

Процедура переноса открытой позиции на следующий операционный день платформы.

Ввиду того, что суть осуществления операции с беспоставочными внебиржевыми финансовыми инструментами не предполагает поставку актива, для того, чтобы не вызвать необходимость расчетов все незакрытые позиции в текущем операционном дне подлежат переносу на следующий операционный день (процедура переноса позиции).

Процедура переноса позиции представляет собой закрытие открытой позиции в текущем операционном дне и ее открытие в следующем операционном дне с корректировкой по процедуре переноса позиции, величина которой рассчитывается в пипсах (пипс -минимальная величина изменения котировки валютной пары).

Размеры корректировок по процедуре переноса позиции устанавливаются Dukascopy Bank SA согласно соглашению о партнерстве на условиях White Label. Актуальная информация о размерах корректировок по процедуре переноса позиции размещена на корпоративном сайте Банка в сети Интернет mtbankfx.by.

Размер корректировки по процедуре переноса позиции зависит от применяемой программы переноса позиции. Применяется три программы переноса позиции: Premium, Advanced, Regular.

Тип программы переноса зависит от операционной активности Клиента, которая рассчитывается как отношение суммы всех исполненных распоряжений по открытию или закрытию позиций, за исключением суммы распоряжений по открытию и закрытию позиций перенесенных на следующий рабочий день (внутридневной операционный оборот) к сумме внутридневного операционного оборота и сумме распоряжений по открытию позиций для переноса на следующий операционный день.

Операционная активность рассчитывается в процентах за последние тридцать календарных дней. Необходимые уровни операционной активности для каждого из типов программы переноса: Premium >90%, Advanced > 20%, Regular < 20%.

Пример расчета операционной активности:

Пример №1

За последние 30 календарных дней Клиент открыл 6 позиций на 1 миллион, закрыл 5 позиций в тот же день и оставил 1 позицию на следующий операционный день.

| | |
|--|------------|
| Объем распоряжений на открытие позиции | 6 000 000 |
| Объем распоряжений на закрытие позиции | 5 000 000 |
| Объем перенесенных на следующий день позиций на 1 день | 1 000 000 |
| Внутридневной операционный оборот | 11 000 000 |
| Внутридневной операционный оборот и объем перенесенных на следующий день позиций | 12 000 000 |
| Операционная Активность: $(11\ 000\ 000 / 12\ 000\ 000) * 100\% = 92\%$ Тип программы переноса будет: Premium | |

Пример №2

За последние 30 календарных дней, Клиент открыл позицию на 1 миллион и оставил ее на 9 дней перед закрытием.

| | |
|--|------------|
| Объем распоряжений на открытие позиции | 1 000 000 |
| Объем распоряжений на закрытие позиции | 1 000 000 |
| Объем перенесенных на следующий день позиций на 9 дней | 9 000 000 |
| Внутридневной операционный оборот | 2 000 000 |
| Внутридневной операционный оборот и объем перенесенных на следующий день позиций | 11 000 000 |
| Операционная Активность: $(2\,000\,000 / 11\,000\,000) * 100\% = 18\%$ | |
| Тип программы переноса будет: Regular | |

Пример №3:

За последние 30 календарных дней Клиент не вел никакой активности.

| | |
|--|---|
| Объем распоряжений на открытие позиции | 0 |
| Объем распоряжений на закрытие позиции | 0 |
| Объем перенесенных на следующий день позиций | 0 |
| Внутридневной операционный оборот | 0 |
| Внутридневной операционный оборот и объем перенесенных на следующий день позиций | 0 |
| Операционная Активность: 0% | |
| Тип процедуры переноса по умолчанию будет: Advanced | |

Операционная Активность пересчитывается каждый день во время сэтлмента и представляет собой средний показатель за последние 30 календарных дней.

Advanced уровень применяется к аккаунтам Клиентов по умолчанию в случае отсутствия операционной статистики за последние 30 дней.

Данные о применяемом типе процедуры переноса на следующий день находят отражение в отчетности личного кабинета Клиента.

The screenshot displays the MTBankFX client interface. At the top left is the MTBankFX logo. On the right, the user's login 'stellaM1' and account ID '1204222' are shown. A navigation bar includes 'Мои данные', 'Отчёты', 'Изменить пароль', and 'Выйти из системы'. The main content area is titled 'Отчёты' and 'Программа переноса позиций'. A sidebar on the left lists various reports, with 'Программа переноса позиций' selected. The main report shows a table of transfer programs: Premium (>90%), Improved (50.1%), and Standard (>=0%). Below this is a detailed explanation of how the transfer program is calculated based on trading activity. A summary table shows 'Сводка внутридневных торговых оборотов (ТО) и объемов переноса (ОП)' for account 1204222, with a trading activity of 50.1%. At the bottom, there is a section for 'Отчет о переносе позиций' with date filters and a data table.

Важно!

Просим обратить внимание, что ставки в таблице, представленной в разделе «Процедура переноса открытой позиции на следующий операционный день» отражают ТЕКУЩЕЕ значение корректировок. В соответствии с изменением ставок и цены инструмента эти значения меняются,

поэтому при пересчете прошлых переносов на основе текущих ставок почти наверняка будут образовываться небольшие расхождения.

Необходимо принимать во внимание, что за позиции, проходящие перенос со среды на четверг или с четверга на пятницу (для пар USD/CAD, USD/TRY, USD/RUB) применяется своп в 3-м размере. Это связано с тем, что совершения операций по SPOT предполагает расчет (дата валютирования) через 2 рабочих дня ($t+2$) за исключением вышеприведенных пар, где период составляет $t+1$. Для переносов со среды на четверг (или с четверга на пятницу для отдельных пар) дата валютирования попадает на выходные, поэтому перенос делается сразу на 3 дня (на понедельник).