

Календарь применения специальных риск-параметров 2021 год

	18.01.2021	15.02.2021	02.04.2021	05.04.2021	03.05.2021	31.05.2021	05.07.2021	30.08.2021	06.09.2021	24.11.2021	24.12.2021	27.12.2021	28.12.2021
	Martin Luther King Jr. Day	Presidents' Day	Good Friday	Easter Monday	May Day	Memorial Day	Independence Day	UK Holiday	Labor Day	Thanksgiving	Christmas Day	Christmas Day UK	Boxing Day
CME Фьючерсный контракт на													
CL нефть Light Sweet Crude Oil													
NG природный газ													
GOLD аффинированное золото в слитках													
SILV аффинированное серебро в слитках	Стандартные	Стандартные	Специальные	Стандартные	Стандартные	Стандартные	Стандартные	Стандартные	Стандартные	Стандартные	Специальные	Стандартные	Стандартные
PLD аффинированный палладий в слитках													
PLT аффинированную платину в слитках													
ICE Фьючерсный контракт на													
BR нефть BRENT	Стандартные	Стандартные	Специальные	Стандартные	Стандартные	Стандартные	Стандартные	Стандартные	Стандартные	Стандартные	Специальные	Стандартные	Стандартные
LBMA Фьючерсный контракт на													
ALMN алюминий													
Co медь	Стандартные	Стандартные	Специальные	Специальные	Специальные	Специальные	Стандартные	Специальные	Стандартные	Стандартные	Стандартные	Специальные	Специальные
Ni никель													
Zn цинк													

 праздничный день соответствующей зарубежной бирже

Значения риск-параметров

Риск-параметры	Стандартные	Специальные	
		для нефти	для других
AutoShiftNumMR	10	0	2
FutMonTime	3 мин	-	30 мин
FutRange	0.66	0.3	-

Расшифровка параметров:

AutoShiftNumMR - максимальное количество автоматических сдвигов в течение каждого Расчетного периода и вечерней дополнительной сессии. Спец. значение действует с 10:00 до 23:00 праздничного дня для фьючерсов нефть BRENT и Light Sweet Crude Oil, для других контрактов с 19:00 дня кануне до 23:00 праздничного дня

FutMonTime - время мониторинга достаточности границ ценового коридора в течение каждого Расчетного периода. Спец. значение действует с 10:00 до 23:00 праздничного дня

FutRange - шири ценового коридора в долях от диапазона оценки рисков. Спец. значение действует с 19:00 дня кануне до 19:00 праздничного дня