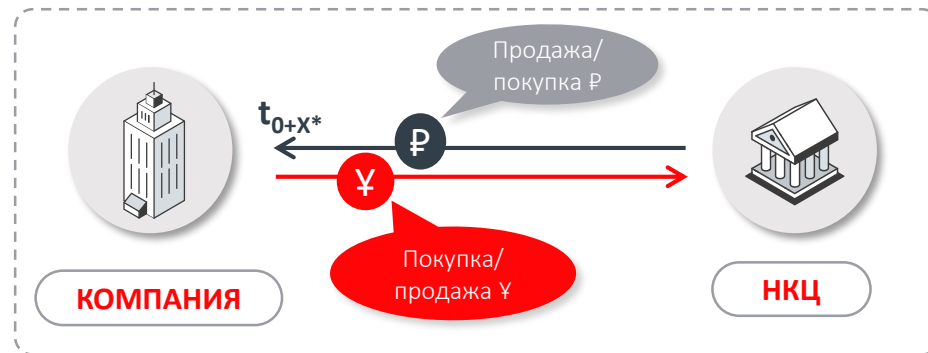


ОПИСАНИЕ МЕХАНИЗМА СДЕЛКИ ВАЛЮТНЫЙ ФОРВАРД С ЦК

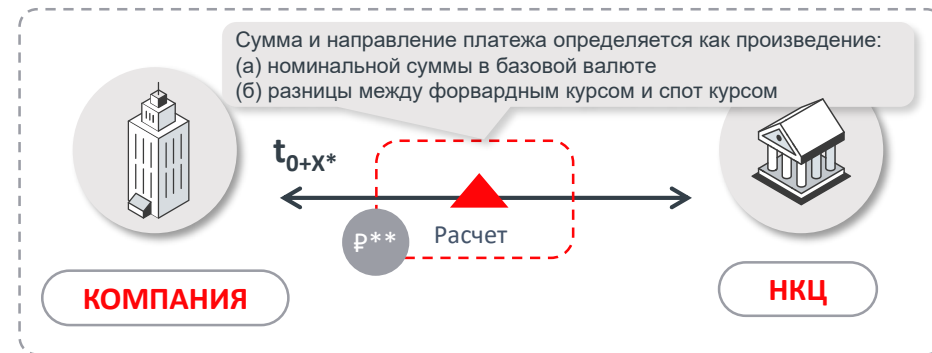
01

Поставочный валютный форвард с ЦК — это форвардный договор валютный форвардный договор (контракт), по которому стороны обязуются обменять определенные суммы в двух валютах на заранее согласованных условиях. Обмен валютами происходит не ранее чем на третий рабочий день после заключения договора. По условиям обмена одна сторона уплачивает другой стороне сумму в первой валюте (например, рубли — ₹). Вторая сторона уплачивает первой стороне сумму во второй валюте (например, юани — ¥). Сумма во второй валюте может быть определена как фиксированная величина, согласованная при заключении сделки. Или как произведение суммы в первой валюте на форвардный курс, установленный на момент заключения договора.



02

Расчетный валютный форвард с ЦК это форвардный договор, по которому стороны обязуются произвести расчеты в согласованную дату на основе разницы между форвардным курсом и спот курсом валютной пары. Сумма платежа определяется как произведение номинальной суммы в базовой валюте на разницу между форвардным курсом и спот курсом. Спот курс устанавливается в соответствии с условиями сделки на дату исполнения. Направление платежа зависит от того, в чью пользу изменился курс.



* В соответствии с условиями Спецификации количество дней X составляет 3 и более рабочих дней

** Валюта платежа устанавливается Спецификацией