

Риск-параметры срочного рынка в период новогодних праздников

Базовый актив	Фьючерсный контракт	Базовые значения ГО
Индексы		
ALSI	на Индекс FTSE/JSE Top40	14%
HSIF	на Индекс Hang Seng	12%
IBVS	на Индекс BOVESPA	14%
MIX	на Индекс MMBБ	20%
RTS	на Индекс PTC	20%
RTSS	на Индекс PTC Стандарт	20%
RTSVX	на российский индекс волатильности	50%
RVI	на волатильность российского рынка	50%
SNSX	на Индекс SENSEX	12%
Акции		
CHMF	на обыкновенные акции ОАО "Северсталь"	35%
FEES	на обыкновенные акции ОАО "ФСК ЕЭС"	35%
GAZR	на обыкновенные акции ОАО "Газпром"	30%
GBMW	на обыкновенные акции BMW AG	14%
GDAI	на обыкновенные акции Daimler AG	14%
GDBK	на обыкновенные акции Deutsche Bank AG	14%
GMKR	на обыкновенные акции ОАО ГМК "Норильский Никель"	30%
GSIE	на обыкновенные акции Siemens AG	14%
GVW3	на привилегированные акции Volkswagen AG	14%
HYDR	на обыкновенные акции ОАО "РусГидро"	35%
LKOH	на обыкновенные акции ОАО "НК "ЛУКОЙЛ"	30%
MOEX	на обыкновенные акции ОАО Московская Биржа	35%
MTSI	на обыкновенные акции ОАО "Мобильные ТелеСистемы"	35%
NOTK	на обыкновенные акции ОАО "НОВАТЭК"	35%
ROSN	на обыкновенные акции ОАО "НК "Роснефть"	30%
RTKM	на обыкновенные акции ОАО "Ростелеком"	35%
SBRF	на обыкновенные акции ОАО "Сбербанк России"	30%
SBPR	на привилегированные акции ОАО "Сбербанк России"	30%
SNGP	на привилегированные акции ОАО "Сургутнефтегаз"	35%
SNGR	на обыкновенные акции ОАО "Сургутнефтегаз"	30%
TATN	на обыкновенные акции ОАО "Татнефть"	35%
TRNF	на привилегированные акции ОАО АК "Транснефть"	35%
URKA	на обыкновенные акции ОАО "Уралкалий"	35%
VTBR	на обыкновенные акции ОАО Банк ВТБ	30%
MOEX	на обыкновенные акции ОАО Московская Биржа	35%
MGNT	на обыкновенные акции ОАО Магнит	35%
Валютные пары		
AUDU	на курс австралийский доллар — доллар США	10%
ED	на курс евро — доллар США	10%
EU	на курс евро — российский рубль	20%
GBPU	на курс фунт стерлингов — доллар США	10%
SI	на курс доллар США — российский рубль	20%
UCHF	на курс доллар США — швейцарский франк	10%
UJPY	на курс доллар США — японская йена	10%
UUAH	на курс доллар США — украинская гривна	30%
Процентные ставки		
MOPR	на ставку трехмесячного кредита MosPrime	18%
RUON	на ставку однодневных рублевых кредитов RUONIA	см. сноску ¹
OFZ2	на "двухлетние" облигации федерального займа	10%
OFZ4	на "четырёхлетние" облигации федерального займа	12%
OFZ6	на "шестилетние" облигации федерального займа	14%
OF10	на "десятилетние" облигации федерального займа	15%

Базовый актив	Фьючерсный контракт	Базовые значения ГО
OF15	на "пятнадцатилетние" облигации федерального займа	16%
RF30	на еврооблигации Российской Федерации	12%
Металлы		
GOLD	на аффинированное золото в слитках	8%
SILV	на аффинированное серебро в слитках	14%
PLD	на аффинированный палладий в слитках	12%
PLT	на аффинированную платину в слитках	8%
CU	на медь	10%
Нефть и нефтепродукты		
BR	на нефть сорта "BRENT"	12%
Производство агросектора		
SUGR	на сахар-сырец	15%

¹ размер минимального базового гарантийного обеспечения определяется в российских рублях по формуле:

$\max(2700; 15 \cdot \sqrt{N} \cdot 2 \cdot 1000000 / 36500)$, где

N - число дней от текущего дня до дня исполнения фьючерса,

Sqrt - корень квадратный.