

ВТБ Капитал Форекс (далее - Компания) осуществляет перенос открытых позиций Клиента на следующий рабочий день путем проведения **сделок по переносу открытой позиции типа «tom/next» (своп)** по текущему курсу (для рублевых пар – по соответствующей последней котировке Компании на дату проведения сделки) с использованием форвардных пунктов.

Для переноса длинной позиции (когда базовая валюта куплена) используется своп Sell/Buy, то есть первой частью свопа длинная позиция закрывается продажей и второй частью свопа вновь открывается покупкой. Курсовую разницу между первой и второй частью свопа Sell/Buy составляет величина форвардного пункта Sell/Buy.

Для переноса короткой позиции (когда базовая валюта продана) используется своп Buy/Sell, то есть первой частью свопа короткая позиция закрывается покупкой и второй частью свопа вновь открывается продажей. Курсовую разницу между первой и второй частью свопа Buy/Sell составляет величина форвардного пункта Buy/Sell.

ФОРВАРДНЫЕ ПУНКТЫ

| Валютная пара | Sell/Buy | Buy/Sell |
|---------------|----------|----------|
| EUR/USD | 0.853 | -0.247 |
| GBP/USD | 0.497 | -0.703 |
| USD/JPY | 0.397 | -0.803 |
| USD/CHF | 0.296 | -0.904 |
| AUD/CAD | 0.695 | -0.505 |
| AUD/JPY | 0.920 | -1.080 |
| AUD/NZD | 1.245 | -0.755 |
| AUD/USD | 0.670 | -0.530 |
| CHF/JPY | 1.095 | -0.705 |
| EUR/AUD | 1.270 | -0.730 |
| EUR/CAD | 1.395 | -0.605 |
| EUR/CHF | 0.545 | -0.655 |
| EUR/GBP | 0.898 | -0.302 |
| EUR/JPY | 0.739 | -0.461 |
| EUR/NZD | 1.655 | -0.345 |
| GBP/AUD | 0.690 | -1.310 |
| GBP/CAD | 0.885 | -1.115 |
| GBP/CHF | 0.495 | -1.505 |
| GBP/JPY | 0.625 | -1.375 |
| GBP/NZD | 1.105 | -0.895 |
| NZD/USD | 0.612 | -0.788 |
| USD/CAD | 0.611 | -0.589 |

Знак перед величиной форвардного пункта означает действие, которое производится с курсом первой части свопа для вычисления курса второй части свопа.

Если курс EUR/USD на 00:00:59 был 1,1000 / 1,10018, то тогда:

- *длинные (Buy) позиции Клиентов по EUR/USD закроются по 1.1000, а откроются по 1.1000853 (1,1000+0,0000853)*
- *короткие (Sell) позиции Клиентов по EUR/USD закроются по 1,10018, а откроются по 1.1001553 (1,10018-0,0000247)*

Таким образом, при текущих значениях форвардных пунктов:

- *перенос длинной позиции 1 000 EUR/USD через ночь уменьшит Средства на 0,0853 USD*
- *перенос короткой позиции 1 000 EUR/USD через ночь уменьшит Средства на 0,0247 USD*