналитика в торговом терминале

Российский рынок %ПФИ имеет грандиозный потенциал к росту



Схожесть стран

- Развивающийся рынок
- Сырьевая экономика

Потенциал

Рынок %ПФИ в Бразилии и ЮАР в десятки раз больше при меньшем ВВП