**Список Ликвидных ценных бумаг по состоянию на 12 марта 2024 года.**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Наименование ЦБ** | **КСУР, в %** | | | | **КПУР, в %** | | | | **КОУР, в %** | | | |
| **Dlong** | **Dshort** | **Dmin long** | **Dmin short** | **Dlong** | **Dshort** | **Dmin long** | **Dmin short** | **Dlong** | **Dshort** | **Dmin long** | **Dmin short** |
| ПАО «Газпром», акция обыкновенная, RU0007661625 | Рассчитывается по формуле: Dlong = 1 - (1-r\*5,9)2 , где r - ставка риска\* | Рассчитывается по формуле: Dshort = (1+r\*5,9)2 - 1 , где r - ставка риска\* | Рассчитывается по формуле: Dmin long = ½Dlong | Рассчитывается по формуле: Dmin short = ½Dshort | Рассчитывается по формуле: Dlong = r\*5,9, где r - ставка риска\* | Рассчитывается по формуле: Dshort = r \*5,9, где r - ставка риска\* | Рассчитывается по формуле: Dmin long = ½Dlong | Рассчитывается по формуле: Dmin short = ½Dshort | Рассчитывается по формуле: Dlong = r\*5,9, где r - ставка риска\* | Рассчитывается по формуле: Dshort = r\*5,9, где r - ставка риска\* | Рассчитывается по формуле: Dmin long = ½Dlong | Рассчитывается по формуле: Dmin short = ½Dshort |
| ПАО НК ЛУКОЙЛ, акция обыкновенная, RU0009024277 |
| ПАО Сбербанк России, акция обыкновенная, RU0009029540 |
| ПАО Сбербанк России, акция привилегированная, RU0009029557 |
| ПАО НК Роснефть, акция обыкновенная, RU000A0J2Q06 |
| ПАО Аэрофлот, акция обыкновенная, RU0009062285 |
| ПАО Сургутнефтегаз, акция обыкновенная, RU0008926258 |
| ПАО Сургутнефтегаз, акция привилегированная, RU0009029524 |
| ПАО АЛРОСА, акция обыкновенная, RU0007252813 |
| ПАО Северсталь, акция обыкновенная, RU0009046510 |
| ПАО НОВАТЭК, акция обыкновенная, RU000A0DKVS5 |
| ПАО Московская Биржа, акция обыкновенная, RU000A0JR4A1 |
| ПАО МТС, акция обыкновенная, RU0007775219 |
| ПАО Магнит, акция обыкновенная, RU000A0JKQU8 |
| ПАО Банк ВТБ, акция обыкновенная, RU000A0JP5V6 |
| ПАО ГМК Норильский Никель, акция обыкновенная, RU0007288411 |
| ПАО ММК, акция обыкновенная, RU0009084396 |
| ПАО НЛМК, акция обыкновенная, RU0009046452 |
| ПАО «Татнефть» им. В.Д. Шашина, акция обыкновенная, RU0009033591 |
| ПАО Газпром нефть, акция обыкновенная, RU0009062467 |
| «PLLC Yandex N.V. class A shs», акция обыкновенная, NL0009805522 |
| CNYRUB\_TOM (валютная пара «Юань– Рубль» с расчетами «завтра») |
| ПАО ФосАгро, акция обыкновенная, RU000A0JRKT8 |

\* Ставки риска являются изменяемыми параметрами и рассчитываются Небанковской кредитной организацией - центральным контрагентом "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) (далее - НКЦ) каждый торговый день. Ставки риска по каждой ценной бумаге публикуются на интернет-сайте НКЦ https://www.nationalclearingcentre.ru/ в разделе Управление рисками.

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Наименование ЦБ** | **КСУР, в %** | | | | **КПУР, в %** | | | | **КОУР, в %** | | | |
| **Dlong** | **Dshort** | **Dmin long** | **Dmin short** | **Dlong** | **Dshort** | **Dmin long** | **Dmin short** | **Dlong** | **Dshort** | **Dmin long** | **Dmin short** |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26215RMFS2 | Рассчитывается по формуле: Dlong = 1 - (1-r)2 , где r - ставка риска\* | - | Рассчитывается по формуле: Dmin long = ½Dlong | - | Рассчитывается по формуле: Dlong = r, где r - ставка риска\* | - | Рассчитывается по формуле: Dmin long = ½Dlong | - | Рассчитывается по формуле: Dlong = r, где r - ставка риска\* | - | Рассчитывается по формуле: Dmin long = ½Dlong | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26222RMFS8 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU29006RMFS2 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26219RMFS4 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26226RMFS9 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26207RMFS9 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26212RMFS9 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26218RMFS6 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26221RMFS0 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26225RMFS1 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26227RMFS7 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26236RMFS8 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26224RMFS4 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26228RMFS5 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26230RMFS1 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26233RMFS5 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26241RMFS8 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26242RMFS6 | - | - | - | - | - | - |
| Министерство финансов РФ, облигации федерального займа, SU26243RMFS4 | - | - | - | - | - | - |

\* Ставки риска являются изменяемыми параметрами и рассчитываются Небанковской кредитной организацией - центральным контрагентом "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество) (далее - НКЦ) каждый торговый день. Ставки риска по каждой ценной бумаге публикуются на интернет-сайте НКЦ https://www.nationalclearingcentre.ru/ в разделе Управление рисками.