

Приложение 2
к Соглашению о порядке обслуживания
на валютном рынке ООО «Компания БКС»

Утверждено
общим собранием участников
Общества с ограниченной ответственностью
“Компания Брокеркредитсервис”
Протокол № 34 от «18» августа 2017 года

ПОРЯДОК РАСЧЕТА ПОКАЗАТЕЛЕЙ
ДЛЯ ЦЕЛЕЙ ИСПОЛНЕНИЯ СОГЛАШЕНИЯ О ПОРЯДКЕ ОБСЛУЖИВАНИЯ
НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ ООО «КОМПАНИЯ БКС»

I. Общие положения

1. Настоящий Порядок расчета показателей для целей исполнения Соглашения о порядке обслуживания на валютном рынке ООО «Компания БКС» (далее – Порядок) определяет порядок расчета показателей, используемых Клиентом, у которого сгруппирован Валютный портфель, и ООО «Компания БКС» при принятии и исполнении поручений Клиента на заключение сделок покупки-продажи иностранной валюты в торговой системе ПАО Московская Биржа (Валютный рынок).
2. Настоящий Порядок является неотъемлемой частью Соглашения о порядке обслуживания на валютном рынке клиентов Общества с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис» (Приложение № 5 к Регламенту) (далее – Соглашение). Условия настоящего порядка являются обязательными для ООО «Компания БКС» и Клиента с момента акцепта Клиентом условий Соглашения в порядке, предусмотренном Соглашением.
3. Настоящий Порядок не применяется для расчета показателей при принятии и исполнении поручений на заключение сделок покупки-продажи иностранной валюты в торговой системе ПАО Московская Биржа (Валютный рынок), поданных Клиентами – физическими лицами, обслуживаемыми с использованием веб-портала «Тинькофф». Расчет показателей стоимости портфеля, значение начальной маржи, скорректированной с учетом поручения Клиента, размер минимальной маржи, по Портфелю Клиента, обслуживаемого с использованием веб-портала «Тинькофф», осуществляется в порядке, предусмотренном Приложениями 1-2 к Соглашению о совершении сделок с неполным покрытием Общества с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис» (Приложение № 7 к Регламенту).
4. Настоящий Порядок не применяется для расчета показателей при принятии и исполнении поручений на заключение сделок покупки-продажи иностранной валюты в торговой системе ПАО Московская Биржа (Валютный рынок), поданных Клиентами – физическими лицами, обслуживаемыми с использованием Приложения «Источник» или Приложения «Simple Invest». Расчет показателей стоимости портфеля, значение начальной маржи, скорректированной с учетом поручения Клиента, размер минимальной маржи, по Портфелю Клиента, обслуживаемого с использованием Приложения «Источник» или Приложения «Simple Invest», осуществляется в порядке, предусмотренном Приложениями 1-2 к Соглашению о совершении сделок с неполным покрытием Общества с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис» (Приложение № 7 к Регламенту).
5. Настоящий Порядок не применяется для расчета показателей при принятии и исполнении поручений на заключение сделок покупки-продажи иностранной валюты в торговой системе ПАО Московская Биржа (Валютный рынок), поданных Клиентами – физическими лицами, обслуживаемыми с использованием Системы Fins. Расчет показателей стоимости портфеля, значение начальной маржи, скорректированной с учетом поручения Клиента, размер минимальной маржи, по Портфелю Клиента, обслуживаемого с использованием Системы Fins, осуществляется в порядке, предусмотренном Приложениями 1-2 к Соглашению о совершении сделок с неполным покрытием Общества с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис» (Приложение № 7 к Регламенту).
6. Настоящий Порядок не применяется для расчета показателей при принятии и исполнении поручений на заключение сделок покупки-продажи иностранной валюты в торговой системе ПАО Московская Биржа (Валютный рынок), поданных Клиентами, у которых в соответствии с Приложением № 7 к Регламенту сгруппирован Объединенный портфель Клиента (фондовый и валютный рынки) или Объединенный портфель Клиента (фондовый, валютный и срочный рынки).
7. Термины и определения, используемые в настоящем Порядке, используются в том понимании и толковании как они указаны в Регламенте оказания услуг на рынке ценных бумаг ООО «Компания БКС» (далее – Регламент), Соглашении о порядке обслуживания на валютном рынке ООО «Компания БКС» (Приложение № 5 к Регламенту), Правилах Организатора торговли и Клиринговой организации (Клирингового центра) (далее – Правилах ТС).

II. Порядок расчета показателей

1. Стоимость Валютного портфеля Клиента (S) определяется в следующем порядке:

$$S = \sum_{i \in I} S_i, \text{ где:}$$

i – i -ая валюта, $i \in RUB$ (рубли).

I – количество значений плановых позиций в расчете стоимости указанного Валютного портфеля Клиента.

S_i – значение плановой позиции по i -му валютному инструменту (значение плановой позиции по российским рублям), определенное в порядке, предусмотренном в пункте 2 настоящего Порядка;

2. Значение плановой позиции по i -му валютному инструменту (значение плановой позиции по российским рублям), определяется в следующем порядке:

$$S_i = A_i - L_i, \text{ где:}$$

A_i – значение показателя, определенного в соответствии с пунктом 3 настоящего Порядка;

L_i – значение показателя, определенного в соответствии с пунктами 4 - 5 настоящего Порядка.

3. Значение показателя A_i , предусмотренного пунктом 2 настоящего Порядка, определяется в следующем порядке:

$$A_i = \left(Q_{i,0}^A + \sum_n Q_{i,n}^A \right) \cdot FXRate_i, \text{ где:}$$

$Q_{i,0}^A$ – остаток денежных средств в единицах i -ой валюты в составе Валютного портфеля Клиента;

$Q_{i,n}^A$ – сумма денежных средств в единицах i -ой валюты, которая должна поступить в состав Валютного портфеля Клиента в результате исполнения n -го обязательства с соответствующим сроком исполнения;

$FXRate_i$ – курс i -ой иностранной валюты к рублю, определенный в соответствии с пунктом 7 настоящего приложения.

В случае если сопряженной валютой по i -ому валютному инструменту является не российский рубль, значение показателя A_i , предусмотренного пунктом 2 настоящего Порядка, определяется в следующем порядке:

$$A_i = \left(Q_{i,0}^A + \sum_n Q_{i,n}^A \right) \cdot P_{i,j} \cdot FXRate_j,$$

где:

$P_{i,j}$ – курс i -ой иностранной валюты к j -ой иностранной валюте, определенный в соответствии с пунктом 6 настоящего приложения;

$FXRate_j$ – курс j -ой иностранной валюты к рублю, определенный в соответствии с пунктом 7 настоящего приложения.

В случае наличия в разрезе одного торгового дня в Валютном портфеле Клиента плановых позиций по валютным инструментам, лоты которых номинированы в одной i -ой иностранной валюте, (плановых позиций по валютным инструментам $Currency_i, Currency_j_TOD$ и $Currency_i, Currency_j_TOM$, где $Currency_i$ – i -ая иностранная валюта, в которой выражен лот валютного инструмента, $Currency_j$ – j -ая сопряженная валюта), ООО «Компания БКС»:

3.1. учитывает остаток денежных средств в единицах i -ой иностранной валюты в составе Валютного портфеля Клиента ($Q_{i,0}^A$) при расчете показателя A_i для целей расчета значения плановой позиции по i -ой валютному инструменту (S_i) с кодом $Currency_i, Currency_j_TOD$, где $Currency_i$ – i -ая иностранная валюта, в которой выражен лот i -ого валютного инструмента, $Currency_j$ – сопряженная валюта RUB (рубли);

3.2. при расчете показателя A_i для целей расчета значения плановой позиции по иным i -ым валютным инструментам (S_i) в Валютном портфеле Клиента, лоты которых выражены в i -ой иностранной валюте, а j -ой сопряженной валютой является не RUB (рубли), принимает показатель $Q_{i,0}^A$ равным 0 (нулю).

4. Значение показателя L_i , предусмотренного пунктом 2 настоящего Порядка, где $i \neq RUB$ (рубли), определяется в следующем порядке:

$$L_i = Q_i^L \cdot FXRate_i, \text{ где:}$$

Q_i^L - сумма денежных обязательств в единицах i -ой валюты, которые должны быть исполнены из Валютного портфеля Клиента;

$FXRate_i$ - курс i -ой иностранной валюты к рублю, определенный в соответствии с пунктом 7 настоящего Порядка.

В случае если сопряженной валютой по i -ому валютному инструменту является не RUB (рубли), значение показателя L_i , предусмотренного пунктом 2 настоящего Порядка, определяется в следующем порядке:

$$L_i = Q_i^L \cdot P_{i,j} \cdot FXRate_j, \text{ где:}$$

$P_{i,j}$ – курс i -ой иностранной валюты к j -ой иностранной валюте, определенный в соответствии с пунктом 6 настоящего приложения;

$FXRate_j$ – курс j -ой иностранной валюты к рублю, определенный в соответствии с пунктом 7 настоящего приложения.

5. Значение показателя L_i , предусмотренного пунктом 2 настоящего приложения, где i -ой валютой является RUB (рубли), определяется в следующем порядке:

$$L_i = Q_i^L + Q_{i,broker}^L, \text{ где:}$$

Q_i^L - сумма денежных обязательств в рублях, которые должны быть исполнены из Валютного портфеля Клиента;

$Q_{i,broker}^L$ - суммы вознаграждения ООО «Компания БКС» и возмещения (оплаты) расходов за исполнение поручений на заключение сделок покупки-продажи иностранной валюты, на которые ООО «Компания БКС» вправе рассчитывать по Генеральному соглашению.

6. Значения показателя $P_{i,j}$ определяются исходя из информации о последнем курсе i -ой иностранной валюты к j -ой иностранной валюте (цене последней сделки, совершенной на анонимных торгах) по соответствующему i -ому валютному инструменту, сложившемся (-ейся) в ходе торгов в торговой системе ПАО Московская Биржа (Валютный рынок) в текущий торговый день. Если в указанную дату торги по соответствующему i -ому валютному инструменту в торговой системе ПАО Московская Биржа (Валютный рынок) не проводились, значения показателя $P_{i,j}$ определяются исходя из информации о последнем курсе i -ой иностранной валюты к j -ой иностранной валюте (цене последней сделки) по соответствующему i -ому валютному инструменту, сложившемся (-ейся) в ближайшую предшествующую дату проведения торгов по соответствующему i -ому валютному инструменту в торговой системе ПАО Московская Биржа (Валютный рынок).

Настоящим Клиент и ООО «Компания БКС» пришли к соглашению, что информация о значениях показателя $P_{i,j}$, подлежащего применению в рамках Соглашения, предоставляется ООО «Компания БКС» Клиенту посредством программного обеспечения QUIK MP «Брокер». Также указанная информация может быть получена Клиентом самостоятельно из открытых источников, в том числе, но, не ограничиваясь, получена с официального сайта Организатора торговли – ПАО Московская Биржа <http://moex.com/>.

7. Значения показателя $FXRate_i$, $FXRate_j$ определяются соответственно исходя из информации о последнем курсе i -ой (j -ой) иностранной валюты к рублю (цене последней сделки, совершенной на анонимных торгах) по соответствующему i -ому (j -ому) валютному инструменту, сложившемся (-ейся) в ходе торгов в торговой системе ПАО Московская Биржа (Валютный рынок) в текущий торговый день. Если в указанную дату торги по соответствующему i -ому (j -ому) валютному инструменту в торговой

системе ПАО Московская Биржа (Валютный рынок) не проводились, значения показателя $FXRate_i$, $FXRate_j$, определяются соответственно исходя из информации о последнем курсе i -ой (j -ой) иностранной валюты (цене последней сделки) по соответствующему i -ому (j -ому) валютному инструменту, сложившемся (-ейся) в ближайшую предшествующую дату проведения торгов по соответствующему i -ому (j -ому) валютному инструменту в торговой системе ПАО Московская Биржа (Валютный рынок). Если i -ой (j -ой) валютой является рубль, значение показателя $FXRate_i$, $FXRate_j$ принимается равным 1 (единице).

Настоящим Клиент и ООО «Компания БКС» пришли к соглашению, что информация о значения показателя $FXRate_i$, $FXRate_j$, подлежащего применению в рамках Соглашения, предоставляется ООО «Компания БКС» Клиенту посредством программного обеспечения QUIK MP «Брокер». Также указанная информация может быть получена Клиентом самостоятельно из открытых источников, в том числе, но, не ограничиваясь, получена с официального сайта Организатора торговли – ПАО Московская Биржа <http://moex.com/>.

8. Размер начальной маржи M_0 и размер минимальной маржи M_x определяется в отношении Валютного портфеля Клиента по следующим формулам:

$$M_0 = \sum_{i=1}^I \text{Max}(R_{0i}^+; R_{0i}^-); M_x = \sum_{i=1}^I \text{Max}(R_{xi}^+; R_{xi}^-), \quad \text{где:}$$

$$R_{0i}^+ = \text{Max}(S_i \times D_{0i}^+; 0); R_{0i}^- = \text{Max}(-S_i \times D_{0i}^-; 0);$$

$$R_{xi}^+ = \text{Max}(S_i \times D_{xi}^+; 0); R_{xi}^- = \text{Max}(-S_i \times D_{xi}^-; 0), \quad \text{где:}$$

S_i и I – показатели определены в соответствии с пунктами 1-2 настоящего Порядка,

D_{0i}^+ - значение начальной ставки риска уменьшения стоимости i -го валютного инструмента (в долях единицы);

D_{0i}^- - значение начальной ставки риска увеличения стоимости i -го валютного инструмента (в долях единицы);

D_{xi}^+ - значение минимальной ставки риска уменьшения стоимости i -го валютного инструмента (в долях единицы);

D_{xi}^- - значение минимальной ставки риска увеличения стоимости i -го валютного инструмента (в долях единицы).

Если i -й валютой является RUB (рубль), значения начальных ставок риска D_{0i}^+ и D_{0i}^- , значения минимальных ставок риска D_{xi}^+ и D_{xi}^- принимаются равными 0 (нулю).

Акцептом Соглашения, Клиент предоставил ООО «Компания БКС» право без дополнительного согласования и уведомления Клиента в одностороннем порядке определять значения начальных ставок риска D_{0i}^+ и D_{0i}^- , значения минимальных ставок риска D_{xi}^+ и

D_{xi}^- в отношении каждого Валютного портфеля Клиента в рамках каждого Генерального соглашения. Информация о значениях начальных и минимальных ставок риска в отношении i -ой иностранной валюты по Валютному портфелю Клиента размещается ООО «Компания БКС» на сайте www.broker.ru в сети Интернет, на конфиденциальном разделе Клиента на www-странице ООО «Компания БКС», направления по факсу, через систему Интернет-трейдинга, а равно любым иным способом обмена сообщениями, как предусмотренным, так и не предусмотренным Регламентом. Значения начальных ставок риска D_{0i}^+ и D_{0i}^- , значения минимальных ставок риска D_{xi}^+ и D_{xi}^- применяются к Валютному портфелю Клиента с момента их размещения ООО «Компания БКС» в порядке, предусмотренном настоящим пунктом Порядка.

9. Исключен.

10. Если Клиент является Клиентом, имеющим прямое подключение к ПТК Организатора торговли, для которого открыт отдельный Расчетный код в Банке НКЦ (АО) в порядке, предусмотренном Регламентом, Правилами клиринга Банка НКЦ (АО), ООО «Компания БКС» вправе определить в отношении Валютного портфеля Клиента значения начальных ставок риска D_{0i}^+ и D_{0i}^- , значения минимальных ставок риска D_{xi}^+ и D_{xi}^- в следующем порядке:

$$D_{0i}^+ = D_{xi}^+ = \frac{RR_{i,NKCBank}^+}{100};$$

$$D_{0i}^- = D_{xi}^- = \frac{RR_{i,NKCBank}^-}{100}, \quad \text{где}$$

D_{0i}^+ , D_{0i}^- , D_{xi}^+ , D_{xi}^- - показатели, определенные в пункте 8 настоящего Порядка;

$RR_{i,NKCBank}^+$ - значение ставки риска падения цены (в процентах), установленное в порядке, предусмотренном Правилами ТС, и раскрытое Клиринговой организацией (Клиринговым центром) на официальном сайте <http://www.nkcbank.ru/>.

$RR_{i,NKCBank}^-$ - значение ставки риска роста цены (в процентах), установленное в порядке, предусмотренном Правилами ТС, и раскрытое Клиринговой организацией (Клиринговым центром) на официальном сайте <http://www.nkcbank.ru/>.

ООО «Компания БКС» дополнительно не осуществляет раскрытие текущих значений показателей $RR_{i,NKCBank}^+$, $RR_{i,NKCBank}^-$ в порядке, предусмотренном пунктом 8 настоящего Порядка.

Настоящим Клиент, имеющим прямое подключение к ПТК Организатора торговли, для которого открыт отдельный Расчетный код в Банке НКЦ (АО), подтверждает, что уведомлен и согласен с тем, что Клиринговая организация (Клиринговый центр) вправе в любой момент осуществлять пересмотр и изменение любых и (или) всех риск-параметров, включая, но, не ограничиваясь, ставки риска падения/роста цены, в том числе, отдельно по Расчетному коду, открытому ООО «Компания БКС» для Клиента в Банке НКЦ (АО), по отдельной i -ой валюте. Настоящим Клиент, имеющим прямое подключение к ПТК Организатора торговли, для которого открыт отдельный Расчетный код в Банке НКЦ (АО), обязуется ежедневно не реже 1 (одного) раза в день обращаться на сайт Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) по адресу www.nkcbank.ru, на сайт ПАО Московская Биржа

Приложение №2

к Соглашению о порядке обслуживания на валютном рынке клиентов
Общества с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис»

www.moex.com на соответствующие разделы указанных Интернет-сайтов для своевременного ознакомления с изменениями вышеуказанных риск-параметров, определенных Клиринговой организацией (Клиринговым центром). Риск неполучения, несвоевременного получения соответствующей необходимой информации об изменениях и ответственность за любые негативные последствия (в том числе, но, не ограничиваясь, убытки, прерывание деловой активности и т.д.) для Клиента и (или) третьих лиц, за счет и в интересах которых действует Клиент, связанные с неполучением/несвоевременным получением Клиентом, третьими лицами, за счет которых действует Клиент, соответствующей необходимой информации об изменениях несет исключительно Клиент. Настоящим Клиент подтверждает, что ООО «Компания БКС» не несет ответственность за любые негативные последствия (в том числе, но, не ограничиваясь, убытки, прерывание деловой активности и т.д.) для Клиента и (или) третьих лиц, за счет и в интересах которых действует Клиент, связанные с неполучением/несвоевременным получением Клиентом соответствующей необходимой информации об изменениях вышеуказанных риск-параметров, определенных Клиринговой организацией (Клиринговым центром).

11. Настоящим Клиент, заявляет и подтверждает, что в случае, если стоимость Валютного портфеля Клиента (S), рассчитанная ООО «Компания БКС» в соответствии с настоящим Порядком, становится менее или равной 1 000 (одной тысяче) рублей, ООО «Компания БКС» вправе с момента наступления указанного обстоятельства и до предоставления ООО «Компания БКС» Клиенту возможности совершения сделок с неполным покрытием без дополнительного уведомления Клиента установить (принять) по Валютному портфелю Клиента значения начальных ставок риска D_{0i}^+ и D_{0i}^- , значения минимальных ставок риска D_{Xi}^+ и D_{Xi}^- ,

предусмотренные пунктом 8 настоящего Порядка, равными 1 (единице), вне зависимости от изменения стоимости Валютного портфеля Клиента в последующие периоды, при этом ООО «Компания БКС» вправе не принимать и не исполнять поручения Клиента на совершение сделки покупки-продажи иностранной валюты, операции, в результате возникновения которого в Валютном портфеле Клиента появится непокрытая позиция в разрезе любого срока исполнения обязательства по указанной сделке, операции. Настоящим Клиент заявляет и подтверждает, что ООО «Компания БКС» вправе без объяснения причин отказать Клиенту, использующему режим совершения сделок с полным покрытием в связи с наступлением обстоятельства, предусмотренного настоящим пунктом Порядка, в предоставлении возможности совершения сделок с неполным покрытием, вне зависимости стоимости Валютного портфеля Клиента на момент обращения Клиента в ООО «Компания БКС» с соответствующим заявлением.

12. При расчете скорректированного размера начальной маржи учитываются вновь поданное поручение Клиента на заключение сделки покупки-продажи иностранной валюты (далее - новое поручение), а также его поручения, которые были приняты ООО «Компания БКС» к исполнению ранее, но в момент расчета скорректированного размера начальной маржи не отменены и не исполнены, или не отменены и исполнены не полностью. При этом в расчете скорректированного размера начальной маржи учитываются только поручения Клиента, которые не предусматривают отлагательных условий для их исполнения, а также поручения Клиента, которые предусматривают отлагательные условия, и на момент расчета скорректированного размера начальной маржи наступили обстоятельства, от которых в соответствии с указанными условиями поставлено в зависимость исполнение этих поручений.

При расчете скорректированного размера начальной маржи не учитываются поручения на заключение сделки своп.

13. Скорректированный размер начальной маржи M_0^{order} определяется по правилам, предусмотренным в пункте 7 настоящего Порядка. При этом для целей определения M_0^{order} , величины R_{0i}^+ и R_{0i}^- определяются в следующем порядке:

$$R_{0i}^+ = S_i - S_i^+ + \sum_{k \in K_i^A} Q_{i,k}^A \cdot P_{i,k} + \dot{R}_{0i}^+;$$

$$R_{0i}^- = S_i - S_i^- - \sum_{k \in K_i^L} Q_{i,k}^L \cdot P_{i,k} + \dot{R}_{0i}^-,$$

где:

S_i - показатель, определяемый в порядке, предусмотренном в пункте 2 настоящего Порядка;

S_i^+ и S_i^- - показатели, определяемые в порядке, предусмотренном в пункте 14 настоящего Порядка;

K_i^A - множество учитываемых поручений Клиента, в результате исполнения которых i -ая иностранная валюта должна поступить в состав Валютного портфеля Клиента;

K_i^L - множество учитываемых поручений Клиента, в результате исполнения которых i -ая иностранная валюта должна быть передана из состава Валютного портфеля Клиента;

$Q_{i,k}^A$ - количество i -ой иностранной валюты, которая соответственно должна поступить в состав Валютный портфеля Клиента и должна быть передана из состава Валютного портфеля Клиента в результате исполнения k -го учитываемого поручения Клиента;

$Q_{i,k}^L$ - количество i -ой иностранной валюты, которая соответственно должна быть передана из состава Валютного портфеля Клиента в результате исполнения k -го учитываемого поручения Клиента;

$P_{i,k}$ - выраженный в рублях курс i -ой иностранной валюты, определяемый в порядке, предусмотренном в пункте 16 настоящего приложения;

\dot{R}_{0i}^+ , \dot{R}_{0i}^- - показатели риска, определенные в порядке, предусмотренном в пункте 17 настоящего Порядка.

14. Показатели S_i^+ и S_i^- определяются в следующем порядке:

$$S_i^+ = \left(\frac{S_i}{P_{i,j} \cdot FXRate_j} + \sum_{k \in K_i^A} Q_{i,k}^A \right) \cdot P_i^+;$$

$$S_i^- = \left(\frac{S_i}{P_{i,j} \cdot FXRate_j} - \sum_{k \in K_i^L} Q_{i,k}^L \right) \cdot P_i^- ,$$

где:

$S_i, P_{i,j}, FXRate_j$ - величины, определяемые в соответствии с пунктах 2, 6, 7 настоящего Порядка;

$K_i^A, K_i^L, Q_{i,k}^A, Q_{i,k}^L$ - величины, определяемые в порядке, предусмотренном в пункте 13 настоящего Порядка;

P_i^+ и P_i^- - соответственно наименьшая и наибольшая цена (курс) i -ой валюты, определяемые в порядке, предусмотренном в пункте 15 настоящего Порядка.

Если j -ой валютой является RUB (рубль), $FXRate_j$ принимается равным 1 (единице).

15. Наименьшая цена (курс) P_i^+ и наибольшая цена (курс) P_i^- i -ой валюты в разрезе соответствующего срока исполнения обязательств по сделке покупки-продажи иностранной валюты определяются в следующем порядке:

$$P_i^+ = \min_{K \in M_i^A} (P_{i,j} \cdot FXRate_j ; P_{i,k}) ; P_i^- = \max_{K \in M_i^L} (P_{i,j} \cdot FXRate_j ; P_{i,k}) ,$$

где:

$P_{i,j}, FXRate_j$ - величины, определяемые в соответствии с пунктах 6, 7 настоящего Порядка;

P_i - курс i -ой иностранной валюты к рублю (цена последней сделки, совершенной на анонимных торгах) по соответствующему i -ому валютному инструменту с кодом *sigтeпcу_ТОМ*, где *sigтeпcу* - i -ая иностранная валюта, сложившемся (-ейся) в текущий торговый день в ходе торгов в торговой системе ПАО Московская Биржа (Валютный рынок).

$P_{i,k}$ определяется в порядке, предусмотренном в пункте 16 настоящего Порядка;

M_i^A и M_i^L - множества учитываемых поручений на покупку и учитываемых поручений на продажу i -ой иностранной валюты в разрезе соответствующего срока исполнения обязательств по сделке покупки-продажи иностранной валюты, при условии, что указанные поручения исполняются на анонимных торгах и (или) на организованных торгах, предусматривающих совершение сделок только по наилучшим ценам (далее - конкурентные поручения).

Если i -ой валютой является рубль, значение показателей P_i^+ , P_i^- принимается равным 1 (единице).

Если j -ой валютой является рубль, $FXRate_j$ принимается равным 1 (единице).

16. Если в поручении на заключение сделки покупки-продажи i -ой иностранной валюты в разрезе соответствующего срока исполнения обязательства по такой сделке, не указана цена (курс) i -ая иностранной валюты, значение показателя $P_{i,k}$ определяется в следующем порядке:

$$P_{i,k} = P_{i,j} \cdot FXRate_j , \text{ где}$$

$P_{i,j}, FXRate_j$ - величины, определяемые в соответствии с пунктах 6, 7 настоящего Порядка;

17. Значения показателей \dot{R}_{0i}^+ , \dot{R}_{0i}^- определяются в следующем порядке:

$$\dot{R}_{0i}^+ = \text{Max} (S_i \times D_{0i}^+ ; 0) ; \dot{R}_{0i}^- = \text{Max} (0 ; -S_i \times D_{0i}^-) , \text{ где:}$$

S_i^+ и S_i^- - показатели, определяемые в порядке, предусмотренном в пункте 14 настоящего Порядка;

D_{0i}^+ , D_{0i}^- - показатели, определенные в пункте 8 настоящего Порядка.