

УТВЕРЖДЕН

Приказом генерального директора

№ 24-06-11/2-ОД от 11 июня 2024 г.

Вступает в действие с 01 июля 2024г.

Генеральный директор  Токарев С.Г.



П О Р Я Д О К

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

г. Пермь, 2024 г.

1. Общие положения

1.1. Настоящий Порядок закрытия непокрытых позиций клиентов в рамках брокерского обслуживания в ООО «Пермская фондовая компания» (далее – настоящий Порядок) утвержден Обществом с ограниченной ответственностью «Пермская 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 или повышенным уровнем риска в соответствии с нормативными актами Банка России, и определяет порядок закрытия позиций указанных клиентов.

Настоящий Порядок разработан во исполнение Указания Банка России N 5636-У от 26.11.2020 «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 «Пермская 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.

1.2. Для целей настоящего Порядка используются следующие термины:

Непокрытая позиция — возникновение или увеличение в абсолютном выражении отрицательного значения плановой позиции по ценным бумагам.

НПР1 — норматив покрытия риска при исполнении поручений клиента, отнесенного Организацией к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска в соответствии с Указанием.

Минимально допустимое числовое значение НПР1 устанавливается в размере 0, за исключением случаев, установленных пунктом 13 Указания.

НПР2 — норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента, отнесенного Организацией к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска 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 меньше 0.

Ограничительное время закрытия позиций — 16:00:00 по местному времени каждого торгового дня, до которого снижение значения НПР2 ниже 0 влечет закрытие позиций клиента.

Контрольное время — 21:00:00 по местному времени 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 15 приложения к Указанию для целей контроля за НПР1.

Размер начальной маржи — величина, рассчитываемая в соответствии с пунктами 15 и 16 приложения к Указанию для целей контроля за НПР2.

Стоимость портфеля клиента — сумма значений плановых позиций, рассчитанных в соответствии с пунктом 2 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 меньше 0, с соблюдением следующих требований.

В отношении клиентов, отнесенных Организацией к категории клиентов со стандартным уровнем риска, Организация осуществляет закрытие позиций до достижения НПР1 нулевого значения (при положительном значении размера начальной маржи).

В отношении клиентов, отнесенных Организацией к категории клиентов с повышенным уровнем риска, Организация осуществляет закрытие позиций до достижения НПР2 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. Порядка, если после реализации ликвидных ценных бумаг клиента значение НПР2 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 НПР2 ниже 0 на анонимных торгах.

3. Сроки закрытия позиций клиентов при снижении НПР2 ниже 0

Организация осуществляет закрытие позиций клиента при снижении НПР2 ниже 0 в следующие сроки:

3.1. в случае если НПР2 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 НПР2 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 (иностранной валютой) 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. Все клиенты Организации совершают необеспеченные сделки через систему интернет-трейдинга, в которой отражается информация о текущей стоимости портфеля, размере начальной и 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 случае если по состоянию на контрольное время значение НПР2 отрицательное, фиксируется запись о значении минимальной маржи и стоимости портфеля клиента по состоянию на контрольное время.

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.

Пронумеровано, пронумеровано,
скреплено печатью

5 (*пять*) листа(ов)

Генеральный директор

С.Г. Токарев

Дата подписания

