



УТВЕРЖДЕНО

Советом директоров ООО ИК «Тренд»

(Протокол № 230706/СД от 06.07.2023)

Вступает в силу с 12.07.2023

ПОРЯДОК ЗАКРЫТИЯ ПОЗИЦИЙ

КЛИЕНТОВ ООО ИК «ТРЕНД»

(редакция №2)

Москва, 2023

1. Настоящий Порядок закрытия позиций клиентов ООО ИК «Тренд» (далее – Порядок) разработан в соответствии с требованиями действующего законодательства Российской Федерации и 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 Банка России).

2. Данный Порядок распространяется на клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска.

3. При возникновении непокрытых позиций по ценным бумагам и денежным средствам клиента со стандартным или повышенным уровнем риска, устанавливаются следующие обязательные нормативы:

- ✓ норматив покрытия риска при исполнении поручений клиента - НПП1;
- ✓ норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента - НПП2.

4. Норматив покрытия риска при исполнении поручений клиента (НПП1), рассчитывается по формуле:

$$\text{НПП1} = S - M0, \text{ где:}$$

S - стоимость портфеля клиента,
M0 - размер начальной маржи.

Размер начальной маржи устанавливается в размере 0. Минимально допустимое числовое значение НПП1 устанавливается в размере 0, за исключением следующих случаев:

✓ если отрицательное значение НПП1 или его снижение относительно своего предыдущего отрицательного значения произошло не в результате совершения брокером действий в отношении портфеля клиента;

✓ в случае, предусмотренном пунктом 20 Указания Банка России;

✓ в случае положительного значения НПП1, определенного брокером в соответствии с вышеуказанной формулой, на момент принятия поручения клиента, исполнение которого привело к отрицательному значению НПП1, или, если исполнение этого поручения поставлено в зависимость от наступления предусмотренных в нем обстоятельств, - на момент наступления таких обстоятельств, исходя из плановых позиций в составе портфеля клиента, скорректированных брокером с учетом принятых, но не исполненных к указанному моменту поручений этого клиента;

✓ в случае начисления брокером и (или) уплаты за счет клиента брокеру и (или) третьим лицам в связи со сделками, заключенными брокером за счет клиента, сумм штрафов, пеней, процентов, неустоек, убытков, расходов и вознаграждений по Соглашению о брокерском обслуживании и (или) по договору брокера с клиентом, предметом которого не является оказание брокерских услуг;

✓ в случае если за счет имущества клиента исполняются обязанности клиента по уплате обязательных платежей, включая случаи исполнения брокером обязанностей налогового агента исполнения решений органов государственной власти;

✓ в случае заключения брокером за счет клиента договоров репо;

✓ в случае проведения брокером операций за счет клиента, связанных с отчуждением (приобретением) иностранной валюты и ее обратным приобретением (отчуждением) брокером;

✓ в случае удовлетворения клиринговой организацией требований, обеспеченных индивидуальным клиринговым обеспечением, в результате неисполнения или ненадлежащего исполнения брокером обязательств из сделок, совершенных за счет клиентов;

✓ в случае исключения брокером ценной бумаги и (или) иностранной валюты из Перечня ликвидных ценных бумаг и иностранных валют;

✓ в случае изменения брокером значений начальной ставки риска и (или) относительной ставки риска изменения цен;

✓ в случае заключения сделки в силу обязанности ее заключения брокером в соответствии с правилами клиринга и (или) в соответствии с условиями фьючерсного договора;

✓ в случае принятия брокером поручения клиента одновременно на совершение двух или более сделок, подлежащих исполнению в один и тот же день, при том что: в соответствии с поручением клиента его частичное исполнение не допускается; заключение любой из сделок приведет к увеличению размера начальной маржи относительно стоимости портфеля клиента;

заключение всех сделок, указанных в поручении клиента, приведет к снижению размера начальной маржи относительно ее первоначального размера.

5. Норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента (НПР2), рассчитывается по формуле:

$$\text{НПР2} = S - M_x, \text{ где:}$$

S - стоимость портфеля клиента,
M_x - размер минимальной маржи.

Размер минимальной маржи устанавливается в размере 0. Минимально допустимое числовое значение НПР2 устанавливается в размере 0.

6. Брокер осуществляет закрытие позиций клиента при снижении НПР2 ниже 0 в следующие сроки:

✓ в случае если НПР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня до «17:00:00» по московскому времени, брокер осуществляет закрытие позиций клиента в течение указанного торгового дня.

✓ в случае если НПР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня после «17:00:00» по московскому времени, брокер осуществляет закрытие позиций клиента не позднее «10:00:00» по московскому времени ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором НПР2 принял значение ниже 0.

✓ в случае если до закрытия позиций клиента организованные торги ценными бумагами (иностранной валютой и(или) производными финансовыми инструментами) были приостановлены и их возобновление произошло после ограничительного времени закрытия позиций, брокер осуществляет закрытие позиций клиента не позднее ограничительного времени закрытия позиций ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором НПР2 принял значение ниже 0.

7. Указанное в пункте 6 настоящего Порядка ограничительное время закрытия позиций является единым для всех портфелей клиентов.

8. Закрытие позиций клиента при снижении НПР2 ниже 0 брокер совершает на анонимных торгах.

9. В случае если НПР1 принял значение ниже 0, брокер направляет клиенту уведомление о снижении значения НПР1 ниже 0 до окончания основной торговой сессии проведения организованных торгов ценными бумагами в день, в который наступило указанное обстоятельство.