



ОПЦИОНЫ НА ВАЛЮТУ

ПРЕИМУЩЕСТВА



Прямая экспозиция

Отсутствие промежуточного инструмента в виде фьючерса между опционом и курсом валюты



Простота конфигурации параметров

Тип поставки, исполнения и способ уплаты премии простые и понятные



Отсутствие рисков экспирации

По итогу исполнения происходит списание или зачисление денежных средств. Отсутствует риск поставки.

ОТЛИЧИЯ НОВЫХ ОПЦИОНОВ ОТ СУЩЕСТВУЮЩИХ

Параметр	Опционы на валюту NEW
Базовый актив	Валютный курс
Поставка	Расчетный
Тип исполнения	Европейский исполнение только в последний день
Уплата премии	Премия уплачивается единовременно, в ближайший клиринг. Нет ежедневной переоценки и вар. маржи
Котировка	В рублях за единицу базового актива
Исполнение	Каждый четверг в вечерний клиринг. Цена исполнения – Фиксинг валютного рынка Московской Биржи в день исполнения



ПАРАМЕТРЫ

№	Полный код БА	БА	Лот	Шаг цены, RUB	Стоимость шага цены, RUB	Шаг страйка	Количество сроков
1	Si	Курс доллар США к российскому рублю	100	0,001	0,1	0,5	2 W, 2 M
2	Eu	Курс евро к российскому рублю	100	0,001	0,1	0,5	2 W, 2 M
3	CNY	Курс китайский юань к российскому рублю	100	0,001	0,1	0,1	2 W, 2 M



ВАЖНЫЕ ЗАМЕЧАНИЯ

- Спецификации инструментов размещены на [сайте](#)
- Опционы **исполняются автоматически**. Поскольку опционы расчетные, то нет ситуаций, в которых может быть целесообразно отказываться от исполнения «в деньгах» или принудительно исполнять «вне денег».
- [Часто задаваемые вопросы](#)





IT ИЗМЕНЕНИЯ

- Полный состав **изменений** релиза **Spectra 7.12** доступен по [ссылке](#).
- Спецификации шлюзов доступны по [ссылке](#)
- Поля **отчетов** остаются без изменений

КОДИРОВКА КОНТРАКТОВ

Краткий код

C		P		K	M	Y	W
S	i	8	7	C	G	3	B
Краткий код БА		Страйк		Тип расчетов	Месяц	Год	Неделя

Поле «М»

Месяц	Код опциона КОЛЛ	Код опциона ПУТ
Январь	A	M
Февраль	B	N
Март	C	O
Апрель	D	P
Май	E	Q
Июнь	F	R
Июль	G	S
Август	H	T
Сентябрь	I	U
Октябрь	J	V
Ноябрь	K	W
Декабрь	L	X

Поле «К»

Код	Базовый актив	Категория	Тип расчетов
A	Фьючерс	Американский	Уплата премии
B	Фьючерс	Американский	Маржируемый
C	Спот	Европейский	Уплата премии

Поле «W»

Код	Неделя
null	Месячный или квартальный опцион
A	Недельный опцион с экспирацией в 1-ий четверг месяца
B	Недельный опцион с экспирацией во 2-ой четверг месяца
C	Недельный опцион с экспирацией в 3-ий четверг месяца
D	Недельный опцион с экспирацией в 4-ый четверг месяца
E	Недельный опцион с экспирацией в 5-ый четверг месяца

Поле «Y»: 3 – «2023», 4 – «2024»

C		K	D					T	E	P		
S	i	P	1	3	0	7	2	3	C	E	8	7
Полный код БА		Тип расчетов	Дата исполнения					Тип опциона	Тип экспирации	Страйк		

Поле «K»

Код	Тип расчетов
P	Премиальный
M	Маржируемый

Поле «T»

Код	Тип опциона
C	Колл
P	Пут

Поле «E»

Код	Тип экспирации
A	Американский
E	Европейский

