**УТВЕРЖДЕН**

решением Правления

ПАО Московская Биржа

(Протокол №3 от 19 января 2018 г.)

**Список параметров сделок спот, сделок фикс и сделок своп на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа (в новой редакции)**

1. **Сделки спот**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **№** | **Код сделки спот** | **Код валюты лота** | **Наименование валюты лота** | **Наименование сопряженной валюты** | **Лот сделки спот** | **Шаг цены** | **Дата исполнения обязательств по сделке спот (T+n)\*** |
|  | **USDRUB\_TOD** | USD | Доллар США | Российский рубль | 1 000 долларов США,для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,0025 руб.,для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+0 |
|  | **USDRUB\_TOM\*\*** | USD | Доллар США | Российский рубль | 1 000 долларов США,для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,0025 руб.,для внесистемных сделок, для заявок со средневзвешенной ценой – 0,0001 руб. | Т+1 |
|  | **USDRUB\_DIS\*\*** | USD | Доллар США | Российский рубль | 1 000 долларов США | 0,000001 руб. | Т+1 |
|  | **USDRUB\_SPT** | USD | Доллар США | Российский рубль | 1 000 долларов США,для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,0025 руб.,для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+2 |
|  | **EURRUB\_TOD** | EUR | Евро | Российский рубль | 1 000 евро,для внесистемных сделок – 1 евро | 0,0025 руб.,для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+0 |
|  | **EURRUB\_TOM** | EUR | Евро | Российский рубль | 1 000 евро,для внесистемных сделок – 1 евро | 0,0025 руб.,для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+1 |
|  | **EURRUB\_SPT** | EUR | Евро | Российский рубль | 1 000 евро,для внесистемных сделок – 1 евро | 0,0025 руб.,для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+2 |
|  | **EURUSD\_TOD** | EUR | Евро | Доллар США | 1 000 евро,для внесистемных сделок – 1 евро | 0,00001 доллара США | Т+0 |
|  | **EURUSD\_TOM** | EUR | Евро | Доллар США | 1 000 евро,для внесистемных сделок – 1 евро | 0,00001 доллара США | Т+1 |
|  | **GBPRUB\_TOD** | GBP | Фунт стерлингов | Российский рубль | 1 000 фунтов стерлингов,для внесистемных сделок – 1 фунт стерлингов | 0,0025 руб.,для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+0 |
|  | **GBPRUB\_TOM** | GBP | Фунт стерлингов | Российский рубль | 1 000 фунтов стерлингов,для внесистемных сделок – 1 фунт стерлингов | 0,0025 руб.,для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+1 |
|  | **CHFRUB\_TOD** | CHF | Швейцарский франк | Российский рубль | 1 000 швейцарских франков,для внесистемных сделок – 1 швейцарский франк | 0,0025 руб.,для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+0 |
|  | **CHFRUB\_TOM** | CHF | Швейцарский франк | Российский рубль | 1 000 швейцарских франков,для внесистемных сделок – 1 швейцарский франк | 0,0025 руб.,для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+1 |
|  | **CNYRUB\_TOD** | CNY | Китайский юань | Российский рубль | 1 000 китайских юаней,для внесистемных сделок – 1 китайский юань | 0,0001 руб. | Т+0 |
|  | **CNYRUB\_TOM** | CNY | Китайский юань | Российский рубль | 1 000 китайских юаней,для внесистемных сделок – 1 китайский юань | 0,0001 руб. | Т+1 |
|  | **CNYRUB\_SPT** | CNY | Китайский юань | Российский рубль | 1 000 китайских юаней,для внесистемных сделок – 1 китайский юань | 0,0001 руб. | Т+2 |
|  | **HKDRUB\_TOD** | HKD | Гонконгский доллар | Российский рубль | 1 000 гонконгских долларов,для внесистемных сделок – 1 гонконгский доллар | 0,0001 руб. | Т+0 |
|  | **HKDRUB\_TOM** | HKD | Гонконгский доллар | Российский рубль | 1 000 гонконгских долларов,для внесистемных сделок – 1 гонконгский доллар | 0,0001 руб. | Т+1 |
|  | **UAHRUB\_TOD** | UAH | Украинская гривна | Российский рубль | 1 000 украинских гривен | 0,0025 руб. (за 10 украинских гривен),для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+0 |
|  | **BYNRUB\_TOD** | BYN | Белорусский рубль | Российский рубль | 1 000 белорусских рублей,для внесистемных сделок – 1 белорусский рубль | 0,0025 руб.,для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+0 |
|  | **BYNRUB\_TOM** | BYN | Белорусский рубль | Российский рубль | 1 000 белорусских рублей,для внесистемных сделок – 1 белорусский рубль | 0,0025 руб.,для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+1 |
|  | **KZTRUB\_TOD** | KZT | Казахстанский тенге | Российский рубль | 10 000 казахстанских тенге | 0,0025 руб. (за 100 казахстанских тенге),для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+0 |
|  | **TRYRUB\_TOD** | TRY | Турецкая лира | Российский рубль | 1000 турецких лир, для внесистемных сделок – 1 турецкая лира | 0,0001 руб. | Т+0 |
|  | **GLDRUB\_TOD\*\*\*** | GLD | Золото | Российский рубль | 1,0 грамм золота | 0,01 руб. | Т+0 |
|  | **GLDRUB\_TOM** | GLD | Золото | Российский рубль | 10,0 грамм золота, для внесистемных сделок – 1,0 грамм золота | 0,01 руб. | Т+1 |
|  | **GLDRUB\_SPT\*\*\*** | GLD | Золото | Российский рубль | 1,0 грамм золота | 0,01 руб. | Т+2 |
|  | **SLVRUB\_TOD\*\*\*** | SLV | Серебро | Российский рубль | 1,0 грамм серебра | 0,01 руб. | Т+0 |
|  | **SLVRUB\_TOM** | SLV | Серебро | Российский рубль | 100,0 грамм серебра, для внесистемных сделок – 1,0 грамм серебра | 0,01 руб. | Т+1 |
|  | **SLVRUB\_SPT\*\*\*** | SLV | Серебро | Российский рубль | 1,0 грамм серебра | 0,01 руб. | Т+2 |

\* T+n – дата, отстоящая от даты заключения сделки (Т) на соответствующее количество календарных дней (n).

В случае если день исполнения обязательств по сделке cпот T+0 приходится на день, не являющийся расчетным днем по соответствующим валютам, то торги по инструменту T+0 в такой день не проводятся (за исключением случаев, когда такие сделки заключаются Банком НКЦ (АО) в соответствии с Правилами клиринга в целях урегулирования обязательств участников клиринга).

В случае если день исполнения обязательств по сделке cпот T+1 или Т+2 приходится на день, не являющийся расчетным днем по соответствующим валютам, то исполнение обязательств переносится на ближайший следующий расчетный день.

\*\* – заключение сделок по инструменту USDRUB\_DIS допускается только в рамках проведения торгов в период дискретного аукциона с Банком России. На время проведения дискретного аукциона приостанавливаются торги инструментом USDRUB\_TOM.

\*\*\* - По данным сделкам спот допускается заключение только внесистемных сделок, а также сделок, входящих в сделку своп.

Средневзвешенный курс по всем инструментам определяется с точностью до четырех знаков после запятой. Внесистемные сделки при расчете средневзвешенного курса не учитываются.

1. Сделки фикс

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **№** | **Код сделки фикс** | **Код валюты лота** | **Наименование валюты лота** | **Наименование сопряженной валюты** | **Лот сделки фикс** | **Количество торговых дней, на которое дата заключения сделки фикс предшествует дате определения курса фиксинга, по которому заключается сделка\*** |
|  | **USDRUBFIX0** | USD | Доллар США | Российский рубль | 1 000 000 долларов США | 0 |
|  | **EURRUBFIX0** | EUR | Евро | Российский рубль | 1 000 000 евро | 0 |

\* Датой исполнения обязательств по сделке фикс является дата, отстоящая от даты определения курса фиксинга, по которому заключается сделка фикс, на 1 (один) календарный день.

В случае если день исполнения обязательств по сделке фикс приходится на день, не являющийся расчетным днем по соответствующим валютам, то исполнение обязательств переносится на ближайший следующий расчетный день.

1. **Сделки своп**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **№** | **Код сделки своп** | **Код валюты лота** | **Наименование валюты лота** | **Наименование сопряженной валюты** | **Лот сделки своп** | **Шаг цены** | **Точность базового курса** | **Точность итогового курса** | **Дата исполнения обязательств по первой и второй части сделки своп (T+n/t+d)\*** |
|  | **USD\_TODTOM** | USD | Доллар США | Российский рубль | 100 000 долларов США, в том числе в режиме аукциона,для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,0001 руб., в режиме аукциона – 0,000001 руб. | 0,0001 руб. | 0,0001 руб., в режиме аукциона – 0,000001 руб. | T+0/t+1 |
|  | **USD\_TODSPT\*\*** | USD | Доллар США | Российский рубль | 100 000 долларов США | 0,000001 руб. | 0,0001 руб. | 0,000001 руб. | T+0/t+2 |
|  | **USD\_TOMSPT** | USD | Доллар США | Российский рубль | 100 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | T+1/t+1 |
|  | **EUR\_TODTOM** | EUR | Евро | Российский рубль | 100 000 евро, в том числе в режиме аукциона,для внесистемных сделок – 1 евро | 0,0001 руб., в режиме аукциона – 0,000001 руб. | 0,0001 руб. | 0,0001 руб., в режиме аукциона – 0,000001 руб. | T+0/t+1 |
|  | **EUR\_TODSPT\*\*** | EUR | Евро | Российский рубль | 100 000 евро | 0,000001 руб. | 0,0001 руб. | 0,000001 руб. | T+0/t+2 |
|  | **EUR\_TOMSPT** | EUR | Евро | Российский рубль | 100 000 евро, для внесистемных сделок – 1 евро | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | T+1/t+1 |
|  | **EURUSDTDTM** | EUR | Евро | Доллар США | 100 000 евро,для внесистемных сделок – 1 евро | 0,000001 доллара США | 0,0001 доллар США | 0,000001 доллара США | T+0/t+1 |
|  | **GBP\_TODTOM** | GBP | Фунт стерлингов | Российский рубль | 100 000 фунтов стерлингов,для внесистемных сделок – 1 фунт стерлингов | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | T+0/t+1 |
|  | **CHF\_TODTOM** | CHF | Швейцарский франк | Российский рубль | 100 000 швейцарских франков,для внесистемных сделок – 1 швейцарский франк | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | T+0/t+1 |
|  | **CNY\_TODTOM** | CNY | Китайский юань | Российский рубль | 100 000 китайских юаней,для внесистемных сделок – 1 китайский юань | 0,000001 руб. | 0,0001 руб. | 0,000001 руб. | T+0/t+1 |
|  | **CNY\_TOMSPT** | CNY | Китайский юань | Российский рубль | 100 000 китайских юаней,для внесистемных сделок – 1 китайский юань | 0,000001 руб. | 0,0001 руб. | 0,000001 руб. | T+1/t+1 |
|  | **HKD\_TODTOM** | HKD | Гонконгский доллар | Российский рубль | 100 000 гонконгских долларов,для внесистемных сделок – 1 гонконгский доллар | 0,000001 руб. | 0,0001 руб. | 0,000001 руб. | T+0/t+1 |
|  | **BYN\_TODTOM** | BYN | Белорусский рубль | Российский рубль | 100 000 белорусских рублей, для внесистемных сделок – 1 белорусский рубль | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | T+0/t+1 |
|  | **GLD\_TODTOM** | GLD | Золото | Российский рубль | 1 000,0 грамм золота, для внесистемных сделок – 1,0 грамм золота | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | T+0/t+1 |
|  | **GLD\_TOMSPT** | GLD | Золото | Российский рубль | 1 000,0 грамм золота, для внесистемных сделок – 1,0 грамм золота | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | T+1/t+1 |
|  | **SLV\_TODTOM** | SLV | Серебро | Российский рубль | 50 000,0 грамм серебра, для внесистемных сделок – 1,0 грамм серебра | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | T+0/t+1 |
|  | **SLV\_TOMSPT** | SLV | Серебро | Российский рубль | 50 000,0 грамм серебра, для внесистемных сделок – 1,0 грамм серебра | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | 0,0001 руб. | T+1/t+1 |

\* T+n – дата, отстоящая от даты заключения сделки (Т) на соответствующее количество календарных дней (n) (первая часть сделки своп).

В случае если день исполнения обязательств по сделке T+0 приходится на день, не являющийся расчетным днем по соответствующим валютам, то торги по сделкам своп T+0/t+1 в такой день не проводятся (за исключением случаев, когда такие сделки заключаются Банком НКЦ (АО) в соответствии с Правилами клиринга в целях урегулирования обязательств участников клиринга).

В случае если день исполнения обязательств по сделке T+1, являющейся первой частью сделки своп, приходится на день, не являющийся расчетным днем по соответствующим валютам, то исполнение обязательств переносится на ближайший следующий расчетный день.

t+d – дата, отстоящая от даты исполнения обязательств по первой части сделки своп на соответствующее количество календарных дней (d) (вторая часть сделки своп).

В случае если день исполнения обязательств по сделке cпот t+1, являющейся второй частью сделки своп, приходится на день, не являющийся расчетным днем по соответствующим валютам, то исполнение обязательств переносится на ближайший следующий расчетный день.

\*\* По данным инструментам допускается заключение сделок только в режиме аукциона с Банком России.