

# ОПИСАНИЕ МЕХАНИЗМА СДЕЛКИ FLOOR С ЦК



**Опционный договор FLOOR с ЦК** представляет собой **расчетный опцион на процентную ставку**, по которому на условиях, согласованных сторонами, одна сторона единовременно или периодически уплачивает другой стороне сумму в согласованной валюте, рассчитанную на основе номинальной суммы в этой валюте и фиксированной ставки (Периодическая премия), а другая сторона единовременно или периодически уплачивает по требованию первой стороны сумму в той же валюте, рассчитанную на основе той же номинальной суммы и разницы между плавающей ставкой и минимальным значением плавающей ставки (Уровень Floor), согласованным сторонами, если эта разница имеет отрицательное значение



\*Периоды начисления процентных платежей и дата осуществления расчетов определяются Спецификацией. Периоды начисления процентных платежей по плавающей и фиксированной ставкам могут как совпадать, так и отличаться, а также варьироваться от недели до года