

Правила формирования Идентификационного кода расчетных премиальных европейских опционов на фьючерсные контракты на товары

1. Настоящие правила формирования Идентификационного кода Договора ПФИ (далее – Правила) устанавливает порядок формирования кода (обозначения) расчётных, премиальных, европейских опционов нулевого страйка на фьючерсные контракты на товары (далее – Опционы).

Термины, специально не определенные в Правилах, используются в значениях, установленных законодательством Российской Федерации, Правилами проведения организованных торгов производными финансовыми инструментами, Спецификациями.

2. Идентификационный код Опциона состоит из 12 символов и определяет ключевые параметры Опциона.

Пример кода (обозначения) опциона

Код базисного актива	Цена страйк	Месяц и тип опциона	Последняя цифра года исполнения опциона	Символ недели в месяце исполнения опциона и вид опциона	Символ дня в неделе исполнения опциона и тип исполнения опциона
GCM	00000	C	4	T	O

- 1) Поле «Код базисного актива» формируется Биржей по следующим правилами: первые два символа – код контракта, который формируется организаторами торговли, на которых обращается базисный актив.
- 2) Поле «Цена страйк» состоит из пяти символов и представляет собой числовое значение цены Страйк Опциона.
- 3) Поле «Месяц и тип опциона» состоит из одного буквенного символа, который присваивается следующим образом:

Месяц	Опцион на покупку (Call-опцион)	Опцион на продажу (Put-опцион)
Январь	A	M
Февраль	B	N
Март	C	O
Апрель	D	P
Май	E	Q
Июнь	F	R
Июль	G	S
Август	H	T
Сентябрь	I	U
Октябрь	J	V
Ноябрь	K	W
Декабрь	L	X

- 4) Поле «Год исполнения опциона» состоит из одного символа, указывающего на последнюю цифру года Даты экспирации Опционов.
- 5) Поле «Символ недели в месяце исполнения опциона и тип расчетов опциона» состоит из одной латинской буквы, где неделя – это неделя, в которую проводятся Торги Опционами. Указанное поле заполняется следующим образом:

	Расчетный Опцион		Поставочный Опцион
--	-------------------------	--	---------------------------

Тип расчетов	маржируемый ¹	премиальный ²	маржируемый	премиальный
1-я неделя	A	F	K	P
2-я неделя	B	G	L	Q
3-я неделя	C	H	M	R
4-я неделя	D	I	N	S
5-я неделя	E	J	O	T

- 6) Поле «Символ дня в неделе исполнения опциона и тип исполнения опциона» состоит из одной латинской буквы. Указанное поле заполняется следующим образом:

Торговый день в неделе исполнения опциона	Опцион европейского типа ³		Опцион американского типа ⁴	
	Режим основных торгов ПФИ и Режим торгов RFQ ПФИ	Режим переговорных сделок ПФИ	Режим основных торгов ПФИ и Режим торгов RFQ ПФИ	Режим переговорных сделок ПФИ
1 (первый) Торговый день	A	O	H	T
2 (второй) Торговый день	B	P	I	U
3 (третий) Торговый день	C	Q	J	V
4 (четвертый) Торговый день	D	R	K	W
5 (пятый) Торговый день	E	S	L	X

¹ Маржируемый Опцион подразумевает

² Премиальный Опцион подразумевает уплату Покупателем премии при заключении такого Опциона, в соответствии со Спецификацией.

³ Покупатель Опциона вправе воспользоваться правом на предъявление требования об исполнении Продавцом обязательства только в определенный день (в последний Торговый день, в который может быть заключен Опцион).

⁴ Покупатель Опциона вправе воспользоваться правом на предъявление требования об исполнении Продавцом обязательства в любое время до определенного дня (до даты последнего Торгового дня, в который может быть заключен Опцион).