



«ПРИНЯТО»
Решением единственного участника
№ ДВ/9-1 от «20» января 2022 г.

Вступает в силу с «24» января 2022 г.

ПОРЯДОК
закрытия позиций клиентов в рамках
брокерского обслуживания
В
ООО ИК «Прайвет Капитал»

г. Москва.
2022 г.

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1.1. Настоящий Порядок закрытия позиций клиентов ООО ИК «Прайвет Капитал» (далее – Порядок) разработан в соответствии с требованиями Указания Банка России от 26 ноября 2020 г. N 5636-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента» (далее – Указание).

1.2. Порядок определяет обстоятельства наступления событий и порядок действий ООО ИК «Прайвет Капитал» (далее – Брокер) по закрытию позиций Клиентов Брокера без получения от Клиентов поручений на совершение соответствующих действий.

1.3. Порядок действует в отношении Клиентов, имеющих непокрытые позиции и относимых Брокером в соответствии с требованиями Указания к категории Клиентов со стандартным и повышенным уровнем риска.

2. ОСНОВНЫЕ ПОНЯТИЯ И ОПРЕДЕЛЕНИЯ

Для целей настоящего Порядка используются следующие понятия, определения и сокращения:

Анонимные торги – организованные торги на основе заявок на покупку и заявок на продажу ценных бумаг по наилучшим из указанных в них ценам, при том, что заявки адресованы всем участникам торгов и информация, позволяющая идентифицировать, подавших заявки участников торгов, не раскрывается в ходе торгов другим участникам.

Брокер – ООО ИК «Прайвет Капитал».

Временно непокрытая позиция – непокрытая позиция по ценной бумаге, денежным средствам (в рублях, иностранной валюте), определяемая Брокером до истечения срока исполнения любого обязательства, предметом которого является указанное имущество, при положительном значении Плановой позиции по нему.

Закрытие позиции – сделка или несколько сделок, совершаемых Брокером в целях снижения размера Минимальной маржи и(или) увеличения Стоимости ликвидного портфеля Клиента.

Клиент – термин, определенный в Разделе 2 Регламента брокерского обслуживания ООО ИК «Прайвет Капитал».

Клиент со стандартным уровнем риска (КСУР) – устанавливаемая по умолчанию категория риска, присваиваемая Брокером Клиенту, не отнесенному к категории клиентов с иным уровнем риска.

Клиент с повышенным уровнем риска (КПУР) – категория риска, присваиваемая Клиенту, отвечающему одному из условий, предусмотренных Указанием.

Клиринговая организация – юридическое лицо, имеющее право осуществлять клиринговую деятельность на основании лицензии на осуществление клиринговой деятельности на территории Российской Федерации в соответствии с законодательством Российской Федерации, а также иностранная организация, имеющая право осуществлять схожую с клиринговой деятельностью в соответствии с законодательством страны своей юрисдикции.

Ликвидная иностранная валюта – иностранная валюта, допущенная к организованным торгам, в том числе на иностранных биржах, в отношении которой хотя бы одной Клиринговой организацией установлены ставки риска, размещаемые в свободном доступе в сети Интернет.

Ликвидная ценная бумага – ценная бумага, допущенная к организованным торгам, в том числе на иностранных биржах, в отношении которой хотя бы одной Клиринговой организацией установлены ставки риска, размещаемые в свободном доступе в сети Интернет.

Минимальная маржа – показатель, рассчитываемый в соответствии с Указанием Банка России от от 26.11.2020 N 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 (КСУР) и (или) повышенным (КПУР) уровнем риска.

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

Непокрытая позиция – плановая позиция по ценной бумаге, денежным средствам (в рублях, иностранной валюте), значение которой является отрицательным.

Норматив покрытия риска при исполнении поручений (НПР1) – рассчитываемая в соответствии с требованиями Указания № 5636-У разность между Стоимостью ликвидного портфеля Клиента и величиной Начальной маржи.

Норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля (НПР2) – рассчитываемая в соответствии с требованиями Указания № 5636-У разность между Стоимостью ликвидного портфеля Клиента и величиной Минимальной маржи.

Ограничительное время закрытия позиций (Ограничительное время) – время (часы, минуты, секунды) каждого торгового дня, до которого снижение значения НПР2 ниже 0 влечет Закрытие позиций Клиента в течение указанного торгового дня. Ограничительное время закрытия позиций определено как 17 часов 00 минут 00 секунд по московскому времени.

Ответственный работник – работник Брокера, в обязанности которого в соответствии с должностной инструкцией входит контроль за Непокрытыми позициями Клиентов, совершение действий по закрытию позиций, а также выполнение иных действий, предусмотренных настоящим документом.

Перечень ликвидного имущества – определяемый Брокером перечень ликвидного имущества, состоящий из следующих списков:

- (а) списка Ликвидных иностранных валют, соответствующих требованиям, предусмотренным Указанием, принимаемых Брокером в качестве обеспечения обязательств Клиента перед Брокером с указанием признака, означающего, что по этой иностранной валюте может возникнуть Непокрытая и (или) Временно непокрытая позиция;
- (б) списка Ликвидных ценных бумаг, соответствующих требованиям, предусмотренным Указанием, принимаемых Брокером в качестве обеспечения обязательств Клиента перед Брокером с указанием признака, означающего, что по этой ценной бумаге может возникнуть Непокрытая и (или) Временно непокрытая позиция.

Плановая позиция – величина, определяемая в соответствии с требованиями Указания:

- по ценным бумагам в разрезе ценных бумаг каждого эмитента, вида, категории (типа), выпуска, транша, серии как сумма количества ценных бумаг, учитываемых в Портфеле Клиента, а также ценных бумаг, которые должны быть зачислены в Портфель Клиента, за вычетом ценных бумаг, которые должны быть списаны из Портфеля Клиента.
- по денежным средствам в разрезе каждой валюты (рублей РФ или иностранной валюты) как сумма денежных средств Клиента, учитываемая в Портфеле Клиента, а также денежных средств, которые должны быть зачислены в Портфель Клиента, за вычетом денежных средств, которые должны быть списаны из Портфеля Клиента, в том числе за вычетом денежных средств, подлежащих списанию из Портфеля Клиента в качестве вознаграждения Брокера, компенсируемых за счет Клиента расходов Брокера и иных предусмотренных Регламентом платежей.

Портфель Клиента – совокупность денежных средств (в валюте Российской Федерации и (или) в иностранной валюте) и (или) ценных бумаг, находящихся в распоряжении Брокера или которые должны поступить в его распоряжение, обязательств из сделок, совершенных за счет указанного имущества, а также задолженность Клиента перед Брокером.

Регламент брокерского обслуживания – Регламент брокерского обслуживания ООО ИК «Прайвет Капитал», определяющие общий порядок и условия обслуживания Клиентов при осуществлении Брокером брокерской деятельности.

Ставка риска – коэффициент в диапазоне [0, 1], используемый для расчета Начальной маржи по инструменту, по которому в Портфеле Клиента образуется Непокрытая позиция.

Стоимость ликвидного портфеля Клиента - величина, рассчитываемая в соответствии с требованиями Указания, представляющая собой сумму значений Плановых позиций Клиента, рассчитанных по каждому *i*-му имуществу, составляющему Портфель Клиента.

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

Иные термины, специально не определенные в настоящем разделе, используются в значениях, установленных законодательством Российской Федерации, регулирующим осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг и проведение операций на финансовых рынках.

3. Основные принципы работы с непокрытыми позициями Клиентов.

3. Основные принципы работы с непокрытыми позициями Клиентов.

3.1. При осуществлении действий, приводящих к возникновению непокрытых позиций Клиентов, а также при закрытии позиций Клиентов Брокера работники Брокера руководствуются настоящим Порядком.

3.2. В случаях, не предусмотренных настоящим Порядком, работники Брокера руководствуются иными внутренними документами Брокера, регламентирующими порядок оказания Брокером брокерских услуг Клиентам и законодательством Российской Федерации, Указанием № 5636-У.

3.3. Расчет НПП1 и НПП2 осуществляется Брокером при помощи программного обеспечения интернет-торговой системы QUIK согласно приложению к Указанию № 5636-У.

3.4. Брокер не допускает возникновения отрицательного значения НПП1 или его снижения относительно своего предыдущего отрицательного значения за исключением случаев, предусмотренных Указанием № 5636-У.

3.5. В случае если НПП2 принимает отрицательное значение, Брокер осуществляет закрытие позиций Клиентов в порядке и сроки, описанные в разделе 4 настоящего Порядка.

Требования вышеуказанного абзаца настоящего пункта не применяются, если значение размера НПП2 равно 0.

Брокер не осуществляет действия по закрытию позиций Клиента, если до их совершения НПП2 принял положительное значение.

3.6. В качестве причин, приводящих к снижению норматива НПП2, выделяются следующие:

а. снижение в ходе торгов Стоимости ликвидного портфеля Клиента, в том числе, при снижении стоимости учитываемых в Портфеле Клиента долевых и долговых ценных бумаг. Снижение стоимости может произойти в результате неблагоприятного изменения цен (курса валют), в частности после составления списка лиц, имеющих право на получение денежных средств, а также иного имущества, в том числе в виде дивидендов и накопленного процентного (купонного) дохода по ценным бумагам;

б. исключение Брокером из Перечня ликвидного имущества Ликвидных ценных бумаг и / или Ликвидных иностранных валют, учитываемых в Портфеле Клиента;

в. увеличение Брокером Ставок риска по одной или нескольким Ликвидным ценным бумагам и / или Ликвидным иностранным валютам, учитываемым в Портфеле Клиента;

г. исключение Ликвидных ценных бумаг и / или Ликвидных иностранных валют из списка финансовых инструментов, допущенных к организованным торгам;

д. списание из Портфеля Клиента сумм вознаграждений и прочих обязательных платежей, а также сумм штрафов, пеней, процентов, неустоек и прочих расходов, предметом которых не является оказание брокерских услуг.

3.7. Исключение Брокером инструмента из Перечня ликвидного имущества осуществляется в случае прекращения раскрытия по данному инструменту Ставок риска Клиринговыми организациями, либо по собственному усмотрению Брокера.

3.6. Изменение Ставок риска по инструменту осуществляется Брокером в случае увеличения Ставок риска Клиринговыми организациями до уровней, превышающих установленные Брокером значения Ставок риска по данному инструменту, либо по собственному усмотрению Брокера.

3.7. Брокер не совершает Закрытие позиций в случае, если значение размера Минимальной маржи равно нулю.

3.8. К Закрытию позиций не относятся действия Брокера, совершенные на основании поручения Клиента, направленного Брокеру для совершения сделки за счет Клиента, в котором указаны конкретные ценные бумаги и / или иностранная валюта и их количество.

4. Порядок осуществления закрытия позиций

4.1. Ограничительное время закрытия позиций – 17:00:00 по московскому времени каждого торгового дня.

4.2. Брокер осуществляет закрытие позиций Клиента при снижении НПП2 ниже 0 в следующие сроки:

- В случае если НПП2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня до Ограничительного времени закрытия позиций, Брокер закрывает позиции Клиента в течение этого торгового дня.
- В случае если НПП2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня после Ограничительного времени закрытия позиций, Брокер закрывает позиции Клиента не позднее Ограничительного времени закрытия позиций ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором наступило это обстоятельство.
- В случае если до закрытия позиций Клиента организованные торги ценными бумагами (иностранной валютой, драгоценными металлами) были приостановлены и их возобновление произошло после Ограничительного времени закрытия позиций, Брокер осуществляет закрытие позиций Клиента не позднее Ограничительного времени закрытия позиций ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором НПП2 принял значение ниже 0.

4.3. Брокер осуществляет закрытие позиций Клиента при снижении НПП2 ниже 0 с соблюдением следующих требований:

4.3.1. В отношении Клиентов, отнесенных Брокером к категории КСУР, Брокер осуществляет закрытие позиций до достижения НПП1 нулевого значения (при положительном значении размера начальной маржи), если достижение большего значения НПП1 не предусмотрено Регламентом брокерского обслуживания. Брокер самостоятельно определяет величину превышения, исходя из конкретных обстоятельств совершения сделок (операций), направленных на Закрытие позиций, таких как:

- минимальный лот ценной бумаги или минимальная сумма операции, установленные для режима торгов, в котором совершается Закрытие позиций;
- минимальный лот ценной бумаги или минимальная сумма операции, соответствующие стандартной бизнес-практике, если Закрытие позиций проводится на внебиржевом рынке.

4.3.2. В отношении Клиентов, отнесенных Брокером к категории КПУР, Брокер осуществляет закрытие позиций до достижения НПП2 нулевого значения (при положительном значении размера минимальной маржи), если достижение большего значения НПП2 не предусмотрено Регламентом брокерского обслуживания. Брокер самостоятельно определяет величину превышения, исходя из конкретных обстоятельств совершения сделок (операций), направленных на Закрытие позиций, таких как:

- минимальный лот ценной бумаги или минимальная сумма операции, установленные для режима торгов, в котором совершается Закрытие позиций;
- минимальный лот ценной бумаги или минимальная сумма операции, соответствующие стандартной бизнес-практике, если Закрытие позиций проводится на внебиржевом рынке.

4.3.3. При осуществлении Брокером закрытия позиции Клиента до приведения НПП1 или НПП2 в соответствие с пунктами 4.3.1, 4.3.2 настоящего Порядка допускается снижение значения НПП1 относительно своего предыдущего отрицательного значения.

4.4. В результате совершения Брокером Сделок при закрытии позиций НПП1 должен достигнуть значения больше нуля или уровня, определяемого Брокером самостоятельно при помощи программного обеспечения интернет-торговой системы QUIK.

4.5. Брокер по своему усмотрению выбирает ценные бумаги, иностранную валюту, подлежащие отчуждению/приобретению в целях Закрытия позиций Клиента, в том числе, среди ценных бумаг и иностранных валют, не входящих в Перечень ликвидного имущества.

При осуществлении Закрытия позиций Брокер вправе самостоятельно определять их состав и очередность реализации.

4.6. Риск возможных убытков и прочих неблагоприятных для Клиента последствий, связанных с осуществлением Брокером Сделки при закрытии позиции Клиента по Сделке, несет Клиент. Подавая Брокеру Поручение на совершение Сделки с неполным покрытием, Клиент подтверждает свою осведомленность о наличии риска возникновения у него убытков и выражает свое согласие с данным обстоятельством.

4.7. Закрытие позиций Клиента при снижении НПП2 ниже 0 Брокер совершает на анонимных торгах, за исключением случая, предусмотренного 4.8. настоящего Порядка.

4.8. Закрытие позиций Клиента не на анонимных торгах Брокер может осуществлять при соблюдении следующих требований:

4.8.1. Покупку ценных бумаг (за исключением облигаций) и (или) драгоценных металлов Брокер осуществляет по цене, не превышающей максимальной цены сделки с такими ценными бумагами и (или) драгоценными металлами, совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут, предшествующих действиям брокера, направленным на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления.

4.8.2. Покупку облигаций и (или) иностранной валюты Брокер осуществляет при соблюдении одного из следующих условий:

- покупка осуществляется по цене, не превышающей максимальную цену сделки с такими облигациями (с такой иностранной валютой), совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут, предшествующих действиям брокера, направленным на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления;
- покупка осуществляется по цене не выше лучшей котировки на продажу таких облигаций и (или) иностранной валюты, опубликованной в информационной системе Блумберг (Bloomberg) или в информационной системе Рефинитив (Refinitiv), более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по этой облигации (иностранной валюте), предусмотренной пунктом 18 Приложения к Указанию № 5636-У.

4.8.3. Покупку иностранной валюты в соответствии с абзацами вторым и третьим пункта 4.8.2 Брокер осуществляет в отсутствие проведения анонимных торгов этой иностранной валютой либо в объеме меньшем, чем минимальный размер биржевого лота, предусмотренный правилами организованных торгов этой иностранной валютой.

4.8.4. Продажу ценных бумаг (за исключением облигаций) и (или) драгоценных металлов Брокер осуществляет по цене не ниже минимальной цены сделки с такими ценными бумагами и (или) драгоценными металлами, совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут, предшествующих действиям брокера, направленным на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления.

4.8.5. Продажу облигаций и (или) иностранной валюты Брокер осуществляет при соблюдении одного из следующих условий:

- продажа осуществляется по цене не ниже минимальной цены сделки с такими облигациями (с такой иностранной валютой), совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут, предшествующих действиям брокера, направленным на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления;

- продажа осуществляется по цене не ниже лучшей котировки на покупку таких облигаций и (или) иностранной валюты, опубликованной в информационной системе Блумберг (Bloomberg) или в информационной системе Рефинитив (Refinitiv), более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по этой облигации (иностранной валюте), предусмотренной пунктом 18 Приложения к Указанию № 5636-У.

4.8.6. Продажу иностранной валюты в соответствии с абзацами вторым и третьим подпункта 4.8.5 настоящего Порядка Брокер осуществляет в отсутствие проведения анонимных торгов этой иностранной валютой либо в объеме меньшем, чем минимальный размер биржевого лота, предусмотренный правилами организованных торгов этой иностранной валютой.

4.8.7. Если источник информации о ценах или котировках, в соответствии с которыми Брокером будет осуществляться закрытие позиций клиента, является информационной системой Блумберг (Bloomberg), то применяются котировки системы Bloomberg Generic Quotes (BGN)..

4.9. Брокер не осуществляет закрытие позиций Клиента, если значение размера минимальной маржи равно 0. Брокер не осуществляет действия по закрытию позиций Клиента, если до их совершения НПП2 принял положительное значение.

4.10. Брокер не направляет Клиенту уведомление о снижении значения НПП1 ниже 0, поскольку Брокер в соответствии с Регламентом брокерского обслуживания в любой момент времени предоставляет Клиентам защищенный доступ к информации о текущих стоимости портфеля Клиента и размере, начальной и минимальной маржи, НПП1 и НПП2 при помощи программного обеспечения интернет-торговой системы QUIK.

5. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНОЕ ПОЛОЖЕНИЕ.

5.1. Организация на постоянной основе осуществляет контроль исполнения настоящего Порядка.

5.2. Внесение изменений и/или дополнений в Порядок производится Брокером в одностороннем порядке с учетом требования законодательства Российской Федерации. В случае изменения требований законодательных и иных нормативных актов, регламентирующих Закрытие позиций, до внесения изменений, Порядок применяется в части, не противоречащей вновь принятым/измененным законодательным и иным нормативным актам.

5.3. Порядок, такие изменения и дополнения вступают в силу с даты размещения новой редакции Порядка на сайте Брокера в сети Интернет, если иная дата не будет указана Брокером при размещении.

5.4. Брокер раскрывает настоящий Порядок, а также изменения и дополнения к нему на своем официальном сайте в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» по адресу: <http://privatecapital.moscow/>, в соответствии с требованиями Указания № 5636-У.