

Сведения о размерах начальной и минимальной маржи

Наименование клиента: Test
Договор на брокерское обслуживание: XXXXX от 09.06.2012
Дата отчета: 10.12.2020

Сумма ДС в портфеле с учетом плановой позиции, руб	-927739,23
Стоимость ликвидных ЦБ в составе портфеля с учетом плановой позиции, руб	1 271 328,00
Стоимость портфеля с учетом ликвидных ЦБ, руб	343 588,77

Сумма ДС в портфеле = Остаток ДС в портфеле + ДС, которые должны поступить в портфель в результате исполнения всех обязательств - ДС, которые должны уйти из портфеля клиента.

Стоимость ликвидных ЦБ = стоимость ликвидных ценных бумаг в составе портфеля + стоимость ликвидных ЦБ, которые должны поступить в портфель в результате исполнения всех обязательств - стоимость ликвидных ЦБ, которые должны уйти из портфеля в результате исполнения всех обязательств. Оценка стоимости ЦБ по цене последней сделки.

Стоимость портфеля = Сумма ДС в портфеле с учетом плановой позиции + Стоимость ликвидных ЦБ в составе портфеля с учетом плановой позиции.

Наименование ЦБ	Количество ЦБ с учетом плановой позиции	Цена последней сделки	Стоимость ЦБ по цене последней сделки, руб	Начальная ставка риска понижения цены (Long)	Начальная ставка риска повышения цены (Short)	Размер маржи по ЦБ с учетом начальной ставки риска
Лукойл-во-ао	-20	1 965,60	-39 312,00	0,2	0,2	7862,4
ГМК НорНик-во-ао	90	5 963,00	536 670,00	0,2	0,2	107334
Газпром-ао	3000	135,89	407 670,00	0,2	0,2	81534
Интер РАО ЕЭС - в3-ао	45000000	0,008140	366 300,00	0,4	0,4	146520

Размер маржи по ЦБ с учетом начальной ставки риска = Стоимость ЦБ по цене последней сделки * начальную ставку риска. Если количество ЦБ в портфеле отрицательное, то берется начальная ставка риска повышения цены, если количество ЦБ положительное, то берется начальная ставка риска понижения цены.

Ставки риска рассчитываются в соответствии с приказом ЦБ РФ №5636-У

Размер начальной маржи, Mo	343 250,40
Размер минимальной маржи, Mx	171 625,20
Требования	0,00
Уровень достаточности средств	1,00
НПР1	338,37
НПР2	171 963,57

Размер начальной маржи равен сумме размеров маржи по ЦБ с учетом начальной ставки риска. Размер минимальной маржи равен 0.5 от размера начальной маржи

Требование показывает, насколько стоимость портфеля меньше размера начальной маржи. Если стоимость портфеля больше или равна размеру начальной маржи, то значение равно 0. Если стоимость портфеля меньше размера начальной маржи, то значение равно разности между размером начальной маржи и стоимостью портфеля.

Норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента (НПР2) рассчитывается как : Стоимость портфеля - Размер минимальной маржи.

Норматив покрытия риска при исполнении поручений клиента рассчитывается как : Стоимость портфеля - Размер

Уровень достаточности средств (УДС) рассчитывается как : (Стоимость портфеля - Размер минимальной маржи)/(Размер начальной маржи - Размер минимальной маржи). введены ограничения: по минимальному значению - "-9,99", по максимальному значению - "9,99".
Если:
УДС >1 - достаточно средств для торгов.
0 < УДС ≤ 1 - недостаточно средств для открытия позиции;
УДС < 0 - маржин колл