

## **Порядок закрытия непокрытых позиций клиентов в рамках брокерского обслуживания ООО «Москва Сити Секьюритиз»**

### **1. Общие положения**

- 1.1. Настоящий Порядок закрытия необеспеченных позиций клиентов в рамках брокерского обслуживания (далее - Порядок), определяет основные параметры и условия закрытия ООО «Москва Сити Секьюритиз» (далее - Общество) необеспеченных позиций клиентов в рамках соглашений, заключенных клиентами путем присоединения к Регламенту оказания брокерских услуг ООО «Москва Сити Секьюритиз» (далее – Регламент Общества).
- 1.2. Порядок разработан на основании законодательства Российской Федерации, нормативных правовых актов Банка России в области рынка ценных бумаг, в том числе на основании Указания 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), а также Регламента Общества.
- 1.3. При осуществлении действий, приводящих к возникновению необеспеченных позиций клиентов, а также при закрытии позиций клиентов работники Общества руководствуются настоящим Порядком.
- 1.4. В случаях, не предусмотренных настоящим Порядком, работники Общества руководствуются иными внутренними документами Общества, регламентирующими порядок оказания Обществом брокерских услуг клиентам, Регламентом Общества, а также законодательством Российской Федерации, в том числе Указанием № 5636-У.

### **2. Термины и сокращения**

- 2.1. В Порядке используются следующие термины и сокращения:

**Анонимные торги** - организованные торги, при которых заявки адресованы всем участникам торгов и информация, позволяющая идентифицировать подавших заявки участников торгов, не раскрывается в ходе торгов другим участникам.

**Закрытие позиций** - меры по снижению размера минимальной маржи и (или) увеличению стоимости портфеля клиента (покупка или продажа ценных бумаг или иностранных валют, входящих в портфель клиента, с целью уменьшения обязательств). Размер минимальной маржи и стоимость портфеля клиента рассчитываются по формулам, приведенным в Приложении к Указанию № 5636-У.

Не относятся к закрытию позиций в целях настоящего Порядка действия Общества, совершенные на основании поручения клиента, направленного Обществу для совершения сделки с финансовыми инструментами за счет клиента, в котором указаны конкретные параметры сделки (вид и наименование инструмента, количество, цена);

**Клиент** - любое юридическое или физическое лицо, заключившее с Обществом Соглашение об оказании брокерских услуг в порядке, предусмотренном Регламентом Общества.

**Клиент с повышенным уровнем риска (КПУР)** - клиент-физическое/юридическое лицо, отнесенный Обществом к данной категории.

**Клиент со стандартным уровнем риска (КСУР)** - любой клиент-физическое/ юридическое лицо, не отнесенный Обществом к категории КПУР/КОУР.

**Клиент с особым уровнем риска (КОУР)** – клиент-юридическое лицо, которому Общество вправе разрешить совершать необеспеченные сделки.

**Конец торгового дня** - время окончания торгов основной торговой сессии фондового рынка Московской Биржи.

**Начальная маржа, Минимальная маржа** - расчетные показатели, определяемые по формулам, определенным Указанием № 5636-У и отражающие совокупную максимальную и минимальную оценку стоимости портфеля клиента с учетом риска уменьшения цены (курса) входящих в портфель клиента ценных бумаг и иностранной валюты.

**Начальная ставка риска** - начальная ставка риска уменьшения цены имущества в портфеле клиента, определяемая в соответствии с Указанием № 5636-У.

**Необеспеченная позиция** - отрицательное значение плановой позиции клиента.

**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 (нуля) влечет закрытие позиций клиента в течение этого торгового дня.

**Ответственный работник** – работник Общества, 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.

**Плановая позиция по денежным средствам** - сумма денежных средств клиента, учитываемая на брокерском счете клиента, а также сумма денежных средств, которые ожидаются к поступлению на брокерский счет клиента по результатам расчетов ранее заключенных сделок, за вычетом денежных средств, которые подлежат списанию с брокерского счета клиента по результатам расчетов ранее заключенных сделок.

**Плановая позиция по ценным бумагам/иностраннным валютам** - Текущая стоимость ценных бумаг/иностраннных валют на Счете депо/брокерском счете/Едином брокерском счете клиента, определяемая по каждому эмитенту, виду и типу ценных бумаг, а также иностранной валюте. В состав плановой позиции по ценным бумагам включается текущая стоимость ценных бумаг /иностраннных валют, подлежащих зачислению на счет депо/брокерский счет/единый брокерский счет клиента, и текущая стоимость ценных бумаг/иностраннных валют, по которым у клиента имеются обязательства по поставке контрагентам.

**Портфель клиента** - плановая позиция клиента по денежным средствам и по ценным бумагам на фондовом рынке Московской Биржи, на СПБ Бирже и по денежным средствам и иностраннным валютам на валютном рынке Московской Биржи. В состав портфеля Клиента считаются входящими денежные средства и (или) ценные бумаги клиента, обязательства из

сделок с ценными бумагами и денежными средствами, совершенных в соответствии с заключенным Соглашением, задолженность клиента перед Обществом по необеспеченным позициям.

**Стоимость портфеля клиента** - расчетный показатель совокупной оценочной стоимости портфеля клиента, рассчитываемый в порядке и по формуле, определенной Указанием № 5636-У.

### 3. Порядок закрытия позиций Клиентов

3.1. Ответственный работник осуществляет контроль непокрытых позиций клиента в режиме реального времени с 10:00 до 18:40 с использованием специализированного программного модуля «Мониторинг маржинальных показателей» (далее – Модуль).

3.2. Структура каждого портфеля клиента, цены биржевых сделок со входящими в портфель инструментами, значения соответствующих им риск-параметров, рассчитанных НКЦ, в течение торговой сессии транслируются в Модуль в режиме реального времени. В соответствии с Указанием № 5636-У на основе текущих значений риск-параметров в Модуле с учетом категории риска клиента автоматически рассчитываются дисконтирующие коэффициенты применительно к позициям клиентов.

3.3. Ограничительное время закрытия позиций - 17 час. 00 мин. 00 сек. по московскому времени каждого торгового дня.

3.4 В Модуле совершается фиксация структуры и маржинальных характеристик портфеля клиента, в котором имеется непокрыта позиция, в момент принятия значения показателем ННР 2 значения ниже 0 (нуля), по состоянию на момент Ограничительного времени и по состоянию на Конец торгового дня.

3.5. Ответственный работник осуществляет закрытие непокрытых позиций в следующие сроки:

- в случае если ННР2 принимает значение ниже 0 (нуля) в течение торгового дня до Ограничительного времени закрытия позиций, Общество закрывает позиции клиента в течение этого торгового дня;
- в случае если ННР2 принимает значение ниже 0 (нуля) 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;
- в случае если до закрытия позиций клиента организованные торги ценными бумагами (иностранной валютой) были приостановлены на каком-либо из рынков Московской биржи 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 ННР2 принял значение ниже 0 (нуля).

3.6. Ответственный работник осуществляет закрытие непокрытых позиций клиента при снижении ННР2 ниже 0 (нуля) с соблюдением следующих требований:

- в отношении клиентов, отнесенных Обществом к категории КСУР, Ответственный работник осуществляет закрытие позиций до достижения нулевого значения ННР1;
- в отношении клиентов, отнесенных Обществом к категории КПУР, Ответственный работник осуществляет закрытие позиций до достижения нулевого значения ННР2;
- при осуществлении Обществом закрытия позиции клиента до приведения ННР1 в соответствие с предыдущим абзацем допускается снижение значения ННР1 относительно своего предыдущего отрицательного значения;
- закрытие позиций клиента при снижении ННР2 ниже 0 (нуля) Общество совершает только на анонимных торгах.

3.7. Закрытие позиций клиентов осуществляет Ответственный работник Общества, который уполномочивается на совершение таких действий распоряжением Генерального директора Общества.

3.8. При осуществлении действий по закрытию позиций клиента Ответственный работник учитывает:

- цены финансовых инструментов в портфеле клиента/финансовых инструментов, подлежащих зачислению в портфель клиента;
- минимальный размер биржевого лота финансовых инструментов в портфеле клиента/финансовых инструментов, подлежащих зачислению в портфель клиента;
- ликвидность финансовых инструментов в портфеле клиента/финансовых инструментов, подлежащих зачислению в портфель клиента;
- сроки совершения сделок, заключаемых в целях закрытия позиций клиента, и проведения расчетов по ним;
- возможные расходы клиента, связанные с заключением сделок по закрытию позиций;
- иные обстоятельства, имеющие значение при совершении действий по закрытию позиций.

3.6. В случае, если НПП1 принял значение ниже 0, брокер по электронной почте в течение 1 (одного) часа направляет клиенту уведомление о снижении значения НПП1 ниже 0. Уведомление должно содержать информацию о стоимости портфеля, о размере начальной маржи и о размере минимальной маржи на момент возникновения основания для направления уведомления, а также информацию о действиях Общества, если значение НПП2 будет ниже 0.

### **3. Прочие положения**

4.1. Внесение изменений и/или дополнений в настоящий Порядок производится Обществом в одностороннем порядке с учетом требований законодательства Российской Федерации и внутренних нормативных документов Общества.

4.2. Порядок, а также изменения и дополнения к нему Обществом на сайте Общества по адресу:

4.3. Все изменения и дополнения в настоящий Порядок вступают в силу с даты опубликования на сайте Общества новой редакции настоящего Порядка.

4.4. Клиенты в целях своевременного ознакомления с изменениями и дополнениями настоящего Порядка обязуются не реже одного раза в неделю обращаться на официальный сайт Общества за сведениями об изменениях, внесенных в Порядок