

ПРИКАЗ

Номер документа	Дата
171124/166	24.11.2017

О внесении изменений в Список ликвидных ценных бумаг для клиентов со стандартным и повышенным уровнем риска и применяемые при расчете ДСплан и ЦБплан правила определения курса иностранной валюты по отношению к рублю РФ.

Приказываю

1. В соответствии со статьей 7 Регламента брокерского обслуживания, утвержденного Приказом Генерального директора Приказом № 160623/101 от 23.06.2016., с последующими изменениями и дополнениями (далее – Регламент):

1.1. Исключить ценные бумаги, указанные в пп. 38 пункта 1 Списка (с учетом изменения нумерации, указанной в п. 1.1 настоящего Приказа), а именно:

38	ПАО «ДИКСИ Групп»	АО	+	-	1-02-40420-Н
----	-------------------	----	---	---	--------------

1.2 В связи с исключением ПАО «ДИКСИ Групп» из списка изменить нумерацию подпунктов Списка, а именно подпункты 39-62 считать подпунктами 38-61 соответственно.

1.3. Изложить Список ликвидных ценных бумаг для клиентов со стандартным и повышенным уровнем риска и применяемые при расчете ДСплан и ЦБплан правила определения курса иностранной валюты по отношению к рублю РФ в редакции Приложения № 1 к настоящему Приказу.

2. Ввести в действие указанные в п. 1. настоящего Приказа изменения и дополнения в Список, а также Список ликвидных ценных бумаг для клиентов со стандартным и повышенным уровнем риска и применяемые при расчете ДСплан и ЦБплан правила определения курса иностранной валюты по отношению к рублю РФ в редакции Приложения № 1 к настоящему Приказу начиная с «5» декабря 2017 г.

3. Уведомить Клиентов о внесении изменений в Список ликвидных ценных бумаг для клиентов со стандартным и повышенным уровнем риска и применяемые при расчете ДСплан и ЦБплан правила определения курса иностранной валюты по отношению к рублю РФ в порядке, предусмотренном статьей 7 Регламента.

4. Ознакомить с настоящим Приказом всех сотрудников.

5. Контроль за исполнением настоящего Приказа возложить на Руководителя Департамента операционной деятельности.

Генеральный директор

должность



подпись

А.Б. Калинин

расшифровка подписи

24 ноября 20 17 года

**Приложение № 1 к Приказу
Генерального директора**

Список ликвидных ценных бумаг для клиентов со стандартным и повышенным уровнем риска и применяемые при расчете ДСплан и ЦБплан правила определения курса иностранной валюты по отношению к рублю РФ

1. Список ликвидных ценных бумаг российских эмитентов для клиентов со стандартным и повышенным уровнем риска

№	Наименование эмитента	Тип ценной бумаги *	Возможность возникновения непокрытой и/или временно непокрытой позиции	Отнесение ценной бумаги к множеству ценных бумаг, коррелирующих с определенным индексом, с указанием индекса, с которым коррелирует данная ценная бумага	Государственный регистрационный номер
1	ПАО «Транснефть»	АП	+	-	2-01-00206-A
2	ПАО «Аэрофлот - российские авиалинии»	АО	-	-	1-01-00010-A
3	Банк ВТБ (ПАО)	АО	+	-	10401000B
4	ПАО «Газпром»	АО	+	-	1-02-00028-A
5	ПАО «ГМК «Норильский никель»	АО	+	-	1-01-40155-F
6	ПАО «Нефтяная компания «ЛУКОЙЛ»	АО	+	-	1-01-00077-A
7	ПАО «Магнит»	АО	+	-	1-01-60525-P
8	ОАО «Магнитогорский металлургический комбинат»	АО	-	-	1-03-00078-A
9	ПАО «МегаФон»	АО	-	-	1-01-00085-A
10	ПАО «Мосэнерго»	АО	-	-	1-01-00085-A
11	ПАО «Нефтяная компания «Роснефть»	АО	+	-	1-02-00122-A
12	ПАО «НОВАТЭК»	АО	+	-	1-02-00268-E
13	ПАО «Новолипецкий металлургический комбинат»	АО	+	-	1-01-00102-A
14	ПАО «Распадская»	АО	-	-	1-04-21725-N
15	ПАО «Российские сети»	АО	-	-	1-01-55385-E
16	ПАО «РусГидро»	АО	+	-	1-01-55038-E
17	ПАО «Сбербанк»	АО	+	-	10301481B
18	ПАО «Сбербанк»	АП	+	-	20301481B
19	ПАО «Северсталь»	АО	+	-	1-02-00143-A
20	ОАО «Сургутнефтегаз»	АО	+	-	1-01-00155-A
21	ОАО «Сургутнефтегаз»	АП	+	-	2-01-00155-A
22	ПАО «Татнефть»	АО	+	-	1-03-00161-A
23	ПАО «Татнефть»	АП	-	-	2-03-00161-A
24	ПАО «ФСК ЕЭС»	АО	+	-	1-01-65018-D
25	ПАО «Московская Биржа»	АО	+	-	1-05-08443-H

26	ПАО «Газпром нефть»	АО	+	-	1-01-00146-A
27	ПАО «АФК «Система»	АО	-	-	1-05-01669-A
28	ПАО «Юнипро»	АО	-	-	1-02-65104-D
29	ПАО «Ростелеком»	АО	+	-	1-01-00124-A
30	ПАО «Ростелеком»	АП	-	-	2-01-00124-A
31	ПАО «МТС»	АО	+	-	1-01-04715-A
32	ПАО «ИНТЕР РАО ЕЭС»	АО	-	-	1-04-33498-E
33	ПАО «АЛРОСА»	АО	+	-	1-03-40046-N
34	ПАО «Акрон»	АО	-	-	1-03-00207-A
35	ПАО АНК «Башнефть»	АО	-	-	1-01-00013-A
36	ПАО АНК «Башнефть»	АП	-	-	2-01-00013-A
37	ПАО «Группа Компаний ПИК»	АО	-	-	1-02-01556-A
38	ПАО «М.видео»	АО	-	-	1-02-11700-A
39	ПАО Мечел	АО	-	-	1-01-55005-E
40	ПАО Мечел	АП	-	-	2-01-55005-E
41	ПАО Новороссийский морской торговый порт	АО	-	-	1-01-30251-E
42	ПАО «ОГК-2»	АО	-	-	1-02-65105-D
43	ПАО «Полюс»	АО	-	-	1-01-55192-E
44	ПАО «ТГК-1»	АО	-	-	1-01-03388-D
45	ПАО «ТМК»	АО	-	-	1-01-29031-H
46	ПАО «ФосАгро»	АО	-	-	1-02-06556-A
47	Минфин России	ОФЗ	-	-	26204RMFS
48	Минфин России	ОФЗ	-	-	26221RMFS
49	Минфин России	ОФЗ	-	-	26207RMFS
50	Минфин России	ОФЗ	-	-	26208RMFS
51	Минфин России	ОФЗ	-	-	26212RMFS
52	Минфин России	ОФЗ	-	-	29006RMFS
53	Минфин России	ОФЗ	-	-	29011RMFS
54	Минфин России	ОФЗ	-	-	25081RMFS
55	Минфин России	ОФЗ	-	-	24018RMFS
56	Минфин России	ОФЗ	-	-	24019RMFS
57	Минфин России	ОФЗ	-	-	26222RMFS
58	Минфин России	ОФЗ	-	-	26215RMFS
59	Минфин России	ОФЗ	-	-	26205RMFS
60	Минфин России	ОФЗ	-	-	29012RMFS
61	Минфин России	ОФЗ	-	-	26216RMFS

* Примечание: АО – акции обыкновенные, АП – акции привилегированные, ОФЗ – облигации федерального займа.

2. Список ликвидных ценных бумаг иностранных эмитентов для клиентов со стандартным и повышенным уровнем риска

№	Наименование эмитента	Возможность возникновения непокрытой и/или временно непокрытой позиции	Отнесение ценной бумаги к множеству ценных бумаг, коррелирующих с определенным индексом, с указанием индекса, с которым коррелирует данная ценная бумага	Международный код (номер) идентификации ценных бумаг (ISIN)
1	Alphabet Inc. (GOOGLE)	+	-	US02079K1079
2	Apple Inc.	+	-	US0378331005
3	AT&T INC.	+	-	US00206R1023

4	Bank of America Corporation	+	-	US0605051046
5	Caterpillar Inc.	+	-	US1491231015
6	Chesapeake Energy Corporation	+	-	US1651671075
7	Cisco Systems, Inc.	+	-	US17275R1023
8	Delta Air Lines, Inc.	+	-	US2473617023
9	Exxon Mobil Corporation	+	-	US30231G1022
10	Facebook, Inc.	+	-	US30303M1027
11	First Solar, Inc.	+	-	US3364331070
12	Ford Motor Company	+	-	US3453708600
13	General Electric Company	+	-	US3696041033
14	Intel Corporation	+	-	US4581401001
15	International Business Machines Corporation	+	-	US4592001014
16	MetLife, Inc.	+	-	US59156R1086
17	Microsoft Corporation	+	-	US5949181045
18	Micron Technology, Inc.	+	-	US5951121038
19	NVIDIA Corporation	+	-	US67066G1040
20	Pfizer Inc.	+	-	US7170811035
21	Starbucks Corporation	+	-	US8552441094
22	The Boeing Company	+	-	US0970231058
23	The Mosaic Company	+	-	US61945C1036
24	Adobe Systems Incorporated	+	-	US00724F1012
25	Amazon.com, Inc.	+	-	US0231351067
26	Best Buy Co., Inc.	+	-	US0865161014
27	GILEAD SCIENCES, INC.	+	-	US3755581036
28	JPMorgan Chase & Co.	+	-	US46625H1005
29	Netflix, Inc.	+	-	US64110L1061
30	Oracle Corporation	+	-	US68389X1054
31	United Company RUSAL PLC	-	-	JE00B5BCW814
32	Polymetal International plc	-	-	JE00B6T5S470
33	KOO «Яндекс Н.В.»	-	-	NL0009805522

3. Применяемые при расчете ДСплан и ЦБплан правила определения курса иностранной валюты по отношению к рублю РФ

При расчете ДСплан и ЦБплан, а также при расчете размера начальной (в том числе скорректированной с учетом поручений Клиента) и минимальной маржи, общей стоимости портфеля

Клиента и стоимости ликвидного портфеля Клиента курс иностранной валюты по отношению к рублю РФ определяется исходя из курса иностранной валюты, установленного Центральным банком Российской Федерации на дату расчета соответствующего показателя, а в случае отсутствия такого курса - кросс-курса иностранной валюты, рассчитанного исходя из курсов иностранных валют, установленных Центральным банком Российской Федерации.

Генеральный директор

должность



подпись

А.Б. Калинин

расшифровка подписи

24 ноября 20 17 года