

Параметры системы управления рисками

Управление мониторинга и контроля рисков

17 августа 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
FDDL560ER68	41 797.00	0.00	930.00	0.00
FDDL560ER87	37 000.00	1 500.00	720.00	30.00
FDDL560ER97	37 250.00	1 500.00	750.00	30.00
FDDL560ERA7	37 500.00	1 479.00	750.00	30.00
FDDL560MS87	38 300.00	1 050.00	660.00	30.00
FDDL560MS97	38 550.00	1 008.00	660.00	0.00
FDDL560NZ38	41 710.00	0.00	810.00	0.00
FDDL560NZ68	41 166.00	0.00	840.00	0.00
FDDL560NZ87	37 350.00	1 050.00	630.00	0.00
FDDL560NZ97	37 600.00	1 050.00	660.00	30.00
FDDL560ZA7	37 850.00	1 023.00	660.00	0.00
FDDZ160NZC7	42 891.00	0.00	1 560.00	0.00
FDDZ360ERC7	42 873.00	0.00	1 110.00	0.00
FDPR560MS87	44 755.00	0.00	900.00	0.00
FDPR560MS97	45 105.00	0.00	930.00	0.00
FDPR560NZ38	47 440.00	0.00	1 230.00	0.00
FDPR560NZ68	49 601.00	0.00	1 350.00	0.00
FDPR560NZ87	43 800.00	0.00	1 050.00	0.00
FDPR560NZ97	44 050.00	0.00	1 080.00	0.00
FDPR560ZA7	44 384.00	0.00	1 080.00	0.00
FDPR560ZC7	46 162.00	0.00	1 170.00	0.00
FDRG560ER38	45 000.00	0.00	1 020.00	0.00
FDRG560ER68	47 623.00	0.00	1 110.00	0.00
FDRG560ER87	41 950.00	0.00	870.00	0.00
FDRG560ER97	42 200.00	0.00	870.00	0.00
FDRG560ERA7	42 450.00	0.00	900.00	0.00
FDRG560ERC7	43 784.00	0.00	960.00	0.00
FDRG560MS87	44 220.00	0.00	900.00	0.00

Фьючерс	Теор. цена	Изменение теор. цены	Лимит изменения цены	Изменение лимита
FDRG560MS97	44 470.00	0.00	930.00	0.00
FDRG560NZ38	46 220.00	0.00	1 050.00	0.00
FDRG560NZ68	48 852.00	0.00	1 140.00	0.00
FDRG560NZ87	43 250.00	0.00	900.00	0.00
FDRG560NZ97	43 500.00	0.00	900.00	0.00
FDRG560NZA7	43 750.00	0.00	930.00	0.00
FDRG560NZC7	44 969.00	0.00	960.00	0.00
FSMOSIDTL87	38 170.00	-280.00	660.00	0.00
FSMOSIDTL97	38 150.00	-100.00	660.00	0.00
FSMOSIMZT87	11 660.00	0.00	860.00	0.00
FSMOSIREG87	43 780.00	-170.00	900.00	0.00
FSMOSIREG97	42 600.00	0.00	900.00	0.00
FSMOSITRD87	36 780.00	0.00	870.00	0.00
FSSAMIDTL87	37 010.00	0.00	750.00	0.00
FSSAMIDTL97	36 910.00	0.00	780.00	0.00
FSSAMIREG87	42 970.00	-280.00	960.00	0.00
FSSAMIREG97	42 970.00	-280.00	990.00	0.00
U18	50.68	0.00	3.60	0.00
U28	50.89	0.00	3.60	0.00
U38	50.91	0.00	3.60	0.00
U48	51.02	0.00	3.60	0.00
U58	51.15	0.00	3.60	0.00
U68	51.14	0.00	3.60	0.00
U78	51.24	0.00	3.60	0.00
U88	51.72	0.00	3.70	0.00
U98	50.84	0.00	3.60	0.00
UA7	49.01	-0.12	3.50	-0.20
UB7	48.31	-0.87	3.40	-0.30
UC7	48.34	-0.52	3.50	0.00

Ставки поставочной маржи, рублей за единицу базового актива

Фьючерс	Ставка	Изменение ставки
U87	422.00	0.00
U97	453.00	0.00

Курс валюты срочного контракта (для расчёта вариационной маржи) = 59.2025.

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%.

Ограничение на увеличение курса валюты срочного контракта для расчёта вариационной маржи на следующий торговый день = 2.9602.

Параметры SPAN

Управление мониторинга и контроля рисков

17 августа 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
FDDL560ER68	60	111 600.00	0.00	127 260.00
FDDL560ER87	60	86 400.00	3 600.00	98 520.00
FDDL560ER97	60	90 000.00	3 600.00	102 600.00
FDDL560ERA7	60	90 000.00	3 600.00	102 600.00
FDDL560MS87	60	79 200.00	3 600.00	90 300.00
FDDL560MS97	60	79 200.00	0.00	90 300.00
FDDL560NZ38	60	97 200.00	0.00	110 820.00
FDDL560NZ68	60	100 800.00	0.00	114 960.00
FDDL560NZ87	60	75 600.00	0.00	86 220.00
FDDL560NZ97	60	79 200.00	3 600.00	90 300.00
FDDL560ZA7	60	79 200.00	0.00	90 300.00
FDDZ160NZC7	60	187 200.00	0.00	213 420.00
FDDZ360ERC7	60	133 200.00	0.00	151 860.00
FDPR560MS87	60	108 000.00	0.00	123 120.00
FDPR560MS97	60	111 600.00	0.00	127 260.00
FDPR560NZ38	60	147 600.00	0.00	168 300.00
FDPR560NZ68	60	162 000.00	0.00	184 680.00
FDPR560NZ87	60	126 000.00	0.00	143 640.00
FDPR560NZ97	60	129 600.00	0.00	147 780.00
FDPR560ZA7	60	129 600.00	0.00	147 780.00
FDPR560NZC7	60	140 400.00	0.00	160 080.00
FDRG560ER38	60	122 400.00	0.00	139 560.00
FDRG560ER68	60	133 200.00	0.00	151 860.00
FDRG560ER87	60	104 400.00	0.00	119 040.00
FDRG560ER97	60	104 400.00	0.00	119 040.00
FDRG560ERA7	60	108 000.00	0.00	123 120.00
FDRG560ERC7	60	115 200.00	0.00	131 340.00
FDRG560MS87	60	108 000.00	0.00	123 120.00

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
FDRG560MS97	60	111 600.00	0.00	127 260.00
FDRG560NZ38	60	126 000.00	0.00	143 640.00
FDRG560NZ68	60	136 800.00	0.00	156 000.00
FDRG560NZ87	60	108 000.00	0.00	123 120.00
FDRG560NZ97	60	108 000.00	0.00	123 120.00
FDRG560NZA7	60	111 600.00	0.00	127 260.00
FDRG560NZC7	60	115 200.00	0.00	131 340.00
FSMOSIDTL87	1	1 320.00	0.00	1 510.00
FSMOSIDTL97	1	1 320.00	0.00	1 510.00
FSMOSIMZT87	1	1 720.00	0.00	1 970.00
FSMOSIREG87	1	1 800.00	0.00	2 060.00
FSMOSIREG97	1	1 800.00	0.00	2 060.00
FSMOSITRD87	1	1 740.00	0.00	1 990.00
FSSAMIDTL87	1	1 500.00	0.00	1 710.00
FSSAMIDTL97	1	1 560.00	0.00	1 780.00
FSSAMIREG87	1	1 920.00	0.00	2 190.00
FSSAMIREG97	1	1 980.00	0.00	2 260.00
U18	1000	469 000.00	-2 000.00	535 000.00
U28	1000	469 000.00	-2 000.00	535 000.00
U38	1000	469 000.00	-2 000.00	535 000.00
U48	1000	469 000.00	-2 000.00	535 000.00
U58	1000	469 000.00	-2 000.00	535 000.00
U68	1000	469 000.00	-2 000.00	535 000.00
U78	1000	469 000.00	-2 000.00	535 000.00
U88	1000	482 000.00	-2 000.00	550 000.00
U98	1000	469 000.00	-2 000.00	535 000.00
UA7	1000	456 000.00	-28 000.00	520 000.00
UB7	1000	443 000.00	-41 000.00	506 000.00
UC7	1000	456 000.00	-2 000.00	520 000.00

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
FDDL560ER97	FDDL560ERA7	1.00	1.00	90 000.00	102 600.00
FDDL560ER87	FDDL560ER97	1.00	1.00	90 000.00	102 600.00
FDDL560ER87	FDDL560ERA7	1.00	1.00	90 000.00	102 600.00
FDDL560ER38	FDDL560ER68	1.00	1.00	111 600.00	127 260.00
FDDL560ERA7	FDDL560ER38	1.00	1.00	104 400.00	119 040.00
FDDL560ER97	FDDL560ER38	1.00	1.00	104 400.00	119 040.00
FDDL560ER87	FDDL560ER38	1.00	1.00	104 400.00	119 040.00
FDDL560ERA7	FDDL560ER68	1.00	1.00	111 600.00	127 260.00
FDDL560ER97	FDDL560ER68	1.00	1.00	111 600.00	127 260.00
FDDL560ER87	FDDL560ER68	1.00	1.00	111 600.00	127 260.00
FDDL560MS87	FDDL560MS97	1.00	1.00	79 200.00	90 300.00
FDDL560NZ97	FDDL560NZA7	1.00	1.00	79 200.00	90 300.00
FDDL560NZ87	FDDL560NZ97	1.00	1.00	79 200.00	90 300.00
FDDL560NZ87	FDDL560NZA7	1.00	1.00	79 200.00	90 300.00
FDDL560NZ38	FDDL560NZ68	1.00	1.00	100 800.00	114 960.00
FDDL560NZA7	FDDL560NZ38	1.00	1.00	97 200.00	110 820.00
FDDL560NZ97	FDDL560NZ38	1.00	1.00	97 200.00	110 820.00
FDDL560NZ87	FDDL560NZ38	1.00	1.00	97 200.00	110 820.00
FDDL560NZA7	FDDL560NZ68	1.00	1.00	100 800.00	114 960.00
FDDL560NZ97	FDDL560NZ68	1.00	1.00	100 800.00	114 960.00
FDDL560NZ87	FDDL560NZ68	1.00	1.00	100 800.00	114 960.00
FSMOSIDTL87	FSMOSIDTL97	1.00	1.00	1 320.00	1 510.00
FSMOSIREG87	FSMOSIREG97	1.00	1.00	1 800.00	2 060.00
FDPR560MS87	FDPR560MS97	1.00	1.00	111 600.00	127 260.00
FDPR560NZ97	FDPR560NZA7	1.00	1.00	129 600.00	147 780.00
FDPR560NZ87	FDPR560NZ97	1.00	1.00	129 600.00	147 780.00
FDPR560NZA7	FDPR560NZA7	1.00	1.00	140 400.00	160 080.00
FDPR560NZ87	FDPR560NZA7	1.00	1.00	129 600.00	147 780.00
FDPR560NZ38	FDPR560NZ68	1.00	1.00	162 000.00	184 680.00
FDPR560NZA7	FDPR560NZ38	1.00	1.00	147 600.00	168 300.00

Фьючерс₁	Фьючерс₂	Вес₁	Вес₂	Надбавка для стандартного уровня маржирования	Надбавка для повышенного уровня маржирования
FDPR560NZ97	FDPR560NZC7	1.00	1.00	140 400.00	160 080.00
FDPR560NZ87	FDPR560NZC7	1.00	1.00	140 400.00	160 080.00
FDPR560NZA7	FDPR560NZ38	1.00	1.00	147 600.00	168 300.00
FDPR560NZC7	FDPR560NZ68	1.00	1.00	162 000.00	184 680.00
FDPR560NZ97	FDPR560NZ38	1.00	1.00	147 600.00	168 300.00
FDPR560NZ87	FDPR560NZ38	1.00	1.00	147 600.00	168 300.00
FDPR560NZA7	FDPR560NZ68	1.00	1.00	162 000.00	184 680.00
FDPR560NZ97	FDPR560NZ68	1.00	1.00	162 000.00	184 680.00
FDPR560NZ87	FDPR560NZ68	1.00	1.00	162 000.00	184 680.00
FDRG560ER97	FDRG560ERA7	1.00	1.00	108 000.00	123 120.00
FDRG560ER87	FDRG560ER97	1.00	1.00	104 400.00	119 040.00
FDRG560ERA7	FDRG560ERC7	1.00	1.00	115 200.00	131 340.00
FDRG560ER87	FDRG560ERA7	1.00	1.00	108 000.00	123 120.00
FDRG560ER38	FDRG560ER68	1.00	1.00	133 200.00	151 860.00
FDRG560ERC7	FDRG560ER38	1.00	1.00	122 400.00	139 560.00
FDRG560ER97	FDRG560ERC7	1.00	1.00	115 200.00	131 340.00
FDRG560ER87	FDRG560ERC7	1.00	1.00	115 200.00	131 340.00
FDRG560ERA7	FDRG560ER38	1.00	1.00	122 400.00	139 560.00
FDRG560ERC7	FDRG560ER68	1.00	1.00	133 200.00	151 860.00
FDRG560ER97	FDRG560ER38	1.00	1.00	122 400.00	139 560.00
FDRG560ER87	FDRG560ER38	1.00	1.00	122 400.00	139 560.00
FDRG560ERA7	FDRG560ER68	1.00	1.00	133 200.00	151 860.00
FDRG560ER97	FDRG560ER68	1.00	1.00	133 200.00	151 860.00
FDRG560ER87	FDRG560ER68	1.00	1.00	133 200.00	151 860.00
FDRG560MS87	FDRG560MS97	1.00	1.00	111 600.00	127 260.00
FDRG560NZ97	FDRG560NZA7	1.00	1.00	111 600.00	127 260.00
FDRG560NZ87	FDRG560NZ97	1.00	1.00	108 000.00	123 120.00
FDRG560NZA7	FDRG560NZC7	1.00	1.00	115 200.00	131 340.00
FDRG560NZ87	FDRG560NZA7	1.00	1.00	111 600.00	127 260.00
FDRG560NZ38	FDRG560NZ68	1.00	1.00	136 800.00	156 000.00
FDRG560NZC7	FDRG560NZ38	1.00	1.00	126 000.00	143 640.00

Фьючерс₁	Фьючерс₂	Вес₁	Вес₂	Надбавка для стандартного уровня мар-жирования	Надбавка для повышенного уровня мар-жирования
FDRG560NZ97	FDRG560NZC7	1.00	1.00	115 200.00	131 340.00
FDRG560NZ87	FDRG560NZC7	1.00	1.00	115 200.00	131 340.00
FDRG560NZA7	FDRG560NZ38	1.00	1.00	126 000.00	143 640.00
FDRG560NZC7	FDRG560NZ68	1.00	1.00	136 800.00	156 000.00
FDRG560NZ97	FDRG560NZ38	1.00	1.00	126 000.00	143 640.00
FDRG560NZ87	FDRG560NZ38	1.00	1.00	126 000.00	143 640.00
FDRG560NZA7	FDRG560NZ68	1.00	1.00	136 800.00	156 000.00
FDRG560NZ97	FDRG560NZ68	1.00	1.00	136 800.00	156 000.00
FDRG560NZ87	FDRG560NZ68	1.00	1.00	136 800.00	156 000.00
FSSAMIDTL87	FSSAMIDTL97	1.00	1.00	1 560.00	1 780.00
FSSAMIREG87	FSSAMIREG97	1.00	1.00	1 980.00	2 260.00
U88	U98	1.00	1.00	482 000.00	550 000.00
U78	U88	1.00	1.00	482 000.00	550 000.00
U68	U78	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U58	U68	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U48	U58	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U38	U48	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U28	U38	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U18	U28	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UC7	U18	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UB7	UC7	1.00	1.00	456 000.00	520 000.00
UA7	UB7	1.00	1.00	115 000.00	132 000.00
U78	U98	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U68	U88	1.00	1.00	482 000.00	550 000.00
U58	U78	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U48	U68	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U38	U58	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U28	U48	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U18	U38	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UC7	U28	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UB7	U18	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00

Фьючерс ₁	Фьючерс ₂	Вес ₁	Вес ₂	Надбавка для стандартного уровня маржирования	Надбавка для повышенного уровня маржирования
UA7	UC7	1.00	1.00	456 000.00	520 000.00
U68	U98	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U58	U88	1.00	1.00	482 000.00	550 000.00
U48	U78	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U38	U68	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U28	U58	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U18	U48	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UC7	U38	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UB7	U28	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UA7	U18	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U58	U98	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U48	U88	1.00	1.00	482 000.00	550 000.00
U38	U78	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U28	U68	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U18	U58	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UC7	U48	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UB7	U38	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UA7	U28	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U48	U98	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U38	U88	1.00	1.00	482 000.00	550 000.00
U28	U78	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U18	U68	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UC7	U58	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UB7	U48	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UA7	U38	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U38	U98	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U28	U88	1.00	1.00	482 000.00	550 000.00
U18	U78	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UC7	U68	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UB7	U58	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UA7	U48	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00

Фьючерс₁	Фьючерс₂	Вес₁	Вес₂	Надбавка для стандартного уровня маржирования	Надбавка для повышенного уровня маржирования
U28	U98	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U18	U88	1.00	1.00	482 000.00	550 000.00
UC7	U78	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UB7	U68	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UA7	U58	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
U18	U98	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UC7	U88	1.00	1.00	482 000.00	550 000.00
UB7	U78	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UA7	U68	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UC7	U98	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UB7	U88	1.00	1.00	482 000.00	550 000.00
UA7	U78	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UB7	U98	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00
UA7	U88	1.00	1.00	482 000.00	550 000.00
UA7	U98	1.00	1.00	469 000.00	535 000.00