ПЕРЕЧЕНЬ ЛИКВИДНОГО ИМУЩЕСТВА

для клиентов с Начальным уровнем риска (КНУР)

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

$D_{longKHYP} = 1 - (1 - R^{+})^{2,8}$ - для длинных позиций

$D_{shortKHYP} = (1 + R^{-})^{2,8} - 1$ - для коротких позиций

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

$D_{longKHYP} = 1 - (1 - R^{+})^{2,8}$ - для длинных позиций

$D_{shortKHYP} = \infty$ - 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	Эмитент	ISIN	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RUB	Рубли		RUB	Валюта	Да
CNY	Юани		CNY	Валюта	Да
ALRS	ALRS	АК АЛРОСА ПАО	RU0007252813	Акции	Нет
CHMF	CHMF	Северсталь ПАО	RU0009046510	Акции	Нет
FLOT	FLOT	Совкомфлот	RU000A0JXNU8	Акции	Нет
GAZP	GAZP	Газпром ПАО	RU0007661625	Акции	Нет
GMKN	GMKN	ГМК Норильский Никель ПАО	RU0007288411	Акции	Нет
HEAD	HEAD	МКПАО Хэдхантер	RU000A107662	Акции	Нет
IRAO	IRAO	Интер РАО ПАО	RU000A0JPNM1	Акции	Нет
LKOH	LKOH	ЛУКОЙЛ ПАО	RU0009024277	Акции	Нет
MOEX	MOEX	ММВБ ПАО	RU000A0JR4A1	Акции	Нет
MTSS	MTSS	МТС ПАО	RU0007775219	Акции	Нет
NLMK	NLMK	НЛМК ПАО	RU0009046452	Акции	Нет
NVTK	NVTK	НОВАТЭК ПАО	RU000A0DKVS5	Акции	Нет
PHOR	PHOR	ФосАгро	RU000A0JRKT8	Акции	Нет
PLZL	PLZL	Полюс ПАО	RU000A0JNAA8	Акции	Нет
ROSN	ROSN	Роснефть ПАО	RU000A0J2Q06	Акции	Нет
RTKM	RTKM	Ростелеком ПАО	RU0008943394	Акции	Нет
SBER	SBER	Сбербанк ПАО	RU0009029540	Акции	Нет
SBERP	SBERP	Сбербанк ПАО	RU0009029557	Акции	Нет
SNGS	SNGS	Сургутнефтегаз ПАО	RU0008926258	Акции	Нет
TATN	TATN	Татнефть ПАО	RU0009033591	Акции	Нет
T	TCSG	Т-Технологии МКПАО	RU000A107UL4	Акции	Нет
VTBR	VTBR	Банк ВТБ ПАО	RU000A0JP5V6	Акции	Нет
X5	X5	Корпоративный центр ИКС 5 П	RU000A108X38	Акции	Нет
YDEX	YDEX	МКПАО ЯНДЕКС	RU000A107T19	Акции	Нет
RU000A10BFG2	Атомэнпр05	Атомэнергопром АО	RU000A10BFG2	Облигации	Нет
RU000A10C3M0	Атомэнпр06	Атомэнергопром АО	RU000A10C3M0	Облигации	Нет
RU000A10C6L5	Атомэнпр07	Атомэнергопром АО	RU000A10C6L5	Облигации	Нет
RU000A10DPS2	Атомэнпр09	Атомэнергопром АО	RU000A10DPS2	Облигации	Нет
RU000A10EJQ7	Атомэнпр11	Атомэнергопром АО	RU000A10EJQ7	Облигации	Нет
RU000A10D9J2	sВЭБ2Р-52	ВЭБ.РФ	RU000A10D9J2	Облигации	Нет
RU000A10C6S0	ВЭБ2Р-53	ВЭБ.РФ	RU000A10C6S0	Облигации	Нет
RU000A10CTX6	ВЭБ2Р-54В	ВЭБ.РФ	RU000A10CTX6	Облигации	Нет
RU000A105YH8	ВЭБР-36	ВЭБ.РФ	RU000A105YH8	Облигации	Нет
RU000A10BBW8	ГазКап1Р12	Газпром капитал ООО	RU000A10BBW8	Облигации	Нет
RU000A10BFM0	ГазКап3Р13	Газпром капитал ООО	RU000A10BFM0	Облигации	Нет
RU000A10BPP2	ГазКап3Р14	Газпром капитал ООО	RU000A10BPP2	Облигации	Нет
RU000A10E9Y0	ГазКап3Р18	Газпром капитал ООО	RU000A10E9Y0	Облигации	Нет
RU000A105R62	ГазКЗ-28Д	Газпром капитал ООО	RU000A105R62	Облигации	Нет
RU000A105BY1	ГазКЗ-28Е	Газпром капитал ООО	RU000A105BY1	Облигации	Нет
RU000A105KU0	ГазКЗ-29Д	Газпром капитал ООО	RU000A105KU0	Облигации	Нет
RU000A105SG2	ГазКЗ-30Д	Газпром капитал ООО	RU000A105SG2	Облигации	Нет
RU000A105JT4	ГазКЗ-31Д	Газпром капитал ООО	RU000A105JT4	Облигации	Нет
RU000A105A95	ГазКЗ-34Д	Газпром капитал ООО	RU000A105A95	Облигации	Нет
RU000A105RH2	ГазКЗ-37Д	Газпром капитал ООО	RU000A105RH2	Облигации	Нет
RU000A108JV4	ГазпКап3Р2	Газпром капитал ООО	RU000A108JV4	Облигации	Нет
RU000A107UW1	Газпн3Р10R	Газпром нефть ПАО	RU000A107UW1	Облигации	Нет
RU000A109B33	Газпн3Р13R	Газпром нефть ПАО	RU000A109B33	Облигации	Нет
RU000A10BK17	Газпн3Р15R	Газпром нефть ПАО	RU000A10BK17	Облигации	Нет
RU000A1083W0	МТС 2Р-05	МТС ПАО	RU000A1083W0	Облигации	Нет

Код актива (Московская Биржа)	Краткое наименование актива	Эмитент	ISIN	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RU000A108G70	НОВАТЭК1Р2	НОВАТЭК ПАО	RU000A108G70	Облигации	Нет
RU000A10AUX8	НОВАТЭК1Р3	НОВАТЭК ПАО	RU000A10AUX8	Облигации	Нет
RU000A10BV55	НОВАТЭК1Р4	НОВАТЭК ПАО	RU000A10BV55	Облигации	Нет
RU000A10C9Y2	НОВАТЭК1Р5	НОВАТЭК ПАО	RU000A10C9Y2	Облигации	Нет
RU000A10CRC4	НорНик1Р14	ГМК Норильский Никель ПАО	RU000A10CRC4	Облигации	Нет
RU000A1083A6	НорНикБ1Р7	ГМК Норильский Никель ПАО	RU000A1083A6	Облигации	Нет
RU000A10B4K3	НорНикБ1Р8	ГМК Норильский Никель ПАО	RU000A10B4K3	Облигации	Нет
SU26207RMFS9	ОФЗ 26207	Минфин России	RU000A0JS3W6	Облигации	Нет
SU26212RMFS9	ОФЗ 26212	Минфин России	RU000A0JTK38	Облигации	Нет
SU26218RMFS6	ОФЗ 26218	Минфин России	RU000A0JVW48	Облигации	Нет
SU26221RMFS0	ОФЗ 26221	Минфин России	RU000A0JXFM1	Облигации	Нет
SU26224RMFS4	ОФЗ 26224	Минфин России	RU000A0ZYUA9	Облигации	Нет
SU26225RMFS1	ОФЗ 26225	Минфин России	RU000A0ZYUB7	Облигации	Нет
SU26228RMFS5	ОФЗ 26228	Минфин России	RU000A100A82	Облигации	Нет
SU26230RMFS1	ОФЗ 26230	Минфин России	RU000A100EF5	Облигации	Нет
SU26232RMFS7	ОФЗ 26232	Минфин России	RU000A1014N4	Облигации	Нет
SU26233RMFS5	ОФЗ 26233	Минфин России	RU000A101F94	Облигации	Нет
SU26235RMFS0	ОФЗ 26235	Минфин России	RU000A1028E3	Облигации	Нет
SU26236RMFS8	ОФЗ 26236	Минфин России	RU000A102BT8	Облигации	Нет
SU26237RMFS6	ОФЗ 26237	Минфин России	RU000A1038Z7	Облигации	Нет
SU26238RMFS4	ОФЗ 26238	Минфин России	RU000A1038V6	Облигации	Нет
SU26239RMFS2	ОФЗ 26239	Минфин России	RU000A103901	Облигации	Нет
SU26240RMFS0	ОФЗ 26240	Минфин России	RU000A103BR0	Облигации	Нет
SU26241RMFS8	ОФЗ 26241	Минфин России	RU000A105FZ9	Облигации	Нет
SU26242RMFS6	ОФЗ 26242	Минфин России	RU000A105RV3	Облигации	Нет
SU26243RMFS4	ОФЗ 26243	Минфин России	RU000A106E90	Облигации	Нет
SU26244RMFS2	ОФЗ 26244	Минфин России	RU000A1074G2	Облигации	Нет
SU26245RMFS9	ОФЗ 26245	Минфин России	RU000A108EG6	Облигации	Нет
SU26246RMFS7	ОФЗ 26246	Минфин России	RU000A108EE1	Облигации	Нет
SU26247RMFS5	ОФЗ 26247	Минфин России	RU000A108EF8	Облигации	Нет
SU26248RMFS3	ОФЗ 26248	Минфин России	RU000A108EH4	Облигации	Нет
SU26249RMFS1	ОФЗ 26249	Минфин России	RU000A10BVC8	Облигации	Нет
SU26250RMFS9	ОФЗ 26250	Минфин России	RU000A10BVH7	Облигации	Нет
SU26251RMFS7	ОФЗ 26251	Минфин России	RU000A10CKT3	Облигации	Нет
SU26252RMFS5	ОФЗ 26252	Минфин России	RU000A10D4Y2	Облигации	Нет
SU26253RMFS3	ОФЗ 26253	Минфин России	RU000A10D517	Облигации	Нет
SU26254RMFS1	ОФЗ 26254	Минфин России	RU000A10D533	Облигации	Нет
RU000A10DQB6	ОФЗ 29 CNY	Минфин России	RU000A10DQB6	Облигации	Нет
SU29007RMFS0	ОФЗ 29007	Минфин России	RU000A0JV4M0	Облигации	Нет
SU29008RMFS8	ОФЗ 29008	Минфин России	RU000A0JV4P3	Облигации	Нет
SU29009RMFS6	ОФЗ 29009	Минфин России	RU000A0JV4N8	Облигации	Нет
SU29013RMFS8	ОФЗ 29013	Минфин России	RU000A101KT1	Облигации	Нет
SU29015RMFS3	ОФЗ 29015	Минфин России	RU000A1025A7	Облигации	Нет
SU29016RMFS1	ОФЗ 29016	Минфин России	RU000A1025B5	Облигации	Нет
SU29017RMFS9	ОФЗ 29017	Минфин России	RU000A1028D5	Облигации	Нет
SU29018RMFS7	ОФЗ 29018	Минфин России	RU000A102A31	Облигации	Нет
SU29020RMFS3	ОФЗ 29020	Минфин России	RU000A102BV4	Облигации	Нет
SU29021RMFS1	ОФЗ 29021	Минфин России	RU000A105B11	Облигации	Нет
SU29022RMFS9	ОФЗ 29022	Минфин России	RU000A105G16	Облигации	Нет
SU29024RMFS5	ОФЗ 29024	Минфин России	RU000A1066D5	Облигации	Нет
SU29025RMFS2	ОФЗ 29025	Минфин России	RU000A106Z61	Облигации	Нет
SU29027RMFS8	ОФЗ 29027	Минфин России	RU000A10AA93	Облигации	Нет
SU29028RMFS6	ОФЗ 29028	Минфин России	RU000A10D4Z9	Облигации	Нет
RU000A10DQA8	ОФЗ 33 CNY	Минфин России	RU000A10DQA8	Облигации	Нет
SU52002RMFS1	ОФЗ 52002	Минфин России	RU000A0ZYZ26	Облигации	Нет
RU000A10AZ60	РЖД 1Р-38R	РЖД ОАО	RU000A10AZ60	Облигации	Нет
RU000A10C8C0	РЖД 1Р-44R	РЖД ОАО	RU000A10C8C0	Облигации	Нет
RU000A10DJR7	РЖД 1Р-49R	РЖД ОАО	RU000A10DJR7	Облигации	Нет
RU000A10DZW3	РЖД 1Р-50R	РЖД ОАО	RU000A10DZW3	Облигации	Нет
RU000A10E8P0	РЖД 1Р-51R	РЖД ОАО	RU000A10E8P0	Облигации	Нет
RU000A10EN11	РЖД 1Р-52R	РЖД ОАО	RU000A10EN11	Облигации	Нет
RU000A1095W4	Ростел1Р9R	Ростелеком ПАО	RU000A1095W4	Облигации	Нет
RU000A10CC24	РусГид2Р07	РусГидро ПАО	RU000A10CC24	Облигации	Нет
RU000A10EPX0	РусГид2Р12	РусГидро ПАО	RU000A10EPX0	Облигации	Нет
RU000A10A851	РФ ЗО 27 Д	Минфин России	RU000A10A851	Облигации	Нет
RU000A10A869	РФ ЗО 28 Д	Минфин России	RU000A10A869	Облигации	Нет
RU000A10A8A6	РФ ЗО 29 Д	Минфин России	RU000A10A8A6	Облигации	Нет
RU000A10A8E8	РФ ЗО 30 Д	Минфин России	RU000A10A8E8	Облигации	Нет
RU000A10A7Y8	РФ ЗО 35 Д	Минфин России	RU000A10A7Y8	Облигации	Нет
RU000A10A802	РФ ЗО 42 Д	Минфин России	RU000A10A802	Облигации	Нет
RU000A10A877	РФ ЗО 43 Д	Минфин России	RU000A10A877	Облигации	Нет
RU000A10A844	РФ ЗО 47 Д	Минфин России	RU000A10A844	Облигации	Нет
RU000A10DS74	Сбер Sb51R	Сбербанк ПАО	RU000A10DS74	Облигации	Нет
RU000A10EF52	Сбер Sb52R	Сбербанк ПАО	RU000A10EF52	Облигации	Нет
RU000A10AXW4	СибурХ1Р03	СИБУР Холдинг ПАО	RU000A10AXW4	Облигации	Нет
RU000A10C8T4	СибурХ1Р07	СИБУР Холдинг ПАО	RU000A10C8T4	Облигации	Нет
RU000A10CMR3	СибурХ1Р08	СИБУР Холдинг ПАО	RU000A10CMR3	Облигации	Нет
RU000A10ECK5	СибурХ1Р09	СИБУР Холдинг ПАО	RU000A10ECK5	Облигации	Нет
RU000A10B7J8	ФосАгро2П3	ФосАгро	RU000A10B7J8	Облигации	Нет

ПЕРЕЧЕНЬ ЛИКВИДНОГО ИМУЩЕСТВА

для клиентов со Стандартным уровнем риска (КСУР)

РЕГИОН
БРОКЕРСКАЯ КОМПАНИЯ

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

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

$D_{shortKCУР} = (1 + R^{-})^2 - 1$ - для коротких позиций

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

$D_{longKCУР} = 1 - (1 - R^{+})^2$ - для длинных позиций

$D_{shortKCУР} = \infty$ - 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	Эмитент	ISIN	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RUB	Рубли		RUB	Валюта	Да
CNY	Юани		CNY	Валюта	Да
ALRS	ALRS	АК АЛРОСА ПАО	RU0007252813	Акции	Нет
CHMF	CHMF	Северсталь ПАО	RU0009046510	Акции	Нет
FLOT	FLOT	Совкомфлот	RU000A0JXNU8	Акции	Нет
GAZP	GAZP	Газпром ПАО	RU0007661625	Акции	Нет
GMKN	GMKN	ГМК Норильский Никель ПАО	RU0007288411	Акции	Нет
HEAD	HEAD	МКПАО Хэдхантер	RU000A107662	Акции	Нет
IRAO	IRAO	Интер РАО ПАО	RU000A0JPNM1	Акции	Нет
LKOH	LKOH	ЛУКОЙЛ ПАО	RU0009024277	Акции	Нет
MOEX	MOEX	ММВБ ПАО	RU000A0JR4A1	Акции	Нет
MTSS	MTSS	МТС ПАО	RU0007775219	Акции	Нет
NLMK	NLMK	НЛМК ПАО	RU0009046452	Акции	Нет
NVTK	NVTK	НОВАТЭК ПАО	RU000A0DKVS5	Акции	Нет
PHOR	PHOR	ФосАгро	RU000A0JRKT8	Акции	Нет
PLZL	PLZL	Полюс ПАО	RU000A0JNAA8	Акции	Нет
ROSN	ROSN	Роснефть ПАО	RU000A0J2Q06	Акции	Нет
RTKM	RTKM	Ростелеком ПАО	RU0008943394	Акции	Нет
SBER	SBER	Сбербанк ПАО	RU0009029540	Акции	Нет
SBERP	SBERP	Сбербанк ПАО	RU0009029557	Акции	Нет
SNGS	SNGS	Сургутнефтегаз ПАО	RU0008926258	Акции	Нет
TATN	TATN	Татнефть ПАО	RU0009033591	Акции	Нет
T	TCSG	Т-Технологии МКПАО	RU000A107UL4	Акции	Нет
VTBR	VTBR	Банк ВТБ ПАО	RU000A0JP5V6	Акции	Нет
X5	X5	Корпоративный центр ИКС 5 ПАО	RU000A108X38	Акции	Нет
YDEX	YDEX	МКПАО ЯНДЕКС	RU000A107T19	Акции	Нет
RU000A10BFG2	Атомэнпр05	Атомэнергопром АО	RU000A10BFG2	Облигации	Нет
RU000A10C3M0	Атомэнпр06	Атомэнергопром АО	RU000A10C3M0	Облигации	Нет
RU000A10C6L5	Атомэнпр07	Атомэнергопром АО	RU000A10C6L5	Облигации	Нет
RU000A10DPS2	Атомэнпр09	Атомэнергопром АО	RU000A10DPS2	Облигации	Нет
RU000A10EJQ7	Атомэнпр11	Атомэнергопром АО	RU000A10EJQ7	Облигации	Нет
RU000A10D9J2	sВЭБ2Р-52	ВЭБ.РФ	RU000A10D9J2	Облигации	Нет
RU000A10C6S0	ВЭБ2Р-53	ВЭБ.РФ	RU000A10C6S0	Облигации	Нет
RU000A10CTX6	ВЭБ2Р-54В	ВЭБ.РФ	RU000A10CTX6	Облигации	Нет
RU000A105YH8	ВЭБР-36	ВЭБ.РФ	RU000A105YH8	Облигации	Нет
RU000A10BBW8	ГазКап1Р12	Газпром капитал ООО	RU000A10BBW8	Облигации	Нет
RU000A10BFM0	ГазКап3Р13	Газпром капитал ООО	RU000A10BFM0	Облигации	Нет
RU000A10BPP2	ГазКап3Р14	Газпром капитал ООО	RU000A10BPP2	Облигации	Нет
RU000A10E9Y0	ГазКап3Р18	Газпром капитал ООО	RU000A10E9Y0	Облигации	Нет
RU000A105R62	ГазКЗ-28Д	Газпром капитал ООО	RU000A105R62	Облигации	Нет
RU000A105BY1	ГазКЗ-28Е	Газпром капитал ООО	RU000A105BY1	Облигации	Нет
RU000A105KU0	ГазКЗ-29Д	Газпром капитал ООО	RU000A105KU0	Облигации	Нет
RU000A105SG2	ГазКЗ-30Д	Газпром капитал ООО	RU000A105SG2	Облигации	Нет
RU000A105JT4	ГазКЗ-31Д	Газпром капитал ООО	RU000A105JT4	Облигации	Нет
RU000A105A95	ГазКЗ-34Д	Газпром капитал ООО	RU000A105A95	Облигации	Нет
RU000A105RH2	ГазКЗ-37Д	Газпром капитал ООО	RU000A105RH2	Облигации	Нет
RU000A108JV4	ГазпКап3Р2	Газпром капитал ООО	RU000A108JV4	Облигации	Нет
RU000A107UW1	Газпн3Р10R	Газпром нефть ПАО	RU000A107UW1	Облигации	Нет
RU000A109B33	Газпн3Р13R	Газпром нефть ПАО	RU000A109B33	Облигации	Нет
RU000A10BK17	Газпн3Р15R	Газпром нефть ПАО	RU000A10BK17	Облигации	Нет
RU000A1083W0	МТС 2Р-05	МТС ПАО	RU000A1083W0	Облигации	Нет
RU000A108G70	НОВАТЭК1Р2	НОВАТЭК ПАО	RU000A108G70	Облигации	Нет

Код актива (Московская Биржа)	Краткое наименование актива	Эмитент	ISIN	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RU000A10AUX8	НОВАТЭК1Р3	НОВАТЭК ПАО	RU000A10AUX8	Облигации	Нет
RU000A10BV55	НОВАТЭК1Р4	НОВАТЭК ПАО	RU000A10BV55	Облигации	Нет
RU000A10C9Y2	НОВАТЭК1Р5	НОВАТЭК ПАО	RU000A10C9Y2	Облигации	Нет
RU000A10CRC4	НорНик1Р14	ГМК Норильский Никель ПАО	RU000A10CRC4	Облигации	Нет
RU000A1083A6	НорНикБ1Р7	ГМК Норильский Никель ПАО	RU000A1083A6	Облигации	Нет
RU000A10B4K3	НорНикБ1Р8	ГМК Норильский Никель ПАО	RU000A10B4K3	Облигации	Нет
SU26207RMFS9	ОФЗ 26207	Минфин России	RU000A0JS3W6	Облигации	Нет
SU26212RMFS9	ОФЗ 26212	Минфин России	RU000A0JTK38	Облигации	Нет
SU26218RMFS6	ОФЗ 26218	Минфин России	RU000A0JVW48	Облигации	Нет
SU26221RMFS0	ОФЗ 26221	Минфин России	RU000A0JXFM1	Облигации	Нет
SU26224RMFS4	ОФЗ 26224	Минфин России	RU000A0ZYUA9	Облигации	Нет
SU26225RMFS1	ОФЗ 26225	Минфин России	RU000A0ZYUB7	Облигации	Нет
SU26228RMFS5	ОФЗ 26228	Минфин России	RU000A100A82	Облигации	Нет
SU26230RMFS1	ОФЗ 26230	Минфин России	RU000A100EF5	Облигации	Нет
SU26232RMFS7	ОФЗ 26232	Минфин России	RU000A1014N4	Облигации	Нет
SU26233RMFS5	ОФЗ 26233	Минфин России	RU000A101F94	Облигации	Нет
SU26235RMFS0	ОФЗ 26235	Минфин России	RU000A1028E3	Облигации	Нет
SU26236RMFS8	ОФЗ 26236	Минфин России	RU000A102BT8	Облигации	Нет
SU26237RMFS6	ОФЗ 26237	Минфин России	RU000A1038Z7	Облигации	Нет
SU26238RMFS4	ОФЗ 26238	Минфин России	RU000A1038V6	Облигации	Нет
SU26239RMFS2	ОФЗ 26239	Минфин России	RU000A103901	Облигации	Нет
SU26240RMFS0	ОФЗ 26240	Минфин России	RU000A103BR0	Облигации	Нет
SU26241RMFS8	ОФЗ 26241	Минфин России	RU000A105FZ9	Облигации	Нет
SU26242RMFS6	ОФЗ 26242	Минфин России	RU000A105RV3	Облигации	Нет
SU26243RMFS4	ОФЗ 26243	Минфин России	RU000A106E90	Облигации	Нет
SU26244RMFS2	ОФЗ 26244	Минфин России	RU000A1074G2	Облигации	Нет
SU26245RMFS9	ОФЗ 26245	Минфин России	RU000A108EG6	Облигации	Нет
SU26246RMFS7	ОФЗ 26246	Минфин России	RU000A108EE1	Облигации	Нет
SU26247RMFS5	ОФЗ 26247	Минфин России	RU000A108EF8	Облигации	Нет
SU26248RMFS3	ОФЗ 26248	Минфин России	RU000A108EH4	Облигации	Нет
SU26249RMFS1	ОФЗ 26249	Минфин России	RU000A10BVC8	Облигации	Нет
SU26250RMFS9	ОФЗ 26250	Минфин России	RU000A10BVH7	Облигации	Нет
SU26251RMFS7	ОФЗ 26251	Минфин России	RU000A10CKT3	Облигации	Нет
SU26252RMFS5	ОФЗ 26252	Минфин России	RU000A10D4Y2	Облигации	Нет
SU26253RMFS3	ОФЗ 26253	Минфин России	RU000A10D517	Облигации	Нет
SU26254RMFS1	ОФЗ 26254	Минфин России	RU000A10D533	Облигации	Нет
RU000A10DQB6	ОФЗ 29 CNY	Минфин России	RU000A10DQB6	Облигации	Нет
SU29007RMFS0	ОФЗ 29007	Минфин России	RU000A0JV4M0	Облигации	Нет
SU29008RMFS8	ОФЗ 29008	Минфин России	RU000A0JV4P3	Облигации	Нет
SU29009RMFS6	ОФЗ 29009	Минфин России	RU000A0JV4N8	Облигации	Нет
SU29013RMFS8	ОФЗ 29013	Минфин России	RU000A101KT1	Облигации	Нет
SU29015RMFS3	ОФЗ 29015	Минфин России	RU000A1025A7	Облигации	Нет
SU29016RMFS1	ОФЗ 29016	Минфин России	RU000A1025B5	Облигации	Нет
SU29017RMFS9	ОФЗ 29017	Минфин России	RU000A1028D5	Облигации	Нет
SU29018RMFS7	ОФЗ 29018	Минфин России	RU000A102A31	Облигации	Нет
SU29020RMFS3	ОФЗ 29020	Минфин России	RU000A102BV4	Облигации	Нет
SU29021RMFS1	ОФЗ 29021	Минфин России	RU000A105B11	Облигации	Нет
SU29022RMFS9	ОФЗ 29022	Минфин России	RU000A105G16	Облигации	Нет
SU29024RMFS5	ОФЗ 29024	Минфин России	RU000A1066D5	Облигации	Нет
SU29025RMFS2	ОФЗ 29025	Минфин России	RU000A106Z61	Облигации	Нет
SU29027RMFS8	ОФЗ 29027	Минфин России	RU000A10AA93	Облигации	Нет
SU29028RMFS6	ОФЗ 29028	Минфин России	RU000A10D4Z9	Облигации	Нет
RU000A10DQA8	ОФЗ 33 CNY	Минфин России	RU000A10DQA8	Облигации	Нет
SU52002RMFS1	ОФЗ 52002	Минфин России	RU000A0ZYZ26	Облигации	Нет
RU000A10AZ60	РЖД 1Р-38R	РЖД ОАО	RU000A10AZ60	Облигации	Нет
RU000A10C8C0	РЖД 1Р-44R	РЖД ОАО	RU000A10C8C0	Облигации	Нет
RU000A10DJR7	РЖД 1Р-49R	РЖД ОАО	RU000A10DJR7	Облигации	Нет
RU000A10DZW3	РЖД 1Р-50R	РЖД ОАО	RU000A10DZW3	Облигации	Нет
RU000A10E8P0	РЖД 1Р-51R	РЖД ОАО	RU000A10E8P0	Облигации	Нет
RU000A10EN11	РЖД 1Р-52R	РЖД ОАО	RU000A10EN11	Облигации	Нет
RU000A1095W4	Ростел1Р9R	Ростелеком ПАО	RU000A1095W4	Облигации	Нет
RU000A10CC24	РусГид2Р07	РусГидро ПАО	RU000A10CC24	Облигации	Нет
RU000A10EPX0	РусГид2Р12	РусГидро ПАО	RU000A10EPX0	Облигации	Нет
RU000A10A851	РФ ЗО 27 Д	Минфин России	RU000A10A851	Облигации	Нет
RU000A10A869	РФ ЗО 28 Д	Минфин России	RU000A10A869	Облигации	Нет
RU000A10A8A6	РФ ЗО 29 Д	Минфин России	RU000A10A8A6	Облигации	Нет
RU000A10A8E8	РФ ЗО 30 Д	Минфин России	RU000A10A8E8	Облигации	Нет
RU000A10A7Y8	РФ ЗО 35 Д	Минфин России	RU000A10A7Y8	Облигации	Нет
RU000A10A802	РФ ЗО 42 Д	Минфин России	RU000A10A802	Облигации	Нет
RU000A10A877	РФ ЗО 43 Д	Минфин России	RU000A10A877	Облигации	Нет
RU000A10A844	РФ ЗО 47 Д	Минфин России	RU000A10A844	Облигации	Нет
RU000A10DS74	Сбер Sb51R	Сбербанк ПАО	RU000A10DS74	Облигации	Нет
RU000A10EF52	Сбер Sb52R	Сбербанк ПАО	RU000A10EF52	Облигации	Нет
RU000A10AXW4	СибурХ1Р03	СИБУР Холдинг ПАО	RU000A10AXW4	Облигации	Нет
RU000A10C8T4	СибурХ1Р07	СИБУР Холдинг ПАО	RU000A10C8T4	Облигации	Нет
RU000A10CMR3	СибурХ1Р08	СИБУР Холдинг ПАО	RU000A10CMR3	Облигации	Нет
RU000A10ECK5	СибурХ1Р09	СИБУР Холдинг ПАО	RU000A10ECK5	Облигации	Нет
RU000A10B7J8	ФосАгро2П3	ФосАгро	RU000A10B7J8	Облигации	Нет

ПЕРЕЧЕНЬ ЛИКВИДНОГО ИМУЩЕСТВА

РЕГИОН
БРОКЕРСКАЯ КОМПАНИЯ

для клиентов с Повышенным уровнем риска (КПУР) и Особым уровнем риска (КОУР)

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

$D_{long\ КПУР_КОУР} = R^{+}$ - для длинных позиций

$D_{shortКПУР_КОУР} = R^{-}$ - для коротких позиций

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

$D_{longКПУР_КОУР} = R^{+}$ - для длинных позиций

$D_{shortКПУР_КОУР} = ∞$ - 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	Эмитент	ISIN	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RUB	Рубли		RUB	Валюта	Да
CNY	Юани		CNY	Валюта	Да
ALRS	ALRS	АК АЛРОСА ПАО	RU0007252813	Акции	Нет
CHMF	CHMF	Северсталь ПАО	RU0009046510	Акции	Нет
FLOT	FLOT	Совкомфлот	RU000A0JXNU8	Акции	Нет
GAZP	GAZP	Газпром ПАО	RU0007661625	Акции	Нет
GMKN	GMKN	ГМК Норильский Никель ПАО	RU0007288411	Акции	Нет
HEAD	HEAD	МКПАО Хэдхантер	RU000A107662	Акции	Нет
IRAO	IRAO	Интер РАО ПАО	RU000A0JPNM1	Акции	Нет
LKOH	LKOH	ЛУКОЙЛ ПАО	RU0009024277	Акции	Нет
MOEX	MOEX	ММВБ ПАО	RU000A0JR4A1	Акции	Нет
MTSS	MTSS	МТС ПАО	RU0007775219	Акции	Нет
NLMK	NLMK	НЛМК ПАО	RU0009046452	Акции	Нет
NVTK	NVTK	НОВАТЭК ПАО	RU000A0DKVS5	Акции	Нет
PHOR	PHOR	ФосАгро	RU000A0JRKT8	Акции	Нет
PLZL	PLZL	Полюс ПАО	RU000A0JNAA8	Акции	Нет
ROSN	ROSN	Роснефть ПАО	RU000A0J2Q06	Акции	Нет
RTKM	RTKM	Ростелеком ПАО	RU0008943394	Акции	Нет
SBER	SBER	Сбербанк ПАО	RU0009029540	Акции	Нет
SBERP	SBERP	Сбербанк ПАО	RU0009029557	Акции	Нет
SNGS	SNGS	Сургутнефтегаз ПАО	RU0008926258	Акции	Нет
TATN	TATN	Татнефть ПАО	RU0009033591	Акции	Нет
T	TCSG	Т-Технологии МКПАО	RU000A107UL4	Акции	Нет
VTBR	VTBR	Банк ВТБ ПАО	RU000A0JP5V6	Акции	Нет
X5	X5	Корпоративный центр ИКС 5 ПА	RU000A108X38	Акции	Нет
YDEX	YDEX	МКПАО ЯНДЕКС	RU000A107T19	Акции	Нет
RU000A10BFG2	Атомэнпр05	Атомэнергопром АО	RU000A10BFG2	Облигации	Нет
RU000A10C3M0	Атомэнпр06	Атомэнергопром АО	RU000A10C3M0	Облигации	Нет
RU000A10C6L5	Атомэнпр07	Атомэнергопром АО	RU000A10C6L5	Облигации	Нет
RU000A10DPS2	Атомэнпр09	Атомэнергопром АО	RU000A10DPS2	Облигации	Нет
RU000A10EJQ7	Атомэнпр11	Атомэнергопром АО	RU000A10EJQ7	Облигации	Нет
RU000A10D9J2	sВЭБ2Р-52	ВЭБ.РФ	RU000A10D9J2	Облигации	Нет
RU000A10C6S0	ВЭБ2Р-53	ВЭБ.РФ	RU000A10C6S0	Облигации	Нет
RU000A10CTX6	ВЭБ2Р-54В	ВЭБ.РФ	RU000A10CTX6	Облигации	Нет
RU000A105YH8	ВЭБР-36	ВЭБ.РФ	RU000A105YH8	Облигации	Нет
RU000A10BBW8	ГазКап1Р12	Газпром капитал ООО	RU000A10BBW8	Облигации	Нет
RU000A10BFM0	ГазКап3Р13	Газпром капитал ООО	RU000A10BFM0	Облигации	Нет
RU000A10BPP2	ГазКап3Р14	Газпром капитал ООО	RU000A10BPP2	Облигации	Нет
RU000A10E9Y0	ГазКап3Р18	Газпром капитал ООО	RU000A10E9Y0	Облигации	Нет
RU000A105R62	ГазКЗ-28Д	Газпром капитал ООО	RU000A105R62	Облигации	Нет
RU000A105BY1	ГазКЗ-28Е	Газпром капитал ООО	RU000A105BY1	Облигации	Нет
RU000A105KU0	ГазКЗ-29Д	Газпром капитал ООО	RU000A105KU0	Облигации	Нет
RU000A105SG2	ГазКЗ-30Д	Газпром капитал ООО	RU000A105SG2	Облигации	Нет
RU000A105JT4	ГазКЗ-31Д	Газпром капитал ООО	RU000A105JT4	Облигации	Нет
RU000A105A95	ГазКЗ-34Д	Газпром капитал ООО	RU000A105A95	Облигации	Нет
RU000A105RH2	ГазКЗ-37Д	Газпром капитал ООО	RU000A105RH2	Облигации	Нет
RU000A108JV4	ГазпКап3Р2	Газпром капитал ООО	RU000A108JV4	Облигации	Нет
RU000A107UW1	Газпн3Р10R	Газпром нефть ПАО	RU000A107UW1	Облигации	Нет
RU000A109B33	Газпн3Р13R	Газпром нефть ПАО	RU000A109B33	Облигации	Нет
RU000A10BK17	Газпн3Р15R	Газпром нефть ПАО	RU000A10BK17	Облигации	Нет
RU000A1083W0	МТС 2Р-05	МТС ПАО	RU000A1083W0	Облигации	Нет

Код актива (Московская Биржа)	Краткое наименование актива	Эмитент	ISIN	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RU000A108G70	НОВАТЭК1Р2	НОВАТЭК ПАО	RU000A108G70	Облигации	Нет
RU000A10AUX8	НОВАТЭК1Р3	НОВАТЭК ПАО	RU000A10AUX8	Облигации	Нет
RU000A10BV55	НОВАТЭК1Р4	НОВАТЭК ПАО	RU000A10BV55	Облигации	Нет
RU000A10C9Y2	НОВАТЭК1Р5	НОВАТЭК ПАО	RU000A10C9Y2	Облигации	Нет
RU000A10CRC4	НорНик1Р14	ГМК Норильский Никель ПАО	RU000A10CRC4	Облигации	Нет
RU000A1083A6	НорНикБ1Р7	ГМК Норильский Никель ПАО	RU000A1083A6	Облигации	Нет
RU000A10B4K3	НорНикБ1Р8	ГМК Норильский Никель ПАО	RU000A10B4K3	Облигации	Нет
SU26207RMFS9	ОФЗ 26207	Минфин России	RU000A0JS3W6	Облигации	Нет
SU26212RMFS9	ОФЗ 26212	Минфин России	RU000A0JTK38	Облигации	Нет
SU26218RMFS6	ОФЗ 26218	Минфин России	RU000A0JVW48	Облигации	Нет
SU26221RMFS0	ОФЗ 26221	Минфин России	RU000A0JXFM1	Облигации	Нет
SU26224RMFS4	ОФЗ 26224	Минфин России	RU000A0ZYUA9	Облигации	Нет
SU26225RMFS1	ОФЗ 26225	Минфин России	RU000A0ZYUB7	Облигации	Нет
SU26228RMFS5	ОФЗ 26228	Минфин России	RU000A100A82	Облигации	Нет
SU26230RMFS1	ОФЗ 26230	Минфин России	RU000A100EF5	Облигации	Нет
SU26232RMFS7	ОФЗ 26232	Минфин России	RU000A1014N4	Облигации	Нет
SU26233RMFS5	ОФЗ 26233	Минфин России	RU000A101F94	Облигации	Нет
SU26235RMFS0	ОФЗ 26235	Минфин России	RU000A1028E3	Облигации	Нет
SU26236RMFS8	ОФЗ 26236	Минфин России	RU000A102BT8	Облигации	Нет
SU26237RMFS6	ОФЗ 26237	Минфин России	RU000A1038Z7	Облигации	Нет
SU26238RMFS4	ОФЗ 26238	Минфин России	RU000A1038V6	Облигации	Нет
SU26239RMFS2	ОФЗ 26239	Минфин России	RU000A103901	Облигации	Нет
SU26240RMFS0	ОФЗ 26240	Минфин России	RU000A103BR0	Облигации	Нет
SU26241RMFS8	ОФЗ 26241	Минфин России	RU000A105FZ9	Облигации	Нет
SU26242RMFS6	ОФЗ 26242	Минфин России	RU000A105RV3	Облигации	Нет
SU26243RMFS4	ОФЗ 26243	Минфин России	RU000A106E90	Облигации	Нет
SU26244RMFS2	ОФЗ 26244	Минфин России	RU000A1074G2	Облигации	Нет
SU26245RMFS9	ОФЗ 26245	Минфин России	RU000A108EG6	Облигации	Нет
SU26246RMFS7	ОФЗ 26246	Минфин России	RU000A108EE1	Облигации	Нет
SU26247RMFS5	ОФЗ 26247	Минфин России	RU000A108EF8	Облигации	Нет
SU26248RMFS3	ОФЗ 26248	Минфин России	RU000A108EH4	Облигации	Нет
SU26249RMFS1	ОФЗ 26249	Минфин России	RU000A10BVC8	Облигации	Нет
SU26250RMFS9	ОФЗ 26250	Минфин России	RU000A10BVH7	Облигации	Нет
SU26251RMFS7	ОФЗ 26251	Минфин России	RU000A10CKT3	Облигации	Нет
SU26252RMFS5	ОФЗ 26252	Минфин России	RU000A10D4Y2	Облигации	Нет
SU26253RMFS3	ОФЗ 26253	Минфин России	RU000A10D517	Облигации	Нет
SU26254RMFS1	ОФЗ 26254	Минфин России	RU000A10D533	Облигации	Нет
RU000A10DQB6	ОФЗ 29 CNY	Минфин России	RU000A10DQB6	Облигации	Нет
SU29007RMFS0	ОФЗ 29007	Минфин России	RU000A0JV4M0	Облигации	Нет
SU29008RMFS8	ОФЗ 29008	Минфин России	RU000A0JV4P3	Облигации	Нет
SU29009RMFS6	ОФЗ 29009	Минфин России	RU000A0JV4N8	Облигации	Нет
SU29013RMFS8	ОФЗ 29013	Минфин России	RU000A101KT1	Облигации	Нет
SU29015RMFS3	ОФЗ 29015	Минфин России	RU000A1025A7	Облигации	Нет
SU29016RMFS1	ОФЗ 29016	Минфин России	RU000A1025B5	Облигации	Нет
SU29017RMFS9	ОФЗ 29017	Минфин России	RU000A1028D5	Облигации	Нет
SU29018RMFS7	ОФЗ 29018	Минфин России	RU000A102A31	Облигации	Нет
SU29020RMFS3	ОФЗ 29020	Минфин России	RU000A102BV4	Облигации	Нет
SU29021RMFS1	ОФЗ 29021	Минфин России	RU000A105B11	Облигации	Нет
SU29022RMFS9	ОФЗ 29022	Минфин России	RU000A105G16	Облигации	Нет
SU29024RMFS5	ОФЗ 29024	Минфин России	RU000A1066D5	Облигации	Нет
SU29025RMFS2	ОФЗ 29025	Минфин России	RU000A106Z61	Облигации	Нет
SU29027RMFS8	ОФЗ 29027	Минфин России	RU000A10AA93	Облигации	Нет
SU29028RMFS6	ОФЗ 29028	Минфин России	RU000A10D4Z9	Облигации	Нет
RU000A10DQA8	ОФЗ 33 CNY	Минфин России	RU000A10DQA8	Облигации	Нет
SU52002RMFS1	ОФЗ 52002	Минфин России	RU000A0ZYZ26	Облигации	Нет
RU000A10AZ60	РЖД 1Р-38R	РЖД ОАО	RU000A10AZ60	Облигации	Нет
RU000A10C8C0	РЖД 1Р-44R	РЖД ОАО	RU000A10C8C0	Облигации	Нет
RU000A10DJR7	РЖД 1Р-49R	РЖД ОАО	RU000A10DJR7	Облигации	Нет
RU000A10DZW3	РЖД 1Р-50R	РЖД ОАО	RU000A10DZW3	Облигации	Нет
RU000A10E8P0	РЖД 1Р-51R	РЖД ОАО	RU000A10E8P0	Облигации	Нет
RU000A10EN11	РЖД 1Р-52R	РЖД ОАО	RU000A10EN11	Облигации	Нет
RU000A1095W4	Ростел1Р9R	Ростелеком ПАО	RU000A1095W4	Облигации	Нет
RU000A10CC24	РусГид2Р07	РусГидро ПАО	RU000A10CC24	Облигации	Нет
RU000A10EPX0	РусГид2Р12	РусГидро ПАО	RU000A10EPX0	Облигации	Нет
RU000A10A851	РФ 3О 27 Д	Минфин России	RU000A10A851	Облигации	Нет
RU000A10A869	РФ 3О 28 Д	Минфин России	RU000A10A869	Облигации	Нет
RU000A10A8A6	РФ 3О 29 Д	Минфин России	RU000A10A8A6	Облигации	Нет
RU000A10A8E8	РФ 3О 30 Д	Минфин России	RU000A10A8E8	Облигации	Нет
RU000A10A7Y8	РФ 3О 35 Д	Минфин России	RU000A10A7Y8	Облигации	Нет
RU000A10A802	РФ 3О 42 Д	Минфин России	RU000A10A802	Облигации	Нет
RU000A10A877	РФ 3О 43 Д	Минфин России	RU000A10A877	Облигации	Нет
RU000A10A844	РФ 3О 47 Д	Минфин России	RU000A10A844	Облигации	Нет
RU000A10DS74	Сбер Sb51R	Сбербанк ПАО	RU000A10DS74	Облигации	Нет
RU000A10EF52	Сбер Sb52R	Сбербанк ПАО	RU000A10EF52	Облигации	Нет
RU000A10AXW4	СибурХ1Р03	СИБУР Холдинг ПАО	RU000A10AXW4	Облигации	Нет
RU000A10C8T4	СибурХ1Р07	СИБУР Холдинг ПАО	RU000A10C8T4	Облигации	Нет
RU000A10CMR3	СибурХ1Р08	СИБУР Холдинг ПАО	RU000A10CMR3	Облигации	Нет
RU000A10ECK5	СибурХ1Р09	СИБУР Холдинг ПАО	RU000A10ECK5	Облигации	Нет
RU000A10B7J8	ФосАгро2П3	ФосАгро	RU000A10B7J8	Облигации	Нет