

Фьючерс на индекс ключевой ставки

Расчетный фьючерс на индекс ключевой ставки.
Экспирация в даты заседаний Банка России по ключевой ставке



~14 000 ₽

объем контракта

1 000 ₽

стоимость 1% ключевой
ставки в контракте

2

кол-во экспираций до конца
2026 года

ПРЕИМУЩЕСТВА

Торговля на ожиданиях
решения ЦБ по ключевой
ставке: движение ставки на
1% ставки дает 1000 руб. на 1
контракт

Низкий порог входа: контракт
стоит около 14 000 ₽ при
ключевой ставке 14%

Управление процентным
риском без выхода на
внебиржевой рынок

ПАРАМЕТРЫ КОНТРАКТА

KEYRATE

Базисный актив	Индекс ключевой ставки
Расчет индекса	при ключевой ставке 14% → индекс 14,00 пунктов
Тип контракта	расчетный
Котировка	в пунктах индекса ключевой ставки
Шаг цены	0,01 пункта
Стоимость шага цены	10 ₽
Цена изменения ставки ЦБ на 1%	1 000 ₽
Объем контракта	~14 000 ₽ при ключевой ставке 14%
Обращающиеся серии	2 ближайших срока
Даты экспирации	плановые даты заседания Банка России, 19:00 МСК
Цена исполнения	ключевая ставка на дату заседания в формате индекса ключевой ставки

ДИНАМИКА КЛЮЧЕВОЙ СТАВКИ

Ключевая ставка Банка России, % годовых · 15.08.2022 – 13.08.2026



Официальный телеграм-канал
Срочного рынка