

Параметры системы управления рисками

Управление мониторинга и контроля рисков

23 июня 2017 г.

Параметры рыночных цен, за единицу базового актива

| Фьючерс | Теор. цена | Изменение теор. цены | Лимит изменения цены | Изменение лимита |
|-------------|------------|----------------------|----------------------|------------------|
| FDDL560ER38 | 39 720.00 | 0.00 | 870.00 | 0.00 |
| FDDL560ER67 | 36 750.00 | -200.00 | 720.00 | 0.00 |
| FDDL560ER77 | 37 520.00 | -200.00 | 750.00 | 0.00 |
| FDDL560ER87 | 38 300.00 | -200.00 | 780.00 | 0.00 |
| FDDL560ER97 | 39 100.00 | -200.00 | 810.00 | 0.00 |
| FDDL560MS77 | 37 125.00 | - | 630.00 | - |
| FDDL560MS87 | 37 413.00 | - | 660.00 | - |
| FDDL560NZ38 | 41 710.00 | 0.00 | 810.00 | 0.00 |
| FDDL560NZ67 | 36 220.00 | -630.00 | 630.00 | 0.00 |
| FDDL560NZ77 | 36 960.00 | -660.00 | 630.00 | -30.00 |
| FDDL560NZ87 | 37 710.00 | -690.00 | 660.00 | -30.00 |
| FDDL560NZ97 | 38 510.00 | -690.00 | 690.00 | 0.00 |
| FDDZ160NZC7 | 42 891.00 | 0.00 | 1 560.00 | 0.00 |
| FDDZ360ERC7 | 42 873.00 | 0.00 | 1 110.00 | 0.00 |
| FDPR560MS77 | 44 411.00 | - | 900.00 | - |
| FDPR560MS87 | 44 755.00 | - | 930.00 | - |
| FDPR560NZ38 | 47 440.00 | 0.00 | 1 260.00 | 0.00 |
| FDPR560NZ67 | 43 850.00 | -200.00 | 1 050.00 | 0.00 |
| FDPR560NZ77 | 44 700.00 | -200.00 | 1 080.00 | 0.00 |
| FDPR560NZ87 | 45 550.00 | -200.00 | 1 110.00 | 0.00 |
| FDPR560NZ97 | 46 400.00 | -200.00 | 1 140.00 | -30.00 |
| FDPR560NZC7 | 46 162.00 | 0.00 | 1 170.00 | 0.00 |
| FDPRM5KIR67 | 45 780.00 | 0.00 | 1 080.00 | 0.00 |
| FDREG5KIR67 | 45 290.00 | 0.00 | 1 110.00 | 0.00 |
| FDRG560ER38 | 45 000.00 | 0.00 | 1 050.00 | 0.00 |
| FDRG560ER67 | 42 050.00 | -350.00 | 870.00 | 0.00 |
| FDRG560ER77 | 42 870.00 | -330.00 | 900.00 | 0.00 |
| FDRG560ER87 | 43 700.00 | -300.00 | 930.00 | 0.00 |
| FDRG560ER97 | 44 550.00 | -300.00 | 960.00 | 0.00 |

| Фьючерс | Теор. цена | Изменение теор. цены | Лимит изменения цены | Изменение лимита |
|----------------|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-------------------------|
| FDRG560ERC7 | 43 784.00 | 0.00 | 960.00 | 0.00 |
| FDRG560MS77 | 43 789.00 | - | 900.00 | - |
| FDRG560MS87 | 44 128.00 | - | 930.00 | - |
| FDRG560NZ38 | 46 220.00 | 0.00 | 1 080.00 | 0.00 |
| FDRG560NZ67 | 43 150.00 | -350.00 | 870.00 | -30.00 |
| FDRG560NZ77 | 44 000.00 | -300.00 | 900.00 | -30.00 |
| FDRG560NZ87 | 44 850.00 | -270.00 | 930.00 | -30.00 |
| FDRG560NZ97 | 45 700.00 | -300.00 | 990.00 | 0.00 |
| FDRG560NZC7 | 44 969.00 | 0.00 | 990.00 | 0.00 |
| FSMOSIDTL67 | 36 650.00 | 0.00 | 630.00 | 0.00 |
| FSMOSIDTL77 | 36 620.00 | 20.00 | 630.00 | 0.00 |
| FSMOSIMZT67 | 10 950.00 | 0.00 | 800.00 | 0.00 |
| FSMOSIREG67 | 43 400.00 | 50.00 | 900.00 | 0.00 |
| FSMOSIREG77 | 43 610.00 | 0.00 | 900.00 | 0.00 |
| FSMOSITRD67 | 33 570.00 | 0.00 | 780.00 | 0.00 |
| FSSAMIDTL67 | 37 400.00 | 0.00 | 780.00 | 0.00 |
| FSSAMIDTL77 | 36 950.00 | 0.00 | 780.00 | 0.00 |
| FSSAMIREG67 | 43 720.00 | 0.00 | 990.00 | 0.00 |
| FSSAMIREG77 | 44 220.00 | 0.00 | 990.00 | -30.00 |
| U18 | 44.51 | 0.00 | 3.20 | 0.00 |
| U28 | 44.75 | 0.00 | 3.20 | 0.00 |
| U38 | 44.97 | 0.00 | 3.20 | 0.00 |
| U48 | 45.18 | 0.00 | 3.20 | 0.00 |
| U58 | 45.21 | 0.00 | 3.20 | 0.00 |
| U68 | 45.69 | 0.00 | 3.20 | 0.00 |
| U78 | 45.09 | 0.00 | 3.20 | 0.00 |
| U87 | 43.11 | 0.11 | 3.10 | 0.00 |
| U97 | 43.30 | 0.10 | 3.20 | 0.00 |
| UA7 | 43.63 | 0.00 | 3.10 | 0.00 |
| UB7 | 43.93 | 0.00 | 3.10 | 0.00 |

| Фьючерс | Теор. цена | Изменение теор. цены | Лимит изменения цены | Изменение лимита |
|----------------|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-------------------------|
| UC7 | 44.23 | 0.00 | 3.10 | 0.00 |

Ставки предварительной поставочной маржи, рублей за единицу базового актива

| Фьючерс | Ставка | Изменение ставки |
|----------------|---------------|-------------------------|
| FDPRM5KIR67 | 920.00 | - |
| FDREG5KIR67 | 910.00 | - |

Ставки поставочной маржи, рублей за единицу базового актива

| Фьючерс | Ставка | Изменение ставки |
|----------------|---------------|-------------------------|
| U67 | 405.00 | 0.00 |
| U77 | 398.00 | 0.00 |

Коэффициент контроля МТЛ

Коэффициент контроля МТЛ установлен в размере 0.02.

Коэффициент изъятия средств из состава взноса Участника клиринга в Коллективный гарантийный фонд

Коэффициент изъятия средств из состава взноса установлен в размере 7.143.

Лимиты на долю рынка

Лимит на долю рынка по всем сериям срочных контрактов установлен в размере 100%.

Курс валюты срочного контракта (для расчёта вариационной маржи) = 59.5083.

Ограничение на увеличение курса валюты срочного контракта для расчёта вариационной маржи на следующий торговый день = 2.9755.

Параметры SPAN

Управление мониторинга и контроля рисков

23 июня 2017 г.

Диапазоны сканирования, рублей за контракт

| Фьючерс | Количество базового актива по 1 контракту | Диапазон сканирования для стандартного уровня маржирования | Изменение Диапазона сканирования для стандартного уровня маржирования | Диапазон сканирования для повышенного уровня маржирования |
|-------------|---|--|---|---|
| FDDL560ER38 | 60 | 104 400.00 | 0.00 | 119 040.00 |
| FDDL560ER67 | 60 | 86 400.00 | 0.00 | 98 520.00 |
| FDDL560ER77 | 60 | 90 000.00 | 0.00 | 102 600.00 |
| FDDL560ER87 | 60 | 93 600.00 | 0.00 | 106 740.00 |
| FDDL560ER97 | 60 | 97 200.00 | 0.00 | 110 820.00 |
| FDDL560MS77 | 60 | 75 600.00 | 0.00 | 86 220.00 |
| FDDL560MS87 | 60 | 79 200.00 | 0.00 | 90 300.00 |
| FDDL560NZ38 | 60 | 97 200.00 | 0.00 | 110 820.00 |
| FDDL560NZ67 | 60 | 75 600.00 | 0.00 | 86 220.00 |
| FDDL560NZ77 | 60 | 75 600.00 | -3 600.00 | 86 220.00 |
| FDDL560NZ87 | 60 | 79 200.00 | -3 600.00 | 90 300.00 |
| FDDL560NZ97 | 60 | 82 800.00 | 0.00 | 94 440.00 |
| FDDZ160NZC7 | 60 | 187 200.00 | 0.00 | 213 420.00 |
| FDDZ360ERC7 | 60 | 133 200.00 | 0.00 | 151 860.00 |
| FDPR560MS77 | 60 | 108 000.00 | 0.00 | 123 120.00 |
| FDPR560MS87 | 60 | 111 600.00 | 0.00 | 127 260.00 |
| FDPR560NZ38 | 60 | 151 200.00 | 0.00 | 172 380.00 |
| FDPR560NZ67 | 60 | 126 000.00 | 0.00 | 143 640.00 |
| FDPR560NZ77 | 60 | 129 600.00 | 0.00 | 147 780.00 |
| FDPR560NZ87 | 60 | 133 200.00 | 0.00 | 151 860.00 |
| FDPR560NZ97 | 60 | 136 800.00 | -3 600.00 | 156 000.00 |
| FDPR560NZC7 | 60 | 140 400.00 | 0.00 | 160 080.00 |
| FDPRM5KIR67 | 1080 | 1 674 000.00 | -658 800.00 | 1 911 600.00 |
| FDREG5KIR67 | 1080 | 1 717 200.00 | -680 400.00 | 1 965 600.00 |
| FDRG560ER38 | 60 | 126 000.00 | 0.00 | 143 640.00 |
| FDRG560ER67 | 60 | 104 400.00 | 0.00 | 119 040.00 |
| FDRG560ER77 | 60 | 108 000.00 | 0.00 | 123 120.00 |
| FDRG560ER87 | 60 | 111 600.00 | 0.00 | 127 260.00 |
| FDRG560ER97 | 60 | 115 200.00 | 0.00 | 131 340.00 |

| Фьючерс | Количество базового актива по 1 контракту | Диапазон сканирования для стандартного уровня маржирования | Изменение Диапазона сканирования для стандартного уровня маржирования | Диапазон сканирования для повышенного уровня маржирования |
|----------------|--|---|--|--|
| FDRG560ERC7 | 60 | 115 200.00 | 0.00 | 131 340.00 |
| FDRG560MS77 | 60 | 108 000.00 | 0.00 | 123 120.00 |
| FDRG560MS87 | 60 | 111 600.00 | 0.00 | 127 260.00 |
| FDRG560NZ38 | 60 | 129 600.00 | 0.00 | 147 780.00 |
| FDRG560NZ67 | 60 | 104 400.00 | -3 600.00 | 119 040.00 |
| FDRG560NZ77 | 60 | 108 000.00 | -3 600.00 | 123 120.00 |
| FDRG560NZ87 | 60 | 111 600.00 | -3 600.00 | 127 260.00 |
| FDRG560NZ97 | 60 | 118 800.00 | 0.00 | 135 480.00 |
| FDRG560NZC7 | 60 | 118 800.00 | 0.00 | 135 480.00 |
| FSMOSIDTL67 | 1 | 1 260.00 | 0.00 | 1 440.00 |
| FSMOSIDTL77 | 1 | 1 260.00 | 0.00 | 1 440.00 |
| FSMOSIMZT67 | 1 | 1 600.00 | 0.00 | 1 830.00 |
| FSMOSIREG67 | 1 | 1 800.00 | 0.00 | 2 060.00 |
| FSMOSIREG77 | 1 | 1 800.00 | 0.00 | 2 060.00 |
| FSMOSITRD67 | 1 | 1 560.00 | 0.00 | 1 780.00 |
| FSSAMIDTL67 | 1 | 1 560.00 | 0.00 | 1 780.00 |
| FSSAMIDTL77 | 1 | 1 560.00 | 0.00 | 1 780.00 |
| FSSAMIREG67 | 1 | 1 980.00 | 0.00 | 2 260.00 |
| FSSAMIREG77 | 1 | 1 980.00 | -60.00 | 2 260.00 |
| U18 | 1000 | 419 000.00 | -3 000.00 | 478 000.00 |
| U28 | 1000 | 419 000.00 | -3 000.00 | 478 000.00 |
| U38 | 1000 | 419 000.00 | -3 000.00 | 478 000.00 |
| U48 | 1000 | 419 000.00 | -3 000.00 | 478 000.00 |
| U58 | 1000 | 419 000.00 | -3 000.00 | 478 000.00 |
| U68 | 1000 | 419 000.00 | -3 000.00 | 478 000.00 |
| U78 | 1000 | 419 000.00 | -3 000.00 | 478 000.00 |
| U87 | 1000 | 406 000.00 | -2 000.00 | 463 000.00 |
| U97 | 1000 | 419 000.00 | -3 000.00 | 478 000.00 |
| UA7 | 1000 | 406 000.00 | -2 000.00 | 463 000.00 |
| UB7 | 1000 | 406 000.00 | -2 000.00 | 463 000.00 |

| Фьючерс | Количество базового актива по 1 контракту | Диапазон сканирования для стандартного уровня маржирования | Изменение Диапазона сканирования для стандартного уровня маржирования | Диапазон сканирования для повышенного уровня маржирования |
|---------|---|--|---|---|
| UC7 | 1000 | 406 000.00 | -2 000.00 | 463 000.00 |

Надбавки за календарные спрэды, рублей за контракт

| Фьючерс ₁ | Фьючерс ₂ | Вес ₁ | Вес ₂ | Надбавка для стандартного уровня маржирования | Надбавка для повышенного уровня маржирования |
|----------------------|----------------------|------------------|------------------|---|--|
| FDDL560ER87 | FDDL560ER97 | 1.00 | 1.00 | 97 200.00 | 110 820.00 |
| FDDL560ER77 | FDDL560ER87 | 1.00 | 1.00 | 93 600.00 | 106 740.00 |
| FDDL560ER67 | FDDL560ER77 | 1.00 | 1.00 | 90 000.00 | 102 600.00 |
| FDDL560ER77 | FDDL560ER97 | 1.00 | 1.00 | 97 200.00 | 110 820.00 |
| FDDL560ER67 | FDDL560ER87 | 1.00 | 1.00 | 93 600.00 | 106 740.00 |
| FDDL560ER67 | FDDL560ER97 | 1.00 | 1.00 | 97 200.00 | 110 820.00 |
| FDDL560ER97 | FDDL560ER38 | 1.00 | 1.00 | 104 400.00 | 119 040.00 |
| FDDL560ER87 | FDDL560ER38 | 1.00 | 1.00 | 104 400.00 | 119 040.00 |
| FDDL560ER77 | FDDL560ER38 | 1.00 | 1.00 | 104 400.00 | 119 040.00 |
| FDDL560ER67 | FDDL560ER38 | 1.00 | 1.00 | 104 400.00 | 119 040.00 |
| FDDL560MS77 | FDDL560MS87 | 1.00 | 1.00 | 79 200.00 | 90 300.00 |
| FDDL560NZ87 | FDDL560NZ97 | 1.00 | 1.00 | 82 800.00 | 94 440.00 |
| FDDL560NZ77 | FDDL560NZ87 | 1.00 | 1.00 | 79 200.00 | 90 300.00 |
| FDDL560NZ67 | FDDL560NZ77 | 1.00 | 1.00 | 75 600.00 | 86 220.00 |
| FDDL560NZ77 | FDDL560NZ97 | 1.00 | 1.00 | 82 800.00 | 94 440.00 |
| FDDL560NZ67 | FDDL560NZ87 | 1.00 | 1.00 | 79 200.00 | 90 300.00 |
| FDDL560NZ67 | FDDL560NZ97 | 1.00 | 1.00 | 82 800.00 | 94 440.00 |
| FDDL560NZ97 | FDDL560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 97 200.00 | 110 820.00 |
| FDDL560NZ87 | FDDL560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 97 200.00 | 110 820.00 |
| FDDL560NZ77 | FDDL560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 97 200.00 | 110 820.00 |
| FDDL560NZ67 | FDDL560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 97 200.00 | 110 820.00 |
| FSMOSIDTL67 | FSMOSIDTL77 | 1.00 | 1.00 | 1 260.00 | 1 440.00 |
| FSMOSIREG67 | FSMOSIREG77 | 1.00 | 1.00 | 1 800.00 | 2 060.00 |
| FDPR560MS77 | FDPR560MS87 | 1.00 | 1.00 | 111 600.00 | 127 260.00 |
| FDPR560NZ87 | FDPR560NZ97 | 1.00 | 1.00 | 136 800.00 | 156 000.00 |
| FDPR560NZ77 | FDPR560NZ87 | 1.00 | 1.00 | 133 200.00 | 151 860.00 |
| FDPR560NZ67 | FDPR560NZ77 | 1.00 | 1.00 | 129 600.00 | 147 780.00 |
| FDPR560NZ77 | FDPR560NZ97 | 1.00 | 1.00 | 136 800.00 | 156 000.00 |
| FDPR560NZ67 | FDPR560NZ87 | 1.00 | 1.00 | 133 200.00 | 151 860.00 |
| FDPR560Nzc7 | FDPR560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 151 200.00 | 172 380.00 |

| Фьючерс ₁ | Фьючерс ₂ | Вес ₁ | Вес ₂ | Надбавка для стандартного уровня маржирования | Надбавка для повышенного уровня маржирования |
|----------------------|----------------------|------------------|------------------|---|--|
| FDPR560NZ97 | FDPR560NZC7 | 1.00 | 1.00 | 140 400.00 | 160 080.00 |
| FDPR560NZ67 | FDPR560NZ97 | 1.00 | 1.00 | 136 800.00 | 156 000.00 |
| FDPR560NZ87 | FDPR560NZC7 | 1.00 | 1.00 | 140 400.00 | 160 080.00 |
| FDPR560NZ77 | FDPR560NZC7 | 1.00 | 1.00 | 140 400.00 | 160 080.00 |
| FDPR560NZ97 | FDPR560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 151 200.00 | 172 380.00 |
| FDPR560NZ67 | FDPR560NZC7 | 1.00 | 1.00 | 140 400.00 | 160 080.00 |
| FDPR560NZ87 | FDPR560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 151 200.00 | 172 380.00 |
| FDPR560NZ77 | FDPR560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 151 200.00 | 172 380.00 |
| FDPR560NZ67 | FDPR560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 151 200.00 | 172 380.00 |
| FDRG560ER87 | FDRG560ER97 | 1.00 | 1.00 | 115 200.00 | 131 340.00 |
| FDRG560ER77 | FDRG560ER87 | 1.00 | 1.00 | 111 600.00 | 127 260.00 |
| FDRG560ER67 | FDRG560ER77 | 1.00 | 1.00 | 108 000.00 | 123 120.00 |
| FDRG560ER77 | FDRG560ER97 | 1.00 | 1.00 | 115 200.00 | 131 340.00 |
| FDRG560ER67 | FDRG560ER87 | 1.00 | 1.00 | 111 600.00 | 127 260.00 |
| FDRG560ERC7 | FDRG560ER38 | 1.00 | 1.00 | 126 000.00 | 143 640.00 |
| FDRG560ER97 | FDRG560ERC7 | 1.00 | 1.00 | 115 200.00 | 131 340.00 |
| FDRG560ER67 | FDRG560ER97 | 1.00 | 1.00 | 115 200.00 | 131 340.00 |
| FDRG560ER87 | FDRG560ERC7 | 1.00 | 1.00 | 115 200.00 | 131 340.00 |
| FDRG560ER77 | FDRG560ERC7 | 1.00 | 1.00 | 115 200.00 | 131 340.00 |
| FDRG560ER97 | FDRG560ER38 | 1.00 | 1.00 | 126 000.00 | 143 640.00 |
| FDRG560ER67 | FDRG560ERC7 | 1.00 | 1.00 | 115 200.00 | 131 340.00 |
| FDRG560ER87 | FDRG560ER38 | 1.00 | 1.00 | 126 000.00 | 143 640.00 |
| FDRG560ER77 | FDRG560ER38 | 1.00 | 1.00 | 126 000.00 | 143 640.00 |
| FDRG560ER67 | FDRG560ER38 | 1.00 | 1.00 | 126 000.00 | 143 640.00 |
| FDRG560MS77 | FDRG560MS87 | 1.00 | 1.00 | 111 600.00 | 127 260.00 |
| FDRG560NZ87 | FDRG560NZ97 | 1.00 | 1.00 | 118 800.00 | 135 480.00 |
| FDRG560NZ77 | FDRG560NZ87 | 1.00 | 1.00 | 111 600.00 | 127 260.00 |
| FDRG560NZ67 | FDRG560NZ77 | 1.00 | 1.00 | 108 000.00 | 123 120.00 |
| FDRG560NZ77 | FDRG560NZ97 | 1.00 | 1.00 | 118 800.00 | 135 480.00 |
| FDRG560NZ67 | FDRG560NZ87 | 1.00 | 1.00 | 111 600.00 | 127 260.00 |
| FDRG560NZC7 | FDRG560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 129 600.00 | 147 780.00 |

| Фьючерс₁ | Фьючерс₂ | Вес₁ | Вес₂ | Надбавка для стандартного уровня мар-жирования | Надбавка для повышенного уровня мар-жирования |
|----------------------------|----------------------------|------------------------|------------------------|---|--|
| FDRG560NZ97 | FDRG560NZC7 | 1.00 | 1.00 | 118 800.00 | 135 480.00 |
| FDRG560NZ67 | FDRG560NZ97 | 1.00 | 1.00 | 118 800.00 | 135 480.00 |
| FDRG560NZ87 | FDRG560NZC7 | 1.00 | 1.00 | 118 800.00 | 135 480.00 |
| FDRG560NZ77 | FDRG560NZC7 | 1.00 | 1.00 | 118 800.00 | 135 480.00 |
| FDRG560NZ97 | FDRG560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 129 600.00 | 147 780.00 |
| FDRG560NZ67 | FDRG560NZC7 | 1.00 | 1.00 | 118 800.00 | 135 480.00 |
| FDRG560NZ87 | FDRG560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 129 600.00 | 147 780.00 |
| FDRG560NZ77 | FDRG560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 129 600.00 | 147 780.00 |
| FDRG560NZ67 | FDRG560NZ38 | 1.00 | 1.00 | 129 600.00 | 147 780.00 |
| FSSAMIDTL67 | FSSAMIDTL77 | 1.00 | 1.00 | 1 560.00 | 1 780.00 |
| FSSAMIREG67 | FSSAMIREG77 | 1.00 | 1.00 | 1 980.00 | 2 260.00 |
| U68 | U78 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U58 | U68 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U48 | U58 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U38 | U48 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U28 | U38 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U18 | U28 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UC7 | U18 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UB7 | UC7 | 1.00 | 1.00 | 406 000.00 | 463 000.00 |
| UA7 | UB7 | 1.00 | 1.00 | 406 000.00 | 463 000.00 |
| U97 | UA7 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U87 | U97 | 1.00 | 1.00 | 102 000.00 | 117 000.00 |
| U58 | U78 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U48 | U68 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U38 | U58 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U28 | U48 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U18 | U38 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UC7 | U28 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UB7 | U18 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UA7 | UC7 | 1.00 | 1.00 | 406 000.00 | 463 000.00 |
| U97 | UB7 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |

| Фьючерс₁ | Фьючерс₂ | Вес₁ | Вес₂ | Надбавка для стандартного уровня мар-жирования | Надбавка для повышенного уровня мар-жирования |
|----------------------------|----------------------------|------------------------|------------------------|---|--|
| U87 | UA7 | 1.00 | 1.00 | 406 000.00 | 463 000.00 |
| U48 | U78 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U38 | U68 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U28 | U58 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U18 | U48 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UC7 | U38 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UB7 | U28 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UA7 | U18 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U97 | UC7 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U87 | UB7 | 1.00 | 1.00 | 406 000.00 | 463 000.00 |
| U38 | U78 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U28 | U68 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U18 | U58 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UC7 | U48 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UB7 | U38 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UA7 | U28 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U97 | U18 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U87 | UC7 | 1.00 | 1.00 | 406 000.00 | 463 000.00 |
| U28 | U78 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U18 | U68 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UC7 | U58 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UB7 | U48 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UA7 | U38 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U97 | U28 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U87 | U18 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U18 | U78 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UC7 | U68 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UB7 | U58 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UA7 | U48 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U97 | U38 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U87 | U28 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |

| Фьючерс₁ | Фьючерс₂ | Вес₁ | Вес₂ | Надбавка для стандартного уровня маржирования | Надбавка для повышенного уровня маржирования |
|----------------------------|----------------------------|------------------------|------------------------|--|---|
| UC7 | U78 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UB7 | U68 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UA7 | U58 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U97 | U48 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U87 | U38 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UB7 | U78 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UA7 | U68 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U97 | U58 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U87 | U48 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| UA7 | U78 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U97 | U68 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U87 | U58 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U97 | U78 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U87 | U68 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |
| U87 | U78 | 1.00 | 1.00 | 419 000.00 | 478 000.00 |