

Утверждено
приказом Генерального директора
Общества с ограниченной ответственностью
«Компания Брокеркредитсервис»
№ 14 р/д от «14» июня 2019 года

**ПОРЯДОК
ЗАКРЫТИЯ ПОЗИЦИЙ КЛИЕНТОВ
ОБЩЕСТВА С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ
«КОМПАНИЯ БРОКЕРКРЕДИТСЕРВИС»**

1. Настоящий Порядок закрытия позиций клиентов Общества с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис» (далее – Порядок) разработан в соответствии с требованиями Указания Банка России от 08.10.2018 г. № 4928-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок с ценными бумагами и заключении договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, критериях ликвидности ценных бумаг, предоставляемых в качестве обеспечения обязательств Клиента перед брокером, при совершении брокером таких сделок и заключении таких договоров, а также об обязательных нормативах брокера, совершающего такие сделки и заключающего такие договоры» (далее – Требования) и определяет порядок действий Общества с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис» (далее – ООО «Компания БКС», Брокер) по снижению размера минимальной маржи, рассчитанного в соответствии с Требованиями и Соглашением о совершении сделок с неполным покрытием (Приложение № 7 к Регламенту оказания услуг на рынке ценных бумаг ООО «Компания БКС», далее Соглашение о совершении сделок с неполным покрытием), и (или) увеличению стоимости соответствующего портфеля Клиента (далее – закрытие позиций Клиента).

ООО «Компания БКС» размещает настоящий Порядок в открытом доступе на официальном интернет-сайте Брокера в информационно-телекоммуникационной сети Интернет <https://broker.ru> с целью обеспечения ознакомления неограниченного круга лиц с настоящим Порядком.

Положения настоящего Порядка подлежат применению с учетом условий Генерального соглашения «О комплексном обслуживании на рынке ценных бумаг», заключенного Клиентом с ООО «Компания БКС», в том числе Регламента оказания услуг на рынке ценных бумаг ООО «Компания БКС» и приложений к нему, в том числе, Соглашения о совершении сделок с неполным покрытием.

2. К закрытию позиций Клиента не относятся действия Брокера, совершенные на основании поручения Клиента, направленного (переданного) брокеру для совершения сделки (заключения договора) за счет Клиента, в котором указаны конкретные ценные бумаги и (или) иностранная валюта и их количество или фьючерсный договор, его базисный актив и срок исполнения такого договора.

3. Настоящий Порядок не распространяется на совершение действий по закрытию позиций Клиента по фьючерсным и опционным контрактам, совершаемых Брокером в соответствии с Соглашением о порядке обслуживания на срочном рынке клиентов ООО «Компания БКС» (Приложение № 6 к Регламенту оказания услуг на рынке ценных бумаг ООО «Компания БКС») в отношении клиентов, не использующих при заключении фьючерсных договоров (контрактов) технологию «единый брокерский счет».

Настоящий Порядок не распространяется на совершение действий по закрытию позиций Клиента на организованных торгах товаров, организованных торгах производными финансовыми инструментами, базисными активами которых является товар, в соответствии с Соглашением о порядке обслуживания на товарном рынке АО НТБ клиентов ООО «Компания БКС» (Приложение № 29 к Регламенту оказания услуг на рынке ценных бумаг ООО «Компания БКС»), Соглашением о порядке обслуживания на рынке нефтепродуктов клиентов ООО «Компания БКС» (Приложение № 30 к Регламенту оказания услуг на рынке ценных бумаг ООО «Компания БКС»).

4. Термины, используемые в настоящем Порядке, употребляются в значениях, определенных в Регламенте оказания услуг на рынке ценных бумаг ООО «Компания БКС», в том числе, но, не ограничиваясь, в Соглашении о совершении сделок с неполным покрытием, Требованиями, иными нормативно-правовыми актами Российской Федерации.

5. Принятие Брокером мер по закрытию позиций в портфеле Клиента осуществляется в порядке и на условиях, предусмотренных Соглашением о совершении сделок с неполным покрытием, с учетом категории клиентов, к которой отнесен Клиент, в отношении которого совершаются указанные действия.

6. Брокер определил в качестве ограничительного времени, до которого снижение значения НПР2 ниже 0 (нуля) влечет закрытие позиций Клиента в течение текущего торгового дня следующее время: 16 часов 00 минут 00 секунд (московское время).

В целях настоящего пункта Порядка под текущим торговым днем понимается промежуток времени с 08 часов 00 минут 00 секунд по 23 часа 59 минут 59 секунд (московское время) дня, в

который проводятся организованные торги хотя бы в одной торговой системе (хотя бы на одной площадке), где зарезервированы денежные средства и/или ценные бумаги, входящие в состав соответствующего портфеля Клиента, и/или в которой по поручению и за счет Клиента заключены сделки, права требования и обязательства из которых включены в состав соответствующего портфеля Клиента.

7. Сотрудник (сотрудники), ответственный(-ые) за совершение действий по закрытию позиций клиентов Брокера, определяется(-ются) приказом Генерального директора ООО «Компания БКС» (далее – Ответственные сотрудники).

8. В случае снижения значения показателя НПР2 ниже 0 (нуля) одновременно в течение торгового дня / в течение короткого промежутка времени текущего торгового дня до наступления ограничительного времени у нескольких клиентов Брокера, Ответственные сотрудники принимают меры по закрытию позиций таких клиентов последовательно с учетом следующих критериев:

- в первую очередь совершаются действия по закрытию позиций клиентов, отнесенных Брокером к категории клиентов со стандартным и повышенным уровнями риска;
- закрытие позиций от наименьшего значения показателя УДС к наибольшему, отражаемого в используемом Ответственными сотрудниками для целей принятия мер по закрытию позиций терминальном модуле риск-менеджера «CoLibri FM»/«CoLibri FX»/«CoLibri SM» ПО системы QUIK. Показатель УДС рассчитывается в следующем порядке:

$$\text{УДС} = \frac{\text{НПР2}}{M_x}, \text{ где}$$

НПР2, M_x – показатели, рассчитываемые Брокером в соответствии с Требованиями и Приложением № 1 к Соглашению о совершении сделок с неполным покрытием.

Выписка(-и) файлов серверной части ООО «Компания БКС» системы QUIK, подписанная уполномоченным лицом ООО «Компания БКС», является пригодным и достаточным для предъявления при разрешении конфликтных ситуаций и/или споров в досудебном порядке и/или суде, третейском суде, государственных и муниципальных органах, организациях доказательством принятия показателя УДС соответствующего значения в конкретный момент времени.

9. При совершении действий по закрытию позиций Клиента Ответственные сотрудники учитывают:

- цены финансовых инструментов в портфеле Клиента/финансовых инструментов, подлежащих зачислению в портфель Клиента;
- минимальный размер биржевого лота финансовых инструментов в портфеле Клиента/финансовых инструментов, подлежащих зачислению в портфель Клиента;
- ликвидность финансовых инструментов в портфеле Клиента/финансовых инструментов, подлежащих зачислению в портфель Клиента;
- сроки совершения сделок, заключаемых в целях закрытия позиций Клиента, и проведения расчетов ним;
- возможные расходы Клиента, связанные с заключением сделок по закрытию позиций;
- иные обстоятельства, имеющие значение при совершении действий по закрытию позиций.

10. Ответственные сотрудники по своему усмотрению, без согласования с Клиентом и/или его предварительного уведомления, выбирают ценные бумаги, в том числе иностранные ценные бумаги, иностранные финансовые инструменты, производные финансовые инструменты, иностранную валюту, подлежащие отчуждению/приобретению в целях закрытия позиций или переноса позиций, в том числе, среди ценных бумаг и иностранных валют, не входящих в перечень ликвидных ценных бумаг и иностранных валют.

При этом при наличии в портфеле Клиента открытой позиции по фьючерсным договорам (контрактам) в первую очередь производится закрытие позиций по таким финансовым инструментам с учетом положений п. 9 настоящего Порядка.

11. Внесение изменений и дополнений в настоящий Порядок, производится Брокером в одностороннем порядке. Все изменения и дополнения к настоящему Порядку утверждаются приказом Генерального директора ООО «Компания БКС».

12. Все изменения и дополнения в настоящий Порядок вступают в силу с даты опубликования на официальном сайте ООО «Компания БКС» <https://broker.ru> в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» новой редакции настоящего Порядка.
13. Клиент в целях своевременного ознакомления с изменениями и дополнениями настоящего Порядка обязуется не реже одного раза в неделю самостоятельно или через уполномоченных лиц обращаться к Брокеру (на официальный сайт ООО «Компания БКС») за сведениями об изменениях, произведенных в Порядок.