[выдержка из приказа ПАО Московская Биржа]

**Об определении порядка расчета и уплаты**

**вариационной маржи**

**по фьючерсу на ставку RUONIA**

На основании подпункта 5.1.3. Спецификации фьючерсного контракта на ставку RUONIA в целях уточнения параметров округления сумм вариационной маржи установить, что расчет вариационной маржи осуществляется по следующим формулам:

где:

|  |  |
| --- | --- |
| **ВМО** | вариационная маржа по Контракту, по которому расчет вариационной маржи ранее не осуществлялся; |
| **ВМТ** | вариационная маржа по Контракту, по которому расчет вариационной маржи осуществлялся ранее; |
| **ЦО** | цена заключения Контракта; |
| **РЦТ** | текущая (последняя) Расчетная цена Контракта; |
| **РЦП** | предыдущая Расчетная цена Контракта; |
| **W** | стоимость минимального шага цены; |
| **R** | минимальный шаг цены; |
| **Round** | функция математического округления с заданной точностью. |