

УТВЕРЖДЕНО
Приказом Генерального директора
ООО «АЛОР +»
№ 220930/89-2 от «30» сентября 2022 г.

ПОЛОЖЕНИЕ

О порядке закрытия позиций клиентов, отнесенных к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, в случае, если НПР2 принимает значение меньше 0, в рамках предоставления брокерского обслуживания на фондовом, валютном рынках и рынке драгоценных металлов.

Оглавление

1. Общие положения
2. Термины и сокращения
3. Порядок закрытия позиций
4. Прочие положения

1. Общие положения.

Настоящее Положение «О порядке закрытия позиций клиентов, отнесенных к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, в случае, если НПР2 принимает значение меньше 0, в рамках предоставления брокерского обслуживания на фондовом, валютном рынках и рынке драгоценных металлов» (далее по тексту — Положение), является внутренним документом ООО «АЛОР +» (далее по тексту — Брокер) и определяет порядок закрытия позиций клиентов (в случае если НПР2 принимает значение меньше 0), отнесенных к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, в рамках предоставления брокерского обслуживания на фондовом, валютном рынках и рынке драгоценных металлов.

2. Термины и сокращения.

2.1. В Положении используются следующие термины и сокращения:

2.1.1. 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.

2.1.2. Временно непокрытая позиция — непокрытая позиция по ценной бумаге или иностранной валюте, или драгоценному металлу, определяемая по обязательствам, подлежащим исполнению до какого-либо срока.

2.1.3. Закрытие позиций — меры, предпринимаемые по снижению размера минимальной маржи и (или) увеличению стоимости портфеля клиента (в случае если НПР2 принимает значение меньше 0).

2.1.4. Клиентский портфель — структурная единица группировки и хранения данных о денежных средствах, Валютных инструментах, Инструментах рынка драгоценных металлов, требованиях и обязательствах Клиента в системе внутреннего учета Брокера посредством обобщения информации обо всех операциях, связанных с движением денежных средств Клиента и/или Валютных инструментов и определения остатков денежных средств и/или Валютных инструментов, и/или Инструментов рынка драгоценных металлов, Чистых открытых позиций на Валютном рынке, рынке драгоценных металлов.

2.1.5. Минимальная маржа — значение, рассчитываемое по формуле, предусмотренной п. 15 Приложения 17 к Регламенту брокерского обслуживания ООО «АЛОР +» (далее — Регламент).

2.1.6. Начальная маржа — значение, рассчитываемое по формуле, предусмотренной п. 15 Приложения 17 к Регламенту.

2.1.7. Непокрытая позиция — плановая позиция, значение которой является отрицательным.

2.1.8. Ограничительное время закрытия позиций — 16 часов 00 минут 00 секунд каждого торгового дня, до которого снижение значения НПР2 ниже 0 влечет закрытие позиций Клиента в течение этого торгового дня.

2.1.9. Состав ликвидного субпортфеля/портфеля клиента/Клиентского портфеля — совокупность плановых позиций, рассчитываемых в соответствии с п. 3 Приложения 17 к Регламенту по ценным бумагам каждого эмитента (лица, обязанного по ценной бумаге), предоставляющим их владельцам одинаковый объем прав, а также по денежным средствам по каждому виду валют и по драгоценным металлам по каждому виду металла.

2.1.10. Стоимость ликвидного портфеля/субпортфеля Клиента/ Клиентского портфеля — значение, рассчитываемое по формуле, предусмотренной п. 2 Приложения 17 к Регламенту.

2.1.11. Субпортфель Клиента — совокупность сгруппированных в рамках портфеля Клиента по определенному признаку активов Клиента (денежных средств (в том числе иностранных валют), драгоценных металлов, ценных бумаг, в том числе ценных бумаг иностранных эмитентов), обязательств из совершенных торговых и неторговых операций с этими активами, а также задолженностей и иных платежных обязательств Клиента перед Брокером в том числе, но не ограничиваясь, в целях расчета показателей, предусмотренных Указанием Банка России от 26.11.2020 N 5636-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента» (далее — Указание). В рамках одного портфеля Клиента у Клиента может быть сгруппировано несколько субпортфелей, в том числе сгруппированных по месту совершения сделок и (или) месту расчетов. Денежные средства (в том числе иностранная валюта),

ценные бумаги иные активы и обязательства, входящие в состав одного субпортфеля Клиента, не могут одновременно входить в состав другого субпортфеля Клиента.

2.1.12. Указание № 5636-У — Указание Банка России от 26.11.2020 № 5636-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента».

2.2. Термины и сокращения, не определенные выше в Положении, используются в значениях, установленных нормативными правовыми актами Российской Федерации, в том числе Указанием № 5636-У, а также Регламентом.

3. Порядок закрытия позиций.

3.1. Условия обслуживания, предусмотренные настоящей статьей 3 Положения, распространяются на деятельность Брокера, совершающего действия, приводящие к возникновению непокрытых позиций по ценным бумагам и денежным средствам клиента, отнесенного к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, в рамках предоставления брокерского обслуживания на фондовом, валютном рынках и рынке драгоценных металлов.

3.2. Брокер рассчитывает следующие обязательные нормативы: норматив покрытия риска при исполнении поручений клиента, отнесенного к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска (далее — НПР1); норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента, отнесенного к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска (далее — НПР2).

3.3. Расчет НПР1 и НПР2 Брокер осуществляет согласно Приложению 17 к Регламенту.

3.4. Брокер обеспечивает доступ Клиента к информации о стоимости ликвидного субпортфеля клиента/Клиентского портфеля, размере начальной и размере минимальной маржи, а также значений НПР1 и НПР2 в режиме реального времени через Систему или ПО РМ клиента QUIK MP «Брокер» или ПО РМ Клиента QUIK для КПК «RocketQUIK» (в зависимости от выбранного Клиентом программного обеспечения) или с помощью мобильного приложения/посредством ALOR OpenAPI (при наличии технической возможности). Брокер вправе при наличии технической возможности предоставлять указанную в настоящем пункте информацию через иное программное обеспечение, предусмотренное настоящим Регламентом/Приложениями к нему.

3.5. Минимально допустимое числовое значение НПР2 устанавливается в размере 0.

3.6. В случае если НПР2 принимает значение меньше 0, Брокер в сроки, предусмотренные пунктом 3.8. настоящего Положения, предпринимает меры по закрытию позиций, за исключением случаев, указанных в абзацах вторым и третьем настоящего пункта.

Требования абзаца первого настоящего пункта не применяются, если значение размера минимальной маржи равно 0.

Брокер не совершает действия по закрытию позиций, если до их совершения НПР2 принял положительное значение.

3.7. К закрытию позиций не относятся действия Брокера, совершенные на основании поручения клиента, направленного (переданного) Брокеру для совершения сделки (заключения договора) за счет клиента, в котором указаны конкретные ценные бумаги и (или) иностранная валюта, и (или) драгоценные металлы и их количество.

3.8. Брокер осуществляет закрытие позиций при снижении НПР2 ниже 0 в следующие сроки.

3.8.1. В случае если НПР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня до ограничительного времени закрытия позиций (16 часов 00 минут 00 секунд), Брокер осуществляет закрытие позиций в течение этого торгового дня.

3.8.2. В случае если НПР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня 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 наступило это обстоятельство.

3.8.3. В случае если до закрытия позиций клиента организованные торги ценными бумагами (производными финансовыми инструментами и (или) иностранной валютой и (или) драгоценными металлами) были приостановлены и их возобновление произошло после ограничительного времени закрытия позиций, Брокер осуществляет закрытие позиций не позднее ограничительного времени

закрытия позиций ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором НПР2 принял значение ниже 0.

3.9. Брокер осуществляет закрытие позиций клиента при снижении НПР2 ниже 0 с соблюдением следующих требований.

3.9.1. В отношении Клиентов, отнесенных Брокером к категории клиентов со стандартным уровнем риска, Брокер осуществляет закрытие позиций, в результате которого значение НПР1 становится больше нулевого значения (при положительном значении размера начальной маржи).

3.9.2. В отношении Клиентов, отнесенных Брокером к категории Клиентов с повышенным уровнем риска, Брокер осуществляет закрытие позиций таких Клиентов в результате которого значение НПР2 становится больше нулевого значения (при положительном значении размера минимальной маржи).

3.10. При осуществлении Брокером закрытия позиции до приведения НПР1 или НПР2 в соответствие с пунктами 3.9.1. и 3.9.2. настоящего Положения допускается снижение значения НПР1 относительно своего предыдущего отрицательного значения.

3.11. Закрытие позиций при снижении НПР2 ниже 0 Брокер совершает на анонимных торгах, за исключением случая, предусмотренного пунктом 3.12 настоящего Положения.

3.12. Брокер может осуществить закрытие позиций не на анонимных торгах в случае соблюдения следующих требований.

3.12.1. Покупка ценных бумаг (за исключением облигаций) и (или) драгоценных металлов осуществляется Брокером по цене, не превышающей максимальной цены сделки с такими ценными бумагами и (или) драгоценными металлами, совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут, предшествующих принятию Брокером поручения Клиента на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, — в течение последних 15 минут до их приостановления.

3.12.2. Покупка облигаций и (или) иностранной валюты осуществляется Брокером при соблюдении следующего условия:

покупка осуществляется по цене, не превышающей максимальную цену сделки с такими облигациями (с такой иностранной валютой), совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут, предшествующих принятию Брокером поручения Клиента на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, — в течение последних 15 минут до их приостановления.

3.12.3. Покупка иностранной валюты в соответствии с пунктом 3.12.2 настоящего Положения осуществляется в отсутствие проведения анонимных торгов этой иностранной валютой либо в объеме меньшем, чем минимальный размер биржевого лота, предусмотренный правилами организованных торгов этой иностранной валютой.

3.12.4. Продажа ценных бумаг (за исключением облигаций) и (или) драгоценных металлов осуществляется Брокером по цене не ниже минимальной цены сделки с такими ценными бумагами и (или) драгоценными металлами, совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут, предшествующих принятию Брокером поручения Клиента на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, — в течение последних 15 минут до их приостановления.

3.12.5. Продажу облигаций и (или) иностранной валюты осуществляется Брокером при соблюдении следующего условия:

продажа осуществляется по цене не ниже минимальной цены сделки с такими облигациями (с такой иностранной валютой), совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут, предшествующих принятию Брокером поручения Клиента на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, — в течение последних 15 минут до их приостановления.

3.12.6. Продажа иностранной валюты в соответствии с пунктом 3.12.5 настоящего Положения осуществляется в отсутствие проведения анонимных торгов этой иностранной валютой либо в объеме меньшем, чем минимальный размер биржевого лота, предусмотренный правилами организованных торгов этой иностранной валютой.

3.12.7. При закрытии позиций не на анонимных торгах источником информации о ценах или котировках, в соответствии с которыми Брокер будет осуществлять закрытие позиций, является ПАО Московская Биржа.

3.13. Брокер оставляет за собой право самостоятельно по каким инструментам/группам инструментов (ценная бумага/иностранная валюта/драгоценный металл) производить закрытие позиций клиента.

3.14. Закрытие позиций клиента происходит преимущественно с учётом следующих особенностей:

- При закрытии позиций приоритет отдается наиболее ликвидным инструментам;
- При закрытии позиций учитывается наибольшее отрицательное влияние на значение ликвидного портфеля клиента, т.е. в первую очередь закрытие происходит в тех инструментах, по которым клиент на момент закрытия получил наибольший убыток;
- При закрытии позиций учитывается валюта задолженности, т.е. инструменты, выраженные в валюте задолженности, закрываются в приоритетном порядке.

4. Прочие положения

- 4.1. Внесение изменений и/или дополнений в настоящее Положение производится Брокером в одностороннем порядке.
- 4.2. Положение, а также изменения и дополнения к нему раскрываются Брокером на официальном сайте Брокера.
- 4.3. **Клиентам настоятельно рекомендуется ознакомиться с Декларацией о рисках**, содержащей информацию по рискам, связанным с совершением маржинальных и непокрытых сделок, раскрытой на WEB-сервере <http://www.alorbroker.ru> (Приложение 5 «Декларация о рисках» к Регламенту).