**УТВЕРЖДЕН**

решением Правления

ПАО Московская Биржа

(Протокол №22 от 12 апреля 2019 г.)

**Список параметров сделок спот, сделок фикс, средневзвешенных сделок и сделок своп на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа**

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\_TDB** | USD | Доллар США | Российский рубль | 1 000 000 долларов США | 0,0025 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 |
|  | **EURUSD\_SPT** | EUR | Евро | Доллар США | 1 000 евро,для внесистемных сделок – 1 евро | 0,00001 доллара США | Т+2 |
|  | **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 |
|  | **GBPUSD\_TOD** | GBP | Фунт стерлингов | Доллар США | 1 000 фунтов стерлингов,для внесистемных сделок – 1 фунт стерлингов | 0,00001 доллара США | Т+0 |
|  | **GBPUSD\_TOМ** | GBP | Фунт стерлингов | Доллар США | 1 000 фунтов стерлингов,для внесистемных сделок – 1 фунт стерлингов | 0,00001 доллара США | Т+1 |
|  | **GBPUSD\_SPT** | GBP | Фунт стерлингов | Доллар США | 1 000 фунтов стерлингов,для внесистемных сделок – 1 фунт стерлингов | 0,00001 доллара США | Т+2 |
|  | **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 |
|  | **USDCHF\_TOD** | USD | Доллар США | Швейцарский франк | 1 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,00001 швейцарского франка | T+0 |
|  | **USDCHF\_TOM** | USD | Доллар США | Швейцарский франк | 1 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,00001 швейцарского франка | T+1 |
|  | **USDCHF\_SPT** | USD | Доллар США | Швейцарский франк | 1 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,00001швейцарского франка | T+2 |
|  | **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 |
|  | **USDCNY\_TOD** | USD | Доллар США | Китайский юань | 1 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,00001 китайского юаня | Т+0 |
|  | **USDCNY\_TOM** | USD | Доллар США | Китайский юань | 1 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,00001 китайского юаня | Т+1 |
|  | **USDCNY\_SPT** | USD | Доллар США | Китайский юань | 1 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,00001 китайского юаня | 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 |
|  | **KZTRUB\_TOM** | KZT | Казахстанский тенге | Российский рубль | 10 000 казахстанских тенге | 0,0025 руб. (за 100 казахстанских тенге),для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | Т+1 |
|  | **KZTRUB\_SPT** | KZT | Казахстанский тенге | Российский рубль | 10 000 казахстанских тенге | 0,0025 руб. (за 100 казахстанских тенге),для внесистемных сделок – 0,0001 руб. | T+2 |
|  | **USDKZT\_TOD** | USD | Доллар США | Казахстанский тенге | 1 000 долларов США,для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,01 казахстанского тенге | T+0 |
|  | **USDKZT\_TOM** | USD | Доллар США | Казахстанский тенге | 1 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,01 казахстанского тенге | T+1 |
|  | **USDKZT\_SPT** | USD | Доллар США | Казахстанский тенге | 1 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,01 казахстанского тенге | T+2 |
|  | **TRYRUB\_TOD** | TRY | Турецкая лира | Российский рубль | 1 000 турецких лир, для внесистемных сделок – 1 турецкая лира | 0,0001 руб. | Т+0 |
|  | **TRYRUB\_TOM** | TRY | Турецкая лира | Российский рубль | 1 000 турецких лир, для внесистемных сделок – 1 турецкая лира | 0,0001 руб. | Т+1 |
|  | **USDTRY\_TOD** | USD | Доллар США | Турецкая лира | 1 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,00001 турецкой лиры | Т+0 |
|  | **USDTRY\_TOM** | USD | Доллар США | Турецкая лира | 1 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,00001 турецкой лиры | Т+1 |
|  | **USDTRY\_SPT** | USD | Доллар США | Турецкая лира | 1 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,00001 турецкой лиры | Т+2 |
|  | **JPYRUB\_TOD** | JPY | Японская иена | Российский рубль | 100 000 японских иен, для внесистемных сделок – 1 японская иена | 0,0001 руб. (за 100 японских иен) | Т+0 |
|  | **JPYRUB\_TOM** | JPY | Японская иена | Российский рубль | 100 000 японских иен, для внесистемных сделок – 1 японская иена | 0,0001 руб.(за 100 японских иен) | Т+1 |
|  | **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 НКО 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 |

1. Средневзвешенные сделки

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **№** | **Код средневзвешенной сделки** | **Код валюты лота** | **Наименование валюты лота** | **Наименование сопряженной валюты** | **Лот средневзвешенной сделки** | **Количество торговых дней, на которое дата заключения средневзвешенной сделки предшествует дате определения средневзвешенного курса, по которому заключается сделка\*** |
|  | **USDRUBWAP0** | USD | Доллар США | Российский рубль | 100 000 долларов США | 0 |

\* Датой исполнения обязательств по сделке фикс или по средневзвешенной сделке является дата, отстоящая от даты определения курса фиксинга или средневзвешенного курса на 11:30 мск., по которому заключается сделка фикс или, соответственно, средневзвешенная сделка, на 1 (один) календарный день.

В случае если день исполнения обязательств по сделке фикс или средневзвешенной сделке 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 | 0,000001 доллара США | 0,000001 доллара США | T+0/t+1 |
|  | **EURUSDTMSP** | EUR | Евро | Доллар США | 100 000 евро,для внесистемных сделок – 1 евро | 0,000001 доллара США | 0,000001 доллара США | 0,000001 доллара США | T+1/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 |
|  | **GBPUSDTDTM** | GBP | Фунт стерлингов | Доллар США | 100 000 фунтов стерлингов,для внесистемных сделок – 1 фунт стерлингов | 0,000001 доллара США | 0,000001 доллара США | 0,000001 доллара США | T+0/t+1 |
|  | **GBPUSDTMSP** | GBP | Фунт стерлингов | Доллар США | 100 000 фунтов стерлингов,для внесистемных сделок – 1 фунт стерлингов | 0,000001 доллара США | 0,000001 доллара США | 0,000001 доллара США | T+1/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 |
|  | **USDCHFTDTM** | USD | Доллар США | Швейцарский франк | 100 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,000001 швейцарского франка | 0,000001 швейцарского франка | 0,000001 швейцарского франка | T+0/t+1 |
|  | **USDCHFTMSP** | USD | Доллар США | Швейцарский франк | 100 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,000001 швейцарского франка | 0,000001 швейцарского франка | 0,000001 швейцарского франка | T+1/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 |
|  | **USDCNYTDTM** | USD | Доллар США | Китайский юань | 100 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,000001 китайского юаня | 0,000001 китайского юаня | 0,000001 китайского юаня | T+0/t+1 |
|  | **USDCNYTMSP** | USD | Доллар США | Китайский юань | 100 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,000001 китайского юаня | 0,000001 китайского юаня | 0,000001 китайского юаня | 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 |
|  | **KZT\_TODTOM** | KZT | Казахстанский тенге | Российский рубль | 1 000 000 казахстанских тенге, для внесистемных сделок – 10 000 казахстанских тенге | 0,0001 руб. (за 100 казахстанских тенге) | 0,0001 руб. (за 100 казахстанских тенге) | 0,0001 руб. (за 100 казахстанских тенге) | T+0/t+1 |
|  | **KZT\_TOMSPT** | KZT | Казахстанский тенге | Российский рубль | 1 000 000 казахстанских тенге, для внесистемных сделок – 10 000 казахстанских тенге | 0,0001 руб. (за 100 казахстанских тенге) | 0,0001 руб. (за 100 казахстанских тенге) | 0,0001 руб. (за 100 казахстанских тенге) | T+1/t+1 |
|  | **USDKZTTDTM** | USD | Доллар США | Казахстанский тенге | 100 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,000001 казахстанско-го тенге | 0,000001 казахстанского тенге | 0,000001 казахстанско-го тенге | T+0/t+1 |
|  | **USDKZTTMSP** | USD | Доллар США | Казахстанский тенге | 100 000 долларов США, для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,000001 казахстанско-го тенге | 0,000001 казахстанского тенге | 0,000001 казахстанско-го тенге | T+1/t+1 |
|  | **TRY\_TODTOM** | TRY | Турецкая лира | Российский рубль | 100 000 турецких лир,для внесистемных сделок – 1 турецкая лира | 0,000001 руб. | 0,0001 руб. | 0,000001 руб. | T+0/t+1 |
|  | **USDTRYTDTM** | USD | Доллар США | Турецкая лира | 100 000 долларов США,для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,000001 турецкой лиры | 0,000001 турецкой лиры | 0,000001 турецкой лиры | T+0/t+1 |
|  | **USDTRYTMSP** | USD | Доллар США | Турецкая лира | 100 000 долларов США,для внесистемных сделок – 1 доллар США | 0,000001 турецкой лиры | 0,000001 турецкой лиры | 0,000001 турецкой лиры | T+1/t+1 |
|  | **JPY\_TODTOM** | JPY | Японская иена | Российский рубль | 1 000 000 японских иен, для внесистемных сделок – 1 японская иена | 0,0001 руб.(за 100 японских иен) | 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 НКО 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.