



УТВЕРЖДЕНО

Советом директоров ООО ИК «Тренд»

(Протокол № 250318/СД от 18.03.2025)

Вступает в силу с 01.04.2025

ПОРЯДОК ЗАКРЫТИЯ ПОЗИЦИЙ

КЛИЕНТОВ ООО ИК «ТРЕНД»

(редакция №3)

Москва, 2025

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 12.02.2024 № 6681-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 с начальным , стандартным или повышенным уровнем риска.

3. В отношении клиентов, отнесенных к категории клиентов с начальным уровнем риска или категории клиентов со стандартным уровнем риска, брокер осуществит закрытие позиций до достижения НПП1 нулевого значения (при положительном значении размера начальной маржи), если достижение большего значения НПП1 не предусмотрено договором о брокерском обслуживании.

4. В отношении клиентов, отнесенных к категории клиентов с повышенным уровнем риска, брокер осуществит закрытие позиций указанных клиентов до достижения НПП2 нулевого значения (при положительном значении размера минимальной маржи), если достижение большего значения НПП2 не предусмотрено договором о брокерском обслуживании.

5. При осуществлении брокером закрытия позиции клиента до приведения НПП1 или НПП2 в соответствие с требованиями пунктов 3 и 4 Порядка допускается снижение значения НПП1 относительно своего предыдущего отрицательного значения.

6. При возникновении непокрытых позиций по ценным бумагам и денежным средствам клиента с начальным , 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.

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

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

S - стоимость портфеля клиента, рассчитываемая в соответствии с пунктом 3 Приложения к Указанию Банка России от 12.02.2024 года № 6681-У

M0 - размер начальной маржи, рассчитываемый в соответствии с пунктом 18 или пунктом 37 Приложения к Указанию Банка России от 12.02.2024 года № 6681-У

S_{блок} - значения показателя, рассчитываемое по формуле в соответствии с пунктом 1 Приложения к Указанию Банка России от 12.02.2024 года № 6681-У

5. Норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента (НПП2), рассчитывается по формуле:

$$\text{НПП2} = S - Mx, \text{ где:}$$

S - стоимость портфеля клиента, , рассчитываемая в соответствии с пунктом 3 Приложения к Указанию Банка России от 12.02.2024 года № 6681-У

Mx - размер минимальной маржи, , рассчитываемая в соответствии с пунктом 18 Приложения к Указанию Банка России от 12.02.2024 года № 6681-У

Минимально допустимое числовое значение НПП2 устанавливается в размере 0.

6. Брокер осуществляет закрытие позиций клиента при снижении НПП2 ниже 0 в следующие сроки:

- ✓ в случае если НПП2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня до «14:00:00» по московскому времени, брокер осуществляет закрытие позиций клиента в течение указанного торгового дня.

✓ в случае если ННР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня после «14:00:00» 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 ННР2 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 ННР2 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 ННР2 ниже 0 брокер совершает на торгах на основе безадресных заявок.

9. Закрытие позиций клиента при снижении ННР2 ниже 0 не на торгах на основе безадресных заявок (включая совершение брокером сделок за счет клиента без его поручения, предусмотренных пунктом 4 статьи 3 Федерального закона от 22 апреля 1996 года N 39-ФЗ "О рынке ценных бумаг", не на организованных торгах) допускается только в следующих случаях:

✓ Покупка ценных бумаг (за исключением облигаций) и (или) драгоценных металлов осуществляется по цене, не превышающей максимальной цены сделки с указанными ценными бумагами и (или) драгоценными металлами, совершенной на торгах на основе безадресных заявок, в течение последних 15 минут, предшествующих действиям брокера, направленным на совершение сделки, или, если торги на основе безадресных заявок приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления.

✓ Покупка облигаций и (или) иностранной валюты осуществляется при соблюдении одного из следующих требований:

- покупка осуществляется по цене, не превышающей максимальной цены сделки с указанными облигациями и (или) иностранной валютой, совершенной на торгах на основе безадресных заявок в течение последних 15 минут, предшествующих действиям брокера, направленным на совершение сделки, или, если торги на основе безадресных заявок приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления;
- покупка осуществляется по цене не выше лучшей котировки на продажу указанных облигаций и (или) иностранной валюты, информация о которой опубликована в информационной системе "Блумберг" (Bloomberg) или в информационной системе "Рефинитив" (Refinitiv) либо предоставлена небанковской кредитной организацией акционерным обществом "Национальный расчетный депозитарий" (далее - НКО АО НРД), или акционерным обществом "Интерфакс" (далее - АО "Интерфакс"), или обществом с ограниченной ответственностью "Сбондс.ру" (далее - ООО "Сбондс.ру"), более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по облигации (иностранной валюте), предусмотренной пунктами 39 - 42 приложения к Указанию Банка России от 12.02.2024 года № 6681-У .

✓ Покупка иностранной валюты осуществляется в отсутствие проведения торгов на основе безадресных заявок указанной иностранной валютой либо в объеме меньшем, чем минимальный размер биржевого лота, предусмотренный правилами организованных торгов указанной иностранной валютой.

✓ Продажа ценных бумаг (за исключением облигаций) и (или) драгоценных металлов осуществляется по цене не ниже минимальной цены сделки с указанными ценными бумагами и (или) драгоценными металлами, совершенной на торгах на основе безадресных заявок в течение последних 15 минут, предшествующих действиям брокера, направленным на совершение сделки, или, если торги на основе безадресных заявок приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления.

✓ Продажа облигаций и (или) иностранной валюты осуществляется при соблюдении одного из следующих требований:

- продажа осуществляется по цене не ниже минимальной цены сделки с указанными облигациями и (или) иностранной валютой, совершенной на торгах на основе безадресных заявок в течение последних 15 минут, предшествующих действиям брокера, направленным на совершение сделки, или, если торги на основе безадресных заявок приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления;
- продажа осуществляется по цене не ниже лучшей котировки на покупку указанных облигаций и (или) иностранной валюты, информация о которой опубликована в информационной системе "Блумберг" (Bloomberg) или в информационной системе "Рефинитив" (Refinitiv) либо предоставлена НКО АО НРД, или АО "Интерфакс", или ООО "Сбондс.ру", более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по облигации (иностранной валюте), предусмотренной пунктами 39 - 42 приложения к Указанию Банка России от 12.02.2024 года № 6681-У .

✓ Продажа иностранной валюты осуществляется в отсутствие проведения торгов на основе безадресных заявок указанной иностранной валютой либо в объеме меньшем, чем минимальный размер биржевого лота, предусмотренный правилами организованных торгов указанной иностранной валютой.

✓ Закрытие позиций клиента осуществляется брокером в соответствии с ценами (котировками) ценных бумаг, и (или) драгоценных металлов, и (или) иностранных валют, источник информации о которых брокер должен согласовать с клиентом, и, если источником информации о котировках является информационная система "Блумберг" (Bloomberg), информационная система "Рефинитив" (Refinitiv), НКО АО НРД, АО "Интерфакс" или ООО "Сбондс.ру", брокер также должен согласовать с клиентом условное обозначение котировок, применяемое для их идентификации.