

П О Р Я Д О К

**ЗАКРЫТИЯ НЕПОКРЫТЫХ ПОЗИЦИЙ КЛИЕНТОВ
В РАМКАХ БРОКЕРСКОГО ОБСЛУЖИВАНИЯ В
ООО «ПРОЕКТНАЯ ФОНДОВАЯ КОМПАНИЯ»**

1. Общие положения

1.1. Настоящий Порядок закрытия непокрытых позиций клиентов в рамках брокерского обслуживания в ООО «Проектная фондовая компания» (далее – настоящий Порядок) утвержден Обществом с ограниченной ответственностью «Проектная фондовая компания» (далее – Организация) в связи с осуществлением Организацией действий, приводящих к возникновению непокрытых позиций по ценным бумагам и (или) денежным средствам клиентов, отнесенных Организацией к категории клиентов со стандартным (далее - КСУР) или повышенным уровнем риска (далее – КПУР) в соответствии с нормативными актами Банка России, и определяет порядок закрытия позиций указанных клиентов.

Настоящий Порядок разработан во исполнение Указания Банка России № 6681-У от 12.02.2024 «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента» (далее – Указание). Положения настоящего Порядка подлежат применению с учетом условий Регламента оказания услуг клиентам ООО «Проектная фондовая компания» на рынке ценных бумаг и срочном рынке (далее - Регламент).

Внесение изменений и дополнений в настоящий Порядок, производится Организацией в одностороннем порядке. Все изменения и дополнения к настоящему Порядку утверждаются приказом Генерального директора Организации.

Настоящий Порядок не распространяется на клиентов, отнесенных Организацией к категории клиентов с особым уровнем риска (далее - КОУР).

1.2. Для целей настоящего Порядка используются следующие термины:

Непокрытая позиция — возникновение или увеличение в абсолютном выражении отрицательного значения плановой позиции по ценной бумаге.

НПР1 — норматив покрытия риска при исполнении поручений клиента, отнесенного Организацией к категории КСУР или КПУР в соответствии с Указанием.

Минимально допустимое числовое значение НПР1 устанавливается в размере 0, за исключением случаев, установленных пунктом 12 Указания.

НПР2 — норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента, отнесенного Организацией к категории КСУР или КПУР в соответствии с Указанием.

Минимально допустимое числовое значение НПР2 устанавливается в размере 0.

Закрытие позиции — меры, предпринимаемые Организацией по снижению размера минимальной маржи и (или) увеличению стоимости портфеля клиента, в случае если НПР2 принимает значение ниже 0.

Ограничительное время закрытия позиций — 14:00:00 времени МСК каждого торгового дня, до которого снижение значения НПР2 ниже 0 влечет закрытие позиций клиента в течение этого торгового дня.

Контрольное время — 19:00:00 времени МСК каждого торгового дня, после которого клиент не может открыть непокрытую позицию.

Ответственный работник — работник Организации, в обязанности которого входит контроль за непокрытыми позициями клиентов, совершение действий по закрытию позиций в соответствии с приказом Генерального директора Организации.

Ликвидные ценные бумаги — ценные бумаги, предоставляемые в качестве обеспечения обязательств клиента перед Организацией и удовлетворяющие критериям ликвидности, установленным Указанием.

Перечень ликвидных ценных бумаг — перечень ценных бумаг, состоящий из списка ценных бумаг, в отношении которых разрешено совершать сделки по продаже, и списка ценных бумаг, принимаемых в обеспечение, публикуемый на сайте Организации (www.pfc.ru).

Размер минимальной маржи — величина, рассчитываемая в соответствии с пунктом 18 приложения к Указанию для целей контроля за НПР1.

Размер начальной маржи — величина, рассчитываемая в соответствии с пунктами 18 и 37 приложения к Указанию для целей контроля за НПР2.

Стоимость портфеля клиента — сумма значений плановых позиций, рассчитанных в соответствии с пунктом 3 приложения к Указанию по ценным бумагам каждого эмитента, предоставляющих их владельцам одинаковый объем прав, и по денежным средствам, учитываемым на счете клиента.

2. Порядок закрытия позиций клиентов

2.1. Организация осуществляет закрытие позиций клиентов при снижении стоимости портфеля ниже размера минимальной маржи, т.е. при снижении НПР2 ниже 0, с соблюдением следующих требований.

Порядок закрытия непокрытых позиций клиентов

В отношении клиентов, отнесенных Организацией к категории КСУР, Организация осуществляет закрытие позиций до достижения НПП1 нулевого значения (при положительном значении размера начальной маржи).

В отношении клиентов, отнесенных Организацией к категории КПУР, Организация осуществляет закрытие позиций до достижения НПП2 нулевого значения (при положительном значении размера минимальной маржи).

2.2. При закрытии позиций клиентов Организация самостоятельно (по своему усмотрению) определяет очередность покупки или продажи ценных бумаг, руководствуясь перечнем ликвидных ценных бумаг.

2.3. В случаях, указанных в п. 2.1. настоящего Порядка, если после реализации ликвидных ценных бумаг клиента значение НПП2 остается меньше 0, то Организация вправе совершать сделки с ценными бумагами, допущенных к организованным торгам, не включенных в перечень ликвидных ценных бумаг. Продажа ценных бумаг, осуществляется в количестве минимально необходимом для восстановления стоимости портфеля клиента до размера не ниже начальной маржи, а в случае их недостаточности – до достижения максимально возможной стоимости портфеля клиента. При наличии различных ценных бумаг Ответственный работник вправе самостоятельно определить, какие именно ценные бумаги будут проданы Организацией для закрытия позиций клиента, исходя из складывающейся рыночной конъюнктуры, состава портфеля клиента и исполнением на наилучших условиях в интересах клиента.

2.4. Организация осуществляет закрытие позиций клиента при снижении НПП2 ниже 0 на анонимных торгах.

2.5. Закрытие позиций может не применяться, если значение размера минимальной маржи равно 0.

3. Сроки закрытия позиций клиентов при снижении НПП2 ниже 0

Организация осуществляет закрытие позиций клиента при снижении НПП2 ниже 0 в следующие сроки:

3.1. В случае если НПП2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня до ограничительного времени закрытия позиций, Организация осуществляет закрытие позиций клиента в течение этого торгового дня;

3.2. В случае если НПП2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня после ограничительного времени закрытия позиций, Организация осуществляет закрытие позиций

клиента не позднее ограничительного времени закрытия позиций клиента ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором наступило это обстоятельство;

3.3. В случае если до закрытия позиций клиента организованные торги ценными бумагами были приостановлены и их возобновление произошло после ограничительного времени закрытия позиций, Организация осуществляет закрытие позиций клиента не позднее ограничительного времени закрытия позиций ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором НПР2 принял значение ниже 0.

3.4. Организация на протяжении всего времени проведения организованных торгов, предоставляет всем клиентам, совершающим необеспеченные сделки, доступ с использование систем интернет-трейдинга к информации о текущих стоимости портфеля клиента, размере начальной и о размере минимальной маржи.

4. Порядок фиксации отрицательных значений НПР2

4.1. В отношении каждого портфеля клиента фиксируется запись (информация) об отрицательных значениях НПР2 по состоянию на ограничительное время закрытия позиций и на контрольное время.

4.2. В записях о значениях НПР2 Организация отражает информацию о значениях минимальной маржи и стоимости портфеля клиента по состоянию на время фиксации.

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