

Утверждено
Приказом № 2021/2809-1 от 28.09.2021г.
Генерального директора ООО «ИК «ФИАНИТ»
Вводится в действие с 01.10.2021 г.

**Порядок работы с непокрытыми позициями клиентов
ООО «ИК «ФИАНИТ»**

2021 г.

1. Общие положения

1.1. Настоящий Порядок работы с непокрытыми позициями клиентов ООО «ИК «ФИАНИТ» (далее – Порядок) является внутренним нормативным документом ООО «ИК «ФИАНИТ» (далее – Общество), определяет порядок работы с непокрытыми позициями Клиентов на финансовых рынках в рамках брокерского договора, заключенного Клиентом путем присоединения к Регламенту оказания брокерских услуг ООО «ИК «ФИАНИТ» (далее – Регламент), в том числе определяет порядок закрытия позиций Клиентов, отнесенных Обществом к категории Клиентов со стандартным уровнем риска.

1.2. Порядок разработан на основании законодательства Российской Федерации, нормативных правовых актов Банка России в области рынка ценных бумаг.

2. Термины и определения

2.1. В Порядке используются следующие термины и определения:

Закрытие позиций – меры по снижению размера минимальной маржи и (или) увеличению стоимости портфеля Клиента. Размер минимальной маржи и стоимость портфеля Клиента рассчитываются по формулам, приведенным в Приложении к Указанию Банка России от 26.11.2020 № 5636-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента» (далее - Указание №5636-У).

Клиент – юридическое или физическое лицо, заключившее с Обществом брокерский договор.

Клиент с повышенным уровнем риска (КПУР) – Клиент - физическое лицо, отнесенный Обществом к данной категории, отвечающий одному из требований, указанных в пункте 30 Указания № 5636-У.

Клиент со стандартным уровнем риска (КСУР) – Клиент - физическое лицо или юридическое лицо, не отнесенный Обществом к категории Клиента с повышенным уровнем риска или к категории Клиента с особым уровнем риска.

НПР1 – норматив покрытия риска при исполнении поручений Клиента, отнесенного Обществом к категориям Клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, рассчитываемый по формуле, установленной Указанием № 5636-У.

НПР2 – норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля Клиента, отнесенного Обществом к категориям Клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, рассчитываемый по формуле, установленной Указанием № 5636-У.

Ограничительное время закрытия позиций – определенное Обществом время каждого торгового дня, до которого снижение значения НПР2 ниже 0 влечет закрытие позиций Клиента в течение этого торгового дня.

2.2. Термины и определения, не указанные выше, используются в значениях, установленных нормативными документами, регулирующими обращение ценных бумаг и срочных

инструментов, иностранной валюты, драгоценных металлов, иными нормативными правовыми актами Российской Федерации, в том числе Указанием № 5636-У.

3. Основные принципы работы с непокрытыми позициями Клиентов.

3.1. При осуществлении действий, направленных на закрытие позиций Клиентов работники Общества руководствуются настоящим Порядком.

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

3.3. Общество включает в состав портфеля Клиента денежные средства (в валюте Российской Федерации и (или) в иностранной валюте) и (или) ценные бумаги и (или) драгоценные металлы, которые в соответствии с брокерским договором находятся в распоряжении Общества или должны поступить в его распоряжение (далее при совместном упоминании - имущество Клиента), обязательства из сделок, совершенных за счет указанного имущества в соответствии с заключенным с Клиентом брокерским договором (далее - сделки за счет Клиента), а также задолженность Клиента перед Обществом. В случае если брокерским договором предусмотрено наличие у Клиента нескольких портфелей, Общество не допускает включение одного и того же имущества Клиента и (или) одних и тех же обязательств из сделок за счет Клиента и (или) одной и той же задолженности Клиента перед Обществом в состав нескольких портфелей Клиента.

3.4. Общество определяет состав портфеля Клиента как совокупность плановых позиций, значения которых оно рассчитывает в соответствии с пунктом 3 приложения к Указанию №5636-У, по ценным бумагам каждого эмитента (лица, обязанного по ценной бумаге), предоставляющим их владельцам одинаковый объем прав, по денежным средствам по каждому виду валют (рубли, доллары США, иные валюты) (далее - плановая позиция).

3.5. Общество не совершает действий, приводящих к возникновению или увеличению в абсолютном выражении отрицательного значения плановой позиции (далее - непокрытая позиция) по ценной бумаге, иностранной валюте, не соответствующим установленным пунктами 3.6. и 3.7. настоящего Порядка требованиям к имуществу, которое может быть передано Обществу в качестве обеспечения обязательств клиента перед Обществом.

Требования абзаца первого настоящего пункта не применяются, если Клиент Общества в соответствии с пунктом 29 Указания №5636-У отнесен Обществом к категории клиентов с особым уровнем риска.

3.6. В качестве обеспечения обязательств клиента перед Обществом, допускается передача Обществу ценных бумаг, иностранной валюты, если значения ставок, указанные в абзацах втором и третьем пункта 17 приложения к Указанию №5636-У, по указанным ценным

бумагам, иностранной валюте размещены хотя бы одной клиринговой организацией в свободном доступе на своем официальном сайте в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет" (далее - сеть "Интернет").

3.7. Передача Обществу иностранной валюты в качестве обеспечения обязательств Клиента перед Обществом, допускается, если она помимо соответствия требованию пункта 3.6. настоящего Порядка также допущена к организованным торгам российским организатором торговли и (или) иностранной биржей.

3.8. Перечень ценных бумаг и иностранных валют, по которым допускается возникновение непокрытых позиций, и (или) по которым положительное значение плановой позиции не принимается равным 0 (перечень ликвидного имущества) утверждается Обществом и размещается на сайте в сети Интернет.

3.9. В случае если ценная бумага перестала соответствовать требованиям, установленным пунктом 3.6. настоящего Порядка, иностранная валюта перестала соответствовать требованиям, установленным пунктами 3.6. и (или) 3.7. настоящего Порядка, Общество исключает их из перечня ликвидного имущества в срок, не превышающий 30 (Тридцати) дней со дня, когда ценная бумага, иностранная валюта перестали соответствовать указанным требованиям.

3.10. Общество не совершает действий, приводящих к возникновению непокрытой позиции по ценной бумаге, иностранной валюте не соответствующим требованиям, установленным пунктами 3.6. и (или) 3.7. настоящего Порядка, определяемой Обществом до истечения срока исполнения любого обязательства, предметом которого является указанное имущество, при положительном значении плановой позиции по нему (далее - временно непокрытая позиция). Требование абзаца первого настоящего пункта не применяется, если Клиент Общества в соответствии с пунктом 29 Указания №5636-У отнесен Обществом к категории клиентов с особым уровнем риска.

3.11. В случае совершения Обществом сделки за счет Клиента на организованных торгах на основе заявок на покупку и заявок на продажу ценных бумаг по наилучшим из указанных в них ценам при условии, что заявки адресованы всем участникам торгов и информация, позволяющая идентифицировать подавших заявки участников торгов, не раскрывается в ходе торгов другим участникам, Общество не допускает возникновения или увеличения в абсолютном выражении непокрытой позиции по ценной бумаге, возникновения или увеличения в абсолютном выражении временно непокрытой позиции по ценной бумаге при одновременном наличии обстоятельств, указанных в пункте 9 Указания №5636-У.

3.12. Требования 3.11. настоящего Порядка не распространяются на заключаемые Обществом сделки за счет Клиента, обязательства из которых допущены к клирингу с участием квалифицированного центрального контрагента.

3.13. Расчет НПР1 и НПР2 осуществляется Обществом при помощи прикладного программного обеспечения согласно приложению к Указанию № 5636-У.

3.14. Общество не допускает возникновения отрицательного значения НПР1 или его снижения относительно своего предыдущего отрицательного значения за исключением случаев, предусмотренных пунктом 13 Указания № 5636-У, с учетом требований пункта 14 Указания № 5636-У.

3.15. В случае если НПР2 принимает отрицательное значение, Общество осуществляет закрытие позиций Клиентов в порядке и сроки, указанные в разделе 4 настоящего Порядка.

Требования вышеуказанного абзаца настоящего пункта не применяются, если значение НПР2 равно 0.

Общество не осуществляет действия по закрытию позиций Клиента, если до их совершения НПР2 принял положительное значение.

4. Порядок закрытия позиций Клиентов

4.1. Ограничительное время закрытия позиций – 14:00:00 по московскому времени каждого торгового дня.

4.2. Общество осуществляет закрытие позиций Клиента при снижении НПР2 ниже 0 в следующие сроки:

4.2.1. В случае если НПР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня до Ограничительного времени закрытия позиций, Общество закрывает позиции Клиента в течение этого торгового дня;

4.2.2. В случае если НПР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня после Ограничительного времени закрытия позиций, Общество закрывает позиции Клиента не позднее Ограничительного времени закрытия позиций ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором наступило это обстоятельство;

4.2.3. В случае если до закрытия позиций Клиента организованные торги ценными бумагами (иностранной валютой) были приостановлены и их возобновление произошло после Ограничительного времени закрытия позиций, Общество осуществляет закрытие позиций Клиента не позднее Ограничительного времени закрытия позиций ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором НПР2 принял значение ниже 0.

4.3. Общество осуществляет закрытие позиций Клиента при снижении НПР2 ниже 0 с соблюдением следующих требований:

4.3.1. В отношении Клиентов, отнесенных Обществом к категории КСУР, Общество осуществляет закрытие позиций до достижения НПР1 нулевого значения (при положительном значении размера начальной маржи), если достижение большего значения НПР1 не предусмотрено брокерским договором;

4.3.2. В отношении Клиентов, отнесенных Обществом к категории КПУР, Общество осуществляет закрытие позиций до достижения НПР2 нулевого значения (при положительном

значении размера минимальной маржи), если достижение большего значения ННР2 не предусмотрено брокерским договором.

4.4. При осуществлении Обществом закрытия позиции Клиента до приведения ННР1 или ННР2 в соответствие с пунктами 4.3.1, 4.3.2 настоящего Порядка допускается снижение значения ННР1 относительно своего предыдущего отрицательного значения.

4.5. Риск возможных убытков и прочих неблагоприятных для Клиента последствий, связанных с осуществлением Обществом сделки при закрытии позиции, несет Клиент.

4.6. Закрытие позиций Клиента при снижении ННР2 ниже 0 Общество совершает на анонимных торгах, за исключением случая, предусмотренного 4.7 настоящего Порядка.

4.7. Закрытие позиций Клиента не на анонимных торгах Общество может осуществлять при соблюдении следующих требований:

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

4.7.2. Покупку облигаций и (или) иностранной валюты Общество 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 Общества, 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;

4.7.3. Покупку иностранной валюты в соответствии с абзацами вторым и третьим пункта 4.7.2 Общество 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;

4.7.4. Продажу ценных бумаг (за исключением облигаций) и (или) драгоценных металлов Общество осуществляет по цене не ниже минимальной цены сделки с такими ценными бумагами, совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут,

предшествующих действиям Общества, направленным на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления;

4.7.5. Продажу облигаций и (или) иностранной валюты Общество 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 Общества, 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;

4.7.6. Продажу иностранной валюты в соответствии с абзацами вторым и третьим подпункта 4.7.5 настоящего Порядка Общество 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. Если источник информации о ценах или котировках, в соответствии с которыми Обществом будет осуществляться закрытие позиций клиента, является информационной системой Блумберг (Bloomberg), то применяются котировки системы Bloomberg Generic Quotes (BGN).

4.9. Общество не осуществляет закрытие позиций Клиента, если значение размера минимальной маржи равно 0. Общество не осуществляет действия по закрытию позиций Клиента, если до их совершения НПР2 принял положительное значение.

4.10. К закрытию позиций Клиента не относятся действия Общества, совершенные на основании поручения Клиента, направленного (переданного) Обществу для совершения сделки (заключения договора) за счет Клиента, в котором указаны конкретные ценные бумаги и (или) иностранная валюта и их количество.

5. Информирование клиентов и хранение информации

5.1. В случае если НПР1 принял значение ниже 0, Общество направляет клиенту уведомление о снижении значения НПР1 ниже 0 (далее - Уведомление) способом, установленным разделом 4 Регламента в течение часа после выявления такого факта.

Уведомление должно содержать информацию о стоимости портфеля Клиента, о размере начальной маржи и о размере минимальной маржи на момент возникновения основания для

направления Уведомления, а также информацию о действиях Общества, если значение НПР2 будет ниже 0.

Требование абзаца первого настоящего пункта не применяется, если Общество в соответствии с брокерским договором каждый час времени проведения организованных торгов не менее 1 раза информирует Клиента о текущих стоимости портфеля Клиента и размере начальной и минимальной маржи либо предоставляет ему защищенный доступ к указанной информации.

5.2. Общество хранит копии направленных Уведомлений не менее 5 (Пяти) лет со дня их направления Клиенту.

5.3. Общество ведет Журнал направленных Уведомлений и вносит в него записи о направленных Уведомлениях не позднее рабочего дня, следующего за днем их направления Клиенту.

Общество ведет Журнал направленных Уведомлений с использованием программно-технических средств, позволяющих предоставлять указанный журнал в виде файла с расширением *.xls или *.xlsx.

Общество хранит записи Журнала направленных Уведомлений не менее 5 (Пяти) лет со дня их внесения.

5.4. В Журнале направленных Уведомлений Общество отражает следующую информацию:

- порядковый номер Уведомления;
- индивидуальный идентификационный код портфеля Клиента, присвоенный Обществом (при наличии);
- стоимость портфеля Клиента, размер начальной маржи и размер минимальной маржи, которые были указаны в Уведомлении;
- дату и время направления Уведомления.

5.5. Общество в отношении каждого портфеля Клиента, отнесенного им к категориям КСУР или КПУР, ведет записи об отрицательных значениях НПР2 по состоянию на Ограничительное время закрытия позиций и на конец торгового дня (далее - контрольное время), а в случае, указанном в абзаце третьем настоящего пункта, - также записи о положительных значениях НПР2.

В записях об отрицательных значениях НПР2 на контрольное время Общество отражает информацию о значении минимальной маржи и стоимости портфеля Клиента по состоянию на контрольное время.

В случае если НПР2 хотя бы 1 раз принимал положительное значение в период между контрольным временем и ближайшим к нему контрольным временем, по состоянию на которые НПР2 принимал отрицательные значения, Общество фиксирует указанное обстоятельство записью о положительном значении НПР2.

В записи о положительном значении НПР2 Общество отражает информацию о значении минимальной маржи и стоимости портфеля Клиента на момент времени, в который НПР2

принимал положительное значение, а также время, на которое указанное значение было зафиксировано.

6. Заключительное положение

6.1. Внесение изменений и/или дополнений в настоящий Порядок производится Обществом в одностороннем порядке с учетом требования законодательства Российской Федерации.

6.2. Порядок, а также изменения и дополнения к нему раскрываются Обществом на сайте в сети Интернет.