
УТВЕРЖДЕНО
Приказом
№
дата ввода в действие с
23.09.2024

ПОРЯДОК

ПОРЯДОК РАСЧЕТА РАЗМЕРА ТРЕБУЕМОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ ДЛЯ КЛИЕНТОВ ООО
«БКС – ФОРЕКС»

Выберите элемент.

Содержание

1. <i>Общие положения</i> _____	3
2. <i>Термины и сокращения</i> _____	3
3. <i>Порядок расчета размера требуемого обеспечения для клиентов</i> _____	4

1. Общие положения

1.1. Настоящий Порядок расчета размера требуемого обеспечения для клиентов, не признанных квалифицированными инвесторами и признанными квалифицированными инвесторами, (далее – Порядок) разработан во исполнение пункта 7 Раздела IV Базового стандарта совершения операций на финансовом рынке при осуществлении деятельности форекс-дилера¹ и регламентирует порядок расчета размера требуемого обеспечения, при котором ООО «БКС-Форекс» (далее – Общество) 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 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг».

1.2. Размер требуемого обеспечения рассчитывается Обществом на каждый торговый день по каждой валютной паре, входящей в перечень котироваемых валютных пар. Данный расчет производится в соответствии с п.3 настоящего Порядка.

1.3. Размер требуемого обеспечения размещается Обществом на своем сайте в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» в срок не позднее начала соответствующего торгового дня.

2. Термины и сокращения

Базовая валюта – первая валюта в обозначении валютной пары, которая является базисным активом сделки;

Валютная пара – базисный актив отдельного договора, в основе которого лежит соотношение цены одной валюты по отношению к другой валюте;

Валюта котировки – вторая валюта в обозначении валютной пары;

Валюта счета (расчетов) – валюта, в которой выражены обязательства сторон по отдельному договору, и валюта, в которой производятся расчеты;

Общество – Общество с ограниченной ответственностью «Брокеркредитсервис-Форекс»;

Клиент – физическое лицо, не являющееся индивидуальным предпринимателем;

Отдельный договор (сделка) – договор, заключаемый Обществом от своего имени и за свой счет с клиентом, не на организованных торгах договора, который является производным финансовым инструментом, обязанность сторон по которому зависит от изменения курса соответствующей валютной пары и условием заключения которого является предоставление Обществом клиенту, возможности принимать на себя обязательство размер которого превышает размер предоставленного этим клиентом обеспечения;

Период наблюдений - временной период 365 календарных дней, предшествующих дню расчета размера требуемого обеспечения;

¹ Базовый стандарт разработан Ассоциацией форекс-дилеров, утвержден и согласован в соответствии с требованиями Федерального закона от 13.07.2015 года N 223-ФЗ «О саморегулируемых организациях в сфере финансового рынка»

Сайт Общества – официальный сайт ООО «БКС-Форекс» в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» по адресу www.bcs-forex.ru;

Требуемое обеспечение – минимальный объем средств, необходимый для заключения Обществом отдельных договоров с физическим лицом, не являющимся индивидуальным предпринимателем.

3. Порядок расчета размера требуемого обеспечения для клиентов ООО «БКС – Форекс»

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 Общество использует последние доступные данные о размере требуемого обеспечения, ставке риска падения и ставке риска роста соответствующей валютной пары, полученные от ПАО «Московская биржа ММВБ-РТС» (www.moex.com) в соответствии с договором, заключенным с указанной организацией.

3.3. Общество также вправе самостоятельно рассчитывать размер требуемого обеспечения на основании собственных исторических данных или на основании исторических данных, полученных от источника в соответствии с договором, заключенным с данным источником.

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

- i. Для каждого торгового дня из установленного периода наблюдений, начиная со второго, рассчитывается значение относительного изменения цены каждой валютной пары к рублю РФ по формуле:

$$(P_i/P_{i-1}) - 1,$$

где:

P_i – курс валютной пары в торговый день i ;

P_{i-1} – курс или валютной пары в предыдущий торговый день $i-1$.

- ii. В случае, если валюта котировки валютной пары является отличной от рубля РФ, Общество для ее конвертации в рубль РФ использует кросс-курс валюты котировки к рублю РФ в торговый день i и торговый день $i-1$, соответственно.
- iii. На основании полученного множества значений относительного изменения курса каждой валютной пары рассчитываются показатели однодневного Value at risk (VaR): VaR (1%) и VaR (99%) для каждой валютной пары к рублю РФ, при этом:
 - под VaR (1%) понимается наименьшее значение из указанного в пункте 3.4 (i) настоящего Порядка множества значений относительного изменения курса валютной пары к рублю РФ после исключения из него не более 1 (одного) процента минимальных значений;

- под VaR (99%) понимается наибольшее значение из указанного в пункте 3.4 (i) настоящего Порядка множества значений относительного изменения курса валютной пары к рублю РФ после исключения из него не более 1 (одного) процента максимальных значений.
- iv. Для преобразования полученных значений однодневного VaR: [VaR (1%) и VaR (99%)] в двухдневный VaR, Общество применяет повышательный коэффициент, равный корню квадратному из двух.
- v. Полученные значения двухдневного VaR, преобразованные в процентный формат, используются для определения размера требуемого обеспечения.

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

3.5. Размер требуемого обеспечения по валютной паре принимается равным большему по модулю значению из двухдневных VaR [VaR (1%) или VaR (99%)], рассчитанных Обществом самостоятельно в соответствии пунктом 3.4, или ставок риска падения или роста соответствующей валютной пары, полученных от ПАО «Московская биржа ММББ-РТС» (www.moex.com) в соответствии с договором.

При этом, размер требуемого обеспечения должен соответствовать условиям пункта 9 статьи 4.1 Федерального закона от 22.04.1996 №39-ФЗ «О рынке ценных бумаг».

3.6. Общество вправе по собственному усмотрению устанавливать требуемое обеспечение выше (больше) рассчитанного в соответствии настоящим Порядком.

3.7. Общество размещает пример расчета размера требуемого обеспечения на сайте Общества.

3.8. Общество обеспечивает хранение расчета размера требуемого обеспечения по каждой валютной паре в течение 5 (пять) лет с даты расчета.