**УТВЕРЖДЕНО**

решением Правления

Публичного акционерного общества

«Московская Биржа ММВБ-РТС»

(Протокол №46 от «24» августа 2018г)

**СПИСОК ПАРАМЕТРОВ РАСЧЕТНЫХ**

**ФЬЮЧЕРСНЫХ КОНТРАКТОВ НА КУРС ДОЛЛАРА США К ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТЕ**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **№** | **Наименование контракта** | **Основной код базового актива[[1]](#footnote-1)** | **Базовый актив** | **Лот контракта** | **Минимальный шаг цены** | **Стоимость минимального шага цены** | **Значение параметра m[[2]](#footnote-2)** | **Источник**  **информации о курсе доллара США к иностранной валюте[[3]](#footnote-3)** | **Время опубликования курса доллара США к иностранной валюте** |
| 1 | Фьючерсный контракт на курс доллар США – японская йена | UJPY | Курс доллара США к японской йене | 1 000 USD | 0,01 JPY | 10 JPY | 5 | Thomson Reuters (WMRates) | **11:00** по лондонскому времени |
| 2 | Фьючерсный контракт на курс доллар США – швейцарский франк | UCHF | Курс доллара США к швейцарскому франку | 1 000 USD | 0,0001 CHF | 0,1 CHF | 4 |
| 3 | Фьючерсный контракт на курс доллар США – канадский доллар | UCAD | Курс доллара США к канадскому доллару | 1 000 USD | 0,0001 CAD | 0,1 CAD | 4 |
| 4 | Фьючерсный контракт на курс доллар США – украинская гривна | UUAH | Курс доллара США к украинской гривне | 1 000 USD | 0,005 UAH | 5 UAH | 4 | Национальный Банк Украины[[4]](#footnote-4) | **16:00** по киевскому времени |
| 5 | Фьючерсный контракт на курс доллар США – турецкая лира | UTRY | Курс доллара США к турецкой лире | 1 000 USD | 0,0001 TRY | 0,1 TRY | 4 | Thomson Reuters/терминал Thomson Reuters на странице CBTATRY | **15:30** по турецкому времени |
| 6 | Фьючерсный контракт на курс доллар США – индийская рупия[[5]](#footnote-5) | UINR | Курс доллара США к индийской рупии | 1 000 USD | 0,0025 INR | 2,5 INR | 4 | Thomson Reuters/терминал Thomson Reuters на странице USDINRREF=FBIL/ терминал Bloomberg на странице USDINR INDEX | **12:30** по индийскому времени |

1. Например, для фьючерсного контракта на курс доллар США – японская йена, код (обозначение) «UJPY-12.18» означает, что Контракт подлежит исполнению в декабре 2018 года. [↑](#footnote-ref-1)
2. Параметр m определяется в соответствии со Спецификацией фьючерсных контрактов на курс доллара США к иностранной валюте. [↑](#footnote-ref-2)
3. Биржа и Клиринговый центр не несут ответственности за недостоверность, неполноту и несвоевременное обновление информации о курсах доллара США к иностранным валютам, перечень которых приведен в настоящем Списке параметров. [↑](#footnote-ref-3)
4. В целях определения курса доллара США – украинская гривна (далее – USD/UAH) используется средневзвешенное значение курса USD/UAH, которое определяется на основании данных межбанковского валютного рынка Национальным Банком Украины (далее – НБУ) по состоянию на 16:00 по киевскому времени и публикуется на сайте НБУ по адресу <http://www.bank.gov.ua/control/uk/publish/article?art_id=9628619&cat_id=9628618> (далее – курс МБК).

   В случае невозможности получить информацию о значении курса МБК (в том числе, в случае приостановления/прекращения опубликования НБУ курса МБК), для определения курса USD/UAH используется значение официального курса USD/UAH, который определяется НБУ в текущий торговый день с датой вступления в силу на следующий торговый день и публикуется на сайте НБУ по адресу: <http://www.bank.gov.ua/control/uk/curmetal/detail/currency?period=daily> (далее – курс НБУ).

   В случае невозможности получить информацию о курсе НБУ по состоянию на 18:00 по московскому времени (в том числе, в случае приостановления/прекращения опубликования НБУ курса НБУ), для определения курса USD/UAH используется значение официального курса USD/UAH, который определен НБУ в предыдущий торговый день с датой вступления в силу в текущий торговый день и опубликован на сайте НБУ по адресу: <http://www.bank.gov.ua/control/uk/curmetal/detail/currency?period=daily>. [↑](#footnote-ref-4)
5. Последним днем заключения фьючерсного контракта на курс доллар США – индийская рупия является Торговый день, отстоящий на 2 (два) Торговых дня до последнего Торгового дня месяца и года исполнения контракта. Например, если последний Торговый день месяца и года исполнения контракта приходится на 31 августа 2018 г., то последним днем заключения фьючерсного контракта на курс доллар США – индийская рупия является 29 августа 2018 г.

   [↑](#footnote-ref-5)