

Порядок закрытия необеспеченных (непокрытых) позиций клиентов в рамках брокерского обслуживания

1. Общие положения

1.1. Настоящий Порядок закрытия необеспеченных позиций Клиентов в рамках брокерского обслуживания (далее - Порядок), определяет основные параметры и условия закрытия АО «Россельхозбанк» (далее - Банк) необеспеченных позиций Клиентов в рамках соглашений об оказании брокерских услуг АО «Россельхозбанк»/соглашений об оказании брокерских услуг АО «Россельхозбанк» с использованием индивидуального инвестиционного счета (далее - Соглашение/Соглашение ИИС), заключенных Клиентами путем присоединения к Регламенту оказания брокерских услуг АО «Россельхозбанк» № 15-Р (далее - Регламент № 15-Р).

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 08.10.2018 № 4928-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок с ценными бумагами и заключении договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, критериях ликвидности ценных бумаг, предоставляемых в качестве обеспечения обязательств клиента перед брокером, при совершении брокером таких сделок и заключении таких договоров, а также об обязательных нормативах брокера, совершающего такие сделки и заключающего такие договоры» (далее - Указание № 4928-У), а также Регламента № 15-Р.

1.3. При осуществлении действий, приводящих к возникновению Необеспеченных позиций Клиентов, а также при закрытии позиций Клиентов работники Банка руководствуются настоящим Порядком.

1.4. В случаях, не предусмотренных настоящим Порядком, работники Банка руководствуются иными внутренними документами Банка, регламентирующими порядок оказания Банком брокерских услуг Клиентам, Регламентом № 15-Р, а также законодательством Российской Федерации, в том числе Указанием № 4928-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 № 4928-У.

Не относится к закрытию позиций в целях настоящего Порядка:

- действия Банка, совершенные на основании поручения Клиента, направленного Банку для совершения сделки с финансовыми инструментами за счет Клиента, в котором указаны конкретные параметры сделки (вид и наименование инструмента, количество, цена);
- закрытие открытых позиций по фьючерсным и (или) опционным договорам.

Клиент - любое юридическое или физическое лицо, заключившее с Банком Соглашение об оказании брокерских услуг в порядке, предусмотренном Регламентом № 15-Р, и/или физическое лицо, заключившее с Банком Соглашение об оказании брокерских услуг с ИИС.

Клиент с повышенным уровнем риска (КПУР) - Клиент-физическое лицо, отнесенный Банком к данной категории, отвечающий одному из требований, указанных в п. 31 Указания № 4928-У.

Клиент со стандартным уровнем риска (КСУР) - любой Клиент-физическое лицо, не отнесенный Банком к категории КПУР.

Клиент с особым уровнем риска (КОУР) - Клиент-юридическое лицо.

Начальная маржа, Минимальная маржа - расчетные показатели, определяемые по формулам, определенным Указанием № 4928-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 № 4928-У.

Необеспеченная позиция - отрицательное значение Плановой позиции Клиента.

НПР1 - норматив покрытия риска при исполнении поручений Клиента, отнесенного Банком к категориям Клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, рассчитываемый по формуле, установленной Указанием № 4928-У.

НПР2 - норматив покрытия риска при изменении Стоимости портфеля Клиента, отнесенного Банком к категориям Клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, рассчитываемый по формуле, установленной Указанием № 4928-У.

Ограничительное время закрытия позиций - определенное Банком время каждого Торгового дня, до которого снижение значения НПР2 ниже 0 (нуля) влечет закрытие позиций Клиента в течение этого Торгового дня.

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/иностранным валютам - Текущая стоимость ценных бумаг/иностранной валюты на Счете депо/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 /иностранной валюты, подлежащих зачислению на Счет депо/брокерский счет Клиента, и Текущая стоимость ценных бумаг/иностранной валюты, по которым у Клиента имеются обязательства по поставке контрагентам.

Портфель Клиента - Плановая позиция Клиента по денежным средствам и по ценным бумагам на Фондовом и по денежным средствам и иностранной валюте на Валютном рынке Московской Биржи (портфель ведется обособленно на каждом из рынков). В состав Портфеля считаются входящими денежные средства и (или) ценные бумаги Клиента, обязательства из сделок с ценными бумагами и денежными средствами, совершенных в соответствии с заключенным Соглашением/Соглашением ИИС, задолженность Клиента перед Банком по Необеспеченным позициям.

Стоимость портфеля Клиента - расчетный показатель совокупной оценочной стоимости портфеля Клиента, рассчитываемый в порядке и по формуле, определенной Указанием № 4928-У.

Торговая сессия (торговый день) - период времени, в течение которого на Организованных торгах в соответствии с Правилами организованных торгов могут заключаться сделки. Если не указано иное, под торговой сессией подразумевается только период основной торговой сессии, в течение которой сделки могут заключаться по общим

правилам. Период времени, в течение которого торги проводятся по специальным правилам (периоды открытия, закрытия торгов, торговля неполными лотами и т.п.), предусмотренные Правилами организованных торгов, если это не оговорено особо, в период торговой сессии не включаются.

Финансовый инструмент - ценные бумаги и иностранная валюта.

2.2. Термины и сокращения, не определенные в Порядке, используются в значениях, установленных нормативными документами, регулирующими обращение ценных бумаг и срочных инструментов, иностранной валюты, иными нормативными правовыми актами Российской Федерации, в том числе Указанием № 4928-У, а также Регламентом № 15-Р.

3. Порядок закрытия позиций Клиентов

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

3.2. Банк осуществляет закрытие позиций Клиента при снижении ННР2 ниже 0 (нуля) в следующие сроки:

- в случае если ННР2 принимает значение ниже 0 (нуля) в течение Торгового дня до Ограничительного времени закрытия позиций, Банк 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, Банк 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, Банк 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).

3.3. Банк осуществляет закрытие позиций Клиента при снижении ННР2 ниже 0 (нуля) с соблюдением следующих требований:

- в отношении Клиентов, отнесенных Банком к категории КСУР, КПУР и КОУР, Банк осуществляет закрытие позиций до достижения ННР1 положительного значения, определенного Регламентом № 15-Р;

- при осуществлении Банком закрытия позиции Клиента до приведения ННР1 в соответствие с предыдущим буллитом допускается снижение значения ННР1 относительно своего предыдущего отрицательного значения;

- закрытие позиций Клиента при снижении ННР2 ниже 0 (нуля) Банк совершает только на анонимных торгах.

3.4. Закрытие позиций Клиентов осуществляют работники Банка, ответственные за совершение действий по закрытию позиций Клиентов (далее - Риск-менеджеры), которые уполномочиваются на совершение таких действий распоряжением директора Департамента по работе на рынках капитала либо лица, его замещающего, в соответствии с функционалом Департамента по работе на рынках капитала, установленным Положением о Департаменте по работе на рынках капитала АО «Россельхозбанк».

3.5. При осуществлении действий по закрытию позиций Клиента Риск-менеджеры учитывают:

- 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. Банк не направляет Клиенту уведомление о снижении значения НПР1 ниже 0 (нуля), поскольку Банк в соответствии с Регламентом № 15-Р в любой момент времени предоставляет Клиентам защищенный доступ к информации о текущих стоимости портфеля Клиента и размере начальной и минимальной маржи, НПР1, НПР2 посредством предоставления защищенного доступа к информационно-торговым системам, в которых транслируются вышеуказанные показатели.

4. Прочие положения

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

4.2. Порядок, а также изменения и дополнения к нему раскрываются Банком на сайте Банка <http://www.rshb.ru> в соответствии с требованиями Указания № 4928-У.

4.3. Все изменения и дополнения в настоящий Порядок вступают в силу с даты опубликования на сайте Банка <http://www.rshb.ru> новой редакции настоящего Порядка.

4.4. Клиент в целях своевременного ознакомления с изменениями и дополнениями настоящего Порядка обязуется не реже одного раза в неделю обращаться на официальный сайт Банка <http://www.rshb.ru> за сведениями об изменениях, внесенных в Порядок.