

«УТВЕРЖДАЮ»

Генеральный директор
ООО ВТБ Форекс



/Самусёв Д.А./

«27» сентября 2021 г.

ООО ВТБ Форекс
г. Москва

ПОЛОЖЕНИЕ

о порядке расчета размера требуемого обеспечения

Оглавление:

1. Термины и определения	3
2. Общие положения	3
3. Порядок расчета размера требуемого обеспечения	4
4. Заключительные положения	5

1. Термины и определения

- 1.1. **Базовый стандарт совершения операций на финансовом рынке** – Базовый стандарт совершения операций на финансовом рынке при осуществлении деятельности форекс-дилера, утвержденный Банком России.
- 1.2. **Квалифицированный инвестор** – клиент, являющийся квалифицированным инвестором в силу федерального закона или клиент, признанный Компанией квалифицированным инвестором на основании и в порядке, определенном Положением о признании лиц квалифицированными инвесторами.
- 1.3. **Компания** – ООО ВТБ Форекс.
- 1.4. **Личный кабинет клиента** – конфиденциальный раздел в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», используемый для предоставления отчетов клиенту в электронной форме, обмена документами, иной информацией между Компанией и клиентом.
- 1.5. **Сайт Компании** – официальный сайт ООО ВТБ Форекс размещенный в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» по адресу <https://vtbforex.ru>
- 1.6. **Валютная пара** - базисный актив отдельного договора, в основе которого лежит соотношение цены одной валюты по отношению к другой.
- 1.7. **Базовая валюта** - первая валюта в обозначении валютной пары, которая является базисным активом отдельного договора.
- 1.8. **Валюта котировки (контрвалюта)** - вторая валюта в обозначении валютной пары
- 1.9. **Валюта счета (расчетов)** - валюта, в которой выражены обязательства сторон по отдельному договору и валюта в которой производятся расчеты.
- 1.10. **Лот** - стандартный размер ПФИ/отдельного договора, устанавливаемый Компанией.
- 1.11. **Отдельный договор** – заключение между Компанией и клиентом Компании договора, являющегося производным финансовым инструментом (далее – ПФИ), предусматривающего покупку валютной пары или продажу валютной пары, с расчетом на согласованную дату валютирования. Указанные операции предполагают осуществление как минимум двух противоположных сделок по покупке и продаже ПФИ, на одинаковую сумму и не предполагают осуществление поставки валют по заключенным сделкам.
- 1.12. **Требуемое обеспечение** - минимальный объем средств, необходимый для заключения форекс-дилером договоров, указанных в пункте 1 статьи 4.1 Федерального закона от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг», с физическим лицом, не являющимся индивидуальным предпринимателем и не признанным квалифицированным инвестором.

2. Общие положения

- 2.1. Настоящее Положение о порядке расчета размера требуемого обеспечения (далее – Положение) разработано в целях исполнения п. 7 Раздела IV Базового стандарта совершения операций на финансовом рынке, а также регламентирует порядок расчета размера требуемого обеспечения, при котором Компания вправе заключать с физическим лицом, не являющимся индивидуальным предпринимателем и не признанным квалифицированным инвестором, договоры, указанные в пункте 1 статьи 4.1. Федерального закона от 22.04.1996 N 39-ФЗ "О рынке ценных бумаг".
- 2.2. Размер требуемого обеспечения рассчитывается Компанией на каждый торговый день по каждой валютной паре.
- 2.3. Установленный Компанией размер требуемого обеспечения по каждой валютной паре для 0,1 (ноль целых одной десятой) лота по такой валютной паре размещается на сайте Компании, а также в Личном кабинете клиента в срок не позднее начала соответствующего торгового дня.
- 2.4. Порядок расчета размера требуемого обеспечения указан в п.3 настоящего Положения.

3. Порядок расчета размера требуемого обеспечения

3.1. Моментом времени, по состоянию на который рассчитывается размер требуемого обеспечения по каждой валютной паре, является 00 часов 01 минута каждого торгового дня.

3.2. Для определения размера требуемого обеспечения Компания использует последние доступные данные о размере требуемого обеспечения для заключения отдельных договоров покупки (ставка риска падения) соответствующей валютной пары и / или продажи (ставка риска роста) соответствующей валютной пары, полученные от ПАО «Московская биржа ММВБ-РТС» (www.moex.com) в соответствии с заключенным с указанной организацией договором к моменту расчета размера требуемого обеспечения Компанией.

3.3. Компания вправе также самостоятельно рассчитывать размер требуемого обеспечения на основании собственных исторических данных.

3.4. Размер требуемого обеспечения рассчитывается исходя из того, что значение двухдневного изменения курса валютной пары к рублю в 99 процентах случаев находится в пределах одностороннего доверительного интервала в распределении таких значений не менее чем за последние 365 дней в следующем порядке:

3.4.1. для каждого торгового дня из установленного периода наблюдений, начиная со второго, рассчитывается значение относительного изменения цены валютной пары к рублю по формуле:

$$(R / R-1) - 1, \text{ где:}$$

R - курс валютной пары по итогам торгов в торговый день i ;

$R-1$ - курс валютной пары по итогам торгов в предыдущий торговый день $i-1$;

3.4.2. в случае, если валюта котировки (контрвалюта) валютной пары является отличной от рубля, для ее конвертации к рублю используется кросс-курс валюты котировки (контрвалюты) к рублю в торговый день i и торговый день $i-1$ соответственно;

3.4.3. на основании полученного множества значений относительного изменения курса каждой валютной пары рассчитываются показатели однодневного Value at risk (VaR): VaR (1%) и (или) VaR (99%), при этом:

— под VaR (1%) понимается наименьшее значение из указанного в пункте 3.4.2. настоящего Положения множества значений относительного изменения курса валютной пары к рублю после исключения из него не более 1 (одного) процента минимальных значений.

— под VaR (99%) понимается наибольшее значение из указанного в пункте 3.4.2. настоящего Положения множества значений относительного изменения курса валютной пары к рублю после исключения из него не более 1 (одного) процента максимальных значений.

3.4.4. для преобразования полученных значений однодневного VaR: [VaR (1%) и / или VaR (99%)] в двухдневный VaR, применяется повышательный коэффициент, равный корню квадратному из двух.

3.4.5. полученные значения двухдневного VaR, преобразованные в процентный формат, составляют размер требуемого обеспечения.

При этом, одно из двух полученных значений двухдневного VaR, соответствующее понижению курса валютной пары к рублю, которое по расчету отрицательное, для целей определения размера требуемого обеспечения берется по модулю.

3.5. Компания для целей расчета требуемого размера обеспечения по отдельному договору покупки валютной пары использует наибольшую по модулю величину из значения двухдневного VaR (1%) (ставка риска падения), самостоятельно рассчитанного для валютной пары в соответствии с п.3.4, и последнего доступного на момент расчета размера требуемого обеспечения значения ставки риска падения соответствующей валютной пары, полученные от ПАО «Московская биржа ММВБ-РТС» в соответствии с заключенным с указанной организацией договором.

3.6. Компания для целей расчета требуемого размера обеспечения по отдельному договору продажи валютной пары использует наибольшую по модулю величину из значения

двухдневного VaR (99%) (ставка риска роста), самостоятельно рассчитанного для валютной пары в соответствии с п.3.4, и последнего доступного на момент расчета размера требуемого обеспечения значения ставки риска роста соответствующей валютной пары, полученные от ПАО «Московская биржа ММВБ-РТС» в соответствии с заключенным с указанной организацией договором.

3.7. Компания вправе по собственному усмотрению устанавливать требуемое обеспечение выше (больше) рассчитанного в соответствии с пунктами 3.4-3.6 настоящего Положения.

3.8. Компания размещает пример расчета размера требуемого обеспечения на сайте Компании, а также в Личном кабинете клиента.

3.9. Компания обеспечивает хранение расчета размера требуемого обеспечения для 0,1 (ноль целых одной десятой) лота по каждой валютной паре в течение 5 лет с даты расчета.

4. Заключительные положения

4.1. Настоящее Положение вступает в силу с 01.10.2021 и подлежит опубликованию на сайте Компании.