

Порядок закрытия позиций

1. Общие положения

1. Порядок закрытия позиций разработан в соответствии с требованиями Указания Банка России от 26.11.2020 N 5636-У "О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента" (далее – Единые требования) и определяет порядок действий Банка «Мир Привилегий» (общество с ограниченной ответственностью по снижению размера минимальной маржи и (или) увеличению стоимости Портфеля Клиента.

2. Положения, зафиксированные в Порядке закрытия позиций, подлежат применению с учетом условий Договора на брокерское обслуживание, заключенного между МП Банком (ООО) и Клиентом, в том числе Приложения 20 Правил обслуживания клиентов при приеме и исполнении необеспеченных сделок обслуживания клиентов при приеме и исполнении необеспеченных сделок к Порядку обслуживания клиентов МП Банка (ООО) на финансовых рынках.

3. К закрытию Позиций Клиента не относятся действия Брокера, совершенные на основании поручения Клиента, направленного (переданного) Банку для совершения сделки (заключения договора) за счет Клиента, в котором указаны конкретные ценные бумаги и их количество.

4. Закрытие позиций Клиента осуществляется в порядке и на условиях, предусмотренных Договором на брокерское обслуживание с учетом категории уровня риска, к которой отнесен Клиент.

5. Минимально допустимые числовые значения НПР1 и НПР2 устанавливаются в размере 0 (Нуля).

6. Время каждого Торгового дня, до которого снижение значения НПР2 ниже 0 (Нуля) влечет закрытие Позиций Клиента в течение этого Торгового дня (ограничительное время закрытия позиции) устанавливается равным 16 ч. 00 мин. 00 сек. по московскому времени.

7. В целях закрытия Позиций время окончания любого Торгового дня определяется как 18 ч. 45 мин. 00 сек. текущего дня по московскому времени.

8. Сотрудник(ки), ответственный(ые) за совершение действий по закрытию Позиций Клиентов определяется(ются) приказом по Банку (далее – Ответственный сотрудник).

9. Закрытие Позиций осуществляется по алгоритмам, настроенным в специализированном терминальном модуле риск-менеджера «CoLibri» ПО QUIK, используемом Ответственным сотрудником, по которым после закрытия Позиций значения НПР1 и НПР2 принимают положительное значение (выше нуля) в зависимости от категории уровня риска Клиента и условий договора с Клиентом.

10. В случае если НПР2 принимает значение ниже 0 (Нуля) в течение Торгового дня до ограничительного времени Ответственный сотрудник осуществляет закрытие Позиций Клиентов:

10.1. в отношении Клиентов, отнесенных к категории КСУР – до достижения НПР1 положительного значения (выше нуля) (при положительном значении размера Начальной маржи);

10.2. в отношении Клиентов, отнесенных к категории КПУР – до достижения НПР2 положительного значения (выше нуля) (при положительном значении размера Минимальной маржи). Ответственный сотрудник вправе закрыть позиции Клиентов,

отнесенных к категории КПУР, до достижения НПП1 положительного значения (выше нуля);

10.3. в отношении Клиентов, отнесенных к категории КОУР – вправе осуществить закрытие позиций до достижения НПП2 минимально возможного положительного значения или иного положительного значения, определенного в договоре с Клиентом.

11. В случае если НПП2 принимает значение ниже 0 (Нуля) в течение Торгового дня до ограничительного времени одновременно у нескольких Клиентов Банка, то закрытие Позиций осуществляется Ответственным сотрудником с учетом следующей последовательности:

11.1. закрытие Позиций Клиентов, отнесенных Банком к категории клиентов со стандартным и повышенным уровнями риска;

11.2. закрытие Позиций от наименьшего значения показателя уровня достаточности денежных средств к наибольшему. Уровень достаточности денежных отражается в специализированном терминальном модуле риск-менеджера «CoLibri» ПО QUIK.

12. Существенные условия заключения сделок купли-продажи:

– вид сделки – покупка и/или продажа в зависимости от направленности открытой позиции Клиента;

– вид, категория (тип), выпуск, идентификатор, ISIN, CFI, иная информация, однозначно идентифицирующая ценную бумагу – соответствуют параметрам Инструмента, по которому у Клиента имеются открытые позиции;

– количество – количество инструментов, в результате сделки(ок) с которым НПП1 или НПП2 превысит 0 (Ноль) на любую величину;

– цена одной ценной бумаги – текущая рыночная цена на момент закрытия Позиции на Анонимных торгах, за исключением случаев заключения сделок не на Анонимных торгах, предусмотренных Приложением 20 Правил обслуживания клиентов при приеме и исполнении необеспеченных сделок к Порядку обслуживания клиентов Банка «СКС» (ООО) на финансовых рынках;

– срок закрытия позиций – в соответствии с Едиными требованиями.

13. Закрытие Позиций осуществляется на Анонимных торгах, за исключением случаев (но не ограничиваясь):

- заключение сделки на Анонимных торгах невозможно;

- в режиме Анонимных торгов отсутствуют предложения соответствующей направленности на соответствующий объем ценных бумаг;

- лот соответствующего инструмента на анонимных торгах превышает требуемое для закрытия Позиций количество.

14. При совершении действий по закрытию Позиций Клиента Ответственный сотрудник учитывает:

– стоимость ценных бумаг в Портфеле Клиента (стоимость ценных бумаг, подлежащих зачислению в Портфель Клиента);

– минимальный размер лота соответствующего инструмента на анонимных торгах в Портфеле Клиента (подлежащих зачислению в Портфель Клиента);

– ликвидность ценных бумаг в Портфеле Клиента (подлежащих зачислению в Портфель Клиента);

– срок совершения сделок, заключаемых в целях закрытия Позиций Клиента, и расчетов по таким сделкам;

– возможные расходы Клиента, связанные с заключением сделок по закрытию Позиций;

– иные обстоятельства, имеющие значение при совершении действий по закрытию Позиций.

15. Ответственные сотрудники по своему усмотрению, без согласования с Клиентом и (или) его предварительного уведомления, выбирают ценные бумаги, в том числе иностранные ценные бумаги, подлежащие отчуждению (приобретению) в целях закрытия Позиций, в том числе, среди ценных бумаг, не входящих в список Ликвидных ценных

бумаг.

16. Закрытие Позций осуществляется в сроки:

– в случае если ННР2 принимает значение ниже 0 (Нуля) в течение Торгового дня до ограничительного времени (16 ч. 00 мин. 00 сек. по московскому времени), закрытие позиций Клиента осуществляется в течение этого Торгового дня;

– в случае если ННР2 принимает значение ниже 0 (Нуля) в течение Торгового дня после ограничительного времени, закрытие позиций Клиента осуществляется не позднее ограничительного времени ближайшего Торгового дня, следующего за Торговым днем, в котором наступило это обстоятельство;

– в случае если до закрытия позиций Клиента организованные торги ценными бумагами были приостановлены и их возобновление произошло после ограничительного времени, закрытие позиций Клиента осуществляется не позднее ограничительного времени ближайшего Торгового дня, следующего за Торговым днем, в котором ННР2 принял значение ниже 0 (Нуля).

17. Не допускается закрытие Позций Клиента в случае, если до их совершения ННР2 принял положительное значение.

18. Банк имеет право вносить изменения и дополнения в настоящий Порядок закрытия позиций в одностороннем порядке, в том числе путем введения в действие новой редакции.

Порядок внесения изменений и/или дополнений аналогичен порядку, указанному в пункте 30 Порядка обслуживания клиентов МП Банка (ООО) на финансовых рынках.

19. Любые изменения и дополнения в Порядок закрытия позиций с момента вступления их в силу равно распространяются на всех Клиентов, в том числе заключивших Договор на брокерское обслуживание ранее даты вступления изменений в силу.