

РосЕвроБанк

Инструменты хеджирования валютных рисков

- Форвард
- Внебиржевой опцион
- Своп
- Фьючерсы срочного рынка Московской биржи

Коротко информация по работе с форвардом :

- Требуется лимит
 - на срок до 3-х месяцев -20% от планируемого объема сделок
 - на срок от 3-х до 6-ти месяцев – 30% от планируемого объема сделок
- Минимальный объем сделки – 30 000 \$, €, £
- Сроки сделок от 1-го дня до 1 года
- Обеспечение не требуется

Внебиржевой опцион :

- Лимит не требуется (при покупке опциона)
- Оплата премии в момент заключения сделки
- Минимальный объем сделки – 100 000 \$, €, £

Своп :

- Комбинация двух противоположных конверсионных сделок с разными датами валютирования
- Условия заключения свопов аналогичны форварду

Биржевой фьючерс :

- Требуется гарантийное обеспечение
- Расчеты в рублях
- Минимальный объем сделки – 1 тысяча \$, €

Иванисов Алексей Сергеевич
Управление операций на финансовых рынках
тел. (495) 777-11-11 доб. 70-61
as.ivanisov@roseurobank.ru