

An aerial photograph of a city skyline at sunset. The sky is a mix of orange, yellow, and blue. In the foreground, a cluster of modern skyscrapers stands out, with some buildings reflecting the warm light. A river or canal is visible on the left side of the frame. The right side of the image is partially obscured by a large red rectangle containing white text.

ДЕТАЛИЗАЦИЯ УТИЛИЗАЦИИ ЛИМИТОВ КОНЦЕНТРАЦИИ НА ЭМИТЕНТОВ В КЛИРИНГОВОМ ТЕРМИНАЛЕ

ОБЩАЯ ИНФОРМАЦИЯ



ЛИМИТ КОНЦЕНТРАЦИИ: Лимит для контроля уровня концентрации переданных в Обеспечение ценных бумаг определенного вида по определенному Эмитенту.

ПОРЯДОК УЧЕТА:

- ✓ Экспозиция на группу активов эмитента рассчитывается как сумма Обеспечения` для всех ценных данного Эмитента для каждого ТКС;
- ✓ Риск концентрации на группу активов эмитента рассчитывается по формуле:

$$Concentration = \max \left(\sum_i \text{Экспозиция на эмитента}_i - \text{Лимит концентрации} ; 0 \right)$$

✓ Единый лимит с учетом риска концентрации на эмитентов рассчитывается по формуле:

$$\begin{aligned} &\text{Единый лимит Участника клиринга с учетом рисков концентрации на Эмитентов} \\ &= \text{ЕЛ}_{\text{РК ЛКЭ}} + \text{Требование по обеспечению рисков концентрации} \\ &+ \sum_i \max(\text{ЕЛ}(i); 0) - \sum_{j,t} \text{Concentration}_{j,t}^i; \end{aligned}$$

ПРИМЕР РАСЧЕТА:

✓ По двум ТКС Участника клиринга Обеспечение` представлено ценными бумагами Газпром, по каждому из ТКС рассчитан Единый лимит, Лимит концентрации на Группу Газпром равен 500, на РК для учета Обеспечения под риск концентрации на эмитента учтено обеспечение в размере 1400, следовательно расчеты ЕЛ с учетом риска концентрации представлены ниже:

РК	Наименования актива в обеспечении	Обеспечение'	Группа активов	ЕЛ	Экспозиция на группу активов (EXPO)	Риск концентрации (CONC)	Требование по обеспечению риска концентрации на Эмитента	Единый лимит с учетом рисков концентрации на Эмитентов (CONL)			
12345	Облигации Газпром 1	500	GAZP_bonds	100	500+1000=1500	max(((1500+500)-500);0)=1500	-min(((1000+100)-1500);0)=400	(1400-400)+400+(100+1000)-1500=1000			
12345	Облигации Газпром 2	1000									
54321	Облигации Газпром 1	400		1000	400+100=500						
54321	Облигации Газпром 2	100									

ОПИСАНИЕ ПРЕДСТАВЛЕНИЯ ДАННЫХ

- Отчет «Лимиты концентрации на эмитентов» отражается в Клиринговом терминале.
- Данные обновляются по завершению последней расчетной сессии по ценным бумагам ~ 20:30 и транслируются до следующего обновления.

Идентификатор фирмы	ТКС	РК	Группа активов	Лимит концентрации на группу эмитентов	Значение	Тип
МС0000000000	-	-	-	-	1 000 000.00	CONL
МС0000000000	-	-	1111_bonds	500 000.00	1 500 000.00	CONC
МС0000000000	S00+00000000	12345	1111_bonds	500 000.00	500 000.00	EXPO
МС0000000000	L00+00000000	54321	1111_bonds	500 000.00	1 500 000.00	EXPO

- Группа активов - Код, обозначающего группу активов Эмитента, по которому учитывается лимит концентрации.
- Значение – величина показателя соответствующий типу записи
- Тип записи

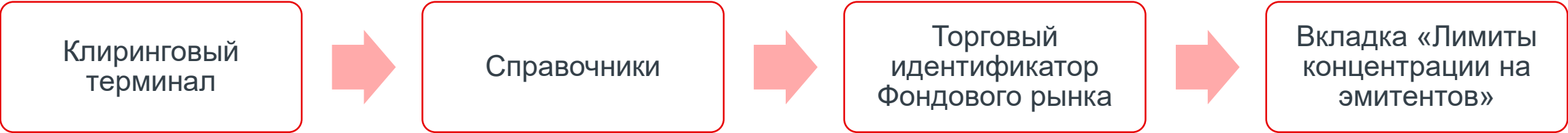
EXPO - Экспозиция на группу активов эмитента

CONC - Риск концентрации на группу активов эмитента

CONL - Единый лимит с учетом риска концентрации на эмитентов

- Методика контроля лимитов концентрации на эмитентов размещена на сайте по ссылке: [Методика контроля ЛКЭ](#).
- Установленные значения лимитов концентрации на эмитентов представлены по ссылке: [Лимиты концентрации на эмитентов](#).
- Соответствие кода группы и наименование группы инструментов представлено в Приложении 1, либо по ссылке: [Соответствие кода группы и наименования группы инструментов](#).

ОТРАЖЕНИЕ В КЛИРИНГОВОМ ТЕРМИНАЛЕ (1/2)



Скриншоты интерфейса клирингового терминала.

Верхний скриншот: Вид на раздел «СПРАВОЧНИКИ». В подменю «Торговые идентификаторы» (выделено красной пунктирной рамкой) отображается таблица:

ИДЕНТИФИКАТОР	РЫНОК	ПРИОРИТЕТНЫЙ ТКС ДЛЯ ОПС	ОСНОВНОЙ РК	РК ДЛЯ М-ДЕПОЗИТА
NC0111100000	Фондовый		10111	
11	Срочный			
MB0111100000	Валютный		10111	

Нижний скриншот: Вид на «КАРТОЧКА ИДЕНТИФИКАТОРА ФИРМЫ NC0111100000». Вкладка «Лимиты концентрации на эмитентов» (выделена красной пунктирной рамкой) является активной. В меню навигации также видны: «Общая информация», «Торгово-клиринговые счета», «Тарифные планы», «Заявления на дополнительные отчеты».

ОТРАЖЕНИЕ В КЛИРИНГОВОМ ТЕРМИНАЛЕ (2/2)

Возможности работы с таблицей «Лимиты концентрации на эмитентов»:

- Выгрузка данных в PDF, CVS
- Сортировка по всем столбцам;
- Фильтрация по полям «ТКС», «Тип» и «Код группы инструментов» с помощью «Поиск».

МОЕХ

НАЦИОНАЛЬНЫЙ
КЛИРИНГОВЫЙ
ЦЕНТР

eng | рус

все рынки

все активы

все ПК

🔍

ООО "ТестКомпани"

Уникод: 0111100000

Профиль СКЗИ: ГОСТ 2024_GOST_Firm11u1

14.07.2025

3+

📧

🔧

ПЕРЕВОДЫ

РАСЧЁТНЫЕ КОДЫ

СЧЕТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ

ДОКУМЕНТЫ

СПРАВОЧНИКИ

Реквизиты для возврата обеспечения

Торговые идентификаторы

Брокерские фирмы

Главная

Торговые идентификаторы

Карточка идентификатора фирмы NC0111100000

ТОРГОВЫЙ ИДЕНТИФИКАТОР NC0111100000

Общая информация

Торгово-клиринговые счета

Тарифные планы

Заявления на дополнительные отчеты

Лимиты концентрации на эмитентов

Закреть форму

+

Поиск

быстрый поиск

🔍

Обновить

Выгрузить

Информация по состоянию на 20:30:29 04.08.2025

ТКС	ПК	КОД ГРУППЫ ИНСТРУМЕНТОВ	ЛИМИТ КОНЦЕНТРАЦИИ НА ЭМИТЕНТА, РУБ	ЗНАЧЕНИЕ, РУБ	ТИП
		2491_BOND	1 050 000 000.00	—	CONC
L00b00002C3A	10111	123_BOND	11 134 000 000.00	913 710.00	EXPO
Y00-00002C23	20333	29_BOND	170 662 000 000.00	135 577 762.00	EXPO
L00-00001972	10555	341_SHARE	451 000 000.00	161 005.00	EXPO
		1346_BOND	1 000 000 000.00	—	CONC
L01e00000F00	10999	140450_SHARE	842 000 000.00	166 415 701.00	EXPO
Y00-00003B3B	30111	215_BOND	103 568 000 000.00	2 088 491.00	EXPO
		—		2 796 364 800 168.00	CONL
S00+000004F7	10888	215_BOND	103 568 000 000.00	844 664 777.00	EXPO
Y00-00002134	20777	90_SHARE	10 922 000 000.00	4 605 375.00	EXPO

Показано с 1 по 10 из 762

1

2

3

4

5

...

77

ПРИЛОЖЕНИЕ 1.

Соответствие Кода группы инструментов и
Наименования группы инструментов

Наименование группы инструментов	Код группы инструментов
Alrosa_SHARE	123_SHARE
BankSPB_SHARE	341_SHARE
FGC_Rosseti_SHARE	305_SHARE
FosAgro_SHARE	346_SHARE
Gazprom_SHARE	29_SHARE
HeadHunter_SHARE	140450_SHARE
InterRAO_SHARE	446_SHARE
Lukoil_SHARE	126_SHARE
Magnit_SHARE	504_SHARE
MMK_SHARE	299_SHARE
MOEX_SHARE	1_SHARE
Mosenergo_SHARE	36_SHARE
MTS_SHARE	54_SHARE
NLMK_SHARE	257_SHARE
NorNickel_SHARE	1367_SHARE
Novatek_SHARE	103_SHARE
PIK_SHARE	1446_SHARE
Polus_SHARE	349_SHARE
Rosneft_SHARE	181_SHARE
Rostelecom_SHARE	393_SHARE
Rusal_SHARE	512_SHARE
RusHydro_SHARE	384_SHARE
Sberbank_SHARE	90_SHARE
Sberbank_SHAREP	90_SHAREP
Severstal_SHARE	129_SHARE
Sovcomflot_SHARE	1601_SHARE
Surgutneftegaz_SHARE	298_SHARE
Surgutneftegaz_SHAREP	298_SHAREP
Tatneft_SHARE	240_SHARE
Tatneft_SHAREP	240_SHAREP
TCSG_SHARE	1160_SHARE
Transneft_SHAREP	83_SHAREP
Unipro_SHARE	1162_SHARE
VKCO_SHARE	61038_SHARE
VTB_SHARE	11_SHARE
Yandex_SHARE	534_SHARE

Наименование группы инструментов	Код группы инструментов
Aeroflot_BOND	1161_BOND
Akron_BOND	375_BOND
AlfaBank_BOND	55_BOND
Alrosa_BOND	123_BOND
Atomenergo_BOND	642_BOND
Bashneft_BOND	184_BOND
DOMRF_BOND	336_BOND
EDB_BOND	1168_BOND
FGC_Rosseti_BOND	305_BOND
FosAgro_BOND	346_BOND
Gazprom_BOND	29_BOND
GazpromNeft_BOND	32_BOND
GPB_BOND	30_BOND
HMAO_BOND	89408_BOND
LenEnergy_BOND	318_BOND
Lukoil_BOND	126_BOND
Magnit_BOND	504_BOND
Megafon_BOND	190_BOND
MetalloInvest_BOND	191_BOND
MOEK_BOND	37_BOND
MOESK_BOND	307_BOND
Mortgage_DOMRF_BOND	510_BOND
Moscow_BOND	1164_BOND
Moscow_obl_BOND	129059_BOND
MTS_BOND	54_BOND
NizhnekamskNK_BOND	440_BOND
NLMK_BOND	257_BOND
NorNickel_BOND	1367_BOND
Novatek_BOND	103_BOND
Novotrans_BOND	2491_BOND
OGK2_BOND	31_BOND
Polus_BOND	349_BOND
PSBBank_BOND	113_BOND
ROSBANK_BOND	79_BOND
Rosneft_BOND	181_BOND
Rosselhoz_BOND	107_BOND
Rosseti_Centre_BOND	308_BOND
Rostelecom_BOND	393_BOND
RusHydro_BOND	384_BOND
RZD_BOND	215_BOND
Saint-Petersburg_BOND	89409_BOND
Sberbank_BOND	90_BOND
Severstal_BOND	129_BOND
SIBUR_BOND	104_BOND
SOPF_BOND	1346_BOND
SOPFinf_BOND	45427_BOND
Sovcombank_BOND	286_BOND
Sovcomflot_BOND	1601_BOND
Transneft_BOND	83_BOND
VEB_BOND	68_BOND
VTB_BOND	11_BOND
X5_BOND	505_BOND
Yandex_BOND	534_BOND