

Особенности совершения операций при использовании сервиса ЕДП (сервис ЕДП)

1. В сервис ЕДП по усмотрению Компании могут быть включены ТС в следующих комбинациях:
 - «Основной рынок», «Срочный рынок FORTS», «Иностранные площадки», «Валютный рынок»;
 - «Основной рынок», «Срочный рынок FORTS», «Иностранные площадки»;
 - «Основной рынок», «Иностранные площадки», «Валютный рынок».
2. При использовании сервиса ЕДП для определения возможности совершения операций и урегулирования сделок в ТС «Основной рынок», «Срочный рынок FORTS», «Иностранные площадки» и «Валютный рынок» Система использует активы клиента, зачисленные в ТС «Основной рынок» (далее счёт ЕДП).

В случае использования Клиентом сервиса ЕДП пункт 15.2. Регламента применяется со следующими ограничениями: при зачислении Компанией денежных средств на инвестиционный счет Клиента на основании банковской выписки со специального брокерского счёта Компании, Компания зачисляет денежные средства Клиента на ТС «Основной рынок» вне зависимости от указанной Клиентом в назначении платежа Торговой Системы из числа входящих в Сервис ЕДП.
3. Совершение операций в ТС «Основной рынок», «Иностранные площадки», «Валютный рынок», приводит к изменению плановых позиций по денежным средствам (включая валюту) и ценным бумагам по счёту ЕДП.
4. Требования/обязательства клиента по получению/уплате Вариационной маржи в ТС «Срочный рынок FORTS» учитываются Системой по денежной позиции счёта ЕДП.
5. Система рассчитывает стоимость портфеля в соответствии с алгоритмами, описанными в нормативных актах Банка России, в частности в указании Банка России от 26.11.2020 №5636-У (далее – Указание №5636-У). Плановая денежная позиция при расчёте формируется с учётом пунктов 2-4 настоящего Приложения.
6. Требования по начальной и минимальной марже, значения НПП1 и НПП2 по счёту ЕДП клиента рассчитываются в соответствии с алгоритмами Указания №5636-У.
7. В соответствии с Указанием №5636-У Компания вправе рассчитывать уменьшенный размер начальной маржи исходя из наличия зависимости между изменениями цен ценных бумаг, курсов иностранных валют, цен фьючерсных договоров и изменениями определенных в соответствии с п. 23 приложения к Указанию №5636-У цены (курса, пунктов) имущества, фьючерсного договора или индекса (далее – базовый индикатор). В этом случае Компания определяет набор множеств ценных бумаг, фьючерсных договоров, иностранных валют (множества с зависимыми ценами), а также соответствующие этим множествам базовые индикаторы, по отношению к которым определяются относительные ставки риска. Список ценных бумаг/фьючерсных договоров/иностранных валют, входящих во множества с зависимыми ценами, базовые индикаторы и относительные ставки риска публикуются на сайте Компании.
8. Компания вправе не заключать по поручению Клиента сделки, в результате которых величина Стоимости портфеля по счёту ЕДП станет ниже уровня начальной маржи по счёту ЕДП (значение НПП1 станет меньше 0).
9. В случае снижения Стоимости портфеля клиента по счёту ЕДП ниже Размера начальной маржи, Компания направляет Клиенту одним из предусмотренных Регламентом способов Уведомление о необходимости закрытия всех (части) позиций или доведения на счёт ЕДП активов в объёме, достаточном для повышения Стоимости портфеля до уровня величины начальной маржи.
10. При снижении Стоимости портфеля ниже Размера минимальной маржи по счёту ЕДП (при снижении величины НПП2 ниже 0) Компания в соответствии с Указанием №5636-У принудительно закрывает позиции Клиента в любой из ТС, входящих в сервис ЕДП, до восстановления факта превышения величины Стоимости портфеля над уровнем Начальной маржи.
11. При использовании сервиса ЕДП может взиматься дополнительная комиссия за недостаток средств гарантийного обеспечения. Под средствами гарантийного обеспечения в данном случае понимаются обязательства Компании перед ТС «Срочный рынок» по внесению гарантийного обеспечения на счёт Клиента под открытые Клиентом позиции в ТС «Срочный рынок». Под недостатком средств гарантийного обеспечения понимается положительное значение разности между суммой обязательств Компании по внесению ГО по всем открытым позициям Клиента в ТС «Срочный рынок FORTS» и суммой денежных

средств Клиента, предназначенных для урегулирования сделок на счёте ЕДП, но не более самой суммы обязательства по внесению ГО. При наличии такой задолженности Компания начисляет комиссионное вознаграждение на сумму задолженности, начиная с дня её образования, в соответствии с тарифами Компании.

12. В случае использования сервиса ЕДП в комбинации «Основной рынок», «Иностранные площадки» «Срочный рынок» перенос непокрытых позиций осуществляется в соответствии с Частью 9 Регламента. Определение денежной позиции, достаточной для урегулирования сделок, ведётся при этом с учётом пунктов 4-5 настоящего Приложения.
13. В случае использования сервиса ЕДП, в состав которого входит ТС «Валютный рынок», урегулирование сделок и перенос непокрытых обязательств клиента осуществляется следующим образом:
 - 13.1 Для проведения расчётов по ранее заключённым сделкам Клиент обязан:
 - до 17:00 по московскому времени обеспечить на счёте ЕДП наличие денежных средств в размере нетто-обязательств, определённых по совокупности сделок, совершённых в торговых системах, входящих в сервис ЕДП и имеющих текущую (сегодняшнюю) дату расчётов, а также с учётом пунктов 4-5 настоящего Приложения.
 - до 18:45 по московскому времени обеспечить на счёте ЕДП наличие ценных бумаг в размере нетто-обязательств, определённых по совокупности сделок, совершённых в торговых системах, входящих в сервис ЕДП и имеющих завтрашнюю (следующий торговый день) дату расчётов.
 - 13.2 Перенос позиций с использованием инструментов ТС «Основной рынок» осуществляется:
 - по ценным бумагам: в торговый день (Т-1), предшествующий дню расчётов (Т0) по соответствующей сделке после завершения торговой сессии в секции фондового рынка ПАО «Московская биржа» или в день расчётов (Т0) по соответствующей сделке в любое время до завершения торговой сессии в секции фондового рынка ПАО «Московская биржа», на усмотрение Компании;
 - по денежным средствам: в день расчётов (Т0) по соответствующей сделке после 17:00 по московскому времени..
 - 13.3 Перенос обязательств по покупке осуществляется сделкой РЕПО, в которой Клиент выступает продавцом по первой части, перенос обязательств по продаже – покупателем по первой части.
 - 13.4 Первая часть РЕПО имеет дату расчётов Т0.
 - 13.5 Цена первой части РЕПО равна цене закрытия, установленной в фондовой секции ПАО «Московская биржа» по соответствующему инструменту в день Т-1.
 - 13.6 Срок РЕПО равен количеству календарных дней между датой расчёта по первой части РЕПО и следующим торговым днём.
 - 13.7 Ставка РЕПО определяется исходя из ставок Тарифов Компании.
 - 13.8 Перенос позиции по инструментам Валютного рынка осуществляется в соответствии с пунктом 38 Регламента. Определение денежной позиции, достаточной для урегулирования сделок, осуществляется с учётом сделок переноса, закрывающих непокрытую позицию по инструментам (ценным бумагам) Основного рынка.
 - 13.9 При одновременном наличии обязательств по покупке по инструментам Основного рынка и инструментам Валютного рынка за российские рубли и при недостаточности денежных средств для их полного исполнения Компания по своему усмотрению выбирает инструменты, являющиеся предметом сделок по переносу обязательств.
14. Сервис ЕДП может быть подключён по инициативе Клиента путём направления Заявления в Компанию посредством Системы либо по инициативе Компании.
15. В случае заключения сделок в ТС ПАО «Санкт-Петербургская биржа» ЕДП с «Валютным рынком» подключается в обязательном порядке по инициативе Компании.
16. В случае противоречия настоящего Приложения общим положениям Регламента применяется настоящее Приложение.