*В НКО НКЦ (АО)*

**ЗАЯВЛЕНИЕ на установление параметров учета рисков исполнения опционных контрактов**

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_,

(*наименование Участника клиринга*)

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |

Идентификатор Участника клиринга:

Прошу установить следующие значения параметров учета рисков исполнения опционных контрактов, учитываемых на разделах регистров учета позиций в рамках Брокерской фирмы с кодом XXYY000:

|  |  |
| --- | --- |
| **Параметр[[1]](#footnote-1)** | **Значение параметра[[2]](#footnote-2)** |
| **D** |  |
| **W** |  |

Контактное лицо: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ (ФИО)

Контактный телефон: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. **Расшифровка поля «Параметр»**:

   D - количество клиринговых сессий, за которое применится значение W.

   W - вес учета рисков с учетом сценариев исполнения опционных контрактов. [↑](#footnote-ref-1)
2. **Порядок заполнения поля «Значения параметра»**:

   По D может устанавливаться значение от 0 до 999, указывается целое число. По умолчанию стоит значение «0».

   По W может устанавливаться значение от 0 до 1, указывается дробное число с двумя знаками после запятой. По умолчанию стоит значение «0». [↑](#footnote-ref-2)