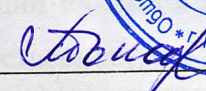


# 1. Общие положения

УТВЕРЖДАЮ:  
Генеральный директор  
ООО «Пермская фондовая компания»  
  
Токарев С.Г.  
«30» сентября 2021 г.



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

Данным постановлением Порядка устанавливаются следующие термины:

Закрытие позиций - действия Организации по снижению размера минимальной маржи и (или) увеличению стоимости портфеля клиента.

Непокрытая позиция - возникающее в результате совершения необеспеченной сделки, отрицательное значение или увеличение в абсолютном выражении значения этого значения (по ценным бумагам или в денежном выражении) или, наоборот, положительное значение.

НПР1 - порог закрытия риска при исполнении обязательств клиента, возникающий в категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, устанавливаемое числовое значение НПР1 устанавливается в размере 0, за исключением случаев, установленных пунктом 13 Указания.

НПР2 - порог закрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента, устанавливаемый Организацией в категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, устанавливаемое числовое значение НПР2 устанавливается в размере 0.

## 1. Общие положения

Настоящий Порядок закрытия непокрытых позиций клиентов в рамках брокерского обслуживания в Обществе с ограниченной ответственностью «Пермская фондовая компания» (далее - Порядок) утвержден ООО «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 в установленном порядке к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, и определяет порядок закрытия позиций таких клиентов.

Настоящий Порядок соответствует указанию Центрального банка Российской Федерации 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 на рынке ценных бумаг ООО «Пермская фондовая компания». Внесение изменений и дополнений в настоящий Порядок, производится Организацией в одностороннем порядке. Все изменения и дополнения к настоящему Порядку утверждаются приказом Генерального директора Организации.

Для целей настоящего Порядка используются следующие термины:

Закрытие позиции - действия Организации по снижению размера минимальной маржи и (или) увеличению стоимости портфеля клиента.

Непокрытая позиция - возникающее в результате совершения необеспеченной сделки, отрицательное значение или увеличение в абсолютном выражении отрицательного значения плановой позиции по ценным бумагам или по денежным средствам по каждому виду валют.

НПР1 - норматив покрытия риска при исполнении поручений клиента, отнесенного Организацией к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска; 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; минимально допустимое числовое значение НПР2 устанавливается в размере 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 – конец торгового дня 21:00:00 по местному времени каждого торгового дня, после которого клиент не может открыть непокрытую позицию.

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

Перечень ликвидных ценных бумаг - единый перечень ценных бумаг, состоящий из списка ценных бумаг, в отношении которых разрешено совершать сделки по продаже, и списка ценных бумаг, принимаемых в обеспечение.

Размер минимальной маржи - величина, рассчитываемая в соответствии с пунктом 15 приложения к Указанию для целей контроля за нормативом покрытия риска при исполнении поручений клиента.

Размер начальной маржи - величина, рассчитываемая в соответствии с пунктами 15 и 16 приложения к Указанию для целей контроля за нормативом покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента.

Стоимость Портфеля - сумма значений плановых позиций, рассчитанных в соответствии с пунктом 2 приложения к Указанию по ценным бумагам каждого эмитента (лица, обязанного по ценной бумаге), предоставляющим их владельцам одинаковый объем прав, и по денежным средствам по каждому виду валют.

## **2. Порядок закрытия позиций клиентов, отнесенных к категории клиентов со стандартным уровнем риска**

Для клиентов со стандартным уровнем риска устанавливается следующий порядок закрытия позиций:

- 2.1. при снижении стоимости портфеля ниже соответствующего размера минимальной маржи (НПР2 меньше 0) Организация в целях снижения размера Минимальной маржи и/или увеличения значения Стоимости портфеля клиента вправе совершать сделки по покупке или продаже ликвидных ценных бумаг или иностранной валюты в объеме достаточном для достижения НПР1 нулевого значения (при положительном значении размера начальной маржи);

- 2.2. если после реализации ликвидного имущества клиента значение НПР2 остается меньше 0, то Организация вправе совершать сделки с ценными бумагами, не включенными в список ценных бумаг, которые могут приниматься в качестве обеспечения по необеспеченным сделкам. Конкретные активы, продажа/покупка которых будет осуществлена в качестве действий по закрытию позиции, определяются Ответственным работником, исходя из складывающейся рыночной конъюнктуры и структуры портфеля.

### **3. Порядок закрытия позиций клиентов, отнесенных к категории клиентов с повышенным уровнем риска**

Для клиентов с повышенным уровнем риска устанавливается следующий порядок закрытия позиций:

- 3.1. при снижении стоимости портфеля ниже соответствующего размера минимальной маржи (НПР2 меньше 0) Организация в целях снижения размера Минимальной маржи и/или увеличения значения Стоимости портфеля клиента вправе совершать сделки по покупке или продаже ликвидных ценных бумаг или иностранной валюты в объеме достаточном для достижения НПР2 нулевого значения (при положительном значении размера минимальной маржи);
- 3.2. если после реализации ликвидного имущества клиента значение НПР2 остается меньше 0, то Организация вправе совершать сделки с ценными бумагами, не включенными в список ценных бумаг, которые могут приниматься в качестве обеспечения по необеспеченным сделкам. Конкретные активы, продажа/покупка которых будет осуществлена в качестве действий по закрытию позиции, определяются Ответственным работником, исходя из складывающейся рыночной конъюнктуры и структуры портфеля.

### **4. Сроки закрытия позиций клиентов при снижении НПР2 ниже 0**

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

- 4.1. 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;
- 4.2. 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;

- 4.3. 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.
- 4.4. Организация в режиме реального времени предоставляет всем клиентам, совершающим необеспеченные сделки, информацию о текущей Стоимости портфеля, размере Начальной и Минимальной маржи. В связи с этим, уведомления при снижении значения НПР2 ниже нуля клиентам не направляется. Организация вправе направить Клиенту, в том числе с использованием торговой системы, информационное сообщение о маржинальных показателях. При этом соответствующие информационные сообщения, не являются уведомлениями в терминах Указания.

## **5. Порядок фиксации отрицательных значений НПР2**

- 5.1. В отношении каждого клиента фиксируется запись (информация) об отрицательных значениях НПР2 по состоянию на Ограничительное время и на Контрольное время.
- 5.2. 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.
- 5.3. 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  
О.Г. Токарев

