



1 октября 2015

Приказ

Москва

№ 166-09

Об установлении ограничения
для величины отклонения Расчетной цены
фьючерсного контракта
на Срочном рынке ПАО Московская Биржа

На основании пункта 9.3 Методики определения расчетной цены срочных контрактов, являющейся Приложением №1 к Правилам организованных торгов на Срочном рынке ПАО Московская Биржа, утвержденных Решением Наблюдательного совета Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС» (Протокол №6 от 04.08.2015 г.) (далее – Методика), приказываю:

1. Установить ограничение для величины отклонения Расчетной цены фьючерсного контракта (SP_t), определенной согласно Методике, от Расчетной цены фьючерсного контракта предыдущего Расчетного периода (начальной Расчетной цены) с учетом которого Расчетная цена фьючерсного контракта определяется как:

$$SP_t = \begin{cases} SP_{t-1} - aL_{t-1}, & \text{если } SP_{t, \text{неогранич}} \leq SP_{t-1} - aL_{t-1}, \\ SP_{t-1} + aL_{t-1}, & \text{если } SP_{t, \text{неогранич}} \geq SP_{t-1} + aL_{t-1}, \end{cases}$$

где:

| | |
|----------------------------|---|
| $SP_{t, \text{неогранич}}$ | Расчетная цена, значение которой не ограничено Лимитом колебаний цен сделок; |
| L_{t-1} | Лимит колебаний цен сделок, установленный в ходе предыдущей клиринговой сессии; |
| a | Коэффициент, применяемый к Лимиту колебаний цен сделок, равный 1. |

Указанное ограничение применяется при условии, что в течение Расчетного периода увеличивался Лимит колебаний цены сделки, и отклонение Расчетной цены фьючерсного контракта, определенной согласно Методике, от Расчетной цены фьючерсного контракта предыдущего Расчетного периода (начальной расчетной цены) превышает установленный на начало данного расчетного периода Лимит колебаний цены сделки.

2. Обеспечить размещение на сайте ПАО Московская Биржа в сети Интернет информации, указанной в пункте 1 настоящего Приказа.

Настоящий Приказ вступает в силу с 05.10.2015 г.

Контроль за исполнением настоящего Приказа оставляю за собой.

Директор Департамента продаж
и сопровождения торгов
Бизнес-дивизиона «Срочный рынок»

 /К.М. Пестов/