

Утверждено
ООО «Калита-Финанс»
15.04.2011 г.

**Правила совершения сделок и операций с финансовыми инструментами, не
обращающимися на организованном рынке**

(Депозит от 250 грн.)

1. Общие положения

1.1. Настоящие Правила совершения операций с финансовыми инструментами, не обращающимися на организованном рынке (далее - Правила), устанавливают общий порядок и условия предоставления услуг обществом с ограниченной ответственностью «Калита-Финанс» и правила совершения сделок с финансовыми инструментами, не обращающимися на организованном рынке.

1.2. Положения настоящих Правил обязательны для всех лиц, вступивших в договорные отношения с обществом с ограниченной ответственностью «Калита-Финанс» на основании договора «Об оказании услуг по доступу к финансово-информационной системе». Далее по тексту Правил ООО «Калита-Финанс» именуется «Компания», а лица, заключившие с Компанией договоры «Об оказании услуг по доступу к финансово-информационной системе», именуются соответственно «Клиенты» или «Клиент».

1.3. Настоящие Правила носят открытый характер и являются неотъемлемой частью договора «Об оказании услуг по доступу к финансово-информационной системе» (далее – Договор).

1.4. Внесение изменений и/или дополнений в настоящие Правила производится Компанией в одностороннем порядке.

1.5. Все изменения и дополнения, вносимые Компанией в настоящие Правила, вступают в силу и становятся обязательными для Клиентов по истечении 5 (пяти) рабочих дней с момента уведомления Клиентов о внесенных в Правила изменениях.

В случае неполучения от Клиента заявления по электронным средствам связи о несогласии с изменениями и дополнениями к настоящим Правилам до вступления их в силу, новые условия считаются принятыми и одобренными Клиентом.

В случае поступления от Клиента заявления по электронным средствам связи о несогласии с изменениями и дополнениями к настоящим Правилам до вступления их в силу, Договор считается расторгнутым с момента поступления такого заявления. При этом в случае наличия у Клиента открытых позиций на дату расторжения договора, Компания вправе закрыть позиции Клиента.

1.6. Уведомление Клиентов о внесении изменений и/или дополнений в настоящие Правила осуществляется Компанией одним из указанных ниже способов:

- рассылкой сообщений посредством ФИС и/или электронной почты;
- публикацией сообщений на веб-сайте Компании по адресу <http://kalita-finance.com.ua>

1.7. Все обязательства, возникающие между участниками торгов, и вытекающие из них платежи подлежат пересчету в валюту клиринга. Курсы пересчета в валюту клиринга (конверторы) определяются по окончании каждого торгового дня, публикуются в ФИС и/или на веб-сайте Компании по адресу <http://kalita-finance.com.ua> и применяются в течение всего последующего торгового дня. Валютой клиринга в целях настоящих Правил является рубль РФ.

2. Термины и определения

2.1. Участник торгов - Клиент, получивший доступ к совершению сделок и операций с финансовыми инструментами посредством ФИС или средств телефонной связи.

2.2. Электронная торговая система (ФИС) - программа для ЭВМ, предназначенная для осуществления действий, направленных на совершение сделок и связанных с ними операций, получения связанной с процессом совершения сделок информации.

2.3. Финансовый инструмент - средство установления прав и обязанностей, возникающих вследствие изменения количественных характеристик базисного актива.

2.4. Базисный актив финансовых инструментов – показатель или совокупность показателей, характеризующих количественную сторону явлений, процессов, связей, входящих в систему производительных сил и производственных отношений (в том числе цены товаров и услуг; курсы валют и ценных бумаг; процентные ставки, фондовые индексы).

- 2.5. Исполнение прав и обязанностей по операции с финансовыми инструментами - осуществление взаиморасчетов по финансовому инструменту.
- 2.6. Вариационная маржа - сумма денежных средств, уплачиваемая (получаемая) участниками сделок в целях исполнения прав и обязанностей по совершенным сделкам.
- 2.7. Комиссионное вознаграждение - вознаграждение, уплачиваемое Клиентом в пользу Компании за предоставление доступа к ФИС, совершение сделок и других операций.
- 2.8. Позиция - натуральное и денежное выражение неиспользованных прав или/и неисполненных обязанностей, вытекающих из совершенных сделок.
- 2.9. Плата за перенос позиции - плата за продление срока действия прав и обязанностей, вытекающих из совершенных сделок.
- 2.10. Первоначальная маржа - сумма денежных средств, необходимая для получения права доступа к ФИС, совершения сделок и других операций.
- 2.11. Необходимая маржа - сумма денежных средств, необходимая для поддержания открытых позиций.
- 2.12. Принудительное закрытие позиции - сделки, совершенные в целях предотвращения возможного невыполнения участником торгов своих обязанностей.
- 2.13. Торговый счет - регистр в ФИС для сплошного и непрерывного учета принадлежащего Клиенту имущества, прав и обязанностей, оснований для их изменения.
- 2.14. Ордер - порядок, последовательность и условия осуществления действий, направленных на совершение сделок между участниками торгов.
- 2.15. Сделки - действия участников торгов, направленные на установление, изменение или прекращение прав и обязанностей в отношении финансовых инструментов.
- 2.16. Операции - использование прав и/или исполнение обязанностей, вытекающих из совершенных сделок или в связи с ними.
- 2.17. Торговый день - промежуток времени, в рамках которого проводятся торговые сессии, а также осуществляются операции, обеспечивающие процесс совершения сделок.
- 2.18. Торговая сессия - промежуток времени в рамках торгового дня, в границах которого участники торгов имеют право предпринимать предусмотренные Договором и настоящими Правилами действия, направленные на совершение сделок и других допустимых операций.
- 2.19. Открытие торговой сессии по инструменту - событие, наступление которого предоставляет право участникам торгов совершать действия, направленные на совершение сделок и других допустимых операций.
- 2.20. Закрытие торговой сессии по инструменту - событие, наступление которого означает невозможность осуществления действий, направленных на совершение сделок и других допустимых операций.
- 2.21. Приостановка торгов – вызванное событиями технического, политического, природного или рыночного характера временное закрытие торговой сессии по инструменту, направленное на предотвращение или устранение неблагоприятных последствий, нанесших или способных нанести ущерб имущественным интересам участников торгов и/или процессу совершения сделок.
- 2.22. Аукционная система торгов - форма проведения торгов, при которой сделки совершаются на основании конкурирующих по ценам и/или времени поступления в ФИС встречных пересекающихся и упорядоченных определенным образом ордеров, принадлежащих участникам торгов.
- 2.23. Очередь ордеров (стакан) – упорядоченная последовательность активных лимитных ордеров на продажу и активных лимитных ордеров на покупку. Ордера на покупку сортируются в порядке убывания цены, а ордера на продажу – в порядке возрастания цены. Участникам торгов показываются десять лучших цен, сформированных ордерами на покупку и десять лучших цен, сформированных ордерами на продажу.
- На каждом ценовом уровне отражается совокупный объем ордеров одинаковой направленности. Исполнение ордеров данной направленности, имеющих одинаковое значение цены, осуществляется в порядке активации этих ордеров в системе: ордер, поданный ранее или

имеющий меньшее значение ID, имеет приоритет в исполнении над другими ордерами с такой же направленностью и ценой.

2.24. Рынок маркет-мейкера - форма проведения торгов, при которой цена инструмента формируется на основании ордеров участников, выполняющих функции маркет-мейкера и выступающих контрагентами в совершенных с другими участниками торгов сделках.

2.25. Маркет-мейкер - участник торгов, в течение торговой сессии по закрепленному за ним инструменту или группе инструментов принимающий на себя обязанности по размещению двухсторонних ордеров (ордеров на покупку и ордеров на продажу) в совокупных объемах, достаточных для удовлетворения встречных ордеров клиентов.

2.26. Встречный ордер - ордер на покупку инструмента, принадлежащий одному участнику торгов, по отношению к ордеру на продажу того же инструмента, принадлежащему другому участнику торгов или ордер на продажу инструмента, принадлежащий одному участнику торгов, по отношению к ордеру на покупку того же инструмента, принадлежащему другому участнику торгов.

2.27. Цена АСК (ASK):

А) В форме проведения торгов «Рынок маркет-мейкера» - минимальное значение цены активных ордеров на продажу, принадлежащих участникам торгов и выполняющим по данному инструменту функции маркет-мейкера.

Б) При аукционной системе торгов - минимальное значение цен активных ордеров на продажу, принадлежащих всем участникам торгов.

2.28. Цена БИД (BID):

А) В форме проведения торгов «Рынок маркет-мейкера» - максимальное значение цены активных ордеров на покупку, принадлежащих участникам торгов, выполняющим по данному инструменту функции маркет-мейкера.

Б) При аукционной системе торгов - максимальное значение цен активных ордеров на покупку, принадлежащих всем участникам торгов

В промежуток времени между закрытием и открытием торговой сессии или приостановкой и возобновлением торговой сессии значения цен БИД и АСК показываются лишь для информативных целей, не связанных с совершением сделок, а также используются для совершения операций принудительного закрытия или переноса позиций с финансовыми инструментами, торговая сессия по которым закрыта или приостановлена.

2.29. Лучшая цена:

А) В форме проведения торгов «Рынок маркет-мейкера» - цена БИД и/или цена АСК. Участникам торгов, не выполняющим функции маркет-мейкера, показываются только значения лучших цен, без указания объемов ордеров, содержащих лучшие цены.

Б) При аукционной системе торгов – максимальное значение цен ордеров на покупку и/или минимальное значение цен ордеров на продажу.

2.30. Лот - минимально допустимое количество финансового инструмента в одном ордере, сделке или операции.

2.31. Торги - процесс размещения и исполнения ордеров, совершения сделок и операций с финансовыми инструментами. Форма проведения торгов, действующая в отношении того или иного финансового инструмента, указывается в описании и спецификации.

2.32. Диапазон цен – рассчитываемые от лучших цен БИД или АСК допустимые значения цен, по которым могут размещаться ордера.

2.33. Защитный диапазон – находящиеся в пределах диапазона цен допустимые значения цен, по которым могут исполняться рыночные ордера, ордера стоп-лосс, стоп и скользящий стоп.

2.34. Прекращение торгов по финансовому инструменту - закрытие имеющихся у Клиентов открытых позиций и последующая приостановка торгов по соответствующему финансовому инструменту, в случае прекращения торгов на бирже по базовому активу данного финансового инструмента, делистинга, дробления, консолидации, других случаях, влияющих на возможность проведения торгов. Закрытие позиций вследствие прекращения торгов по финансовому инструменту производится по лучшей цене на момент прекращения торгов по финансовому инструменту.

3. Ордера

3.1. Ордера размещаются, исполняются, отменяются в промежуток времени между открытием и закрытием торговой сессии по финансовому инструменту. Для каждого финансового инструмента Компания устанавливает допустимый перечень ордеров и порядок их действия. Компания имеет право ограничить действие определенных типов и видов ордеров. Перечень ордеров, допустимых к размещению по данному инструменту, содержится в описании (спецификации) финансового инструмента.

Активный ордер - ордер, в установленном порядке зарегистрированный в ФИС и имеющий статус ACTIVE или Pending.

Активация ордера - присвоение ордеру статуса ACTIVE или Pending.

Отмена ордера - присвоение ордеру статуса Cancelled.

Исполнение ордера - совершение на основании ордера сделки с присвоением ордеру статуса Executed.

Пересекающиеся ордера - встречные ордера, содержащие одинаковые значения цен. При аукционной системе торгов не допускается размещение и исполнение пересекающихся ордеров, принадлежащих одному и тому же клиенту. При пересечении таких ордеров, ордер, имеющий максимальное значение номера (ID), отменяется.

Ордера размещаются, изменяются, отменяются посредством ФИС или при помощи средств телефонной связи:

а) непосредственно Клиентом;

б) лицом, уполномоченным на то Клиентом. Клиент вправе действовать через уполномоченных лиц, предоставив им пароли доступа к ФИС и совершению операций посредством телефонной связи. Действия уполномоченных Клиентом лиц приравниваются к действиям Клиента.

в) сотрудником Компании от имени и по поручению Клиента;

г) сотрудником Компании без поручения Клиента в случаях, предусмотренных Договором и настоящими Правилами.

С момента активации до момента отмены или исполнения ордера, осуществляется постоянная проверка ордеров на предмет достаточности денежных средств, необходимых для исполнения ордера.

В случае несоблюдения условий достаточности средств, ордера поочередно отменяются до момента соблюдения условий достаточности средств. При этом в первую очередь отменяется активный ордер, имеющий максимальное значение номера (ID), присвоенного системой при его активации.

3.2. Типы ордеров, требования к их содержанию, порядок размещения, отмены, исполнения.

3.2.1. Рыночный ордер:

А) В форме проведения торгов «Рынок маркет-мейкера» – ордер Клиента, адресованный маркет-мейкеру, встречный ордер которого содержит лучшую в момент размещения Клиентом ордера цену (минимальную цену из всех активных ордеров маркет-мейкеров на продажу и/или максимальную цену из всех активных ордеров маркет-мейкеров на покупку) и выражающий согласие Клиента совершить сделку на указанных маркет-мейкером условиях.

Б) При аукционной системе торгов - ордер Клиента, адресованный всем участникам торгов и выражающий безоговорочное согласие Клиента совершить сделку по лучшим ценам, имеющимся на рынке. При аукционной системе торгов допускается частичное исполнение рыночного ордера.

Независимо от формы организации торгов, рыночный ордер должен содержать следующие обязательные реквизиты: идентификатор торгового счета клиента, инструмент (наименование инструмента), количество инструмента (объем), направление сделки (покупка или продажа).

Рыночный ордер может содержать дополнительные реквизиты: цена, диапазон, Стоп-лосс, Тейк-профит.

При аукционной системе торгов размещение рыночного ордера, не содержащего дополнительные реквизиты «цена» и «защитный диапазон», влечет за собой автоматическое установление максимального значения параметра «диапазон». После принятия системой, такой рыночный ордер исполняется по лучшим ценам в рамках установленного защитного диапазона, после чего, в случае наличия неисполненного остатка, превращается в бессрочный лимитный ордер с ценой, равной цене первой сделки, совершенной на основании этого рыночного ордера и помещается в очередь ордеров.

При аукционной системе торгов рыночные ордера, содержащие дополнительные реквизиты «цена» и «защитный диапазон», исполняются в пределах заданного диапазона, после чего, в случае наличия неисполненного остатка, превращаются в бессрочный лимитный с ценой, равной значению дополнительного реквизита «цена».

Рыночные ордера, содержащие обязательные реквизиты, принимаются к исполнению при соблюдении условия достаточности средств для их исполнения, наличия встречных ордеров в установленном Клиентом или ЭТС диапазоне цен. Рыночные ордера отменяются в момент закрытия торговой сессии по инструменту при несоблюдении условия достаточности денежных средств, отсутствии встречных ордеров в установленном клиентом или ЭТС диапазоне цен. Рыночные ордера одинаковой направленности, имеющие совпадающие значения цен, исполняются в порядке их активации в ЭТС.

3.2.2. Ордер «закрыть позицию» - не содержащий дополнительных реквизитов рыночный ордер в объеме, равном по абсолютному значению и противоположном по направлению объему открытой позиции клиента, и адресованный участникам торгов, встречные ордера которых содержат лучшие на момент поступления в торговую систему рыночного ордера цены.

3.2.3. Лимитный ордер - ордер клиента, направленный на совершение сделки по цене, указанной в ордере.

При форме организации торгов «Рынок маркет-мейкера», лимитный ордер исполняется или отменяется в полном объеме. При аукционной системе торгов допускается частичное исполнение лимитного ордера.

Лимитный ордер исполняется в промежуток времени между активацией и отменой этого ордера по факту размещения другим участником торгов встречного пересекающегося ордера.

Лимитный ордер должен содержать следующие обязательные реквизиты: идентификатор торгового счета клиента, инструмент (наименование инструмента), количество инструмента (объем), цену, направление сделки (покупка или продажа), срок действия (Режим: дневной (Daily) или действующий до отмены (GTC)).

Срок действия «дневной» означает, что, при соблюдении прочих условий, ордер является активным до окончания торгового дня, после чего автоматически отменяется.

Срок действия «до отмены» означает, что, при соблюдении прочих условий, ордер является активным до момента его отмены участником торгов или уполномоченным на то лицом.

Лимитный ордер может содержать следующие дополнительные реквизиты: Стоп-лосс, Тейк-профит.

Лимитные ордера, содержащие обязательные реквизиты, принимаются к размещению и исполнению при соблюдении условия достаточности денежных средств на протяжении всего времени с момента размещения до момента исполнения или отмены.

Лимитный ордер может быть отменен Клиентом в промежуток времени между открытием и закрытием торговой сессии. Лимитный ордер отменяется автоматически при несоблюдении условия достаточности денежных средств, истечения срока действия, в других случаях, предусмотренных Договором и настоящими Правилами.

3.2.4. Ордер Стоп (STOP) - не содержащий дополнительных реквизитов рыночный ордер, исполнение которого зависит от реализации указанных в реквизитах ордера стоп условий.

При форме проведения торгов «Рынок маркет-мейкера», условия считаются реализованными, если в промежуток времени между размещением ордера Стоп в торговой системе и его отменой лучшая цена встречного ордера маркет-мейкера:

- а) станет равной или выше цены ордера Стоп на покупку;
- б) станет равной или ниже цены ордера Стоп на продажу.

При аукционной форме проведения торгов условия считаются реализованными, если в промежуток времени между размещением ордера Стоп в торговой системе и его отменой:

а) лучшая цена ордеров на продажу, не принадлежащих счету клиента, станет равной или выше цены ордера стоп на покупку

б) лучшая цена ордеров на покупку, не принадлежащих счету клиента, станет равной или ниже цены ордера стоп на продажу.

Ордер Стоп должен содержать следующие обязательные реквизиты: идентификатор торгового счета Клиента, наименование (обозначение) инструмента, количество инструмента (объем), цену, направление сделки (покупка или продажа), срок действия (Режим: дневной (Daily) или действующий до отмены (GTC)).

Срок действия «дневной» означает, что, при соблюдении прочих условий, ордер является активным до окончания торгового дня, после чего автоматически отменяется.

Срок действия «до отмены» означает, что, при соблюдении прочих условий, ордер является активным до момента его отмены участником торгов или уполномоченным на то лицом.

Ордер Стоп может содержать следующие дополнительные реквизиты: Стоп-лосс, Тейк-профит.

Ордера Стоп, содержащие обязательные реквизиты, принимаются к размещению и исполнению при соблюдении условия достаточности денежных средств на протяжении всего времени с момента размещения до момента исполнения или отмены.

Ордер Стоп может быть размещён или отменен Клиентом в промежуток времени между открытием и закрытием торговой сессии. Ордер Стоп отменяется автоматически при несоблюдении условия достаточности денежных средств, истечения срока действия, в других случаях, предусмотренных Договором и настоящими Правилами.

3.2.5. Ордер Стоп-лосс (SL) - ордер «ЗАКРЫТЬ ПОЗИЦИЮ», исполнение которого зависит от реализации указанных в реквизитах ордера условий.

При форме проведения торгов «Рынок маркет-мейкера» условия считаются реализованными, если в промежуток времени между активацией ордера Стоп-лосс в торговой системе и его отменой лучшая цена встречного ордера маркет-мейкера:

а) станет равной или превысит цену ордера Стоп-лосс на покупку;

б) станет равной или ниже цены ордера Стоп-лосс на продажу.

При аукционной форме проведения торгов условия считаются реализованными, если в промежуток времени между размещением ордера стоп в торговой системе и его отменой:

а) лучшая цена ордеров на продажу, не принадлежащих счету клиента, станет равной или выше цены ордера стоп на покупку

б) лучшая цена ордеров на покупку, не принадлежащих счету клиента, станет равной или ниже цены ордера стоп на продажу.

Ордер Стоп-лосс должен содержать следующие обязательные реквизиты: идентификатор торгового счета клиента, наименование (обозначение) инструмента, количество инструмента (объем), цену, направление сделки (покупка или продажа).

Ордер Стоп-лосс автоматически отменяется по факту закрытия или изменения направления позиции.

3.2.6. Ордер Тейк-профит (TP):

А) При форме проведения торгов «Рынок маркет-мейкера» - ордер «ЗАКРЫТЬ ПОЗИЦИЮ», исполнение которого зависит от реализации указанных в реквизитах ордера условий.

Условия считаются реализованными, если в промежуток времени между активацией ордера Тейк-профит в торговой системе и его отменой лучшая цена встречного ордера маркет-мейкера:

а) станет равной или ниже цены ордера Тейк-профит на покупку;

б) станет равной или превысит цену ордера Тейк-профит на продажу.

Б) При аукционной системе торгов - не содержащий дополнительных реквизитов лимитный ордер в объеме, равном по абсолютному значению и противоположном по направлению объему открытой позиции клиента.

Ордер Тейк-профит должен содержать следующие обязательные реквизиты: идентификатор торгового счета клиента, наименование (обозначение) инструмента, количество инструмента (объем), цену, направление сделки (покупка или продажа).

Ордер Тейк-профит автоматически отменяется по факту закрытия или изменения направления позиции.

3.2.7. Ордер Скользящий стоп (TS) - ордер типа Стоп-лосс, значение цены которого определяется по заданному клиентом правилу.

Ордер Скользящий стоп должен содержать следующие обязательные реквизиты: идентификатор торгового счета клиента, наименование (обозначение) инструмента, количество инструмента (объем), цену, правило определения изменения цены (шаг), направление сделки (покупка или продажа).

Цена ордера Скользящий стоп (TS) с направлением «Покупка» изменяется по правилу:

$$TSprice=ASKmin+STEP, \text{ где:}$$

ASKmin - минимальное значение цены ASK с момента активации ордера, включая цену ASK на момент активации ордера;

STEP - шаг цены.

Цена ордера Скользящий стоп (TS) с направлением «Продажа» изменяется по правилу:

$$TSprice=BIDmax-STEP, \text{ где:}$$

BIDmax – максимальное значение цены BID с момента активации ордера, включая цену BID на момент активации ордера;

STEP - шаг цены.

3.2.8. Дополнительные реквизиты ордеров.

Цена рыночного ордера - дополнительный реквизит, устанавливающий значение цены, по которой может быть совершена сделка между клиентом и другими участниками торгов.

Защитный диапазон - дополнительный реквизит рыночного ордера, устанавливающий интервал значений цен, по которым может быть совершена сделка между клиентом и другими участниками торгов.

При форме проведения торгов «Рынок маркет-мейера», в случае отсутствия в торговой системе встречных ордеров маркет-мейкеров, значения цен которых входят в установленный клиентом интервал допустимых значений цен, рыночный ордер клиента отменяется. При этом клиенту со стороны маркет-мейкера может поступить лимитный ордер, встречный по отношению к отмененному ордеру клиента, действующий ограниченный промежуток времени и выражающий безусловное согласие маркет-мейкера совершить сделку на указанных в ордере условиях.

При аукционной системе торгов, в случае отсутствия в торговой системе встречных ордеров, содержащих цены, лежащие в пределах заданного диапазона, ордер клиента в части неисполненного объема превращается в лимитный ордер и помещается в очередь ордеров.

При аукционной системе торгов не содержащим дополнительные реквизиты рыночным ордерам, ордерам стоп-лосс, стоп, скользящий стоп, автоматически присваивается максимальное значение защитного диапазона. Максимальное значение параметра «диапазон», выраженное в пунктах, составляет 30% от диапазона допустимых значений цен, в рамках которого ордера принимаются в ЭТС. Выраженные в пунктах значения параметров «Диапазон допустимых значений цен» и «Защитный диапазон» приведены в спецификациях финансовых инструментов.

Дополнительный реквизит Стоп-лосс (для рыночного, лимитного и Стоп ордеров) - значение реквизитов «цена» и «инструмент» ордера Стоп-лосс, активация которого обусловлена:

а) исполнением ордера, содержащего дополнительный реквизит;

б) наличием позиции, совпадающей по реквизиту «инструмент» и направлению с аналогичными реквизитами исполненного ордера, содержащего дополнительный реквизит Стоп-лосс.

Дополнительный реквизит Тейк-профит (для рыночного, лимитного и стоп ордеров) - значение реквизита «цена» и «инструмент» ордера Тейк-профит, активация которого обусловлена:

а) исполнением ордера, содержащего дополнительный реквизит;

б) наличием позиции, совпадающей по реквизиту «инструмент» и направлению с аналогичными реквизитами исполненного ордера, содержащего дополнительный реквизит Тейк-профит.

В случае одновременного исполнения ордеров, содержащих дополнительные реквизиты, активируются ордера по дополнительным реквизитам ордера, имеющего максимальное значение номера (ID), присвоенного системой при его активации.

3.2.9. Ордера типа Лимитный и Стоп могут быть сгруппированы условием, в соответствии с которым исполнение одного из ордеров, входящего в группу, приводит к отмене всех остальных входящих в группу активных ордеров. Ордера типа Стоп-лосс, Тейк-профит, Скользящий стоп не могут состоять в группах.

4. Сделки

4.1. Сделки с финансовыми инструментами совершаются на основании: исполненных ордеров; на основании действий, связанных с переносом или принудительным закрытием позиций.

Каждой сделке присваиваются следующие реквизиты: номер сделки, наименование инструмента, дата и время совершения сделки, цена, номер ордера.

Сделкам, связанным с переносом позиций, вместо номера ордера присваивается обозначение процедуры – RO/TN, указывающее метод переноса позиций.

Сделкам, связанным с принудительным закрытием позиций, вместо номера ордера присваивается обозначение процедуры MC (Margin Call), указывающее основание совершения сделки.

5. Операции

5.1. Операции отражают факт зачисления и/или списания денежных средств в связи с изменением и/или исполнением обязанностей и/или использованием прав, вытекающих из Договора и настоящих Правил и/или совершенных Клиентом сделок.

5.2. Торговые операции - списание денежных средств с торгового счета Клиента и/или зачисление денежных средств на торговый счет Клиента в связи получением или уплатой вариационной маржи, комиссионного вознаграждения, платы за перенос позиции.

Торговая операция содержит следующие реквизиты: номер операции, номер сделки, тип, наименование финансового инструмента, дату и время проведения операции, количество инструмента с указанием направления (покупка/продажа), средневзвешенную цену учета прав и обязанностей, цену использования прав/исполнения обязанностей (цена закрытия), сумму вариационной маржи, значение конвертора, сумму комиссионного вознаграждения, сумму платы за перенос позиции, остаток денежных средств на торговом счете.

Типы торговых операций:

Open - использование прав или исполнение обязанностей в связи с открытием позиции.

Close - использование прав или исполнение обязанностей в связи с закрытием позиции.

CHANGE - использование прав или исполнение обязанностей в связи с изменением позиции.

Lose - исполнение обязанностей в связи с принудительным закрытием позиции.

SWAPCLOSE/SWAPOPEN - использование прав или исполнение обязанностей в связи переносом позиции.

ROLLOVER - использование прав или исполнение обязанностей, в связи с взиманием или начислением платы за перенос позиций.

5.3. Неторговые операции - операции, не связанные с получением или уплатой вариационной маржи, комиссионного вознаграждения, платы за перенос позиций.

Неторговая операция содержит следующие реквизиты: номер операции, тип, дату и время совершения операции, сумму зачисления/списания, сумму комиссионного вознаграждения, остаток денежных средств.

Типы неторговых операций:

DEPOSIT - зачисление денежных средств, переведенных Клиентом на счет Компании или списание денежных средств с торгового счета Клиента с целью перевода денежных средств со счета Компании на банковский счет Клиента.

TRANSFER - перевод денежных средств между торговыми счетами Клиента. Перевод денежных средств между торговыми счетами Клиента может осуществляться в размере не обремененных обязательствами средств, а именно, в размере суммы свободных денежных средств (в случае отсутствия открытых позиций) или в размере суммы свободных денежных средств за вычетом суммы незафиксированной положительной вариационной маржи (при наличии открытых позиций).

6. Позиции

6.1. Позиция отражает натуральное и денежное выражение нереализованных (неиспользованных) прав и/или неисполненных обязанностей, вытекающих из совершенных сделок.

Позиция содержит следующие реквизиты: идентификатор торгового счета; наименование инструмента; количество инструмента (объем); средневзвешенную цену позиции; рыночную цену или средневзвешенную рыночную цену (для аукционной системы торгов); сумму вариационной маржи, которую Клиент получит в случае немедленного закрытия позиции; сумму вариационной маржи фактически полученной/уплаченной Клиентом вследствие частичного закрытия позиции; реквизиты ордеров, направленных на закрытие позиции.

6.2. Принудительное закрытие позиции.

Если текущий баланс торгового счета клиента становится ниже суммы необходимой маржи, все позиции Клиента, относящиеся к торговому счету, на котором образовался недостаток денежных средств, закрываются путем совершения сделок по лучшим ценам, имевшимся на момент образования недостатка средств. Принудительное закрытие позиций может быть осуществлено и в других случаях, предусмотренных Договором и Правилами.

6.3. Перенос позиции - продление срока действия прав и обязанностей, вытекающих из совершенных ранее сделок.

Перенос позиций на следующий торговый день осуществляется автоматически по факту наличия на торговом счете клиента в момент окончания торгового дня открытой позиции. Перенос позиции осуществляется в момент закрытия торгового дня путем совершения двух противоположных сделок с одинаковой ценой и вытекающих из них операций по списанию/зачислению сумм вариационной маржи и платы за перенос позиции.

Плата за перенос позиции рассчитывается в следующем порядке:

а) Расчет суммы обязательств по каждой открытой позиции, которая конвертируется в валюту клиринга по формуле:

$$\text{Position Liability} = \text{abs}(\text{Volume} * \text{Position Price}) * \text{Converter}, \text{ где:}$$

Volume - объем позиции;

Position Price - цена позиции;

Converter – курс пересчета в валюту клиринга.

б) Расчет совокупной суммы обязательств по всем позициям по формуле:

$$\text{Total Positions Liability} = \text{SUM}(\text{Position Liability})$$

в) Расчет суммы нетто-обязательств Клиента по формуле:

$$\text{Net liability} = (\text{Effective Margin} - \text{Total Positions Liability}), \text{ где:}$$

Effective Margin – свободные денежные средства.

Если сумма нетто-обязательств Клиента меньше нуля, то это означает, что обязательства по позициям клиента превышают его собственные средства. Это, в свою очередь, означает, что компания предоставила ему займ, за пользование которым он должен заплатить процент. Если сумма нетто-обязательств клиента больше или равна нулю, то обязательства клиента по позициям полностью покрываются его собственными средствами, и на остаток этих средств Компания уплачивает Клиенту процент за пользование средствами.

г) Расчет суммы платы за перенос позиции Ext по формулам:

$$\text{Если Net Liability} < 0, \text{ то Ext} = \text{Net Liability} * (\text{R}(\text{ask}) / 100 / \text{AB})$$

$$\text{Если Net Liability} \geq 0, \text{ то Ext} = \text{Net Liability} * (\text{R}(\text{bid}) / 100 / \text{AB}),$$

где R(ask) - значение ask процентной ставки валюты клиринга;

R(bid) - значение bid процентной ставки валюты клиринга.

Значения процентных ставок R(ask) = 11%, R(bid) = 9%.

При переносе позиции с пятницы на понедельник плата за перенос позиции взимается в тройном размере.

Пересчет основных показателей в гривну осуществляется по курсу UAHRUR на конец предыдущей торговой сессии.

6.4. Если базисным активом финансового инструмента является цена фьючерсного контракта, имеющего определенную дату поставки, то в последний день торгов фьючерсным контрактом открытые позиции Клиента по финансовому инструменту закрываются по лучшим ценам, действовавшим на момент закрытия торговой сессии по финансовому инструменту. Все лимитные ордера, включая ордера стоп-лосс и тейк-профит, отменяются. В новой торговой сессии позиции вновь открываются, но по цене следующего действующего фьючерсного контракта.

7. Вариационная маржа

7.1. Вариационная маржа вычисляется по формуле:

а) для позиции с направлением «Покупка»:

$$P/L = (P_{\text{close}} - P_p) * Q * k$$

б) для позиции с направлением «Продажа»:

$$P/L = (P_p - P_{close}) * Q * k, \text{ где:}$$

P_p – цена позиции;

P_{close} - цена, по которой позиция была или может быть закрыта;

Q - количество инструмента;

k - конвертор, применяемый для пересчета в валюту клиринга.

Конверторы, применяемые в отношении каждого инструмента, приведены в Таблицах 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10.

Пересчет основных показателей в гривну осуществляется по курсу UAHRUR на конец предыдущей торговой сессии.

8. Комиссионное вознаграждение

8.1. Комиссионное вознаграждение, установленное в процентах от суммы сделки рассчитывается по формуле:

$$Comm = P * Q * s * k / 100, \text{ где:}$$

P - цена сделки;

Q - количество инструмента;

s - ставка комиссионного вознаграждения (%);

k - конвертор, применяемый для пересчета в валюту клиринга.

8.2. Комиссионное вознаграждение, установленное, как фиксированная величина в рублях за сделку одним лотом, рассчитывается по формуле:

$$Comm = Q / C * s, \text{ где:}$$

Q - количество инструмента;

C – размер лота

s - ставка комиссионного вознаграждения (фиксированная величина в рублях);

Конверторы и ставки комиссионного вознаграждения, применяемые в отношении каждого инструмента, приведены в Таблицах 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10, 11, 12, 13.

Пересчет основных показателей в гривну осуществляется по курсу UAHRUR на конец предыдущей торговой сессии.

9. Первоначальная, необходимая маржа

9.1. Первоначальная маржа, устанавливаемая в процентах от суммы обязательств, рассчитывается по формуле:

$$IM = P * Q * m * k / 100, \text{ где:}$$

P - цена;

Q - количество инструмента;

m - ставка маржи в процентах;

k - конвертор, применяемый для пересчета в валюту клиринга.

Конверторы, применяемые в отношении каждого инструмента, а также ставки первоначальной маржи, приведены в Таблицах 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10, 11, 12, 13.

9.2. Первоначальная маржа, устанавливаемая в виде фиксированной суммы за лот, рассчитывается по формуле:

$IM = Lots * Mfix$, где:

Lots- число лотов в открытой позиции;

Mfix - фиксированная ставка первоначальной маржи из расчета на один лот.

9.3. Необходимая маржа рассчитывается по формуле:

$NM = IM * n$, где:

IM - сумма первоначальной маржи;

n - ставка необходимой маржи.

Ставки необходимой маржи, применяемые к каждому инструменту, указаны в Таблицах 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10, 11, 12, 13, а также в описании инструмента.

Пересчет основных показателей в гривну осуществляется по курсу UAHRUR на конец предыдущей торговой сессии.

10. Расписание торговых дней и торговых сессий

10.1. Расписание торговых дней (Киевское время):

№ п/п	Торговые дни
1	понедельник 01:00 - вторник 01:00
2	вторник 01:01 - среда 01:00
3	среда 01:01 - четверг 01:00
4	четверг 01:01 - пятница 01:00
5	пятница 01:01 – пятница 22:00
6	пятница 22:01 – воскресенье 01:00 (спецсессия выходного дня ТОЛЬКО ДЛЯ ИНСТРУМЕНТОВ USDRUR, UAHRUR, USDUAN)
7	воскресенье 01:01 – воскресенье 18:00 (спецсессия выходного дня ТОЛЬКО ДЛЯ ИНСТРУМЕНТОВ USDRUR, UAHRUR, USDUAN)

Расписание торговых дней может быть изменено в связи с праздничными и выходными днями, а также другими событиями, о чем Компания уведомляет участников торгов посредством ФИС и/или размещения информации на веб-сайте Компании по адресу <http://kalita-finance.com.ua>

10.2. Расписание торговых сессий по финансовым инструментам приведено в Таблице 2 настоящих Правил а также дублируются в описании (спецификации) инструмента в ФИС.

10.3. Торговая сессия по инструменту считается открытой после наступления даты и времени открытия торговой сессии и факта размещения в ФИС не менее одной пары двухсторонних ордеров, принадлежащих участникам торгов, выполняющим функции маркет-мейкера.

10.4. Торговая сессия по инструменту считается закрытой после наступления даты и времени закрытия торговой сессии или осуществления действий со стороны Компании, направленных на закрытие торговой сессии.

10.5. Расписание торговых сессий может изменяться в том числе, в связи с праздничными и выходными днями, а также другими событиями в стране происхождения базисного актива, в связи с изменением расписания торговых дней.

11. Правила осуществления сделок и операций посредством телефонной связи

Клиент имеет право совершать посредством телефонной связи следующие действия:

11.1. В течение торговой сессии по инструменту размещать, отменять все допустимые типы ордеров, изменять допустимые реквизиты ордеров. Установление и изменение группировки ордеров посредством телефонной связи запрещено.

11.2. В течение торгового дня запрашивать информацию о состоянии торговых счетов, в том числе информацию об остатках денежных средств, уплаченных/полученных суммах вариационной маржи, комиссионного вознаграждения, платы за перенос позиции, ценах исполнения ордеров, ценах закрытия позиций.

11.3. В течение торгового дня запрашивать информацию о текущих, минимальных, максимальных значениях цен финансовых инструментов; расписании торговых дней и торговых сессий; причинах приостановки, сроках возобновления торгов.

11.4. Для совершения указанных выше действий Клиент обязан:

а) Назвать номер договора и номер торгового счета, в отношении которого совершается сделка, запрашивается информация;

б) Назвать телефонный пароль, установленный к торговому счету, в отношении которого совершаются операции или запрашивается информация.

11.5. Для совершения сделки с помощью рыночного ордера Клиент обязан назвать тип ордера (Рыночный), направление сделки (покупка или продажа), объем сделки и наименование финансового инструмента. Указание дополнительных реквизитов Цена, Стоп-лосс/Тейк-профит к рыночному ордеру, размещаемому посредством телефонной связи, запрещено.

Сотрудник Компании повторяет Клиенту существенные условия сделки. В течение пяти секунд после повторения сотрудником Компании существенных условия сделки, Клиент обязан принять решение и выразить его одним из слов «Подтверждаю» или «Отказ». Если Клиент отказался от сделки, сотрудник Компании подтверждает отказ фразой «Сделки нет» и прекращает переговоры. Если Клиент не выразил свое решение в течение пяти секунд после предоставления цен, действия Клиента рассматриваются как отказ от сделки.

Если Клиент принял решение о совершение сделки, сотрудник Компании размещает ордер в ФИС и сообщает Клиенту результаты размещения ордера. В случае исполнения ордера, сотрудник Компании произносит слово «Сделано» и сообщает Клиенту условия сделки, осуществленной на основании ордера: номер торгового счета, количество инструмента, направление сделки (покупка/продажа), цену. После произнесения сотрудником Компании слова «Сделано», Клиент не может отказаться от сделки.

В случае отмены или невозможности размещения ордера, сотрудник Компании сообщает Клиенту причину отмены или невозможности размещения ордера.

11.6. Для размещения или отмены Лимитного ордера Клиент обязан указать: действие (разместить или отменить), тип ордера (Лимитный), направление сделки (покупка или продажа), наименование инструмента, количество инструмента, режим (дневной или бессрочный), цену.

Сотрудник Компании размещает или отменяет лимитный ордер в ФИС и, в случае активации или отмены лимитного ордера, сообщает Клиенту существенные условия ордера. В случае невозможности размещения или отмены ордера с указанными Клиентом реквизитами, сотрудник Компании информирует Клиента о причинах невозможности размещения или отмены лимитного ордера.

11.7. Для размещения или отмены ордера Стоп Клиент обязан указать: действие (разместить или отменить), тип ордера (Стоп), направление сделки (покупка или продажа), наименование и количество инструмента, режим (дневной или бессрочный), цену. Сотрудник Компании размещает или отменяет ордер Стоп и информирует Клиента о результатах осуществленных действий.

11.8. Для размещения или отмены ордеров Стоп-лосс и/или Тейк-профит к позиции Клиент обязан указать: действие (разместить или отменить), тип ордера (Стоп-лосс или Тейк-профит), наименование инструмента, значения цен.

Сотрудник Компании размещает или отменяет ордер Стоп-лосс или Тейк-профит в ФИС и информирует Клиента о результатах осуществленных действий.

11.9. Для размещения или отмены ордера Скользящий стоп к позиции Клиент обязан указать: действие (разместить или отменить), тип ордера (Скользящий стоп), наименование инструмента, выраженное в пунктах значение шага.

Сотрудник Компании размещает или отменяет ордер Скользящий стоп в ФИС и информирует Клиента о результатах осуществленных действий.

11.10. Для установления или изменения дополнительных реквизитов Стоп-лосс или Тейк-профит к ордерам типа Лимитный и Стоп Клиент обязан указать: действие (разместить или отменить), типы реквизитов (Стоп-лосс или Тейк-профит), наименование инструмента, количество инструмента, цену, значения дополнительных реквизитов.

Сотрудник Компании устанавливает значения реквизитов в ФИС и информирует Клиента о результатах осуществленных действий.

11.11. Если в процессе переговоров связь была прервана и до момента обрыва соединения существенные условия действий, направленных на совершение сделок не были согласованы, переговоры признаются не состоявшимися и не влекут за собой действий со стороны Компании или Клиента. Если до момента обрыва соединения были согласованы все существенные условия действий, направленных на совершение сделок, переговоры признаются состоявшимися и являются основанием для занесения предпринятых Клиентом действий в ФИС.

12. Чрезвычайные ситуации

12.1. Чрезвычайными признаются ситуации, вызванные действиями участников торгов или событиями технического, политического, природного или рыночного характера, наступление которых наносит или способно нанести ущерб имущественным интересам участников торгов и/или процессу торгов в целом. Решение о признании ситуации чрезвычайной принимается Генеральным директором Компании или уполномоченным им лицом.

12.2. В целях предупреждения или устранения последствий чрезвычайных ситуаций, защиты интересов участников торгов, Компания вправе:

- устанавливать и изменять диапазон допустимых значений цен, в рамках которого ордера принимаются в торговую систему, виды допустимых ордеров, порядок и сроки их действия. Границы допустимого диапазона цен показываются в окне создания, редактирования ордеров и позиций. Виды допустимых ордеров показываются в описании (спецификации) инструмента.
- устанавливать и изменять ставки первоначальной и необходимой маржи;
- устанавливать ограничения на количество инструмента в ордерах и позициях;
- приостановить торги. Решение о приостановке торгов принимается Компанией. Участникам торгов выдаются системные сообщения о причинах и продолжительности приостановки торгов.
- отменить или аннулировать результаты торгов частично или полностью.

**14. Финансовые инструменты, не обращающиеся на организованном рынке.
Форма торгов – рынок Маркет-Мейкера.**

Таблица 2. Финансовые инструменты валютного рынка

Тикер	Описание инструмента	Валюта котировки	Размер лота	Первонач. маржа	Необх. маржа	Конвертор	Комиссия	Расписание торгов (время Киевское)
EURRUR	Курс евро к российскому рублю	RUR	1000	1,00%	20,00%	1	0	01:00 пнд - 22:00 птн
SDRRUR	Стоимость специальных прав заимствования в рублях	RUR	1000	1,00%	20,00%	1	0	01:00 пнд - 22:00 птн
UERUR	Стоимость бивалютной корзины в рублях	RUR	100000	1500р	20,00%	1	0	01:00 пнд - 22:00 птн
USDRUR	Курс доллара к российскому рублю	RUR	100000	1500р	20,00%	1	0	Торговый день
USDUAH	Курс доллара США к украинской гривне	UAH	1000	1,00%	20,00%	UAHRUR	0	Торговый день
UAHRUR	Курс украинской гривны к российскому рублю	RUR	10000	1,00%	20,00%	1	0	Торговый день
GBPRUR	Курс фунта стерлинга к российскому рублю	RUR	1000	1,00%	20,00%	1	0	01:00 пнд - 22:00 птн
CHFRUR	Курс швейцарского франка к российскому рублю	RUR	1000	1,00%	20,00%	1	0	01:00 пнд - 22:00 птн
CADRUR	Курс канадского доллара к российскому рублю	RUR	1000	1,00%	20,00%	1	0	01:00 пнд - 22:00 птн
AUDRUR	Курс австралийского доллара к российскому рублю	RUR	1000	1,00%	20,00%	1	0	01:00 пнд - 22:00 птн
NZDRUR	Курс новозеландского доллара к российскому рублю	RUR	5000	1,00%	20,00%	1	0	01:00 пнд - 22:00 птн
RURJPY	Курс российского рубля к японской иене	JPY	50000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDJPY	0	01:00 пнд - 22:00 птн

Таблица 3. Финансовые инструменты на основе значений фондовых и товарных индексов

Тикер	Описание инструмента	Валюта котировки	Размер лота	Первонач. маржа	Необх. маржа	Конвертор	Комиссия	Расписание торгов (время Киевское)
CAC40	Значение индекса CAC40 (Cotation Assistée en Continu), Франция, Париж	RUR	10	5,00%	20,00%	1	0,10%	10:00 – 18:30
COMPQ	Значение индекса NASDAQ Composite, США	RUR	10	5,00%	20,00%	1	0,10%	16:30 – 23:00
DAX	Значение индекса DAX (Deutscher Aktien Index), Германия, Франкфурт	RUR	10	5,00%	20,00%	1	0,10%	10:00 – 18:30
DOW30	Значение индекса Dow Jones Industrial Average, США	RUR	10	5,00%	20,00%	1	0,10%	16:30 – 23:00
FTSE100	Значение индекса Financial Time Stock Exchange, Великобритания, Лондон	RUR	10	5,00%	20,00%	1	0,10%	10:00 – 18:30
MICEX	Значение индекса Московской Межбанковской Валютной Биржи, Россия	RUR	10	10,00%	20,00%	1	0,10%	09:30 – 17:45
Nikkei	Значение индекса Nikkei (Nihon Keizai Shimbun), Япония, Токио	RUR	10	5,00%	20,00%	1	0,10%	3:00– 5:00, 6:30– 09:00
SP500	Стоимость контракта E-MINI S&P 500	RUR	10	5,00%	20,00%	1	0,10%	01:00 пнд - 22:00 птн
SPX	Значение индекса Standard&Poor's 500, США	RUR	10	5,00%	20,00%	1	0,10%	16:30 – 23:00
KFPK	Значение индекса потребительской корзины	RUR	1	30,00%	20,00%	1	0,02%	01:00 пнд - 22:00 птн

Таблица 4. Финансовые инструменты на основе курса акций российских компаний

Тикер	Описание инструмента	Валюта котировки	Размер лота	Первонач. маржа	Необх. маржа	Конвертор	Комиссия	расписание торгов (время Киевское)
AFKC	Курс акции АФК Система	RUR	100	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
AFLT	Курс акции ОАО «Аэрофлот»	RUR	100	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
APTK	Курс акции ОАО «Аптечная сеть 36,6»	RUR	30	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
AVAZ	Курс акции ОАО «АвтоВАЗ»	RUR	100	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
CHMF	Курс акции ЧерМК ОАО «Северсталь»	RUR	10	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
GMKN	Курс акции ОАО «ГМК «Норильский никель»	RUR	1	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
HYDR	Курс акции ОАО «РусГидро»	RUR	2000	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
IRAO	Курс акции ОАО «Интер РАО ЕЭС»	RUR	100000	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
LKOH	Курс акции ОАО «Лукойл»	RUR	2	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
MAGN	Курс акции ОАО «Магнитогорский металлургический комбинат»	RUR	100	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
MTS	Курс акции ОАО «Мобильные ТелеСистемы»	RUR	10	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
NLMK	Курс акции ОАО «НЛМК»	RUR	30	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
PIKK	Курс акции ОАО «Группа Компаний ПИК»	RUR	30	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
PLZL	Курс акции ОАО "Полус Золото"	RUR	2	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
RASP	Курс акции ОАО "Распадская"	RUR	20	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45

RBCI	Курс акции ОАО «РБК Информационные Системы»	RUR	100	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
ROSN	Курс акции НК «Роснефть»	RUR	20	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
RTKM	Курс акции ОАО «Ростелеком»	RUR	30	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
SIBN	Курс акции ОАО «Газпром нефть»	RUR	30	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
SNGS	Курс акции ОАО «Сургутнефтегаз»	RUR	100	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
TATN	Курс акции ОАО «Татнефть»	RUR	20	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
TRNFP	Курс акции ОАО «АК «Транснефть»	RUR	1	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
URKA	Курс акции ОАО "Уралкалий"	RUR	30	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
VTBR	Курс акции ОАО «Банк ВТБ»	RUR	100000	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
AKRN	Курс акции ОАО «Акрон»	RUR	5	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
MSNG	Курс акции ОАО «Мосэнерго»	RUR	1000	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45

Таблица 5. Финансовые инструменты на основе курса акций американских компаний

Тикер	Описание инструмента	Валюта котировки	Размер лота	Первонач. маржа	Необх. маржа	Конвертор	Комиссия	расписание торгов (время Киевское)
AA	Курс акции компании Alcoa Inc.	USD	20	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
AAPL	Курс акции компании Apple Computer, Inc.	USD	1	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
AMR	Курс акции компании AMR Corporation	USD	30	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00

BAC	Курс акции компании Bank of America Corp.	USD	20	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
C	Курс акции компании Citigroup Inc.	USD	50	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
EBAY	Курс акции компании eBay Inc.	USD	10	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
F	Курс акции компании Ford Motor Company	USD	20	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
GE	Курс акции компании General Electric co	USD	20	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
GOOG	Курс акции компании Google Inc.	USD	1	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
HPQ	Курс акции компании Hewlett Packard co	USD	10	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
INTC	Курс акции компании Intel Corporation	USD	10	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
JPM	Курс акции компании J.P. Morgan Chase & Co.	USD	10	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
KO	Курс акции компании Coca- Cola co.	USD	10	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
MSI	Курс акции Motorola Solutions, Inc.	USD	10	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
MSFT	Курс акции компании Microsoft corporation	USD	10	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
NOK	Курс акции компании Nokia corp.	USD	20	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
TM	Курс акции компании Toyota Motor Corporation	USD	5	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
TTM	Курс акции компании Tata Motors Ltd	USD	10	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00

YHOO	Курс акции компании Yahoo! Inc.	USD	20	5,00%	20,00%	USDRUR	0,30%	16:30 – 23:00
------	---------------------------------	-----	----	-------	--------	--------	-------	---------------

Таблица 6. Финансовые инструменты на основе цен товарного рынка

Тикер	Описание инструмента	Валюта котировки	Размер лота	Первонач. маржа	Необх. маржа	Конвертор	Комиссия	расписание торгов (время Киевское)
GASOLINEcf d	Средняя цена бензина АИ95	RUR	10000	0,5%	20,00%	1	0,02%	01:00 пнд - 22:00 птн
NG	Цена фьючерсного контракта на стоимость одного декаترم природного газа в долларах США	USD	100	5,00%	20,00%	USDRUR	0,15%	01:00 пнд - 22:00 птн
RBOV	Цена фьючерсного контракта на стоимость одного галлона бензина RBOV в долларах США	USD	100	5,00%	20,00%	USDRUR	0,15%	01:00 пнд - 22:00 птн

Таблица 7. Финансовые инструменты на основе цен драгоценных металлов

Тикер	Описание инструмента	Валюта котировки	Размер лота	Первонач. маржа	Необх. маржа	Конвертор	Комиссия	расписание торгов (время Киевское)
PLATINUM	Стоимость 1 тройской унции платины в долларах США	USD	1	1,5%	20,00%	USDRUR	0,03%	01:00 пнд - 22:00 птн
Silver	Стоимость одной унции серебра	USD	100	1,50%	20,00%	USDRUR	0,06%	01:00 пнд - 22:00 птн
GOLDRUR	Стоимость одного грамма золота в российских рублях	RUR	10	5,00%	20,00%	1	0,06%	01:00 пнд - 22:00 птн
PTRUR	Стоимость одного грамма платины в российских рублях	RUR	10	5%	20,00%	1	0,06%	01:00 пнд - 22:00 птн
SILVERRUR	Стоимость одного грамма серебра в российских рублях	RUR	1000	5%	20,00%	1	0,06%	01:00 пнд - 22:00 птн

Таблица 8. Финансовые инструменты аграрного рынка

Тикер	Описание инструмента	Валюта котировки	Размер лота	Первонач. маржа	Необх. маржа	Конвертор	Комиссия	расписание торгов (время Киевское)
KC	Стоимость одной тысячи фунтов кофе в долларах США	USD	1	3,00%	20,00%	USDRUR	0,02%	11:00 – 21:00
MILK	Стоимость 100 фунтов молока класса III (СМЕ) в долларах США	USD	100	2,00%	20,00%	USDRUR	0,02%	01:00 пнд - 22:00 птн
CC	Стоимость одной тонны какао в долларах США	USD	1	2,00%	20,00%	USDRUR	0,02%	11:00 – 21:00
HE	Стоимость ста фунтов свинины постной в долларах США	USD	10	2,00%	20,00%	USDRUR	0,02%	17:05 пнд - 22:00 птн
LE	Стоимость ста фунтов живого скота в долларах США	USD	10	2,00%	20,00%	USDRUR	0,02%	17:05 пнд - 22:00 птн
ZW	Стоимость ста бушелей пшеницы в долларах США	USD	1	3,00%	20,00%	USDRUR	0,02%	2:00-15:15, 17:30-21:15
ZC	Стоимость ста бушелей кукурузы в долларах США	USD	1	3,00%	20,00%	USDRUR	0,02%	2:00-15:15, 17:30-21:15
ZS	Стоимость ста бушелей бобов сои в долларах США	USD	1	3,00%	20,00%	USDRUR	0,02%	2:00-15:15, 17:30-21:15
CT	Стоимость ста фунтов хлопка в долларах США	USD	10	7,00%	20,00%	USDRUR	0,02%	04:00 – 21:30

**15. Финансовые инструменты, не обращающиеся на организованном рынке.
Форма торгов – аукционная.**

Таблица 9. Финансовые инструменты валютного рынка

Тикер	Описание инструмента	Валюта котировки	Размер лота	Первонач. маржа	Необх. маржа	Конвертор	Комиссия	расписание торгов (время Киевское)
EURUSD	Курс евро к доллару США	USD	1000	1,00%	20,00%	USDRUR	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
GBPUSD	Курс британского фунта стерлингов к доллару США	USD	1000	1,00%	20,00%	USDRUR	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
USDCHF	Курс доллара США к швейцарскому франку	CHF	1000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDCHF	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
USDJPY	Курс доллара США к японской иене	JPY	1000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDJPY	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн

USDCAD	Курс доллара США к канадскому доллару	CAD	1000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDCAD	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
AUDUSD	Курс австралийского доллара к доллару США	USD	1000	1,00%	20,00%	USDRUR	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
NZDUSD	Курс новозеландского доллара к доллару США	USD	5000	1,00%	20,00%	USDRUR	4,75руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
AUDJPY	Курс австралийского доллара к японской иене	JPY	1000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDJPY	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
AUDNZD	Курс австралийского доллара к новозеландскому доллару	NZD	1000	1,00%	20,00%	USDRUR*NZDUSD	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
CADCHF	Курс канадского доллара к швейцарскому франку	CHF	1000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDCHF	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
CADJPY	Курс канадского доллара к японской иене	JPY	1000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDJPY	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
CHFJPY	Курс швейцарского франка к японской иене	JPY	1000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDJPY	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
EURAUD	Курс евро к австралийскому доллару	AUD	1000	1,00%	20,00%	USDRUR*AUDUSD	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
EURCAD	Курс евро к канадскому доллару	CAD	1000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDCAD	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
EURCHF	Курс евро к швейцарскому франку	CHF	1000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDCHF	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
EURGBP	Курс евро к британскому фунту стерлингов	GBP	1000	1,00%	20,00%	USDRUR*GBPUSD	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
EURJPY	Курс евро к японской иене	JPY	1000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDJPY	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
EURNZD	Курс евро к новозеландскому доллару	NZD	1000	1,00%	20,00%	USDRUR*NZDUSD	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
GBPAUD	Курс британского фунта стерлингов к австралийскому доллару	AUD	1000	1,00%	20,00%	USDRUR*AUDUSD	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн

GBPCAD	Курс британского фунта стерлингов к канадскому доллару	CAD	1000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDCAD	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
GBPCHE	Курс британского фунта стерлингов к швейцарскому франку	CHF	1000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDCHF	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
GBPJPY	Курс британского фунта стерлингов к японской иене	JPY	1000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDJPY	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
GBPNZD	Курс британского фунта стерлингов к новозеландскому доллару	NZD	1000	1,00%	20,00%	USDRUR*NZDUSD	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
NZDJPY	Курс новозеландского доллара к японской иене	JPY	5000	1,00%	20,00%	USDRUR/USDJPY	4,75руб.	01:00 пнд - 22:00 птн
SDRUSD	Стоимость специальных прав заимствования в долларах	USD	1000	1,00%	20,00%	USDRUR	0,95руб.	01:00 пнд - 22:00 птн

Таблица 10. Финансовые инструменты на основе курса акций российских компаний

Тикер	Описание инструмента	Валюта котировки	Размер лота	Первонач. маржа	Необх. маржа	Конвертор	Комиссия	расписание торгов (время Киевское)
GSPBEX	Курс акции ОАО «Газпром»	RUR	20	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45
SBER	Курс акции ОАО «Сбербанк России»	RUR	30	10,00%	20,00%	1	0,15%	09:30 – 17:45

Таблица 11. Финансовые инструменты на основе цен товарного рынка

Тикер	Описание инструмента	Валюта котировки	Размер лота	Первонач. маржа	Необх. маржа	Конвертор	Комиссия	расписание торгов (время Киевское)
BRN	Цена фьючерсного контракта на стоимость одного барреля нефти марки Brent в долларах США	USD	10	5,00%	20,00%	USDRUR	0,15%	01:00 пнд - 22:00 птн

Таблица 12. Финансовые инструменты на основе цен драгоценных металлов

Тикер	Описание инструмента	Валюта котировки	Размер лота	Первонач. маржа	Необх. маржа	Конвертор	Комиссия	расписание торгов (время Киевское)
Gold	Стоимость одной унции золота	USD	1	1,50%	20,00%	USDRUR	0,03%	01:00 пнд - 22:00 птн

Таблица 13. Финансовые инструменты аграрного рынка

Тикер	Описание инструмента	Валюта котировки	Размер лота	Первонач. маржа	Необх. маржа	Конвертор	Комиссия	расписание торгов (время Киевское)
SB	Стоимость 10000 фунтов сахара в долларах США	USD	1	3,00%	20,00%	USDRUR	0,02%	11:00 – 21:00

Примечание: по некоторым инструментам, отображенным в ФИС, торги могут не проводиться; их котировки указываются только в информативных целях.

Вступают в действие с 20.04.2011 г.