

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%.

Примеры 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.

Программа переноса				
Моя программа переноса		Ставки	Свопы	Овернайт лог
Действующая программа переноса Advanced				
Программа переноса:		Требуемая активность	Текущая торговая активность	
Premium		>90%		
Advanced		>20%	31.30%	
Regular		≥0%		
Тип программы переноса зависит от операционной активности Клиента, которая рассчитывается в процентах за последние тридцать календарных дней. Размер примененной корректировки по процедуре переноса позиции (далее – Свопы) Вы можете найти в представленных отчетах данного раздела.				
Данные по овернайт и торговому объему				
Аккаунт	Овернайт, млн	Торговый объем, млн	Общий объем, млн	Торговая активность
	0.01 USD	0.00 USD	0.01 USD	31.30%

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 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). Так как дата валютирования попадает на выходные, перенос делается сразу на 3 дня (на понедельник). По некоторым валютным парам дата валютирования может рассчитываться по схеме T+1. По таким парам своп в 3-м размере будет применяться при переносе позиции с четверга на пятницу. Примерами таких пар выступают USD/CAD, USD/TRY, USD/RUB, EUR/RUB.