

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:

$$D_{longКНУР} = 1 - (1 - R^+)^{2,8} \quad \text{- для длинных позиций}$$

$$D_{shortКНУР} = (1 + R)^{2,8} - 1 \quad \text{- для коротких позиций}$$

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

$$D_{longКНУР} = 1 - (1 - R^+)^{2,8} \quad \text{- для длинных позиций}$$

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

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	Эмитент	ISIN	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RUB	Рубли		RUB	Валюта	Да
ALRS	ALRS	АК АЛРОСА ПАО	RU0007252813	Акции	Нет
VTBR	VTBR	Банк ВТБ ПАО	RU000A0JP5V6	Акции	Нет
GAZP	GAZP	Газпром ПАО	RU0007661625	Акции	Нет
GMKN	GMKN	ГМК Норильский Никель ПАО	RU0007288411	Акции	Нет
IRAO	IRAO	Интер РАО ПАО	RU000A0JPNM1	Акции	Нет
X5	X5	Корпоративный центр ИКС 5 ПАО	RU000A108X38	Акции	Нет
LKOH	LKOH	ЛУКОЙЛ ПАО	RU0009024277	Акции	Нет
YDEX	YDEX	МКПАО ЯНДЕКС	RU000A107T19	Акции	Нет
MOEX	MOEX	ММВБ ПАО	RU000A0JR4A1	Акции	Нет
MTSS	MTSS	МТС ПАО	RU000775219	Акции	Нет
NLMK	NLMK	НЛМК ПАО	RU0009046452	Акции	Нет
NVTK	NVTK	НОВАТЭК ПАО	RU000A0DKV55	Акции	Нет
PLZL	PLZL	Полюс ПАО	RU000A0JNAA8	Акции	Нет
RTKM	RTKM	Ростелеком ПАО	RU0008943394	Акции	Нет
SBER	SBER	Сбербанк ПАО	RU0009029540	Акции	Нет
CHMF	CHMF	Северсталь ПАО	RU0009046510	Акции	Нет
FLOT	FLOT	Совкомфлот	RU000A0JXNU8	Акции	Нет
SNGS	SNGS	Сургутнефтегаз ПАО	RU0008926258	Акции	Нет
TATN	TATN	Татнефть ПАО	RU0009033591	Акции	Нет
T	T	T-Технологии МКПАО	RU000A107UL4	Акции	Нет
PHOR	PHOR	ФосАгро	RU000A0JRK78	Акции	Нет
SBERP	SBERP	Сбербанк ПАО	RU0009029557	Акции	Нет
RU000A10BFG2	Атомэнпр05	Атомэнергопром АО	RU000A10BFG2	Облигации	Нет
RU000A10C6L5	Атомэнпр07	Атомэнергопром АО	RU000A10C6L5	Облигации	Нет
RU000A10CT33	Атомэнпр08	Атомэнергопром АО	RU000A10CT33	Облигации	Нет
RU000A108JV4	ГазпКап3P2	Газпром капитал ООО	RU000A108JV4	Облигации	Нет
RU000A105BY1	ГазК3-28Е	Газпром капитал ООО	RU000A105BY1	Облигации	Нет
RU000A105A95	ГазК3-34Д	Газпром капитал ООО	RU000A105A95	Облигации	Нет
RU000A105RH2	ГазК3-37Д	Газпром капитал ООО	RU000A105RH2	Облигации	Нет
RU000A109B33	Газпн3P13R	Газпром нефть ПАО	RU000A109B33	Облигации	Нет
RU000A10BK09	Газпн3P14R	Газпром нефть ПАО	RU000A10BK09	Облигации	Нет
RU000A10BK17	Газпн3P15R	Газпром нефть ПАО	RU000A10BK17	Облигации	Нет
RU000A1083A6	НорНикБ1P7	ГМК Норильский Никель ПАО	RU000A1083A6	Облигации	Нет
RU000A102DB2	ГПБ001P18P	ГПБ КБ	RU000A102DB2	Облигации	Нет
RU000A102GJ8	ГПБ001P19P	ГПБ КБ	RU000A102GJ8	Облигации	Нет
RU000A105GW4	ГПБ001P22P	ГПБ КБ	RU000A105GW4	Облигации	Нет
RU000A10ANZ8	Магнит5P01	Магнит ПАО	RU000A10ANZ8	Облигации	Нет
RU000A10B0A2	Магнит5P03	Магнит ПАО	RU000A10B0A2	Облигации	Нет
RU000A10C618	Магнит4P08	Магнит ПАО	RU000A10C618	Облигации	Нет
RU000A10BF48	ЯНДЕКС1P1	МКПАО ЯНДЕКС	RU000A10BF48	Облигации	Нет
RU000A10CMT9	ЯНДЕКС1P2	МКПАО ЯНДЕКС	RU000A10CMT9	Облигации	Нет
RU000A1083U4	МТС 2P-04	МТС ПАО	RU000A1083U4	Облигации	Нет
RU000A1083W0	МТС 2P-05	МТС ПАО	RU000A1083W0	Облигации	Нет
RU000A10BW62	МТС 2P-12	МТС ПАО	RU000A10BW62	Облигации	Нет
RU000A10CQ85	МТС 1P-29	МТС ПАО	RU000A10CQ85	Облигации	Нет
RU000A0JUAN8	РЖД-30 обл	РЖД ОАО	RU000A0JUAN8	Облигации	Нет
RU000A108Z85	РЖД 1P-32R	РЖД ОАО	RU000A108Z85	Облигации	Нет
RU000A10AUE8	РЖД 1P-36R	РЖД ОАО	RU000A10AUE8	Облигации	Нет
RU000A10AZ45	РЖД 1P-37R	РЖД ОАО	RU000A10AZ45	Облигации	Нет
RU000A10AZ60	РЖД 1P-38R	РЖД ОАО	RU000A10AZ60	Облигации	Нет
RU000A10B115	РЖД 1P-40R	РЖД ОАО	RU000A10B115	Облигации	Нет

Код актива (Московская Биржа)	Краткое наименование актива	Эмитент	ISIN	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RU000A10BGF2	РЖД 1P-42R	РЖД ОАО	RU000A10BGF2	Облигации	Нет
RU000A10BTA6	РЖД 1P-43R	РЖД ОАО	RU000A10BTA6	Облигации	Нет
RU000A10C8C0	РЖД 1P-44R	РЖД ОАО	RU000A10C8C0	Облигации	Нет
RU000A10CDZ5	РЖД 1P-45R	РЖД ОАО	RU000A10CDZ5	Облигации	Нет
RU000A109X29	РостелP12R	Ростелеком ПАО	RU000A109X29	Облигации	Нет
RU000A10A349	РусГид2P01	РусГидро ПАО	RU000A10A349	Облигации	Нет
RU000A10AEB8	РусГид2P05	РусГидро ПАО	RU000A10AEB8	Облигации	Нет
RU000A10BRR4	РусГид2P06	РусГидро ПАО	RU000A10BRR4	Облигации	Нет
RU000A10CC24	РусГид2P07	РусГидро ПАО	RU000A10CC24	Облигации	Нет
RU000A10BZH8	Сбер Sbd7R	Сбербанк ПАО	RU000A10BZH8	Облигации	Нет
RU000A10C8S6	Сбер Sbd8R	Сбербанк ПАО	RU000A10C8S6	Облигации	Нет
RU000A109K40	ФосАгро P12	ФосАгро	RU000A109K40	Облигации	Нет
SU26207RMFS9	ОФЗ 26207	Минфин России	RU000A0JS3W6	ОФЗ	Нет
SU26212RMFS9	ОФЗ 26212	Минфин России	RU000A0JTK38	ОФЗ	Нет
SU26218RMFS6	ОФЗ 26218	Минфин России	RU000A0JVW48	ОФЗ	Нет
SU26219RMFS4	ОФЗ 26219	Минфин России	RU000A0JWM07	ОФЗ	Нет
SU26221RMFS0	ОФЗ 26221	Минфин России	RU000A0JXFM1	ОФЗ	Нет
SU26224RMFS4	ОФЗ 26224	Минфин России	RU000A0ZYUA9	ОФЗ	Нет
SU26225RMFS1	ОФЗ 26225	Минфин России	RU000A0ZYUB7	ОФЗ	Нет
SU26226RMFS9	ОФЗ 26226	Минфин России	RU000A0ZZYW2	ОФЗ	Нет
SU26228RMFS5	ОФЗ 26228	Минфин России	RU000A100A82	ОФЗ	Нет
SU26230RMFS1	ОФЗ 26230	Минфин России	RU000A100EF5	ОФЗ	Нет
SU26232RMFS7	ОФЗ 26232	Минфин России	RU000A1014N4	ОФЗ	Нет
SU26233RMFS5	ОФЗ 26233	Минфин России	RU000A101F94	ОФЗ	Нет
SU26235RMFS0	ОФЗ 26235	Минфин России	RU000A1028E3	ОФЗ	Нет
SU26236RMFS8	ОФЗ 26236	Минфин России	RU000A102BT8	ОФЗ	Нет
SU26237RMFS6	ОФЗ 26237	Минфин России	RU000A1038Z7	ОФЗ	Нет
SU26238RMFS4	ОФЗ 26238	Минфин России	RU000A1038V6	ОФЗ	Нет
SU26239RMFS2	ОФЗ 26239	Минфин России	RU000A103901	ОФЗ	Нет
SU26240RMFS0	ОФЗ 26240	Минфин России	RU000A103BR0	ОФЗ	Нет
SU26241RMFS8	ОФЗ 26241	Минфин России	RU000A105FZ9	ОФЗ	Нет
SU26242RMFS6	ОФЗ 26242	Минфин России	RU000A105RV3	ОФЗ	Нет
SU26243RMFS4	ОФЗ 26243	Минфин России	RU000A106E90	ОФЗ	Нет
SU26244RMFS2	ОФЗ 26244	Минфин России	RU000A1074G2	ОФЗ	Нет
SU26245RMFS9	ОФЗ 26245	Минфин России	RU000A108EG6	ОФЗ	Нет
SU26246RMFS7	ОФЗ 26246	Минфин России	RU000A108EE1	ОФЗ	Нет
SU26247RMFS5	ОФЗ 26247	Минфин России	RU000A108EF8	ОФЗ	Нет
SU26248RMFS3	ОФЗ 26248	Минфин России	RU000A108EH4	ОФЗ	Нет
SU26249RMFS1	ОФЗ 26249	Минфин России	RU000A10BVC8	ОФЗ	Нет
SU26250RMFS9	ОФЗ 26250	Минфин России	RU000A10BVH7	ОФЗ	Нет
SU29007RMFS0	ОФЗ 29007	Минфин России	RU000A0JV4M0	ОФЗ	Нет
SU29008RMFS8	ОФЗ 29008	Минфин России	RU000A0JV4P3	ОФЗ	Нет
SU29009RMFS6	ОФЗ 29009	Минфин России	RU000A0JV4N8	ОФЗ	Нет
SU29010RMFS4	ОФЗ 29010	Минфин России	RU000A0JV4Q1	ОФЗ	Нет
SU29013RMFS8	ОФЗ 29013	Минфин России	RU000A101KT1	ОФЗ	Нет
SU29015RMFS3	ОФЗ 29015	Минфин России	RU000A1025A7	ОФЗ	Нет
SU29016RMFS1	ОФЗ 29016	Минфин России	RU000A1025B5	ОФЗ	Нет
SU29018RMFS7	ОФЗ 29018	Минфин России	RU000A102A31	ОФЗ	Нет
SU29019RMFS5	ОФЗ 29019	Минфин России	RU000A102A49	ОФЗ	Нет
SU29020RMFS3	ОФЗ 29020	Минфин России	RU000A102BV4	ОФЗ	Нет
SU29021RMFS1	ОФЗ 29021	Минфин России	RU000A105B11	ОФЗ	Нет
SU29022RMFS9	ОФЗ 29022	Минфин России	RU000A105G16	ОФЗ	Нет
SU29023RMFS7	ОФЗ 29023	Минфин России	RU000A105L19	ОФЗ	Нет
SU29024RMFS5	ОФЗ 29024	Минфин России	RU000A1066D5	ОФЗ	Нет
SU29025RMFS2	ОФЗ 29025	Минфин России	RU000A106Z61	ОФЗ	Нет
SU29027RMFS8	ОФЗ 29027	Минфин России	RU000A10AA93	ОФЗ	Нет
SU52002RMFS1	ОФЗ 52002	Минфин России	RU000A0ZYZ26	ОФЗ	Нет
SU26252RMFS5	ОФЗ 26252	Минфин России	RU000A10D4Y2	ОФЗ	Нет
SU26251RMFS7	ОФЗ 26251	Минфин России	RU000A10CKT3	ОФЗ	Нет
RU000A10DQB6	ОФЗ 29 CNY	Минфин России	RU000A10DQB6	ОФЗ	Нет
RU000A10DQA8	ОФЗ 33 CNY	Минфин России	RU000A10DQA8	ОФЗ	Нет
RU000A10A851	РФ 30 27 Д	Минфин России	RU000A10A851	ОФЗ	Нет
RU000A10A869	РФ 30 28 Д	Минфин России	RU000A10A869	ОФЗ	Нет
RU000A10A8A6	РФ 30 29 Д	Минфин России	RU000A10A8A6	ОФЗ	Нет
RU000A10A8E8	РФ 30 30 Д	Минфин России	RU000A10A8E8	ОФЗ	Нет
RU000A10A7Y8	РФ 30 35 Д	Минфин России	RU000A10A7Y8	ОФЗ	Нет
RU000A10A802	РФ 30 42 Д	Минфин России	RU000A10A802	ОФЗ	Нет
RU000A10A877	РФ 30 43 Д	Минфин России	RU000A10A877	ОФЗ	Нет
RU000A10A844	РФ 30 47 Д	Минфин России	RU000A10A844	ОФЗ	Нет
RU000A10A828	РФ 30 27 Е	Минфин России	RU000A10A828	ОФЗ	Нет
RU000A10A836	РФ 30 32 Е	Минфин России	RU000A10A836	ОФЗ	Нет
RU000A10A893	РФ 30 36 Е	Минфин России	RU000A10A893	ОФЗ	Нет

ПЕРЕЧЕНЬ ЛИКВИДНОГО ИМУЩЕСТВА
для клиентов со Стандартным уровнем риска (КСУР)



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

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

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

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

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

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

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	Эмитент	ISIN	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RUB	Рубли		RUB	Валюта	Да
ALRS	ALRS	АК АЛРОСА ПАО	RU0007252813	Акции	Нет
VTBR	VTBR	Банк ВТБ ПАО	RU000A0JP5V6	Акции	Нет
GAZP	GAZP	Газпром ПАО	RU0007661625	Акции	Нет
GMKN	GMKN	ГМК Норильский Никель ПАО	RU0007288411	Акции	Нет
IRAO	IRAO	Интер РАО ПАО	RU000A0JPNM1	Акции	Нет
X5	X5	Корпоративный центр ИКС 5 ПАО	RU000A108X38	Акции	Нет
LKOH	LKOH	ЛУКОЙЛ ПАО	RU0009024277	Акции	Нет
YDEX	YDEX	МКПАО ЯНДЕКС	RU000A107T19	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	RU000A0DKV55	Акции	Нет
PLZL	PLZL	Полос ПАО	RU000A0JNAA8	Акции	Нет
RTKM	RTKM	Ростелеком ПАО	RU0008943394	Акции	Нет
SBER	SBER	Сбербанк ПАО	RU0009029540	Акции	Нет
CHMF	CHMF	Северсталь ПАО	RU0009046510	Акции	Нет
FLOT	FLOT	Совкомфлот	RU000A0JXNU8	Акции	Нет
SNGS	SNGS	Сургутнефтегаз ПАО	RU0008926258	Акции	Нет
TATN	TATN	Татнефть ПАО	RU0009033591	Акции	Нет
T	T	T-Технологии МКПАО	RU000A107UL4	Акции	Нет
PHOR	PHOR	ФосАгро	RU000A0JRK78	Акции	Нет
SBERP	SBERP	Сбербанк ПАО	RU0009029557	Акции	Нет
RU000A10BFG2	Атомэнпр05	Атомэнергопром АО	RU000A10BFG2	Облигации	Нет
RU000A10C6L5	Атомэнпр07	Атомэнергопром АО	RU000A10C6L5	Облигации	Нет
RU000A10CT33	Атомэнпр08	Атомэнергопром АО	RU000A10CT33	Облигации	Нет
RU000A108JV4	ГазпКап3P2	Газпром капитал ООО	RU000A108JV4	Облигации	Нет
RU000A105BY1	ГазК3-28Е	Газпром капитал ООО	RU000A105BY1	Облигации	Нет
RU000A105A95	ГазК3-34Д	Газпром капитал ООО	RU000A105A95	Облигации	Нет
RU000A105RH2	ГазК3-37Д	Газпром капитал ООО	RU000A105RH2	Облигации	Нет
RU000A109B33	Газпн3P13R	Газпром нефть ПАО	RU000A109B33	Облигации	Нет
RU000A10BK09	Газпн3P14R	Газпром нефть ПАО	RU000A10BK09	Облигации	Нет
RU000A10BK17	Газпн3P15R	Газпром нефть ПАО	RU000A10BK17	Облигации	Нет
RU000A1083A6	НорНикБ1P7	ГМК Норильский Никель ПАО	RU000A1083A6	Облигации	Нет
RU000A102DB2	ГПБ001P18P	ГПБ КБ	RU000A102DB2	Облигации	Нет
RU000A102GJ8	ГПБ001P19P	ГПБ КБ	RU000A102GJ8	Облигации	Нет
RU000A105GW4	ГПБ001P22P	ГПБ КБ	RU000A105GW4	Облигации	Нет
RU000A10ANZ8	Магнит5P01	Магнит ПАО	RU000A10ANZ8	Облигации	Нет
RU000A10B0A2	Магнит5P03	Магнит ПАО	RU000A10B0A2	Облигации	Нет
RU000A10C618	Магнит4P08	Магнит ПАО	RU000A10C618	Облигации	Нет
RU000A10BF48	ЯНДЕКС1P1	МКПАО ЯНДЕКС	RU000A10BF48	Облигации	Нет
RU000A10CMT9	ЯНДЕКС1P2	МКПАО ЯНДЕКС	RU000A10CMT9	Облигации	Нет
RU000A1083U4	МТС 2P-04	МТС ПАО	RU000A1083U4	Облигации	Нет
RU000A1083W0	МТС 2P-05	МТС ПАО	RU000A1083W0	Облигации	Нет
RU000A10BW62	МТС 2P-12	МТС ПАО	RU000A10BW62	Облигации	Нет
RU000A10CQ85	МТС 1P-29	МТС ПАО	RU000A10CQ85	Облигации	Нет
RU000A0JUAH8	РЖД-30 обл	РЖД ОАО	RU000A0JUAH8	Облигации	Нет
RU000A108Z85	РЖД 1P-32R	РЖД ОАО	RU000A108Z85	Облигации	Нет
RU000A10AUE8	РЖД 1P-36R	РЖД ОАО	RU000A10AUE8	Облигации	Нет
RU000A10AZ45	РЖД 1P-37R	РЖД ОАО	RU000A10AZ45	Облигации	Нет
RU000A10AZ60	РЖД 1P-38R	РЖД ОАО	RU000A10AZ60	Облигации	Нет
RU000A10B115	РЖД 1P-40R	РЖД ОАО	RU000A10B115	Облигации	Нет
RU000A10BGF2	РЖД 1P-42R	РЖД ОАО	RU000A10BGF2	Облигации	Нет

Код актива (Московская Биржа)	Краткое наименование актива	Эмитент	ISIN	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RU000A10BTA6	РЖД 1Р-43R	РЖД ОАО	RU000A10BTA6	Облигации	Нет
RU000A10C8C0	РЖД 1Р-44R	РЖД ОАО	RU000A10C8C0	Облигации	Нет
RU000A10CDZ5	РЖД 1Р-45R	РЖД ОАО	RU000A10CDZ5	Облигации	Нет
RU000A109X29	РостелР12R	Ростелеком ПАО	RU000A109X29	Облигации	Нет
RU000A10A349	РусГид2P01	РусГидро ПАО	RU000A10A349	Облигации	Нет
RU000A10AEB8	РусГид2P05	РусГидро ПАО	RU000A10AEB8	Облигации	Нет
RU000A10BRR4	РусГид2P06	РусГидро ПАО	RU000A10BRR4	Облигации	Нет
RU000A10CC24	РусГид2P07	РусГидро ПАО	RU000A10CC24	Облигации	Нет
RU000A10BZH8	Сбер Sbd7R	Сбербанк ПАО	RU000A10BZH8	Облигации	Нет
RU000A10C8S6	Сбер Sbd8R	Сбербанк ПАО	RU000A10C8S6	Облигации	Нет
RU000A109K40	ФосАгро П2	ФосАгро	RU000A109K40	Облигации	Нет
SU26207RMFS9	ОФЗ 26207	Минфин России	RU000A0JS3W6	ОФЗ	Нет
SU26212RMFS9	ОФЗ 26212	Минфин России	RU000A0JTK38	ОФЗ	Нет
SU26218RMFS6	ОФЗ 26218	Минфин России	RU000A0JVW48	ОФЗ	Нет
SU26219RMFS4	ОФЗ 26219	Минфин России	RU000A0JWM07	ОФЗ	Нет
SU26221RMFS0	ОФЗ 26221	Минфин России	RU000A0JXFM1	ОФЗ	Нет
SU26224RMFS4	ОФЗ 26224	Минфин России	RU000A0ZYUA9	ОФЗ	Нет
SU26225RMFS1	ОФЗ 26225	Минфин России	RU000A0ZYUB7	ОФЗ	Нет
SU26226RMFS9	ОФЗ 26226	Минфин России	RU000A0ZZYW2	ОФЗ	Нет
SU26228RMFS5	ОФЗ 26228	Минфин России	RU000A100A82	ОФЗ	Нет
SU26230RMFS1	ОФЗ 26230	Минфин России	RU000A100EF5	ОФЗ	Нет
SU26232RMFS7	ОФЗ 26232	Минфин России	RU000A1014N4	ОФЗ	Нет
SU26233RMFS5	ОФЗ 26233	Минфин России	RU000A101F94	ОФЗ	Нет
SU26235RMFS0	ОФЗ 26235	Минфин России	RU000A1028E3	ОФЗ	Нет
SU26236RMFS8	ОФЗ 26236	Минфин России	RU000A102BT8	ОФЗ	Нет
SU26237RMFS6	ОФЗ 26237	Минфин России	RU000A1038Z7	ОФЗ	Нет
SU26238RMFS4	ОФЗ 26238	Минфин России	RU000A1038V6	ОФЗ	Нет
SU26239RMFS2	ОФЗ 26239	Минфин России	RU000A103901	ОФЗ	Нет
SU26240RMFS0	ОФЗ 26240	Минфин России	RU000A103BR0	ОФЗ	Нет
SU26241RMFS8	ОФЗ 26241	Минфин России	RU000A105FZ9	ОФЗ	Нет
SU26242RMFS6	ОФЗ 26242	Минфин России	RU000A105RV3	ОФЗ	Нет
SU26243RMFS4	ОФЗ 26243	Минфин России	RU000A106E90	ОФЗ	Нет
SU26244RMFS2	ОФЗ 26244	Минфин России	RU000A1074G2	ОФЗ	Нет
SU26245RMFS9	ОФЗ 26245	Минфин России	RU000A108EG6	ОФЗ	Нет
SU26246RMFS7	ОФЗ 26246	Минфин России	RU000A108EE1	ОФЗ	Нет
SU26247RMFS5	ОФЗ 26247	Минфин России	RU000A108EF8	ОФЗ	Нет
SU26248RMFS3	ОФЗ 26248	Минфин России	RU000A108EH4	ОФЗ	Нет
SU26249RMFS1	ОФЗ 26249	Минфин России	RU000A10BVC8	ОФЗ	Нет
SU26250RMFS9	ОФЗ 26250	Минфин России	RU000A10BVH7	ОФЗ	Нет
SU29007RMFS0	ОФЗ 29007	Минфин России	RU000A0JV4M0	ОФЗ	Нет
SU29008RMFS8	ОФЗ 29008	Минфин России	RU000A0JV4P3	ОФЗ	Нет
SU29009RMFS6	ОФЗ 29009	Минфин России	RU000A0JV4N8	ОФЗ	Нет
SU29010RMFS4	ОФЗ 29010	Минфин России	RU000A0JV4Q1	ОФЗ	Нет
SU29013RMFS8	ОФЗ 29013	Минфин России	RU000A101KT1	ОФЗ	Нет
SU29015RMFS3	ОФЗ 29015	Минфин России	RU000A1025A7	ОФЗ	Нет
SU29016RMFS1	ОФЗ 29016	Минфин России	RU000A1025B5	ОФЗ	Нет
SU29018RMFS7	ОФЗ 29018	Минфин России	RU000A102A31	ОФЗ	Нет
SU29019RMFS5	ОФЗ 29019	Минфин России	RU000A102A49	ОФЗ	Нет
SU29020RMFS3	ОФЗ 29020	Минфин России	RU000A102BV4	ОФЗ	Нет
SU29021RMFS1	ОФЗ 29021	Минфин России	RU000A105B11	ОФЗ	Нет
SU29022RMFS9	ОФЗ 29022	Минфин России	RU000A105G16	ОФЗ	Нет
SU29023RMFS7	ОФЗ 29023	Минфин России	RU000A105L19	ОФЗ	Нет
SU29024RMFS5	ОФЗ 29024	Минфин России	RU000A1066D5	ОФЗ	Нет
SU29025RMFS2	ОФЗ 29025	Минфин России	RU000A106Z61	ОФЗ	Нет
SU29027RMFS8	ОФЗ 29027	Минфин России	RU000A10AA93	ОФЗ	Нет
SU52002RMFS1	ОФЗ 52002	Минфин России	RU000A0ZYZ26	ОФЗ	Нет
SU26252RMFS5	ОФЗ 26252	Минфин России	RU000A10D4Y2	ОФЗ	Нет
SU26251RMFS7	ОФЗ 26251	Минфин России	RU000A10CKT3	ОФЗ	Нет
RU000A10DQB6	ОФЗ 29 CNY	Минфин России	RU000A10DQB6	ОФЗ	Нет
RU000A10DQA8	ОФЗ 33 CNY	Минфин России	RU000A10DQA8	ОФЗ	Нет
RU000A10A851	РФ 30 27 Д	Минфин России	RU000A10A851	ОФЗ	Нет
RU000A10A869	РФ 30 28 Д	Минфин России	RU000A10A869	ОФЗ	Нет
RU000A10A8A6	РФ 30 29 Д	Минфин России	RU000A10A8A6	ОФЗ	Нет
RU000A10A8E8	РФ 30 30 Д	Минфин России	RU000A10A8E8	ОФЗ	Нет
RU000A10A7Y8	РФ 30 35 Д	Минфин России	RU000A10A7Y8	ОФЗ	Нет
RU000A10A802	РФ 30 42 Д	Минфин России	RU000A10A802	ОФЗ	Нет
RU000A10A877	РФ 30 43 Д	Минфин России	RU000A10A877	ОФЗ	Нет
RU000A10A844	РФ 30 47 Д	Минфин России	RU000A10A844	ОФЗ	Нет
RU000A10A828	РФ 30 27 Е	Минфин России	RU000A10A828	ОФЗ	Нет
RU000A10A836	РФ 30 32 Е	Минфин России	RU000A10A836	ОФЗ	Нет
RU000A10A893	РФ 30 36 Е	Минфин России	RU000A10A893	ОФЗ	Нет

ПЕРЕЧЕНЬ ЛИКВИДНОГО ИМУЩЕСТВА



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:

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

$$D_{short\text{КПУР_КОУР}} = R^- \quad \text{- для коротких позиций}$$

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

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

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

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	Эмитент	ISIN	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RUB	Рубли			Валюта	Да
ALRS	ALRS	АК АЛРОСА ПАО	RU0007252813	Акции	Нет
VTBR	VTBR	Банк ВТБ ПАО	RU000A0JP5V6	Акции	Нет
GAZP	GAZP	Газпром ПАО	RU0007661625	Акции	Нет
GMKN	GMKN	ГМК Норильский Никель ПАО	RU0007288411	Акции	Нет
IRAO	IRAO	Ингер РАО ПАО	RU000A0JPNM1	Акции	Нет
X5	X5	Корпоративный центр ИКС 5 ПАО	RU000A108X38	Акции	Нет
LKOH	LKOH	ЛУКОЙЛ ПАО	RU0009024277	Акции	Нет
YDEX	YDEX	МКПАО ЯНДЕКС	RU000A107T19	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
PLZL	PLZL	Полос ПАО	RU000A0JNAA8	Акции	Нет
RTKM	RTKM	Ростелеком ПАО	RU0008943394	Акции	Нет
SBER	SBER	Сбербанк ПАО	RU0009029540	Акции	Нет
CHMF	CHMF	Северсталь ПАО	RU0009046510	Акции	Нет
FLOT	FLOT	Совкомфлот	RU000A0JXNU8	Акции	Нет
SNGS	SNGS	Сургутнефтегаз ПАО	RU0008926258	Акции	Нет
TATN	TATN	Татнефть ПАО	RU0009033591	Акции	Нет
T	T	T-Технологии МКПАО	RU000A107UL4	Акции	Нет
PHOR	PHOR	ФосАгро	RU000A0JRKT8	Акции	Нет
SBERP	SBERP	Сбербанк ПАО	RU0009029557	Акции	Нет
RU000A10BFG2	Атомэнпр05	Атомэнергопром АО	RU000A10BFG2	Облигации	Нет
RU000A10C6L5	Атомэнпр07	Атомэнергопром АО	RU000A10C6L5	Облигации	Нет
RU000A10CT33	Атомэнпр08	Атомэнергопром АО	RU000A10CT33	Облигации	Нет
RU000A108JV4	ГазпКап3P2	Газпром капитал ООО	RU000A108JV4	Облигации	Нет
RU000A105BY1	ГазК3-28E	Газпром капитал ООО	RU000A105BY1	Облигации	Нет
RU000A105A95	ГазК3-34Д	Газпром капитал ООО	RU000A105A95	Облигации	Нет
RU000A105RH2	ГазК3-37Д	Газпром капитал ООО	RU000A105RH2	Облигации	Нет
RU000A109B33	Газпн3P13R	Газпром нефть ПАО	RU000A109B33	Облигации	Нет
RU000A10BK09	Газпн3P14R	Газпром нефть ПАО	RU000A10BK09	Облигации	Нет
RU000A10BK17	Газпн3P15R	Газпром нефть ПАО	RU000A10BK17	Облигации	Нет
RU000A1083A6	НорНикБ1P7	ГМК Норильский Никель ПАО	RU000A1083A6	Облигации	Нет
RU000A102DB2	ГПБ001P18P	ГПБ КБ	RU000A102DB2	Облигации	Нет
RU000A102GJ8	ГПБ001P19P	ГПБ КБ	RU000A102GJ8	Облигации	Нет
RU000A105GW4	ГПБ001P22P	ГПБ КБ	RU000A105GW4	Облигации	Нет
RU000A10ANZ8	Магнит5P01	Магнит ПАО	RU000A10ANZ8	Облигации	Нет
RU000A10B0A2	Магнит5P03	Магнит ПАО	RU000A10B0A2	Облигации	Нет
RU000A10C618	Магнит4P08	Магнит ПАО	RU000A10C618	Облигации	Нет
RU000A10BF48	ЯНДЕКС1P1	МКПАО ЯНДЕКС	RU000A10BF48	Облигации	Нет
RU000A10CMT9	ЯНДЕКС1P2	МКПАО ЯНДЕКС	RU000A10CMT9	Облигации	Нет
RU000A1083U4	МТС 2P-04	МТС ПАО	RU000A1083U4	Облигации	Нет
RU000A1083W0	МТС 2P-05	МТС ПАО	RU000A1083W0	Облигации	Нет
RU000A10BW62	МТС 2P-12	МТС ПАО	RU000A10BW62	Облигации	Нет
RU000A10CQ85	МТС 1P-29	МТС ПАО	RU000A10CQ85	Облигации	Нет
RU000A0JUAH8	РЖД-30 обл	РЖД ОАО	RU000A0JUAH8	Облигации	Нет
RU000A108Z85	РЖД 1P-32R	РЖД ОАО	RU000A108Z85	Облигации	Нет
RU000A10AUE8	РЖД 1P-36R	РЖД ОАО	RU000A10AUE8	Облигации	Нет
RU000A10AZ45	РЖД 1P-37R	РЖД ОАО	RU000A10AZ45	Облигации	Нет
RU000A10AZ60	РЖД 1P-38R	РЖД ОАО	RU000A10AZ60	Облигации	Нет

Код актива (Московская Биржа)	Краткое наименование актива	Эмитент	ISIN	Тип актива	Разрешены Непокрытые и (или) Временно непокрытые позиции
RU000A10B115	РЖД 1P-40R	РЖД ОАО	RU000A10B115	Облигации	Нет
RU000A10BGF2	РЖД 1P-42R	РЖД ОАО	RU000A10BGF2	Облигации	Нет
RU000A10BTA6	РЖД 1P-43R	РЖД ОАО	RU000A10BTA6	Облигации	Нет
RU000A10C8C0	РЖД 1P-44R	РЖД ОАО	RU000A10C8C0	Облигации	Нет
RU000A10CDZ5	РЖД 1P-45R	РЖД ОАО	RU000A10CDZ5	Облигации	Нет
RU000A109X29	РостелP12R	Ростелеком ПАО	RU000A109X29	Облигации	Нет
RU000A10A349	РусГид2P01	РусГидро ПАО	RU000A10A349	Облигации	Нет
RU000A10AEB8	РусГид2P05	РусГидро ПАО	RU000A10AEB8	Облигации	Нет
RU000A10BRR4	РусГид2P06	РусГидро ПАО	RU000A10BRR4	Облигации	Нет
RU000A10CC24	РусГид2P07	РусГидро ПАО	RU000A10CC24	Облигации	Нет
RU000A10BZH8	Сбер Sbd7R	Сбербанк ПАО	RU000A10BZH8	Облигации	Нет
RU000A10C8S6	Сбер Sbd8R	Сбербанк ПАО	RU000A10C8S6	Облигации	Нет
RU000A109K40	ФосАгро П2	ФосАгро	RU000A109K40	Облигации	Нет
SU26207RMFS9	ОФЗ 26207	Минфин России	RU000AOJS3W6	ОФЗ	Нет
SU26212RMFS9	ОФЗ 26212	Минфин России	RU000AOJTK38	ОФЗ	Нет
SU26218RMFS6	ОФЗ 26218	Минфин России	RU000AOJW48	ОФЗ	Нет
SU26219RMFS4	ОФЗ 26219	Минфин России	RU000AOJWM07	ОФЗ	Нет
SU26221RMFS0	ОФЗ 26221	Минфин России	RU000AOJXFM1	ОФЗ	Нет
SU26224RMFS4	ОФЗ 26224	Минфин России	RU000AOZYUA9	ОФЗ	Нет
SU26225RMFS1	ОФЗ 26225	Минфин России	RU000AOZYUB7	ОФЗ	Нет
SU26226RMFS9	ОФЗ 26226	Минфин России	RU000AOZZYW2	ОФЗ	Нет
SU26228RMFS5	ОФЗ 26228	Минфин России	RU000A100A82	ОФЗ	Нет
SU26230RMFS1	ОФЗ 26230	Минфин России	RU000A100EF5	ОФЗ	Нет
SU26232RMFS7	ОФЗ 26232	Минфин России	RU000A1014N4	ОФЗ	Нет
SU26233RMFS5	ОФЗ 26233	Минфин России	RU000A101F94	ОФЗ	Нет
SU26235RMFS0	ОФЗ 26235	Минфин России	RU000A1028E3	ОФЗ	Нет
SU26236RMFS8	ОФЗ 26236	Минфин России	RU000A102BT8	ОФЗ	Нет
SU26237RMFS6	ОФЗ 26237	Минфин России	RU000A1038Z7	ОФЗ	Нет
SU26238RMFS4	ОФЗ 26238	Минфин России	RU000A1038V6	ОФЗ	Нет
SU26239RMFS2	ОФЗ 26239	Минфин России	RU000A103901	ОФЗ	Нет
SU26240RMFS0	ОФЗ 26240	Минфин России	RU000A103BR0	ОФЗ	Нет
SU26241RMFS8	ОФЗ 26241	Минфин России	RU000A105FZ9	ОФЗ	Нет
SU26242RMFS6	ОФЗ 26242	Минфин России	RU000A105RV3	ОФЗ	Нет
SU26243RMFS4	ОФЗ 26243	Минфин России	RU000A106E90	ОФЗ	Нет
SU26244RMFS2	ОФЗ 26244	Минфин России	RU000A1074G2	ОФЗ	Нет
SU26245RMFS9	ОФЗ 26245	Минфин России	RU000A108EG6	ОФЗ	Нет
SU26246RMFS7	ОФЗ 26246	Минфин России	RU000A108EE1	ОФЗ	Нет
SU26247RMFS5	ОФЗ 26247	Минфин России	RU000A108EF8	ОФЗ	Нет
SU26248RMFS3	ОФЗ 26248	Минфин России	RU000A108EH4	ОФЗ	Нет
SU26249RMFS1	ОФЗ 26249	Минфин России	RU000A108VC8	ОФЗ	Нет
SU26250RMFS9	ОФЗ 26250	Минфин России	RU000A108VH7	ОФЗ	Нет
SU29007RMFS0	ОФЗ 29007	Минфин России	RU000AOJV4M0	ОФЗ	Нет
SU29008RMFS8	ОФЗ 29008	Минфин России	RU000AOJV4P3	ОФЗ	Нет
SU29009RMFS6	ОФЗ 29009	Минфин России	RU000AOJV4N8	ОФЗ	Нет
SU29010RMFS4	ОФЗ 29010	Минфин России	RU000AOJV4Q1	ОФЗ	Нет
SU29013RMFS8	ОФЗ 29013	Минфин России	RU000A101KT1	ОФЗ	Нет
SU29015RMFS3	ОФЗ 29015	Минфин России	RU000A1025A7	ОФЗ	Нет
SU29016RMFS1	ОФЗ 29016	Минфин России	RU000A1025B5	ОФЗ	Нет
SU29018RMFS7	ОФЗ 29018	Минфин России	RU000A102A31	ОФЗ	Нет
SU29019RMFS5	ОФЗ 29019	Минфин России	RU000A102A49	ОФЗ	Нет
SU29020RMFS3	ОФЗ 29020	Минфин России	RU000A102BV4	ОФЗ	Нет
SU29021RMFS1	ОФЗ 29021	Минфин России	RU000A105B11	ОФЗ	Нет
SU29022RMFS9	ОФЗ 29022	Минфин России	RU000A105G16	ОФЗ	Нет
SU29023RMFS7	ОФЗ 29023	Минфин России	RU000A105L19	ОФЗ	Нет
SU29024RMFS5	ОФЗ 29024	Минфин России	RU000A1066D5	ОФЗ	Нет
SU29025RMFS2	ОФЗ 29025	Минфин России	RU000A106Z61	ОФЗ	Нет
SU29027RMFS8	ОФЗ 29027	Минфин России	RU000A10AA93	ОФЗ	Нет
SU52002RMFS1	ОФЗ 52002	Минфин России	RU000AOZYZ26	ОФЗ	Нет
SU26252RMFS5	ОФЗ 26252	Минфин России	RU000A10D4Y2	ОФЗ	Нет
SU26251RMFS7	ОФЗ 26251	Минфин России	RU000A10CKT3	ОФЗ	Нет
RU000A10DQB6	ОФЗ 29 CNY	Минфин России	RU000A10DQB6	ОФЗ	Нет
RU000A10DQA8	ОФЗ 33 CNY	Минфин России	RU000A10DQA8	ОФЗ	Нет
RU000A10A851	РФ 30 27 Д	Минфин России	RU000A10A851	ОФЗ	Нет
RU000A10A869	РФ 30 28 Д	Минфин России	RU000A10A869	ОФЗ	Нет
RU000A10A8A6	РФ 30 29 Д	Минфин России	RU000A10A8A6	ОФЗ	Нет
RU000A10A8E8	РФ 30 30 Д	Минфин России	RU000A10A8E8	ОФЗ	Нет
RU000A10A7Y8	РФ 30 35 Д	Минфин России	RU000A10A7Y8	ОФЗ	Нет
RU000A10A802	РФ 30 42 Д	Минфин России	RU000A10A802	ОФЗ	Нет
RU000A10A877	РФ 30 43 Д	Минфин России	RU000A10A877	ОФЗ	Нет
RU000A10A844	РФ 30 47 Д	Минфин России	RU000A10A844	ОФЗ	Нет
RU000A10A828	РФ 30 27 Е	Минфин России	RU000A10A828	ОФЗ	Нет
RU000A10A836	РФ 30 32 Е	Минфин России	RU000A10A836	ОФЗ	Нет
RU000A10A893	РФ 30 36 Е	Минфин России	RU000A10A893	ОФЗ	Нет