

Ставки минимального базового гарантийного обеспечения на срочном рынке

Код	Описание	С 19:00 29.04.15 по 05.05.15	С 19:00 05.05.15
Индексы			
ALSI	Фьючерсный контракт на Индекс FTSE/JSE Top40	14%	12%
HSIF	Фьючерсный контракт на Индекс Hang Seng	12%	10%
IBVS	Фьючерсный контракт на Индекс BOVESPA	14%	12%
MIX	Фьючерсный контракт на Индекс ММББ	16%	14%
RTS	Фьючерсный контракт на индекс РТС	17%	15%
RTSS	Фьючерсный контракт на Индекс РТС Стандарт	14%	12%
RVI	Фьючерсный контракт на волатильность российского рынка	50%	50%
RTSVX	Фьючерсный контракт на Российский индекс волатильности	50%	50%
SNSX	Фьючерсный контракт на Индекс SENSEX	12%	10%
Акции			
CHMF	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Северсталь"	25%	20%
FEES	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "ФСК ЕЭС"	35%	25%
GAZR	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Газпром"	20%	15%
GBMW	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции BMW AG	14%	12%
GDAI	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции Daimler AG	14%	12%
GDBK	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции Deutsche Bank AG	18%	15%
GMKR	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО ГМК "Норильский Никель"	20%	15%
GSIE	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции Siemens AG	14%	12%
GVW3	Фьючерсный контракт на привилегированные акции Volkswagen AG	14%	12%
HYDR	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "РусГидро"	25%	18%
LKOH	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "НК "ЛУКОЙЛ"	20%	15%
MGNT	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Магнит"	20%	18%
MOEX	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО Московская Биржа	25%	20%
MTSI	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "МТС"	20%	20%
NOTK	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "НОВАТЭК"	20%	20%
ROSN	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "НК "Роснефть"	20%	15%
RTKM	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Ростелеком"	30%	25%
SBPR	Фьючерсный контракт на привилегированные акции ОАО "Сбербанк России"	20%	15%
SBRF	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Сбербанк России"	20%	15%
SNGP	Фьючерсный контракт на привилегированные акции ОАО "Сургутнефтегаз"	20%	15%
SNGR	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Сургутнефтегаз"	20%	15%
TATN	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина	25%	20%
TRNF	Фьючерсный контракт на привилегированные акции ОАО АК "Транснефть"	25%	15%
URKA	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО "Уралкалий"	30%	25%
VTBR	Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО Банк ВТБ	20%	18%
Валюты			
AUDU	Фьючерсный контракт на курс австралийский доллар-доллар США	6%	5%
CY	Фьючерсный контракт на курс китайский юань - российский рубль	14%	11%
ED	Фьючерсный контракт на курс евро-доллар	4%	3%
Eu	Фьючерсный контракт на курс евро-рубль	14%	11%
GBPU	Фьючерсный контракт на курс фунт стерлингов-доллар США	4%	3%
Si	Фьючерсный контракт на курс доллар США - российский рубль	14%	11%
UCAD	Фьючерсный контракт на курс доллар США - канадский доллар	5%	4%
UCHF	Фьючерсный контракт на курс доллар США - швейцарский франк	5%	4%
UJPY	Фьючерсный контракт на курс доллар США - японская йена	5%	4%
UTRY	Фьючерсный контракт на курс доллар США - турецкая лира	9%	7%
UUAH	Фьючерсный контракт на курс доллар США - украинская гривна	29%	21%
Облигации			
OFZ2	Фьючерсный контракт на "двухлетние" облигации федерального займа	8%	8%
OFZ4	Фьючерсный контракт на "четырёхлетние" облигации федерального займа	10%	10%
OFZ6	Фьючерсный контракт на "шестилетние" облигации федерального займа	12%	12%
OF10	Фьючерсный контракт на "десятилетние" облигации федерального займа	13%	13%
OF15	Фьючерсный контракт на "пятнадцатилетние" облигации федерального займа	14%	14%
RF30	Фьючерсный контракт на еврооблигации Российской Федерации	10%	10%

Код	Описание	С 19:00 29.04.15 по 05.05.15	С 19:00 05.05.15
Ставки			
MOPR	Фьючерсный контракт на ставку трехмесячного кредита MosPrime	15%	15%
RUON	Фьючерсный контракт на ставку RUONIA	*	*
Товары			
BR	Фьючерсный контракт на нефть сорта "BRENT"	16%	12%
CU	Фьючерсный контракт на медь	11%	8%
GOLD	Фьючерсный контракт на аффинированное золото в слитках	8%	6%
PLD	Фьючерсный контракт на аффинированный палладий в слитках	14%	10%
PLT	Фьючерсный контракт на аффинированную платину в слитках	11%	8%
SILV	Фьючерсный контракт на аффинированное серебро в слитках	16%	12%
SUGR	Фьючерсный контракт на сахар-сырец	17%	15%
Инструменты срочных рынков ЗАО НТБ и ОАО "Мосэнергобиржа"			
ECBM	Фьючерсный контракт на индекс э/э в хабе "Центр" (базовые часы суток)	15%	15%
ECBQ	Квартальный фьючерсный контракт на индекс э/э в хабе "Центр" базовые часы	10%	10%
ECBY	Годовой фьючерсный контракт на индекс э/э в хабе "Центр" базовые часы	5%	5%
ECPM	Фьючерсный контракт на индекс э/э в хабе "Центр" (пиковые часы суток)	15%	15%
EUBM	Фьючерсный контракт на индекс э/э в хабе "Урал" (базовые часы суток)	15%	15%
EUBQ	Квартальный фьючерсный контракт на индекс э/э в хабе "Урал" базовые часы	10%	10%
EUBY	Годовой фьючерсный контракт на индекс э/э в хабе "Урал" базовые часы	5%	5%
EUPM	Фьючерсный контракт на индекс э/э в хабе "Урал" (пиковые часы суток)	15%	15%
SEBM	Фьючерсный контракт на индекс э/э в хабе "Восточная Сибирь" (базовые часы с	15%	15%
SWBM	Фьючерсный контракт на индекс э/э в хабе "Западная Сибирь" (базовые часы су	15%	15%
RG1EU	Фьючерсный контракт на крупу рисовую, ГОСТ, 1 сорт, EXW регион ЮФО	20%	20%
RREXU	Фьючерсный контракт на рис, EXW-элеватор региона поставки ЮФО	20%	20%
RT1EU	Фьючерсный контракт на крупу рисовую, ТУ, 1 сорт, EXW регион ЮФО	20%	20%
W3EXU	Фьючерсный контракт на пшеницу 3 класса, EXW-элеватор региона поставки ЮФО	15%	15%
W4EXU	Фьючерсный контракт на пшеницу 4 класса, EXW-элеватор региона поставки ЮФО	15%	15%
W5EXU	Фьючерсный контракт на пшеницу 5 класса, EXW-элеватор региона поставки ЮФО	15%	15%

* 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.