

Формули розрахунку параметрів Свопу

Даний документ розроблений відповідно до Правил БТМ деривативних контрактів АТ «ФОНДОВА БІРЖА ПФТС» з метою визначення параметрів Свопу (кількості розрахункового базового активу за першою/другою частиною Свопу, дати розрахунків за другою частиною Свопу, інших параметрів тощо) на підставі умов (даних), які містяться в заявці учасника торгів на укладання Свопу.

Всі терміни у цьому документі вживаються згідно з діючими законодавчими та підзаконними актами, правилами, положеннями та стандартами Біржі.

1. В формулах, наведених в цьому документі, використовуються наступні позначення:

Своп	– поставний деривативний контракт грошового ринку, базовими активами якого є валюта, умови якого визначаються Специфікацією, законодавством України, цими Правилами та Правилами клірингу, та який складається з двох взаємопов'язаних частин (першої частини та другої частини): за першою частиною у день укладення Контракту: одна сторона зобов'язана передати другій стороні визначену Контрактом кількість основного базового активу, а друга сторона – передати першій стороні визначену першою частиною Контракту кількість розрахункового базового активу; за другою частиною, у визначений Контрактом день: друга сторона зобов'язана передати першій стороні ту саму кількість основного базового активу, яка була передана за першою частиною, а перша сторона - передати другій стороні визначену другою частиною Контракту кількість розрахункового базового активу.
Контракт	– Своп, що укладається на Торгах з використанням Торговельної системи у вигляді електронного документа;
Заявка	– заявка на укладання Свопу в режимі «Свопи з контролем ризиків»;
Сума₁заявка	– вказана у Заявці сума першої частини Контракту, виражена у валюті розрахунків з точністю до двох знаків після коми;
Сума₁	– кількість розрахункового базового активу в першій частині Контракту (сума першої частини Контракту), виражена у валюті розрахунків з точністю до двох знаків після коми;
Сума₂	– кількість розрахункового базового активу в другій частині Контракту (сума другої частини Контракту), виражена у валюті розрахунків з точністю до двох знаків після коми;
Кількість	– вказана у Заявці кількість основного базового активу в першій та другій частині Контракту;
Ціна₁, Ціна₂	– ціна за одну одиницю основного базового активу в першій та в другій частинах Контракту, виражена у валюті розрахунків з точністю до чотирьох знаків після коми;
Ставка%	– вказана у Заявці ставка Свопу у відсотках річних, виражена з точністю до чотирьох знаків після коми;

Дохід	– сума процентного доходу (витрат) за Контрактом, яка виражається у валюті розрахунків з точністю до двох знаків після коми;
Строк	– вказаний у Заявці строк Свопу (проміжок часу, виражений в календарних днях, між датами виконання першої та другої частин Контракту);
Код розрахунків	– параметр першої частини Контракту, що вказується в Заявці, який визначає термін та умови (спосіб) виконання розрахунків за першою частиною Контракту;
T₁	– дата виконання першої частини Контракту (дата розрахунків за першою частиною Контракту);
T₂	– дата виконання другої частини Контракту (дата розрахунків за другою частиною Контракту);
Термін_{365дн}	– кількість днів між виконанням першої та другої частинами Контракту, що припадають на календарні роки, які складаються з 365 днів (у випадку, якщо дати виконання першої та другої частин Контракту співпадають, дорівнює 1 (одиниці));
Термін_{366дн}	– кількість днів між виконанням першої та другої частинами Контракту, що припадають на календарні роки, які складаються з 366 днів (у випадку, якщо дати виконання першої та другої частин Контракту співпадають, дорівнює 1 (одиниці)).

Термін_{365дн} та Термін_{366дн} визначаються, виходячи із вказаного в Заявці строку Свопу. (Термін_{365дн} + Термін_{366дн} = Строк)

2. Розрахунок параметрів Контракту здійснюється за такими формулами:

2.1. **Ціна для першої частини Контракту** розраховується, виходячи із вказаної учасником торгів інформації в Заявці, за формулою:

$$\text{Ціна}_1 = \frac{\text{Сума}_1 \text{заявка}}{\text{Кількість}} \quad (\text{формула 2.1})$$

2.2. **Кількість розрахункового базового активу в першій частині Контракту** (сума першої частини Контракту) розраховується за формулою:

$$\text{Сума}_1 = \text{Ціна}_1 \times \text{Кількість} \quad (\text{формула 2.2})$$

2.3. **Датою розрахунків за першою частиною Контракту** є дата укладання Контракту. **Дата розрахунків за першою частиною Контракту (дата виконання першої частини Контракту)** визначається кодом розрахунків, зазначеним учасником торгів в Заявці, на підставі якої укладається Контракт, шляхом додавання до дати проведення торгів кількості календарних днів, які відповідають кількості робочих днів у вказаному учасником торгів в Заявці коді розрахунків. Якщо кількість робочих днів (термін) для виконання розрахунків в коді розрахунків дорівнює нулю, це означає, що датою виконання першої частини Контракту є дата проведення торгів (дата укладання Контракту).

2.4. Дата розрахунків за другою частиною **Контракту** (дата виконання другої частини **Контракту**) визначається строком Свопу, зазначеним учасником торгів в Заявці, на підставі якої укладається **Контракт**, шляхом додавання строку Свопу до дати виконання першої частини **Контракту**:

$$T_2 = T_1 + \text{Строк} \quad (\text{формула 2.3})$$

2.5. Ціна для другої частини **Контракту** розраховується за формулою:

$$\text{Ціна}_2 = \text{Ціна}_1 + \frac{\text{Ціна}_1 \times \text{Ставка}\%}{100\%} \cdot \left(\frac{\text{Термін 365дн}}{365\text{дн}} + \frac{\text{Термін 366дн}}{366\text{дн}} \right) \quad (\text{формула 2.4})$$

2.6. **Кількість розрахункового базового активу в другій частині Контракту** (сума другої частини **Контракту**) розраховується за формулою:

$$\text{Сума}_2 = \text{Ціна}_2 \times \text{Кількість} \quad (\text{формула 2.5})$$

2.7. Сума процентного доходу (витрат) за **Контрактом** розраховується за формулою:

$$\text{Дохід} = \text{Сума}_2 - \text{Сума}_1 \quad (\text{формула 2.6})$$
