

ПОРЯДОК
закрытия позиций клиентов, заключивших договор о
брокерском обслуживании на рынках ценных бумаг

Введен в действие Приказом от 15.03.2024

МОСКВА, 2024

Оглавление

1. ОСНОВНЫЕ ПОНЯТИЯ И ОПРЕДЕЛЕНИЯ	3
2. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	4
3. ПОРЯДОК ЗАКРЫТИЯ ПОЗИЦИЙ КЛИЕНТОВ.....	4
4. ОСОБЫЕ СЛУЧАИ ЗАКРЫТИЯ ПОЗИЦИЙ В ТС СРОЧНЫЙ РЫНОК	5
5. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ	5

1. ОСНОВНЫЕ ПОНЯТИЯ И ОПРЕДЕЛЕНИЯ

Настоящий Порядок закрытия позиций клиентов, заключивших договор о брокерском обслуживании на рынках ценных бумаг (далее – Порядок) определяет содержание и последовательность действий Банка, направленных на Закрытие позиций Клиентов со стандартным уровнем риска.

Позиция клиента определяется и рассчитывается Банком в отношении Счета в соответствии с положениями Регламента оказания услуг на рынках ценных бумаг (далее - Регламент), которые размещены на интернет-сайте Банка и которые Клиент принял путем присоединения к ним в целом.

Для целей настоящего *Поряка* используются следующие понятия, определения и сокращения:

Закрытие позиций - совершение Банком Офсетных сделок в соответствии с настоящим Порядком.

Основные показатели - Стоимость портфеля Клиента, размер Начальной маржи и размер Минимальной маржи.

Минимальная маржа – показатель, рассчитываемый в соответствии с указанием Банка России от 26 ноября 2020 г. № 5636-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента» (далее – Указание № 5636-У) и применяемый к Портфелям Клиентов, отнесенных Банком к категориям Клиентов со стандартным и (или) повышенным уровнем риска.

Московская Биржа – публичное акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС».

Начальная маржа – показатель, рассчитываемый в соответствии с Указанием № 5636-У и применяемый к Портфелям Клиентов, отнесенных Банком к категориям Клиентов со стандартным и (или) повышенным уровнем риска.

Норматив покрытия риска при изменении стоимости Портфеля Клиента (далее – **НПР2**) – показатель, рассчитываемый в соответствии с Указанием № 5636-У и применяемый к Портфелям Клиентов, отнесенных Банком к категориям Клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска.

Норматив покрытия риска при исполнении поручений Клиента (далее – **НПР1**) – показатель, рассчитываемый в соответствии с Указанием № 5636-У и применяемый к Портфелям Клиентов, отнесенных Банком к категориям Клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска.

Ограничительное время закрытия позиций (Ограничительное время) – 16:00:00 по московскому времени каждого торгового дня. Снижение значения НПР2 ниже нуля до ограничительного времени закрытия позиций в течение торгового дня влечет закрытие позиций Клиента в течение этого торгового дня.

Офсетная сделка – Срочная Сделка, влекущая за собой прекращение прав и обязанностей Клиента по ранее открытой Позиции по Срочным Сделкам в связи с возникновением противоположной позиции по одному и тому же Фьючерсному контракту на одном и том же разделе регистра учета позиций. Клиент при присоединении к Регламенту оказания услуг на рынках ценных бумаг или при направлении в Банк Заявления об изменении условий Договора, где указано подключение к ТС Срочный рынок, одновременно передает в Банк Поручение на совершение Офсетной сделки, которая направлена на защиту имущественных интересов Клиента.

Портфель — денежные средства (в валюте Российской Федерации и (или) в иностранной валюте), ценные бумаги и иные активы Клиента, учитываемые на Счете Клиента, которые в соответствии с Договором находятся в распоряжении Банка или должны поступить в распоряжение Банка (имущество Клиента), обязательства из сделок, совершенных за счет указанного имущества Клиента в соответствии с Договором (сделки за счет Клиента), а также задолженность Клиента перед Банком.

Стоимость Портфеля Клиента – показатель, рассчитываемый в соответствии с Указанием № 5636-У и применяемый к Портфелям Клиентов, отнесенных Банком к категориям Клиентов со стандартным и (или) повышенным уровнем риска.

QUIK/webQUIK (рабочее место QUIK/webQUIK) – термин, определенный в пункте 2 Регламента оказания услуг на рынке ценных бумаг.

Все термины, используемые по тексту настоящего документа, имеют значение, данное им в Регламенте, если иное не предусмотрено настоящим документом.

Иные термины, специально не определенные Порядком, используются в значениях, установленных действующим законодательством Российской Федерации, Регламентом.

2. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

2.1. Настоящий документ определяет порядок и сроки закрытия Банком позиций Клиентов в случаях, определенных в Указании № 5636-У.

2.2. Настоящий документ разработан с учетом требований следующих нормативных документов (с последующими изменениями и дополнениями):

- Федеральный закон № 39-ФЗ от 22.04.1996 г. «О рынке ценных бумаг»;
- Указания Банка России от 26 ноября 2020 г. № 5636-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента»;
- иных нормативных правовых актов законодательства Российской Федерации, регулирующих проведение операций на финансовых рынках.

2.3. Клиент относится Банком к следующей категории риска: Клиент со стандартным уровнем риска (далее – КСУР).

2.4. Минимально допустимые числовые значения НПП1 и НПП2 устанавливаются в размере нуля. В случаях, предусмотренных Указанием № 5636-У, возможно возникновение отрицательного значения НПП1 или его снижение относительно своего предыдущего отрицательного значения. При снижении НПП1 ниже нуля Банк ограничивает совершение Клиентом Срочных Сделок.

2.5. Все сроки, указанные в настоящем документе в часах и минутах, определяются по московскому времени.

В случае принятия новых или изменения действующих законодательных нормативных правовых актов, регулирующих осуществление брокерской деятельности, настоящий документ до внесения соответствующих изменений и дополнений действует в части им не противоречащей.

3. ПОРЯДОК ЗАКРЫТИЯ ПОЗИЦИЙ КЛИЕНТОВ

3.1. Банк осуществляет с использованием специализированного программного модуля Системы QUIK контроль позиций Клиента в режиме реального времени с 08:50 до 23:50 каждого торгового дня.

3.2. Банк самостоятельно рассчитывает показатели портфеля клиента: Стоимость портфеля, Начальная маржа, Минимальная маржа, НПП1, НПП2 в соответствии с Указанием № 5636-У на основе ставок риска по доступным для торговли инструментам. Ставки риска Банк определяет самостоятельно.

3.3. Банк с использованием Рабочего места QUIK (при наличии технической возможности) и (или) Рабочего места WebQUIK (при наличии технической возможности) и (или) Приложения МИ в режиме реального времени предоставляет всем Клиентам, совершающим Срочные Сделки, информацию об Основных показателях, рассчитанных Банком в соответствии с Регламентом и приложением к Указанию № 5636-У. Отдельные уведомления при снижении значения НПП1 ниже нуля Банк Клиентам не направляет.

3.4. Банк вправе направить Клиенту, в том числе с использованием Системы QUIK, информационное сообщение об Основных показателях Клиента. При этом соответствующие информационные сообщения, направляемые Банком, не являются уведомлениями в значении, данном им в Указании № 5636-У.

3.5. Клиент обязан самостоятельно контролировать Стоимость Портфеля Клиента и не допускать снижения Стоимости Портфеля Клиента ниже соответствующего ему размера Начальной маржи.

3.6. При снижении Стоимости Портфеля Клиента ниже размера Начальной маржи (снижение НПП1 ниже нуля) Клиент обязан осуществить внесение денежных средств на Брокерском счете и/или

осуществить операции по полному или частичному снижению размера Начальной маржи и/или увеличения Стоимости Портфеля Клиента таким образом, чтобы Стоимость портфеля превысила размер Начальной маржи.

3.7. Банк осуществляет закрытие позиций Клиента при снижении Стоимости Портфеля ниже размера Минимальной маржи (снижение НПП2 ниже нуля) в следующие сроки:

- в случае если Стоимость Портфеля снизилась ниже размера Минимальной маржи до Ограничительного времени, Банк осуществляет закрытие позиций Клиента в течение этого торгового дня;

- в случае если Стоимость Портфеля снизилась ниже размера Минимальной маржи в течение торгового дня после Ограничительного времени, Банк осуществляет закрытие позиций Клиента не позднее Ограничительного времени ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором наступило это обстоятельство;

- в случае если до закрытия позиций Клиента организованные торги ценными бумагами / производными финансовыми инструментами / иностранной валютой были приостановлены и их возобновление произошло после Ограничительного времени, Банк должен осуществить закрытие позиций Клиента не позднее Ограничительного времени ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором Стоимость Портфеля снизилась ниже размера Минимальной маржи.

3.8. Банк не осуществляет закрытие позиций Клиента, если до их совершения НПП2 принял положительное значение, за исключением случаев, когда иное предусмотрено Регламентом. Для КСУР Банк осуществляет Закрытие позиций до достижения НПП1 значения 0 или значения, минимально превышающего 0 с учетом лотности финансового инструмента, используемого Банком для Закрытия позиций.

3.9. Банк не несет ответственности за любые убытки Клиента, возникшие вследствие совершения Банком операций по Закрытию позиций.

3.10. Наивысший приоритет при совершении Банком Закрытия позиций клиента имеют анонимные торги. Закрытие позиций Клиента не на анонимных торгах допускается исключительно в случае соблюдения Банком требований, предусмотренных пунктом 22 Указания Банка России № 5636-У.

3.11. Банк вправе самостоятельно и по своему усмотрению определять состав и количество финансовых инструментов, находящихся на Счете Клиента, за счет которых совершаются действия по Закрытию позиций Клиента, предусмотренные пунктом 3.6 и 3.7 данного Порядка.

4. ОСОБЫЕ СЛУЧАИ ЗАКРЫТИЯ ПОЗИЦИЙ В ТС СРОЧНЫЙ РЫНОК

4.1. Банк вне зависимости от значения нормативов НПП1 и НПП2 имеет право заключить Офсетные сделки в следующих случаях:

- если Клиент не закрывает Срочные Сделки на основании требования Банка, направленного в соответствии с Регламентом;

- при поступлении сведений о направлении в суд заявления о признании Клиента банкротом в порядке, предусмотренном Федеральным законом «О несостоятельности (банкротстве)»;

- в случае получения официальной информации о смерти Клиента – физического лица;

- в случае направления в Банк уведомления о расторжении Договора и (или) направления Банком Клиенту уведомления о расторжении Договора;

- иных случаях, предусмотренных Регламентом.

4.2. Закрытие позиций в случаях, перечисленных в пункте 4.1 настоящего документа, осуществляется Банком не зависимо от условий, определенных в иных пунктах настоящего документа.

5. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

5.1. Внесение изменений и/или дополнений в Порядок производится в одностороннем порядке путем утверждения Порядка в новой редакции.

5.2. В случае изменения действующего законодательства Российской Федерации, в том числе внесения изменений в нормативные правовые акты Банка России, внесения изменений во внутренние

нормативные документы Банка, Порядок действует в части, не противоречащей действующему законодательству Российской Федерации и действующим внутренним нормативным документам Банка.

5.3. Настоящие Порядок вступает в силу с момента опубликования на официальном сайте Банка в информационно-телекоммуникационной сети Интернет.