

Особенности совершения операций при использовании сервиса ЕДП с опцией ПГО (сервис ЕДП)

1. В сервис ЕДП по усмотрению Компании могут быть включены ТС в следующих комбинациях:
 - «Основной рынок», «Срочный рынок FORTS» (в сервис ЕДП здесь и далее в Приложении №21 входят только фьючерсные контракты срочного рынка 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 любой из ТС, указанных в пункте 1 настоящего Приложения, 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. Величина Гарантийного обеспечения в ТС «Срочный рынок FORTS» рассчитывается Системой при помощи Сервиса ПГО с учётом разнонаправленных позиций по аналогичному базовому активу в других ТС (далее - портфельное ГО) и уменьшает денежную позицию счёта ЕДП. Алгоритм расчёта определяется Системой. Список инструментов, которые учитываются в портфельном ГО публикуется на сайте Компании.
6. Система рассчитывает стоимость портфеля и требования по начальной и минимальной марже в соответствии с алгоритмами, основанными на модели управления рисками Брокера и обеспечивающими соблюдение всех нормативов, установленных Банком России. Плановая денежная позиция при расчёте формируется с учётом пунктов 2-5 настоящего Приложения.
7. 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.
8. 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.
9. При снижении Стоимости портфеля ниже Размера минимальной маржи по счёту ЕДП Компания в соответствии с требованиями Банка России принудительно закрывает позиции Клиента в любой из ТС, входящих в сервис ЕДП, до восстановления факта превышения величины Стоимости портфеля над уровнем Начальной маржи.
10. При использовании сервиса ЕДП может взиматься дополнительная комиссия за недостаток средств гарантийного обеспечения. Под недостатком средств гарантийного обеспечения понимается положительное значение разности между суммой обязательств Клиента по внесению ГО по всем открытым позициям 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.
11. 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.

12. В случае использования сервиса ЕДП, в состав которого входит ТС «Валютный рынок», урегулирование сделок и перенос непокрытых обязательств клиента осуществляется следующим образом:
 - 12.1 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.
 - 12.2 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 после завершения торговой сессии в секции фондового рынка ПАО «Московская биржа», на усмотрение Компании;
 - по денежным средствам: в день расчётов (Т0) по соответствующей сделке после завершения торговой сессии в секции фондового рынка ПАО «Московская биржа».
 - 12.3 Перенос обязательств по покупке осуществляется сделкой Репо, в которой Клиент выступает продавцом по первой части, перенос обязательств по продаже – покупателем по первой части.
 - 12.4 Первая часть Репо имеет дату расчётов Т0.
 - 12.5 Цена первой части Репо равна цене закрытия, установленной в фондовой секции ПАО «Московская биржа» по соответствующему инструменту в день Т-1.
 - 12.6 Срок Репо равен количеству календарных дней между датой расчёта по первой части Репо и следующим торговым днём.
 - 12.7 Ставка Репо определяется исходя из ставок Тарифов Компании.
 - 12.8 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.
 - 12.9 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
13. В случае противоречия настоящего Приложения общим положениям Регламента применяется настоящее Приложение.