

**ЗНАЧЕНИЯ РИСК-ПАРАМЕТРОВ ТОВАРНОГО РЫНКА,  
 УСТАНОВЛЕННЫХ ДЛЯ ОРГАНИЗАТОРА ТОРГОВЛИ ПАО "САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКАЯ БИРЖА"**

Действуют с "22" февраля 2018 г.

**1. Код L ("Двойной встречный аукцион в отделениях Черные металлы, Цветные металлы и сплавы, Драгоценные металлы с обеспечением")**

Риск-параметр		Правила применения риск-параметра	Значение
S,пок з	Ставка обеспечения заявки покупателя	Обеспечение заявки рассчитывается как произведение Ставки обеспечения заявки покупателя, количества Лотов в заявке и цены за Лот, указанной в заявке (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления)	10%
S,прод з	Ставка обеспечения заявки продавца	Контроль заявок продавца не проводится	0
S,пок дог	Ставка обеспечения договора покупателя	Обеспечение договора на дату заключения Договора рассчитывается как произведение Ставки обеспечения заявки покупателя и суммы Договора (V) (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления) за вычетом Обеспечения сборов, рассчитанного как произведение ставки клирингового сбора (С) и суммы Договора (V) (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления).	9.9%
		Обеспечение договора на Дату денежного обеспечения (второй рабочий день от даты заключения Договора).	100%
S,прод дог	Ставка обеспечения договора продавца	Обеспечение договора не предоставляется	0
К	Коэффициент контроля товарного лимита	Контроль заявок продавца не проводится	0
Kpart	Коэффициент частичного исполнения	Частичное исполнение обязательств не допускается	0
Кдо	Коэффициент контроля денежного обеспечения на Дату денежного обеспечения	Проводится Контроль обеспечения денежных обязательств (контроль возможности исполнения денежных обязательств Участника клиринга, возникших из Договора) на Дату денежного обеспечения (второй рабочий день от даты заключения Договора)	1
Кто	Коэффициент контроля товарного обеспечения на Дату товарного обеспечения	Контроль обеспечения товарных обязательств на Дату товарного обеспечения не проводится	0
Ку,пок	Коэффициент контроля исполнения со стороны покупателя	Уведомление об исполнении обязательств по договору предоставляется Участником клиринга, являющимся покупателем Товара до третьего рабочего дня месяца, следующего за месяцем, на который, в соответствии с условиями Договора, приходится дата окончания срока поставки	1
Ку,прод	Коэффициент контроля исполнения со стороны продавца	Уведомление об исполнении обязательств по договору предоставляется Участником клиринга, являющимся продавцом Товара, до третьего рабочего дня месяца, следующего за месяцем, на который, в соответствии с условиями Договора, приходится дата окончания срока поставки.	1

Kret	Коэффициент возврата денежных средств	Возврат денежных средств осуществляется на основании поручения Участника клиринга	0
Кн	Коэффициент выплаты неустойки	Требования по выплате Неустойки исполняются за счет Гарантийного обеспечения Несостоятельного Участника клиринга	1

**2. Код Q ("Торги по покупке-продаже вагонов со 100% ИКО")**

Риск-параметр		Правила применения риск-параметра	Значение
S,пок з	Ставка обеспечения заявки покупателя	Обеспечение заявки рассчитывается как произведение Ставки обеспечения заявки покупателя, количества Лотов в заявке и цены за Лот, указанной в заявке (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления)	2%
S,прод з	Ставка обеспечения заявки продавца	Контроль заявок продавца не проводится	0
S,пок дог	Ставка обеспечения договора покупателя	Обеспечение договора на дату заключения Договора рассчитывается как произведение Ставки обеспечения заявки покупателя и суммы Договора (V) (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления) за вычетом Обеспечения сборов, рассчитанного как произведение ставки клирингового сбора (С) и суммы Договора (V) (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления).  Обеспечение договора на Дату денежного обеспечения (второй рабочий день от даты заключения Договора).	1.9%  100%
S,прод дог	Ставка обеспечения договора продавца	Обеспечение договора не предоставляется	0
К	Коэффициент контроля товарного лимита	Контроль заявок продавца не проводится	0
Kpart	Коэффициент частичного исполнения	Частичное исполнение обязательств не допускается	0
Кдо	Коэффициент контроля денежного обеспечения на Дату денежного обеспечения	Проводится Контроль обеспечения денежных обязательств (контроль возможности исполнения денежных обязательств Участника клиринга, возникших из Договора) на Дату денежного обеспечения (второй рабочий день от даты заключения Договора)	1
Кто	Коэффициент контроля товарного обеспечения на Дату товарного обеспечения	Контроль обеспечения товарных обязательств на Дату товарного обеспечения не проводится	0
Ку,пок	Коэффициент контроля исполнения со стороны покупателя	Уведомление об исполнении обязательств по договору предоставляется Участником клиринга, являющимся покупателем Товара до третьего рабочего дня месяца, следующего за месяцем, на который, в соответствии с условиями Договора, приходится дата окончания срока поставки	1
Ку,прод	Коэффициент контроля исполнения со стороны продавца	Уведомление об исполнении обязательств по договору предоставляется Участником клиринга, являющимся продавцом Товара, до третьего рабочего дня месяца, следующего за месяцем, на который, в соответствии с условиями Договора, приходится дата окончания срока поставки.	1
Kret	Коэффициент возврата денежных средств	Возврат денежных средств осуществляется на основании поручения Участника клиринга	0
Кн	Коэффициент выплаты неустойки	Требования по выплате Неустойки исполняются за счет Гарантийного обеспечения Несостоятельного Участника клиринга	1

### 3. Код D ("Аукцион на повышение по продаже сельскохозяйственной продукции")

Риск-параметр		Правила применения риск-параметра	Значение
S,пок з	Ставка обеспечения заявки покупателя	Обеспечение заявки рассчитывается как произведение Ставки обеспечения заявки покупателя, количества Лотов в заявке и стартовой (начальной) цены Лота (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления)	3%
S,прод з	Ставка обеспечения заявки продавца	Контроль заявок продавца не проводится	0
S,пок дог	Ставка обеспечения договора покупателя	Обеспечение договора рассчитывается на дату заключения Договора как произведение Ставки обеспечения заявки покупателя, количества Лотов (L) в Договоре и стартовой (начальной) цены Лота (Z0) (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления) за вычетом Обеспечения сборов, рассчитанного как произведение ставки клирингового сбора (С) и суммы Договора (V) (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления)	Расчетная величина: $(S,пок з * L * Z0 - C * V) / V$
S,прод дог	Ставка обеспечения договора продавца	Обеспечение договора не предоставляется	0
К	Коэффициент контроля товарного лимита	Для Участника клиринга, являющегося заказчиком аукциона на повышение/понижение по продаже Товара устанавливается ограничение на размер обязательств, которые могут быть допущены к клирингу в размере объема поданных Заявок на продажу Товара  Для Участников клиринга, не являющихся заказчиком аукциона на повышение/понижение по продаже Товара Товарный лимит устанавливается равным нулю (ограничение на объявление заявок на продажу).	1
Kpart	Коэффициент частичного исполнения	Частичное исполнение обязательств не допускается	0
Кдо	Коэффициент контроля денежного обеспечения на Дату денежного обеспечения	Контроль обеспечения денежных обязательств на Дату денежного обеспечения не проводится	0
Кто	Коэффициент контроля товарного обеспечения на Дату товарного обеспечения	Контроль обеспечения товарных обязательств на Дату товарного обеспечения не проводится	0
Ку,пок	Коэффициент контроля исполнения со стороны покупателя	Покупатель, в случае неисполнения товарных обязательств Продавцом, предоставляет Уведомление о неисполнении товарных обязательств Продавцом до даты оформления Акта приема-передачи товара, установленной условиями Договора	0
Ку,прод	Коэффициент контроля исполнения со стороны продавца	Уведомление об исполнении обязательств предоставляется Участником клиринга, являющимся заказчиком аукциона на повышение/понижение по продаже Товара до третьего рабочего дня месяца, следующего за месяцем, на который, в соответствии с условиями Договора, приходится дата окончания срока поставки	1
Kret	Коэффициент возврата денежных средств	Возврат денежных средств без предоставления Участником клиринга поручений осуществляется во всех случаях, установленных п.14.5. Правил клиринга	1
Кн	Коэффициент выплаты неустойки	Требования по выплате Неустойки не исполняются за счет Гарантийного обеспечения Несостоятельного Участника клиринга	0

**4. Код В ("Торги по покупке-продаже товаров в отделении Продукция химической промышленности, с обеспечением ")**

<b>Риск-параметр</b>		<b>Правила применения риск-параметра</b>	<b>Значение</b>
S,пок з	Ставка обеспечения заявки покупателя	Обеспечение заявки рассчитывается как произведение Ставки обеспечения заявки покупателя, количества Лотов в заявке и цены за Лот, указанной в заявке (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления)	10%
S,прод з	Ставка обеспечения заявки продавца	Контроль заявок продавца не проводится	0
S,пок дог	Ставка обеспечения договора покупателя	Обеспечение договора рассчитывается на дату заключения Договора как произведение Ставки обеспечения заявки покупателя и суммы Договора (V) (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления) за вычетом Обеспечения сборов, рассчитанного как произведение ставки клирингового сбора (С) и суммы Договора (V) (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления)	Расчетная величина: $(S_{\text{пок з}} * V - C * V) / V$
S,прод дог	Ставка обеспечения договора продавца	Обеспечение договора не предоставляется	0
К	Коэффициент контроля товарного лимита	Контроль заявок продавца не проводится	0
Kpart	Коэффициент частичного исполнения	Частичное исполнение обязательств не допускается	0
Кдо	Коэффициент контроля денежного обеспечения на Дату денежного обеспечения	Контроль обеспечения денежных обязательств на Дату денежного обеспечения не проводится	0
Кто	Коэффициент контроля товарного обеспечения на Дату товарного обеспечения	Контроль обеспечения товарных обязательств на Дату товарного обеспечения не проводится	0
Ку,пок	Коэффициент контроля исполнения со стороны покупателя	Уведомление об исполнении обязательств предоставляется Участником клиринга, являющимся покупателем Товара до третьего рабочего дня месяца, следующего за месяцем, на который, в соответствии с условиями Договора, приходится дата окончания срока поставки	1
Ку,прод	Коэффициент контроля исполнения со стороны продавца	Уведомление об исполнении обязательств предоставляется Участником клиринга, являющимся продавцом Товара до третьего рабочего дня месяца, следующего за месяцем, на который, в соответствии с условиями Договора, приходится дата окончания срока поставки	1
Kret	Коэффициент возврата денежных средств	Возврат денежных средств осуществляется на основании поручения Участника клиринга	0
Кн	Коэффициент выплаты неустойки	Требования по выплате Неустойки исполняются за счет Гарантийного обеспечения Несостоятельного Участника клиринга	1

**5. Код F ("Торги по покупке-продаже строительных материалов со 100% ИКО")**

<b>Риск-параметр</b>		<b>Правила применения риск-параметра</b>	<b>Значение</b>
S,пок з	Ставка обеспечения заявки покупателя	Обеспечение заявки рассчитывается как произведение Ставки обеспечения заявки покупателя, количества Лотов в заявке и цены за Лот, указанной в заявке (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления)	10%
S,прод з	Ставка обеспечения заявки продавца	Контроль заявок продавца не проводится	0
S,пок дог	Ставка обеспечения договора покупателя	Обеспечение договора на дату заключения Договора рассчитывается как произведение Ставки обеспечения заявки покупателя и суммы Договора (V) (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления) за вычетом Обеспечения сборов, рассчитанного как произведение ставки клирингового сбора (С) и суммы Договора (V) (величина определяется с точностью до копеек по правилам математического округления).  Обеспечение договора на Дату денежного обеспечения (третий рабочий день от даты заключения Договора).	9.9%  100%
S,прод дог	Ставка обеспечения договора продавца	Обеспечение договора не предоставляется	0
К	Коэффициент контроля товарного лимита	Контроль заявок продавца не проводится	0
Kpart	Коэффициент частичного исполнения	Частичное исполнение обязательств не допускается	0
Кдо	Коэффициент контроля денежного обеспечения на Дату денежного обеспечения	Проводится Контроль обеспечения денежных обязательств (контроль возможности исполнения денежных обязательств Участника клиринга, возникших из Договора) на Дату денежного обеспечения (третий рабочий день от даты заключения Договора)	1
Кто	Коэффициент контроля товарного обеспечения на Дату товарного обеспечения	Контроль обеспечения товарных обязательств на Дату товарного обеспечения не проводится	0
Ку,пок	Коэффициент контроля исполнения со стороны покупателя	Уведомление об исполнении обязательств по договору предоставляется Участником клиринга, являющимся покупателем Товара до третьего рабочего дня месяца, следующего за месяцем, на который, в соответствии с условиями Договора, приходится дата окончания срока поставки	1
Ку,прод	Коэффициент контроля исполнения со стороны продавца	Уведомление об исполнении обязательств по договору предоставляется Участником клиринга, являющимся продавцом Товара, до третьего рабочего дня месяца, следующего за месяцем, на который, в соответствии с условиями Договора, приходится дата окончания срока поставки.	1
Kret	Коэффициент возврата денежных средств	Возврат денежных средств осуществляется на основании поручения Участника клиринга	0
Кн	Коэффициент выплаты неустойки	Требования по выплате Неустойки исполняются за счет Гарантийного обеспечения Несостоятельного Участника клиринга	1

**6. Все Коды\*, за исключением указанных в п.п.1-5.**

Риск-параметр		Правила применения риск-параметра	Значение
S,пок з	Ставка обеспечения заявки покупателя	Контроль заявок покупателя не проводится	0
S,прод з	Ставка обеспечения заявки продавца	Контроль заявок продавца не проводится	0
S,пок дог	Ставка обеспечения договора покупателя	Обеспечение договора не предоставляется	0
S,прод дог	Ставка обеспечения договора продавца	Обеспечение договора не предоставляется	0
К	Коэффициент контроля товарного лимита  (во всех Режимах торгов, где торги проводятся в форме аукциона на повышение/понижение и заказчиком аукциона является продавец Товара)	Для Участника клиринга, являющегося заказчиком аукциона на повышение/понижение по продаже Товара устанавливается ограничение на размер обязательств, которые могут быть допущены к клирингу в размере объема поданных Заявок на продажу Товара Для Участников клиринга, не являющихся заказчиками аукциона на повышение/понижение по продаже Товара Товарный лимит устанавливается равным нулю (ограничение на объявление заявок на продажу).	1
К	Коэффициент контроля товарного лимита  (во всех Режимах торгов, где торги проводятся в форме аукциона на повышение/понижение и заказчиком аукциона является покупатель Товара)	Для Участников клиринга, не являющихся заказчиками аукциона на повышение/понижение по покупке Товара устанавливается ограничение на размер обязательств, которые могут быть допущены к клирингу в размере объема поданных Заявок на продажу Товара Для Участника клиринга, являющегося заказчиком аукциона на повышение/понижение по покупке Товара Товарный лимит устанавливается равным нулю (ограничение на объявление заявок на продажу)	1
К	Коэффициент контроля товарного лимита (во всех Режимах торгов, где торги проводятся в форме двойного встречного аукциона)	Контроль заявок продавца не проводится	0
Kpart	Коэффициент частичного исполнения	Частичное исполнение обязательств не допускается	0
Kдо	Коэффициент контроля денежного обеспечения на Дату денежного обеспечения	Контроль обеспечения денежных обязательств на Дату денежного обеспечения не проводится	0
Kто	Коэффициент контроля товарного обеспечения на Дату товарного обеспечения	Контроль обеспечения товарных обязательств на Дату товарного обеспечения не проводится	0
Kу,пок	Коэффициент контроля исполнения со стороны покупателя	Покупатель, в случае неисполнения товарных обязательств Продавцом, предоставляет Уведомление о неисполнении товарных обязательств Продавцом до третьего рабочего дня месяца, следующего за месяцем, на который, в соответствии с условиями Договора, приходится дата окончания срока поставки. Уведомление об исполнении обязательств может быть предоставлено в те же сроки.	0
Kу,прод	Коэффициент контроля исполнения со стороны продавца	Продавец, в случае неисполнения денежных обязательств Покупателем, предоставляет Уведомление о неисполнении денежных обязательств Покупателем до третьего рабочего дня месяца, следующего за месяцем, на который, в соответствии с условиями Договора, приходится дата окончания срока поставки. Уведомление об исполнении обязательств может быть предоставлено в те же сроки.	0
Kret	Коэффициент возврата денежных средств	Возврат денежных средств без предоставления Участником клиринга поручений не осуществляется	0
Кн	Коэффициент выплаты неустойки	Требования по выплате Неустойки не исполняются за счет Гарантийного обеспечения Несостоятельного Участника клиринга	0

\* Значения Кодов размещены на сайте Организатора торговли по адресу: [www.spbexchange.ru](http://www.spbexchange.ru)