

Порядок закрытия позиций клиентов,
в отношении которых ООО ИК «Айгенис» совершает действия, приводящие к
возникновению непокрытых позиций по ценным бумагам и(или) денежным средствам,
и отнесенных ООО ИК «Айгенис» к категории клиентов со стандартным или
повышенным уровнем риска

Согласно Указанию Банка России от 26.11.2020 № 5636-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента» (далее – Указание) ООО ИК «Айгенис» (далее – Брокер) настоящим устанавливает порядок принятия мер, в том числе совершения сделок и иных операций, по снижению размера минимальной маржи, рассчитанного в соответствии с пунктом 15 приложения к Указанию (далее – Размер минимальной маржи), и(или) увеличению стоимости портфеля клиента (далее – Портфель клиента), определяемого в соответствии с Указанием, (далее – Закрытие позиций) в зависимости от категории риска клиента в случае, если норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента (далее – НПП2) принимает значение меньше 0 (далее – Порядок закрытия позиций клиента или Порядок).

1. С целью контроля рисков, возникающих при совершении маржинальных и необеспеченных сделок, Брокер осуществляет расчет показателей риска по Брокерскому счету Клиента. В качестве абсолютных показателей риска используются размер Начальной маржи и размер Минимальной маржи, рассчитываемые Брокером, а также показатели НПП1, определяемым как разность Величины обеспечения и Начальной маржи и НПП2, определенным как разность Величины обеспечения и минимальной маржи в соответствии с Указанием 5636-У. Брокер предоставляет Клиенту доступ к расчету показателей риска, а также к стоимости Портфеля и текущей Величине обеспечения через ИТС QUIK (для Клиентов, акцептовавших данный способ обмена сообщениями) или Личный кабинет Клиента (для Клиентов, акцептовавших данный способ обмена сообщениями).
2. В случае если Величина обеспечения станет ниже размера Начальной маржи, Брокер ограничивает возможность Клиента открывать новые позиции.
3. В случае если НПП1 принял значение ниже 0 (в случае снижения Величины обеспечения ниже размера Начальной маржи) Брокер информирует Клиента о снижении значения НПП1 ниже 0 и о необходимости закрытия всех (части) позиций или доведения на Брокерский счет денежных средств (ценных бумаг) в объеме, достаточном для восстановления значения НПП1 выше 0 (восстановлении Величины обеспечения до уровня, выше размера Начальной маржи). Указанная информация размещается в ИТС QUIK (для Клиентов, акцептовавших данный способ обмена сообщениями) / в Личном кабинете Клиента (для Клиентов, акцептовавших данный способ обмена сообщениями).

4. Порядок закрытия позиций клиентов, отнесенных к категории клиентов со стандартным уровнем риска (КСУР).

4.1. Если Величина обеспечения Клиентов, отнесенных Брокером к категории клиентов со стандартным уровнем риска, снизилась ниже размера Минимальной маржи в течение торгового дня до ограничительного времени закрытия позиций, Брокер в обязательном порядке до окончания торгового дня, в который наступило указанное обстоятельство, принудительно (без поручения Клиента и без предварительного уведомления) закрывает все или часть позиций Клиента для восстановления Величины обеспечения до размера не ниже Начальной маржи.

5. Порядок закрытия позиций клиентов, отнесенных к категории клиентов с повышенным уровнем риска (КПУР).

5.1. Если Величина обеспечения Клиентов, отнесенных Брокером к категории клиентов с повышенным уровнем риска, снизилась ниже размера Минимальной маржи в течение торгового дня до ограничительного времени закрытия позиций, Брокер в обязательном порядке до окончания торгового дня, в который наступило указанное обстоятельство, принудительно (без поручения Клиента и без предварительного уведомления) закрывает все или часть позиций Клиента для восстановления Величины обеспечения до размера не ниже Минимальной маржи.

6. В целях обеспечения возможности принудительного закрытия Брокер вправе снять все или часть неисполненных поручений (заявок) Клиента.

7. Стоимость портфеля Клиента в результате принудительного закрытия части или всех непокрытых позиций должна превысить размер Начальной маржи не менее чем на 10,00 (Десять рублей 00 копеек).

8. Выбор позиций Клиента, подлежащих принудительному закрытию, Брокер осуществляет по своему усмотрению, руководствуясь списком Ликвидного имущества.

9. Если Величина обеспечения снизилась ниже размера Минимальной маржи в течение торгового дня после ограничительного времени закрытия позиций, Брокер осуществляет принудительное (без поручения Клиента и без предварительного уведомления) закрытие всех или части непокрытых позиций Клиента не позднее ограничительного времени закрытия позиций клиента ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором наступило данное обстоятельство. В целях обеспечения возможности принудительного закрытия Брокер вправе снять все или часть неисполненных поручений (заявок) Клиента. Выбор позиций Клиента, подлежащих принудительному закрытию, Брокер осуществляет по своему усмотрению, руководствуясь списком Ликвидных ценных бумаг Требования настоящего пункта не применяются, если до принудительного закрытия позиций Клиента Брокером стоимость Портфеля этого Клиента превысила размер Минимальной маржи.

10. В случае отсутствия у Клиента Ликвидного имущества, которое может быть объектом сделок, направленных на закрытие позиций, в порядке, предусмотренном п.п.4, 5 настоящего Порядка, Клиент считается подавшим Брокеру поручение на совершение сделок по продаже ценных бумаг, допущенных к торгам ПАО Московская Биржа, не включенных в список Ликвидного имущества. Реализация

ценных бумаг осуществляется в количестве не меньшем, чем это необходимо для восстановления Величины обеспечения до размера не ниже Начальной маржи, а в случае недостаточности количества ценных бумаг – до достижения максимально возможной Величины обеспечения Клиента. При наличии различных ценных бумаг Брокер вправе самостоятельно определить, какие именно ценные бумаги будут реализованы. Сделки должны совершаться по рыночной цене на момент заключения сделки.

11. При закрытии позиций Клиента Брокер осуществляет либо продажу ценных бумаг, находящихся на Брокерском счете Клиента, с целью погашения за счет полученных денежных средств задолженности Клиента перед Брокером, либо покупку ценных бумаг за счет денежных средств Клиента с целью погашения задолженности Клиента перед Брокером по поставке ценных бумаг. Брокер, с целью восстановления Величины обеспечения до размера Начальной маржи, помимо закрытия позиций Клиента в ценных бумагах вправе, но не обязан по своему усмотрению закрыть открытые позиции Клиента в срочных контрактах, иностранной валюте и других финансовых инструментах.
12. Существенные условия указанных в п.п.4-5 Порядка сделок определяются Брокером в соответствии с требованиями Банка России, определенными в Указании и иных нормативных актах.

13. Сроки закрытия позиций клиентов.

- 13.1. Вне зависимости от категории риска клиента (КСУР или КПУР) Брокер осуществляет закрытие позиций клиента при снижении НПР2 ниже 0 в следующие сроки:
 - 13.1.1. В случае если НПР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня до 16:00:00 по московскому времени (ограничительное время закрытия позиций), Брокер осуществляет закрытие позиций клиента в течение этого торгового дня.
 - 13.1.2. В случае если НПР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня после 16:00:00 по московскому времени, Брокер осуществляет закрытие позиций клиента не позднее 16:00:00 по московскому времени ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором наступило это обстоятельство.
 - 13.1.3. В случае если до закрытия позиций клиента организованные торги ценными бумагами (иностранной валютой) были приостановлены и их возобновление произошло после 16:00:00 по московскому времени, Брокер должен осуществить закрытие позиций клиента не позднее 16:00:00 по московскому времени ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором НПР2 принял значение ниже 0. В целях Закрытия позиций время окончания любого торгового дня определяется как 23:59:59 по московскому времени текущего дня.