|  |  |
| --- | --- |
|  | **УТВЕРЖДЕНА**  Правлением ПАО Московская Биржа «21» ноября 2022 г. (Протокол № 86)  Председатель Правления  ПАО Московская Биржа  \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Ю.О. Денисов |

# Методика расчета индикативных валютных курсов

1. **Общие положения**
   1. Настоящая Методика расчета индикативных валютных курсов (далее – Методика) определяет порядок расчета Публичным акционерным обществом «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее - Биржа) индикативного курса денежной единицы одной страны, выраженного в денежной единице другой страны (далее – Индикативный курс) для целей расчета индексов срочного и фондового рынков Группы «Московская Биржа» и (или) иных показателей, расчет которых необходим для проведения биржевых торгов и осуществления операций на рынках Биржи.
   2. Индикативный курс рассчитывается Биржей на основании информации о торгах иностранной валютой, проводимых Биржей (далее – Курс Московской Биржи), и/или информации о курсах иностранной валюты одного государства, выраженных в денежной единице другого государства, объявляемых центральным банком государства котируемой валюты и транслируемых на официальной странице сайта соответствующего центрального банка (далее – Курс Центрального Банка государства котируемой валюты), и/или информации о курсах Банка России иностранной валюты к российскому рублю (далее – Курс Банка России), и/или информации об отношении двух Индикативных курсов (далее – Кросс-курс).
   3. Перечень Индикативных курсов, рассчитываемых Биржей, а также параметры их расчета и источники данных указаны в Приложении 1 к настоящей Методике.
   4. Настоящая Методика, а также все изменения и дополнения к ней, утверждаются Биржей и вступают в силу в дату, определяемую Биржей.
   5. Текст утвержденной Биржей Методики (изменений и дополнений к ней) раскрывается на сайте Биржи в сети Интернет не позднее, чем за один рабочий день до даты вступления ее в силу, если иное не предусмотрено решением Биржи.
2. **Расчет Курса Московской Биржи**
   1. Курс Московской Биржи рассчитывается на основе сделок, заключенных на торгах иностранной валютой, проводимых Биржей по соответствующему Инструменту.
   2. Курс Московской Биржи рассчитывается каждую секунду в течение времени проведения торгов в системном режиме каждого дня проведения торгов на валютном рынке Биржи.
   3. Курс Московской Биржи рассчитывается по следующей формуле:

где:

– Курс Московской Биржи в момент времени t;

MAt – скользящая средняя в момент времени t, определяемая в соответствии с пунктом 2.4 настоящей Методики.

* 1. Скользящая средняя в момент времени t рассчитывается по следующей формуле:



где:

MAt – скользящая средняя в момент времени t;

Ri – цена сделки после устранения нерыночных отклонений, в момент времени i, определяемая в соответствии с пунктом 2.5 настоящей Методики;

M – период усреднения, выраженный в секундах, определяемый в соответствии с Приложением 1 к настоящей Методике.

* 1. Цена сделки после устранения нерыночных отклонений в момент времени t определяется по следующей формуле:



где:

Rt – цена сделки после устранения нерыночных отклонений в момент времени t;

Rt-1 – цена сделки после устранения нерыночных отклонений в момент времени t-1;

RAt – цена последней сделки по соответствующему Инструменту в момент времени t (без учета внесистемных сделок);

K – предельное значение отклонения, определяемое в соответствии с Приложением 1 к настоящей Методике;

S – период расчета отклонений, выраженный в секундах, определяемый в соответствии с Приложением 1 к настоящей Методике.

1. **Курс Центрального Банка государства котируемой валюты**
   1. Курс Центрального Банка государства котируемой валюты определяется центральным банком государства котируемой валюты на основании информации о сделках с соответствующей иностранной валютой и публикуется на официальной странице сайта данного Центрального Банка.
2. **Курс Банка России**
   1. Курс Банка России определяется как последний опубликованный на официальной странице сайта Центрального банка Российской Федерации в сети Интернет (<https://cbr.ru/currency_base/daily/>) курс иностранной валюты к российскому рублю. Биржа осуществляет мониторинг информации на указанной странице с периодичностью не превышающей, как правило, одного часа.
3. **Расчет Кросс-курсов**
   1. Расчет Кросс-курсов, приведенных в Таблице 2 Приложения 1, осуществляется по формуле расчета Кросс-курса с использованием Индикативных курсов, приведенных в Таблице 1 Приложения 1:

где:

Rtcur1cur3 – Индикативный курс валюты 1 к валюте 3 в момент времени t;

Rtcur1cur2 – Индикативный курса валюты 1 к валюте 2 в момент времени t;

Rtcur3cur2 – Индикативный курса валюты 3 к валюте 2 в момент времени t.

1. **Прочие положения**
   1. В случае непроведения торгов на Бирже валютной парой, используемой для расчета Индикативного курса, в качестве Индикативного курса устанавливается одно из следующих значений:

а) значение Курса Банка России;

б) значение Кросс-курса, рассчитанного с использованием Курса Банка России по валютной паре, торги которой не проводятся;

в) значение Курса Центрального Банка государства котируемой валюты на день определения Индикативного курса;

г) значение валютного курса, сложившееся на торгах российских или зарубежных бирж в случае принятия Биржей соответствующего решения.

1. **Раскрытие информации о значении Индикативного курса**
   1. Биржа вправе в информационных целях раскрывать на своем сайте в сети Интернет рассчитанные значения Индикативных курсов.

Приложение № 1 к Методике расчета

Индикативных валютных курсов

# Перечень Индикативных курсов и параметры расчета

**Таблица 1**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Код** | **Индикативный курс** | **Курсы, используемые для расчета Индикативного курса** | **Инструмент** | **Предельное отклонение K** | **Период усредне-ния M** | **Период расчета отклоне-ний S** |
| USD/RUB | Индикативный курс доллара США к российскому рублю | Курс Московской Биржи | USDRUB\_TOM | 0.0005 | 60 | 60 |
| EUR/RUB | Индикативный курс евро к российскому рублю | Курс Московской Биржи | EURRUB\_TOM | 0.0005 | 60 | 60 |
| CNY/RUB | Индикативный курс китайского юаня к российскому рублю | Курс Московской Биржи | CNYRUB\_TOM | 0.0005 | 60 | 60 |
| CHF/RUB | Индикативный курс швейцарского франка к российскому рублю | Курс Банка России | CHF | - | - | - |
| JPY/RUB | Индикативный курс японской йены к российскому рублю | Курс Банка России, деленный на 100 | JPY / 100 | - | - | - |
| TRY/RUB | Индикативный курс турецкой лиры к российскому рублю | Курс Банка России, деленный на 10 | TRY / 10 | - | - | - |
| GBP/RUB | Индикативный курс фунта стерлингов Соединенного Королевства к российскому рублю | Курс Банка России | GBP | - | - | - |
| HKD/RUB | Индикативный курс гонконгского доллара к российскому рублю | Курс Банка России, деленный на 10 | HKD / 10 | - | - | - |
| CAD/RUB | Индикативный курс канадского доллара к российскому рублю | Курс Банка России | CAD | - | - | - |

**Таблица 2**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Код** | **Кросс-курс** | Rtcur1cur2 | Rtcur3cur2 |
| USD/JPY | Индикативный курс доллара США к японской йене | USD/RUB | JPY/RUB |
| USD/CHF | Индикативный курс доллара США к швейцарскому франку | USD/RUB | CHF/RUB |
| USD/TRY | Индикативный курс доллара США к турецкой лире | USD/RUB | TRY/RUB |
| EUR/USD | Индикативный курс евро к доллару США | EUR/RUB | USD/RUB |