



MOSCOW  
EXCHANGE



Сентябрь 2016  
г. Москва

# Своп контракты с фиксированной датой исполнения обязательств

# Ценность для участников торгов

---

- ❑ Единая дата исполнения по второй части своп контракта и единый размер лота позволит участникам прекращать обязательства фиксированными поставочными фьючерсами.
- ❑ Днем исполнения своп контракта является расчетный день, следующий за днем исполнения расчетного фьючерсного контракта на срочном рынке, что позволяет участникам синхронизироваться с беспоставочными фьючерсами.
- ❑ Возможность переноса позиций по фиксированным поставочным фьючерсам на более длительный срок новыми своп инструментами.
- ❑ Возможность хеджирования и арбитража в условиях усиления волатильности российского валютного рынка.



# Спецификация

**В дополнение к новым фиксированным поставочным фьючерсам, торги которыми стартовали 18 июля 2016 г. на ВР планируется организовать торги поставочными своп контрактами с фиксированными датами исполнения с единым маржированием по позициям на ВР.**

Идентификатор в торговой системе – TOMMMYY, где MM – месяц исполнения, а YY – год исполнения своп контракта:

- USDTOM1216
- USDTOM0317
- USDTOM0617
- USDTOM0917

▪ ...

- EURTOM1216
- EURTOM0317
- EURTOM0617
- EURTOM0917

▪ ...

- CNYTOM1216
- CNYTOM0317
- CNYTOM0617
- CNYTOM0917

▪ ...

T+год\*



максимальный срок контракта



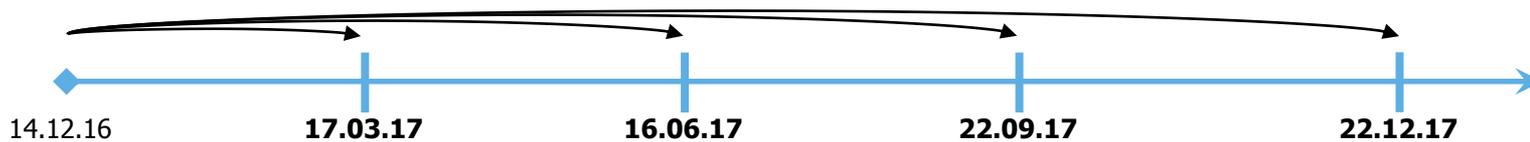
T+полгода



# Даты исполнения

## Фиксированный поставочный фьючерс (1216, 0317, 0617...)

- любая длительность
- фиксированная дата исполнения



## Фиксированный своп контракт (ТОМ – 1216, 0317, 0617...)

- любая длительность
- фиксированная дата исполнения второй части своп контракта



Единая дата исполнения



# Параметры инструмента

## Лот (в валюте лота)

Инструменты	Системный режим торгов	Внесистемный режим торгов	Системный режим торгов	Внесистемный режим торгов
Фиксированные фьючерсные контракты (ММYY)	100 000	100 000	100 000	100 000
Фиксированные своп контракты	-	-	100 000	100 000

## Шаг цены (в рублях)

Инструменты	Системный режим торгов	Внесистемный режим торгов	Системный режим торгов	Внесистемный режим торгов
Фиксированные фьючерсные контракты (ММYY)	USD, EUR – 0,01 CNY – 0,001	USD, EUR – 0,01 CNY – 0,001	USD, EUR – 0,01 CNY – 0,001	USD, EUR – 0,01 CNY – 0,001
Фиксированные своп контракты	-	-	USD, EUR – 0,0001 CNY – 0,000001	USD, EUR – 0,0001 CNY – 0,000001



**СПАСИБО  
ЗА ВНИМАНИЕ**



**МОСКОВСКАЯ  
БИРЖА**