

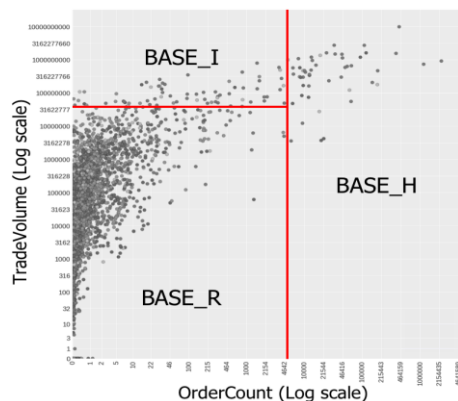
# Агрегированный нетто-объем 1: методология

Клиенты разделяются на группы в зависимости от среднего дневного количества поданных на биржу заявок и среднего дневного объема сделок за последние 60 торговых дней. Для каждого клиента расчет средних значений происходит только с учетом тех дней, в торгах которых клиент принимал участие. Продукт рассчитывается по SBER, GAZP, USDRUB (TOD + TOM), Si, RI

## Принцип разделения клиентов на группы

| Инструмент | BASE_H   | BASE_I  | BASE_R                               |
|------------|--|---|--------------------------------------|
| SBER, GAZP | Среднее кол-во заявок > 5000<br>по всем инструментам рынка акций | Среднее кол-во заявок <= 5000<br>Средний объем сделок > 50 млн. руб.    | Клиенты, не вошедшие в другие группы |
| USDRUB*    | Среднее кол-во заявок > 2000                                     | Среднее кол-во заявок <= 2000<br>Средний объем сделок > 500 млн. руб    |                                      |
| Si         | Среднее кол-во заявок > 2000                                     | Среднее кол-во заявок <= 2000<br>Средний объем сделок > 2000 контрактов |                                      |
| RI         | Среднее кол-во заявок > 1000                                     | Среднее кол-во заявок <= 1000<br>Средний объем сделок > 1000 контрактов |                                      |

## Пример разделения



## Пример расчета нетто-объема по группам для SBER

| Клиент   | Среднее кол-во заявок за последние 60 дней | Средний объем торгов за последние 60 дней | Нетто-объем за сегодня | Группа |
|----------|--|---|------------------------|--------|
| Клиент 1 | 1000                                       | 60 млн. руб.                              | +400                   | BASE_I |
| Клиент 2 | 6000                                       | 20 млн. руб.                              | -200                   | BASE_H |
| Клиент 3 | 7000                                       | 100 млн. руб.                             | -100                   | BASE_H |
| Клиент 4 | 2000                                       | 3 млн. руб.                               | -300                   | BASE_R |
| Клиент 5 | 20   | 1 млн. руб.                               | -400                   | BASE_R |
| Клиент 6 | 500  | 70 млн. руб.                              | +600                   | BASE_I |

| Группа                | Нетто-объем       |
|-----------------------|-------------------|
| BASE_H (Клиент 2 и 3) | -200 - 100 = -300 |
| BASE_I (Клиент 1 и 6) | 400 + 600 = 1000  |
| BASE_R (Клиент 4 и 5) | -300 - 400 = -700 |

\*Из расчетов по инструменту USDRUB исключены клиенты, нетто-объем которых был позитивным в более чем 70% или менее чем 30% дней из 60 предыдущих торговых дней, и которые принимали участие в торгах в более чем 30 торговых днях из предыдущих 60.

Нетто-объем не публикуется, если в одну из групп попадает менее 20 клиентов.