**Расчет средневзвешенной цены позиции по инструменту начиная с 21 мая 2018**

Средневзвешенная цена является параметром расчета ГО (WAPrice). Она пересчитывается по итогам каждой сделки. После клиринга она принимается равной расчетной цене инструмента.

Начиная с 21 мая 2018 рассчитывается в зависимости от направленности позиции:

– объем сделок на покупку в единицах цены контракта;

– объем сделок на продажу в единицах цены контракта;

– объем сделок на покупку в количестве контрактов;

– объем сделок на продажу в количестве контрактов;

- объем сделки в количестве контрактов;

– цена сделки;

Если сделка в покупку:

Если сделка в продажу:

Если

Иначе

**Расчет средневзвешенной цены позиции по инструменту до 21 мая 2018**

Пусть перед сделкой имеется позиция объемом контрактов, объем сделки контрактов (все объемы здесь и ниже считаются положительными). Средневзвешенная цена позиции до совершения сделки , цена сделки .  В случае сделки возможны следующие варианты:

Алгоритм изменения цены позиции (WAPrice):

1. Сделка открывает позицию, т.е. направление сделки совпадает с направлением позиции. Тогда новая средневзвешенная цена равна:
2. Сделка закрывает позицию, т.е. направление сделки противоположно направлению позиции и . Тогда средневзвешенная цена не меняется.
3. Сделка «переворачивает» позицию, т.е. направление сделки противоположно направлению позиции и . В этом случае новая средневзвешенная цена равна .