

Маркет-мейкерские условия котирования СВОП контрактов валютной пары CNYRUB

№ п.п.	Параметры исполнения обязательств	Значения параметров исполнения обязательств						Условия исполнения обязательств по ММ	Размер вознаграждения ММ	
									Полный календарный месяц	Неполный календарный месяц
1	Инструменты, в отношении которых исполняются обязательства ММ одновременно	CNY_TOM1W	CNY_TOM2W	CNY_TOM1M	CNY_TOM2M	CNY_TOM3M	CNY_TOM6M	Выполнение условий, указанных в пункте 2 и/или пунктах 3-5.	200 000 рублей	PB=dw/dm*200000 PB – размер вознаграждения Маркет-мейкера за неполный Отчетный период, в рублях dw – количество Торговых дней действия Договора в Отчетный период dm – количество Торговых дней Отчетного периода
2	Совокупный объем сделок, заключенных Маркет-мейкером с Инструментом (за исключением внесистемных сделок) в ходе Основной сессии каждого Торгового дня Отчетного периода	30 млн. юаней								
3	Максимальная разница между ценами заявок на покупку Инструмента и ценами заявок на продажу, выставленных Маркет-мейкером (Спрэд двусторонней котировки)	СПРЭД*=N*K								
4	Минимально допустимый объем заявки на продажу и покупку Инструмента, выставленных Маркет-мейкером с направленностью «покупка/продажа» и «продажа/покупка» по первой части сделки своп	1 млн. юаней	1 млн. юаней	1 млн. юаней	1 млн. юаней	1 млн. юаней	1 млн. юаней			
5	Период времени в ходе Основной сессии каждого Торгового дня Отчетного периода, в течение которого Маркет-мейкер должен выполнять обязательства в отношении Инструмента	45%	45%	45%	45%	45%	45%			

* При расчете СПРЭДа, переменные N и K обозначают следующее:

N – количество календарных дней между датой исполнения первых и вторых частей соответствующих сделок своп;

K – 0,004% от Базового курса сделки своп