**УТВЕРЖДЕНО**

решением Правления

Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС»

(Протокол №06 от 03 февраля 2017 года)

**СПИСОК ПАРАМЕТРОВ МАРЖИРУЕМЫХ ОПЦИОНОВ**

**на фьючерсные контракты на курс доллара США к иностранной валюте**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **№** | **Наименование контракта** | **Базовый актив** | **Код базового актива[[1]](#footnote-1)** | **Минимальный шаг цены** | **Стоимость минимального шага цены** | **Значение параметра m[[2]](#footnote-2)** |
|  | Маржируемый опцион на фьючерсный контракт на курс доллар США – японская йена  | Фьючерсный контракт на курс доллар США – японская йена | UJPY-xx.yy | 0,01 JPY | 10 JPY | 5 |
|  | Маржируемый опцион на фьючерсный контракт на курс доллар США – швейцарский франк  | Фьючерсный контракт на курс доллар США – швейцарский франк | UCHF-xx.yy | 0,0001 CHF | 0,1 CHF | 4 |
|  | Маржируемый опцион на фьючерсный контракт на курс доллар США – канадский доллар  | Фьючерсный контракт на курс доллар США – канадский доллар | UCAD-xx.yy | 0,0001 CAD | 0,1 CAD | 4 |

1. xx – месяц исполнения фьючерсного контракта, yy – год исполнения фьючерсного контракта

Например, код (обозначение) «UJ-12.17» означает, что фьючерсный контракт на курс доллар США-японская йена, являющийся базовым активом маржируемого опциона, подлежит исполнению в декабре 2017 года. [↑](#footnote-ref-1)
2. Параметр m определяется в соответствии со Спецификацей маржируемых опционов на фьючерсные контракты на курс доллара США к иностранной валюте. [↑](#footnote-ref-2)