

**Порядок
закрытия позиций клиентов ООО «ББР БРОКЕР».**

1. Общие положения

1.1. Настоящий Порядок закрытия позиций Клиентов ООО «ББР БРОКЕР», возникающих в результате заключения сделок с Ценными бумагами, иностранной валютой или заключения договоров, являющихся производными финансовыми инструментами («Позиция по Срочным контрактам», «Срочных контрактов»), (далее – Порядок), разработан в соответствии с требованиями Указания Банка России от 12.02.2024 № 6681-У (далее – Указание).

1.2. Порядок определяет:

1.2.1. категории уровня риска Клиентов, в отношении которых применяется процедура закрытия позиций Клиента в том виде и на тех условиях, как она описана в настоящем Порядке;

1.2.2. обстоятельства и условия, при наступлении которых возникает необходимость закрытия позиции;

1.2.3. временные рамки закрытия позиции (ограничительное время закрытия позиций)

1.3. Термины, используемые в настоящем Порядке, употребляются в значениях, определенных Регламентом оказания ООО «ББР БРОКЕР» брокерских услуг.

1.4. Закрытием позиций Клиента являются меры, предпринимаемые ООО «ББР БРОКЕР», направленные на снижение размера Минимальной маржи и (или) увеличению стоимости Портфеля Клиента, в случаях, определенных Регламентом оказания ООО «ББР БРОКЕР» брокерских услуг.

1.5. Возникновение необходимости закрытия позиций ООО «ББР БРОКЕР» может интерпретироваться как сознательный отказ Клиента от самостоятельного управления рисками по своему брокерскому счету). Тем не менее, во всех случаях принудительного ответственность за любые возникающие в связи с указанными мероприятиями убытки возлагается в соответствии с заключенным между ООО «ББР БРОКЕР» и Договором, условия которого установлены в Регламенте, на Клиента.

1.6. Настоящий Порядок применяется в отношении Клиентов, отнесенных к категории КНУР, КСУР, КПУР.

2. Термины и определения

2.1. Термины, используемые в тексте настоящего Порядка, имеют следующие значения:

Минимальная маржа – величина, рассчитываемая в соответствии с требованиями Указания, а также с Порядком определения стоимости портфеля, начальной и минимальной маржи, а также прочих показателей в целях контроля обеспечения непокрытых позиций клиентов в целях контроля достаточности Активов Клиента, составляет 0,5 от значения Начальной маржи.

Начальная маржа – величина, рассчитываемая в соответствии с Указанием, а также с Порядком определения стоимости портфеля, начальной и минимальной маржи, а также прочих показателей в целях контроля обеспечения непокрытых позиций клиентов в целях контроля достаточности Активов Клиента, представляющая собой требование к минимальному объему собственных средств в Портфеле Клиента с Непокрытыми позициями и(или) Открытыми позициями по Срочным контрактам, при снижении стоимости Портфеля Клиента ниже которого запрещается образование новых или увеличение значений существующих Непокрытых позиций и(или) Открытыми позициями по Срочным контрактам.

НПР1 – норматив покрытия риска при исполнении Поручений, рассчитываемый в соответствии с требованиями Указания.

НПР2 – норматив покрытия риска при изменении стоимости Портфеля Клиента, рассчитываемый в соответствии с требованиями Указания.

Принудительное закрытие позиций – Сделка или несколько Сделок, совершаемых Брокером в целях снижения размера Минимальной маржи и(или) увеличения стоимости Портфеля Клиента, за исключением Сделок, совершенных Брокером на основании Поручения Клиента, направленного (переданного) Брокеру для совершения Сделки за счет Клиента, в котором указаны конкретные Ценные бумаги и (или) Иностранная валюта и их количество и(или) Срочный контракт, его Базовый актив и срок исполнения указанного Срочного контракта.

3. Контроль достаточности обеспечения позиций Клиента.

3.1. Мерами, обеспечивающими соблюдение Брокером, установленных Банком России требований к нормативам при совершении им Необеспеченных сделок, Срочных сделок являются:

3.1.1. Осуществление контроля за достаточностью обеспечения позиций Клиента по денежным средствам, в том числе в иностранной валюте, Ценным бумагам, Инструментам Срочного рынка осуществляется при помощи специализированного программного модуля ИТС QUIK на основе следующих показателей, расчет которых производится в соответствии с Указанием:

- 1) стоимость Портфеля Клиента;
- 2) размер Гарантийного обеспечения для Срочного рынка;
- 3) размер Начальной маржи;
- 4) размер Минимальной маржи.

3.1.2. Информирование Клиентов о состоянии показателей, указанных в п.3.1.1. настоящего Порядка. Брокер регулярно производит расчет показателей, установленных Указанием по каждой плановой позиции каждого Портфеля Клиента. Информация о стоимости Портфеля, размере Начальной и Минимальной маржи по каждому Портфелю и предоставляется Клиенту через используемый специализированный программный модуль ИТС QUIK.

3.1.3. Обязанность Клиента, имеющего Непокрытую позицию и (или) Срочный контракт ежедневно контролировать состояние своих Портфелей и Счета, уточнять текущие значения показателей Стоимости портфеля Клиента, Размера Начальной и Минимальной маржи по каждому Портфелю, Гарантийного обеспечения, производить проверку сообщений и уведомлений, направленных Брокером Клиенту, используя Личный Кабинет или специализированный программный модуль ИТС QUIK, обращаясь к Брокеру лично или по телефону.

3.2. Брокер с использованием специализированного программного модуля ИТС QUIK осуществляет автоматизированным способом контроль позиций Клиентов, отнесенных к категориям КНУР, КСУР и КПУР, в режиме реального времени с 09:50 до 23:50 каждого торгового дня.

4. Общие подходы к принудительному закрытию позиций

4.1. Под принудительным закрытием понимается ситуация, в которой Брокер, самостоятельно принимает меры по сокращению Непокрытой позиции и (или) закрытию позиций Срочных контрактов Клиента. В этом случае Брокер без Поручения Клиента совершает за счет Клиента одну или несколько Сделок для уменьшения или прекращения совокупного объема обязательств по заключенным Сделкам и (или) позиций Срочных контрактов Клиента по ранее заключенным Сделкам, Срочным контрактам Клиента в порядке, предусмотренном Регламентом оказания ООО «ББР БРОКЕР» брокерских услуг и закрепленном в настоящем Порядке.

4.2. Принудительное закрытие может осуществляться совокупно в отношении Портфеля Клиента либо в отношении позиций в отдельных финансовых инструментах.

Расчет Плановых позиций и процедура принудительного закрытия применяются в отношении каждого отдельного Портфеля Клиента.

4.2.1. Принудительное закрытие в отношении Портфеля Клиента осуществляется при наступлении следующих условий:

- снижение ниже нуля показателя НПР2 (определенный и рассчитанный в соответствии с Указанием);
- в иных случаях, предусмотренных Регламентом.

4.2.2. Брокер принудительно закрывает позиции в отношении Портфеля Клиента КНУР и КСУР, если уровень НПР1 принял отрицательное значение.

4.2.3. Брокер принудительно закрывает позиции в отношении Портфеля Клиента КПУР, если уровень НПР2 принял отрицательное значение.

4.2.4. Принудительное закрытие в отношении отдельных позиций в Портфеле Клиента осуществляется в отношении инструментов Фондового рынка по которым у Клиента имеется Непокрытая позиция, в случае если Непокрытые позиции по ним больше не допускаются в связи с изменением Брокером Перечня ликвидного имущества, сделки с которыми могут создавать Непокрытые позиции. Принудительное закрытие в отношении отдельных позиций в Портфеле Клиента осуществляется в отношении инструментов Срочного рынка в случае, указанном в п.4.2.1 настоящего Порядка.

3.3. Брокер освобождается от обязательства по принудительному закрытию, предусмотренному п.4.2.1 настоящего Порядка, в случае если уровень Минимальной маржи по счету Клиента равен нулю.

4.3. Принудительное закрытие позиций осуществляется Брокером за счет Клиента без Поручения Клиента путем совершения одной или нескольких Сделок для сокращения обязательств (закрытия позиций) Клиента в порядке, предусмотренном Регламентом.

4.4. Принудительное закрытие осуществляется в следующих объемах:

4.4.1. в случае, предусмотренном абз.1 п.4.2.1 настоящего Порядка, Принудительное закрытие подразумевает выборочное, полное или частичное, закрытие отдельных Непокрытых позиций и (или) Позиций по Срочным контрактам, открытых Клиентом, таким образом, чтобы уровень НПР1 и НПР2 (определенные и рассчитанные в соответствии с Указанием) достигли или превысили восстановительные значения, предусмотренные настоящим Порядком. Обязанность Брокера по принудительному закрытию считается исполненной и в том случае, если достижение НПР1 восстановительных значений частично произошло в результате исполнения Поручений Клиента по его Счету (Портфелю);

4.4.2. в случае, предусмотренном п.4.2.1 настоящего Порядка, принудительно в полном объеме закрывается позиция в конкретном Активе Клиента;

4.4.3. в иных случаях объем, сроки и порядок принудительного закрытия определяется Регламентом.

4.5. Восстановительные значения для целей настоящего Порядка составляют:

4.5.1. для Клиентов КНУР и КСУР – уровень НПР1, равный или превышающий нулевое значение (при положительном значении Начальной маржи);

4.5.2. для Клиентов КПУР – по усмотрению Брокера в диапазоне от уровня НПР2, равного или превышающего нулевое значение (при положительном значении размера Минимальной маржи), до уровня НПР1, равного или превышающего нулевое значение (при положительном значении размера Минимальной маржи).

4.6. В случае принудительного закрытия на основаниях, предусмотренных абз. 1 п.4.2.1 настоящего Порядка, Брокер выбирает финансовые инструменты, позиции в которых должны быть сокращены, и определяет размер такого сокращения по каждому инструменту по своему усмотрению. Сокращаться могут позиции как в Ценных бумагах и валютах, включенных Брокером в список активов, сделки с которыми могут создавать Непокрытые позиции, так и в прочих активах на счете (Портфеле) Клиента.

4.7. В случаях, перечисленных в разделе 22 Регламента, Брокер принудительно закрывает открытые позиции Клиента на Срочном рынке путем совершения встречной сделки с тем же базовым активом и сроком исполнения (офсетной сделки) и (или) путем

исполнения (экспирации) Срочного контракта. Брокер самостоятельно определяет порядок закрытия клиентских позиций, а также инструмент и объем закрываемой клиентской позиции.

4.8. Перед тем, как приступить к принудительному закрытию Брокер имеет право аннулировать все ранее принятые от Клиента Поручения. До завершения всех процедур по совершению сделок по принудительному закрытию Брокер имеет право приостановить прием новых поручений Клиента.

5. Сроки и ограничительное время принудительного закрытия

5.1. Принудительное закрытие осуществляется в следующие сроки:

5.1.1. На основаниях, предусмотренных абз. 1 п.4.2.1 настоящего Порядка - в течение торгового дня, в котором данные основания возникли. В случае, если основания для принудительного закрытия возникли после ограничительного времени, либо если с момента возникновения указанных оснований организованные торги Ценными бумагами, иностранной валютой, Срочными контрактами были приостановлены и их возобновление произошло после ограничительного времени, принудительное закрытие осуществляется не позднее ограничительного времени ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором возникли основания для принудительного закрытия.

5.1.2. Выбор срока принудительного закрытия по основаниям, не перечисленным в п.п. 5.1.1. настоящего Порядка, остается на усмотрение Брокера.

5.2. Ограничительное время принудительного закрытия для целей настоящего Порядка определяется как 16 часов 00 минут 00 секунд по московскому времени в период основной сессии торгового дня, определяемого согласно правилам торгов соответствующего организатора торговли.

6. Принудительное закрытие позиций в особых случаях

6.1. ООО «ББР БРОКЕР» вне зависимости от значения нормативов НПР1 и НПР2 имеет право осуществить Закрытие позиций в следующих случаях:

6.1.1. если Клиент не закрывает Срочные Сделки / обязательства по Непокрытой позиции на основании требования Брокера, направленного в соответствии с Регламентом оказания ООО «ББР БРОКЕР» брокерских услуг;

6.1.2. при поступлении сведений о направлении в суд заявления о признании Клиента банкротом в порядке, предусмотренном Федеральным законом «О несостоятельности (банкротстве)»;

6.1.3. в случае получения официальной информации о смерти Клиента – физического лица;

6.1.4. в случае направления Брокеру уведомления о расторжении Договора и (или) направления Брокером Клиенту уведомления о расторжении Договора;

6.1.5. иных случаях, предусмотренных Регламентом оказания ООО «ББР БРОКЕР» брокерских услуг.

6.2. Закрытие позиций в случаях, перечисленных в пункте 6.1 настоящего Порядка, осуществляется Брокером независимо от условий, определенных в иных пунктах настоящего Порядка.

7. Заключительные положения

7.1. Текст настоящего Порядка подлежит размещению на официальном Сайте Брокера в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»: www.bbrbroker.ru.

7.2. Брокер с учетом применимого законодательства в любое время в одностороннем порядке вправе вносить изменения в настоящий Порядок, в том числе утверждать его в новой редакции в одностороннем порядке. Информация о вносимых изменениях или утверждении новой редакции Порядка публикуется на официальном Сайте Брокера в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»: www.bbrbroker.ru.

7.3. Все изменения и дополнения в настоящий Порядок вступают в силу с даты опубликования новой редакции Регламента оказания ООО «ББР БРОКЕР» брокерских услуг

на официальном Сайте Брокера в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»: www.bbrbroker.ru.

7.4. Клиент в целях своевременного ознакомления с изменениями и дополнениями настоящего Порядка обязуется не реже одного раза в неделю самостоятельно или через уполномоченных лиц обращаться к Брокеру на официальный Сайт Брокера в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»: www.bbrbroker.ru а сведениями об изменениях, произведенных в Порядок.