

ПЕРЕЧЕНЬ ЛИКВИДНОГО ИМУЩЕСТВА

для клиентов со Стандартным уровнем риска (КСУР) и Повышенным уровнем риска (КПУР)

Для каждого актива, по которому разрешены Непокрытые позиции и (или) Временно непокрытые позиции, ставки риска рассчитываются по формулам:

$$D_{long} = 1 - (1 - R^+)^2 \quad - \text{ для длинных позиций}$$

$$D_{short} = (1 + R^-)^2 - 1 \quad - \text{ для коротких позиций}$$

Для каждого актива, по которому не разрешены Непокрытые позиции и (или) Временно непокрытые позиции, ставки риска рассчитываются по формулам:

$$D_{long} = 1 - (1 - R^+)^2 \quad - \text{ для длинных позиций}$$

$$D_{short} = \infty \quad - \text{ ставка риска не рассчитывается, так как по активу не разрешены Непокрытые позиции и (или) Временно непокрытые позиции.}$$

 R^+ - значение Ставки риска падения цены (%), рассчитываемой НКО НКЦ (АО), для соответствующего актива на соответствующую дату для Диапазона 2;

 R^- - значение Ставки риска роста цены (%), рассчитываемой НКО НКЦ (АО), для соответствующего актива на соответствующую дату для Диапазона 2.

Значения R публикуются НКО НКЦ (АО) и доступны для просмотра по ссылкам:

[Динамические риск-параметры рыночных рисков на фондовом рынке](#)
[Динамические риск-параметры рыночных рисков на валютном рынке](#)

Код актива (Московская Биржа)	Краткое наименование актива	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RUB	Рубли	Валюта	Да
RU000A0ZYU21	АЛЬФА БО40	Облигации	Нет
RU000A105UW5	АЛЬФАБ2P21	Облигации	Нет
RU000A106268	АЛЬФАБ2P22	Облигации	Нет
RU000A106AJ2	АЛЬФАБ2P23	Облигации	Нет
RU000A106KV6	АЛЬФАБ2P24	Облигации	Нет
RU000A107AM4	АЛЬФАБ2P25	Облигации	Нет
RU000A107TH4	АЛЬФАБ2P26	Облигации	Нет
RU000A0JX5W4	АльфаБО-18	Облигации	Нет
RU000A0ZYBM4	АльфаБО-21	Облигации	Нет
RU000A106TM6	ВТБ Б1-343	Облигации	Нет
RU000A108PE7	ВТБ Б1-354	Облигации	Нет
RU000A101TB0	ВЭБ 1P-19	Облигации	Нет
RU000A1013P1	ВЭБ1P-18	Облигации	Нет
RU000A1031U3	ВЭБ1P-26	Облигации	Нет
RU000A105A95	ГазКЗ-34Д	Облигации	Нет
RU000A105RH2	ГазКЗ-37Д	Облигации	Нет
RU000A1017J5	Газпф3P2R	Облигации	Нет
RU000A101GJ0	Газпф3P3R	Облигации	Нет
RU000A105KP0	Газпф3P5R	Облигации	Нет
RU000A106565	Газпф3P6R	Облигации	Нет
RU000A101Z74	ГПБ001P17P	Облигации	Нет
RU000A102GJ8	ГПБ001P19P	Облигации	Нет
RU000A104B46	ГПБ001P21P	Облигации	Нет
RU000A105GW4	ГПБ001P22P	Облигации	Нет
RU000A1064G3	ГПБ001P26P	Облигации	Нет
RU000A106YH6	ГПБ003P01P	Облигации	Нет
RU000A107UA7	ГПБ005P03P	Облигации	Нет
RU000A1065K2	ДОМ 1P-15R	Облигации	Нет
RU000A00Z7C0	ДОМ 1P-4R	Облигации	Нет
RU000A1004W6	ДОМ 1P-5R	Облигации	Нет
RU000A106938	НОВАТЭК1P1	Облигации	Нет
RU000A105A61	НорНикБ1P2	Облигации	Нет
RU000A1083A6	НорНикБ1P7	Облигации	Нет
SU26207RMFS9	ОФЗ 26207	Гос облигации	Нет
SU26212RMFS9	ОФЗ 26212	Гос облигации	Нет
SU26218RMFS6	ОФЗ 26218	Гос облигации	Нет
SU26219RMFS4	ОФЗ 26219	Гос облигации	Нет
SU26221RMFS0	ОФЗ 26221	Гос облигации	Нет
SU26224RMFS4	ОФЗ 26224	Гос облигации	Нет
SU26225RMFS1	ОФЗ 26225	Гос облигации	Нет
SU26226RMFS9	ОФЗ 26226	Гос облигации	Нет
SU26228RMFS5	ОФЗ 26228	Гос облигации	Нет
SU26229RMFS3	ОФЗ 26229	Гос облигации	Нет
SU26230RMFS1	ОФЗ 26230	Гос облигации	Нет
SU26232RMFS7	ОФЗ 26232	Гос облигации	Нет
SU26233RMFS5	ОФЗ 26233	Гос облигации	Нет
SU26234RMFS3	ОФЗ 26234	Гос облигации	Нет
SU26235RMFS0	ОФЗ 26235	Гос облигации	Нет
SU26236RMFS8	ОФЗ 26236	Гос облигации	Нет
SU26237RMFS6	ОФЗ 26237	Гос облигации	Нет
SU26238RMFS4	ОФЗ 26238	Гос облигации	Нет
SU26239RMFS2	ОФЗ 26239	Гос облигации	Нет
SU26240RMFS0	ОФЗ 26240	Гос облигации	Нет
SU26241RMFS8	ОФЗ 26241	Гос облигации	Нет
SU26242RMFS6	ОФЗ 26242	Гос облигации	Нет

SU26243RMFS4	ОФЗ 26243	Гос облигации	Her
SU26244RMFS2	ОФЗ 26244	Гос облигации	Her
SU26246RMFS7	ОФЗ 26246	Гос облигации	Her
SU26247RMFS5	ОФЗ 26247	Гос облигации	Her
SU26248RMFS3	ОФЗ 26248	Гос облигации	Her
SU29007RMFS0	ОФЗ 29007	Гос облигации	Her
SU29008RMFS8	ОФЗ 29008	Гос облигации	Her
SU29009RMFS6	ОФЗ 29009	Гос облигации	Her
SU29010RMFS4	ОФЗ 29010	Гос облигации	Her
SU29013RMFS8	ОФЗ 29013	Гос облигации	Her
SU29014RMFS6	ОФЗ 29014	Гос облигации	Her
SU29015RMFS3	ОФЗ 29015	Гос облигации	Her
SU29016RMFS1	ОФЗ 29016	Гос облигации	Her
SU29017RMFS9	ОФЗ 29017	Гос облигации	Her
SU29018RMFS7	ОФЗ 29018	Гос облигации	Her
SU29019RMFS5	ОФЗ 29019	Гос облигации	Her
SU29020RMFS3	ОФЗ 29020	Гос облигации	Her
SU29021RMFS1	ОФЗ 29021	Гос облигации	Her
SU29022RMFS9	ОФЗ 29022	Гос облигации	Her
SU29023RMFS7	ОФЗ 29023	Гос облигации	Her
SU29024RMFS5	ОФЗ 29024	Гос облигации	Her
SU29025RMFS2	ОФЗ 29025	Гос облигации	Her
SU46012RMFS9	ОФЗ 46012	Гос облигации	Her
SU46020RMFS2	ОФЗ 46020	Гос облигации	Her
SU52002RMFS1	ОФЗ 52002	Гос облигации	Her
SU52003RMFS9	ОФЗ 52003	Гос облигации	Her
SU52004RMFS7	ОФЗ 52004	Гос облигации	Her
SU52005RMFS4	ОФЗ 52005	Гос облигации	Her
RU000A0ZYU05	РЖД 1P-05R	Облигации	Her
RU000A0ZZ9R4	РЖД 1P-07R	Облигации	Her
RU000A0ZZGT5	РЖД 1P-08R	Облигации	Her
RU000A1007Z2	РЖД 1P-13R	Облигации	Her
RU000A1008D7	РЖД 1P-14R	Облигации	Her
RU000A100HY9	РЖД 1P-16R	Облигации	Her
RU000A1010M4	РЖД 1P-17R	Облигации	Her
RU000A101M04	РЖД 1P-20R	Облигации	Her
RU000A102QP4	РЖД 1P-21R	Облигации	Her
RU000A104SX0	РЖД 1P-24R	Облигации	Her
RU000A106K43	РЖД 1P-26R	Облигации	Her
RU000A106VV3	РЖД 1P-27R	Облигации	Her
RU000A106ZL5	РЖД 1P-28R	Облигации	Her
RU000A108Z85	РЖД 1P-32R	Облигации	Her
RU000A0JXN05	РЖД Б01P1R	Облигации	Her
RU000A0JXQ44	РЖД Б01P2R	Облигации	Her
RU000A0JTU85	РЖД-28 обл	Облигации	Her
RU000A0JUAH8	РЖД-30 обл	Облигации	Her
RU000A0JSGV0	РЖД-32 обл	Облигации	Her
RU000A0JXQK2	Роснфт1P4	Облигации	Her
RU000A101SF3	Роснфт2P10	Облигации	Her
RU000A0OZYL6	Роснфт2P3	Облигации	Her
RU000A0OZYT40	Роснфт2P4	Облигации	Her
RU000A0OZYVU5	Роснфт2P5	Облигации	Her
RU000A105PH6	Россети1P7	Облигации	Her
RU000A106GD2	РусГидБП11	Облигации	Her
RU000A106ZU6	РусГидБП12	Облигации	Her
RU000A1057P8	РусГидрБП6	Облигации	Her
RU000A105HC4	РусГидрБП7	Облигации	Her
RU000A105SL2	РусГидрБП9	Облигации	Her
RU000A102YG7	Сбер Sb25R	Облигации	Her
RU000A103661	Сбер Sb27R	Облигации	Her
RU000A105SD9	Сбер Sb42R	Облигации	Her
RU000A1069P3	Сбер Sb44R	Облигации	Her
RU000A103KG4	Сбер SbD1R	Облигации	Her
RU000A1008W7	СеверстБ06	Облигации	Her
RU000A103DS4	СибурХ Б03	Облигации	Her
RU000A104XW2	СибурХ1P01	Облигации	Her
RU000A1010B7	ТрифБО1P13	Облигации	Her
RU000A0OZYDD9	ТрифБО1P8	Облигации	Her
RU000A0OZYJ91	ФСК РС Б4	Облигации	Her
RU000A101CL5	ФСК РС1P4	Облигации	Her
RU000A105559	ФСК РС1P6	Облигации	Her
RU000A104Z48	СБЭБ2P-33	Облигации	Her
RU000A107A28	сГПБ005P1P	Облигации	Her

ПЕРЕЧЕНЬ ЛИКВИДНОГО ИМУЩЕСТВА

для клиентов с Особым уровнем риска (КОУР)

Для каждого актива, по которому разрешены Непокрытые позиции и (или) Временно непокрытые позиции, ставки риска рассчитываются по формулам:

$$D_{long} = R^+$$

- для длинных позиций

$$D_{short} = R^-$$

- для коротких позиций

Для каждого актива, по которому не разрешены Непокрытые позиции и (или) Временно непокрытые позиции, ставки риска рассчитываются по формулам:

$$D_{long} = R^+$$

- для длинных позиций

$$D_{short} = \infty$$

- ставка риска не рассчитывается, так как по активу не разрешены Непокрытые позиции и (или) Временно непокрытые позиции.

R^+ - значение Ставки риска падения цены (%), рассчитываемой НКО НКЦ (АО), для соответствующего актива на соответствующую дату для Диапазона 2;

R^- - значение Ставки риска роста цены (%), рассчитываемой НКО НКЦ (АО), для соответствующего актива на соответствующую дату для Диапазона 2.

Значения R публикуются НКО НКЦ (АО) и доступны для просмотра по ссылкам:

[Динамические риск-параметры рыночных рисков на фондовом рынке](#)

[Динамические риск-параметры рыночных рисков на валютном рынке](#)

Код актива (Московская Биржа)	Краткое наименование актива	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RUB	Рубли	Валюта	Да
RU000A0ZYU21	АЛЬФА БО40	Облигации	Нет
RU000A105UW5	АЛЬФАБ2Р21	Облигации	Нет
RU000A106268	АЛЬФАБ2Р22	Облигации	Нет
RU000A106AJ2	АЛЬФАБ2Р23	Облигации	Нет
RU000A106KV6	АЛЬФАБ2Р24	Облигации	Нет
RU000A107AM4	АЛЬФАБ2Р25	Облигации	Нет
RU000A107TH4	АЛЬФАБ2Р26	Облигации	Нет
RU000A0JX5W4	АльфаБО-18	Облигации	Нет
RU000A0ZYBM4	АльфаБО-21	Облигации	Нет
RU000A106TM6	ВТБ Б1-343	Облигации	Нет
RU000A108PE7	ВТБ Б1-354	Облигации	Нет
RU000A101TB0	ВЭБ 1Р-19	Облигации	Нет
RU000A1013P1	ВЭБ1Р-18	Облигации	Нет
RU000A1031U3	ВЭБ1Р-26	Облигации	Нет
RU000A105A95	ГазКЗ-34Д	Облигации	Нет
RU000A105RH2	ГазКЗ-37Д	Облигации	Нет
RU000A1017J5	Газпф3Р2R	Облигации	Нет
RU000A101GJ0	Газпф3Р3R	Облигации	Нет
RU000A105KP0	Газпф3Р5R	Облигации	Нет
RU000A106565	Газпф3Р6R	Облигации	Нет
RU000A101Z74	ГПБ001Р17Р	Облигации	Нет
RU000A102GJ8	ГПБ001Р19Р	Облигации	Нет
RU000A104B46	ГПБ001Р21Р	Облигации	Нет
RU000A105GW4	ГПБ001Р22Р	Облигации	Нет
RU000A1064G3	ГПБ001Р26Р	Облигации	Нет
RU000A106YH6	ГПБ003Р01Р	Облигации	Нет
RU000A107UA7	ГПБ005Р03Р	Облигации	Нет
RU000A1065K2	ДОМ 1Р-15R	Облигации	Нет
RU000A0ZZ7C0	ДОМ 1Р-4R	Облигации	Нет
RU000A1004W6	ДОМ 1Р-5R	Облигации	Нет
RU000A106938	НОВАТЭК1Р1	Облигации	Нет
RU000A105A61	НорНикБ1Р2	Облигации	Нет
RU000A1083A6	НорНикБ1Р7	Облигации	Нет
SU26207RMFS9	ОФЗ 26207	Гос облигации	Нет
SU26212RMFS9	ОФЗ 26212	Гос облигации	Нет
SU26218RMFS6	ОФЗ 26218	Гос облигации	Нет
SU26219RMFS4	ОФЗ 26219	Гос облигации	Нет
SU26221RMFS0	ОФЗ 26221	Гос облигации	Нет
SU26224RMFS4	ОФЗ 26224	Гос облигации	Нет
SU26225RMFS1	ОФЗ 26225	Гос облигации	Нет
SU26226RMFS9	ОФЗ 26226	Гос облигации	Нет
SU26228RMFS5	ОФЗ 26228	Гос облигации	Нет
SU26229RMFS3	ОФЗ 26229	Гос облигации	Нет
SU26230RMFS1	ОФЗ 26230	Гос облигации	Нет
SU26232RMFS7	ОФЗ 26232	Гос облигации	Нет
SU26233RMFS5	ОФЗ 26233	Гос облигации	Нет
SU26234RMFS3	ОФЗ 26234	Гос облигации	Нет
SU26235RMFS0	ОФЗ 26235	Гос облигации	Нет
SU26236RMFS8	ОФЗ 26236	Гос облигации	Нет
SU26237RMFS6	ОФЗ 26237	Гос облигации	Нет
SU26238RMFS4	ОФЗ 26238	Гос облигации	Нет
SU26239RMFS2	ОФЗ 26239	Гос облигации	Нет
SU26240RMFS0	ОФЗ 26240	Гос облигации	Нет
SU26241RMFS8	ОФЗ 26241	Гос облигации	Нет
SU26242RMFS6	ОФЗ 26242	Гос облигации	Нет
SU26243RMFS4	ОФЗ 26243	Гос облигации	Нет
SU26244RMFS2	ОФЗ 26244	Гос облигации	Нет
SU26246RMFS7	ОФЗ 26246	Гос облигации	Нет
SU26247RMFS5	ОФЗ 26247	Гос облигации	Нет
SU26248RMFS3	ОФЗ 26248	Гос облигации	Нет
SU29007RMFS0	ОФЗ 29007	Гос облигации	Нет
SU29008RMFS8	ОФЗ 29008	Гос облигации	Нет
SU29009RMFS6	ОФЗ 29009	Гос облигации	Нет

SU29010RMFS4	ОФЗ 29010	Гос облигации	Нет
SU29013RMFS8	ОФЗ 29013	Гос облигации	Нет
SU29014RMFS6	ОФЗ 29014	Гос облигации	Нет
SU29015RMFS3	ОФЗ 29015	Гос облигации	Нет
SU29016RMFS1	ОФЗ 29016	Гос облигации	Нет
SU29017RMFS9	ОФЗ 29017	Гос облигации	Нет
SU29018RMFS7	ОФЗ 29018	Гос облигации	Нет
SU29019RMFS5	ОФЗ 29019	Гос облигации	Нет
SU29020RMFS3	ОФЗ 29020	Гос облигации	Нет
SU29021RMFS1	ОФЗ 29021	Гос облигации	Нет
SU29022RMFS9	ОФЗ 29022	Гос облигации	Нет
SU29023RMFS7	ОФЗ 29023	Гос облигации	Нет
SU29024RMFS5	ОФЗ 29024	Гос облигации	Нет
SU29025RMFS2	ОФЗ 29025	Гос облигации	Нет
SU46012RMFS9	ОФЗ 46012	Гос облигации	Нет
SU46020RMFS2	ОФЗ 46020	Гос облигации	Нет
SU52002RMFS1	ОФЗ 52002	Гос облигации	Нет
SU52003RMFS9	ОФЗ 52003	Гос облигации	Нет
SU52004RMFS7	ОФЗ 52004	Гос облигации	Нет
SU52005RMFS4	ОФЗ 52005	Гос облигации	Нет
RU000A0ZYU05	РЖД 1P-05R	Облигации	Нет
RU000A0ZZ9R4	РЖД 1P-07R	Облигации	Нет
RU000A0ZZGT5	РЖД 1P-08R	Облигации	Нет
RU000A1007Z2	РЖД 1P-13R	Облигации	Нет
RU000A1008D7	РЖД 1P-14R	Облигации	Нет
RU000A100HY9	РЖД 1P-16R	Облигации	Нет
RU000A1010M4	РЖД 1P-17R	Облигации	Нет
RU000A101M04	РЖД 1P-20R	Облигации	Нет
RU000A102QP4	РЖД 1P-21R	Облигации	Нет
RU000A104SX0	РЖД 1P-24R	Облигации	Нет
RU000A106K43	РЖД 1P-26R	Облигации	Нет
RU000A106VV3	РЖД 1P-27R	Облигации	Нет
RU000A106ZL5	РЖД 1P-28R	Облигации	Нет
RU000A108Z85	РЖД 1P-32R	Облигации	Нет
RU000A0JXN05	РЖД Б01P1R	Облигации	Нет
RU000A0JXQ44	РЖД Б01P2R	Облигации	Нет
RU000A0JTU85	РЖД-28 обл	Облигации	Нет
RU000A0JUAH8	РЖД-30 обл	Облигации	Нет
RU000A0JSGV0	РЖД-32 обл	Облигации	Нет
RU000A0JXQK2	Роснфт1P4	Облигации	Нет
RU000A101SF3	Роснфт2P10	Облигации	Нет
RU000A0ZYL65	Роснфт2P3	Облигации	Нет
RU000A0ZYT40	Роснфт2P4	Облигации	Нет
RU000A0ZVVU5	Роснфт2P5	Облигации	Нет
RU000A105PH6	Россети1P7	Облигации	Нет
RU000A106GD2	РусГидБП11	Облигации	Нет
RU000A106ZU6	РусГидБП12	Облигации	Нет
RU000A1057P8	РусГидрБП6	Облигации	Нет
RU000A105HC4	РусГидрБП7	Облигации	Нет
RU000A105SL2	РусГидрБП9	Облигации	Нет
RU000A102YG7	Сбер Sb25R	Облигации	Нет
RU000A103661	Сбер Sb27R	Облигации	Нет
RU000A105SD9	Сбер Sb42R	Облигации	Нет
RU000A1069P3	Сбер Sb44R	Облигации	Нет
RU000A103KG4	Сбер SbD1R	Облигации	Нет
RU000A1008W7	СеверстБ06	Облигации	Нет
RU000A103DS4	СибурХ Б03	Облигации	Нет
RU000A104XW2	СибурХ1P01	Облигации	Нет
RU000A1010B7	ТрифБ01P13	Облигации	Нет
RU000A0ZYDD9	ТрифБ01P8	Облигации	Нет
RU000A0ZYJ91	ФСК РС Б4	Облигации	Нет
RU000A101CL5	ФСК РС1P4	Облигации	Нет
RU000A105559	ФСК РС1P6	Облигации	Нет
RU000A104Z48	sBЭБ2P-33	Облигации	Нет
RU000A107A28	гТПБ005P1P	Облигации	Нет