

УТВЕРЖДЕНО

Советом директоров ООО ИК «Тренд»

(Протокол № 190628/СД от 28.06.2019г.)

(вступает в силу с 01.07.2019г.)

ПОРЯДОК ЗАКРЫТИЯ ПОЗИЦИЙ КЛИЕНТОВ ООО ИК «Тренд»

Москва, 2019

1. Настоящий Порядок закрытия позиций клиентов ООО ИК «Тренд» (далее – Порядок) разработан в соответствии с требованиями действующего законодательства Российской Федерации и во исполнение Указания Банка России № 4928-У от 08 октября 2018 года «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок с ценными бумагами и заключении договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, критериях ликвидности ценных бумаг, предоставляемых в качестве обеспечения обязательств клиента перед брокером, при совершении брокером таких сделок и заключении таких договоров, а также об обязательных нормативах брокера, совершающего такие сделки и заключающего такие договоры».

2. Данный Порядок распространяется на Клиентов ООО ИК «Тренд» со стандартным или повышенным уровнем риска, заключивших с ООО ИК «Тренд» Соглашение о брокерском обслуживании.

3. Термины и определения, используемые в настоящем Порядке, понимаются и толкуются в соответствии со значением, определенном в федеральных законах Российской Федерации, нормативных актах Банка России, Регламенте брокерского обслуживания ООО ИК «Тренд» и(или) Соглашении о брокерском обслуживании либо в соответствии с обычаями или практикой их применения на финансовом рынке.

4. Расчет Стоимости портфеля Клиента, Начальной маржи, Минимальной маржи, НПП1 и НПП2 осуществляется непрерывно при помощи программного обеспечения согласно Указания № 4928-У. Информация о значениях указанных показателей предоставляется Клиентам в системах интернет-трейдинга.

5. ООО ИК «Тренд» не допускает возникновения отрицательного значения НПП1 или его снижения относительно своего предыдущего отрицательного значения за исключением следующих случаев, предусмотренных Указанием № 4928-У:

- ✓ если отрицательное значение НПП1 или его снижение относительно своего предыдущего отрицательного значения произошло не в результате совершения Брокером действий в отношении Портфеля Клиента;
- ✓ в случае положительного значения НПП1, определенного Брокером в соответствии с вышеуказанной формулой, на момент принятия Поручения Клиента, исполнение которого привело к отрицательному значению НПП1, или, если исполнение этого Поручения поставлено в зависимость от наступления предусмотренных в нем обстоятельств, - на момент наступления таких обстоятельств, исходя из плановых позиций в Портфеле Клиента, скорректированных Брокером с учетом принятых, но не исполненных к указанному моменту Поручений этого Клиента;
- ✓ в случае начисления Брокером и (или) уплаты за счет Клиента Брокеру и (или) третьим лицам в связи со сделками, заключенными Брокером за счет Клиента, сумм штрафов, пеней, процентов, неустоек, убытков, расходов и вознаграждений, в том числе по договору Брокера с Клиентом, предметом которого не является оказание брокерских услуг;
- ✓ в случае если за счет средств Клиента исполняются обязанности Клиента по уплате обязательных платежей, в том числе в связи с исполнением Брокером обязанностей налогового агента, или в связи с исполнением решения органов государственной власти;

- ✓ в случае заключения Брокером за счет Клиента договоров РЕПО;
- ✓ в случае проведения Брокером операций за счет Клиента, связанных с отчуждением (приобретением) иностранной валюты и ее обратным приобретением (отчуждением) Брокером;
- ✓ в случае удовлетворения клиринговой организацией требований, обеспеченных индивидуальным клиринговым обеспечением, в результате неисполнения или ненадлежащего исполнения Брокером обязательств из сделок, совершенных за счет клиентов;
- ✓ в случае исключения Брокером ценной бумаги и (или) иностранной валюты из перечня ликвидных ценных бумаг и иностранных валют;
- ✓ в случае изменения Брокером значений начальной ставки риска и (или) относительной ставки риска изменения цен;
- ✓ в случае принятия Брокером поручения Клиента одновременно на совершение двух или более сделок, подлежащих исполнению в один и тот же день, при том что: в соответствии с таким поручением Клиента его частичное исполнение не допускается; заключение любой из этих сделок приведет к увеличению размера начальной маржи относительно стоимости Портфеля Клиента; заключение всех сделок, указанных в Поручении, приведет к снижению размера начальной маржи относительно ее первоначального размера.

6. Брокер осуществляет закрытие позиций Клиента при снижении ННР2 ниже 0 в следующие сроки:

- ✓ в случае если ННР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня до «16:00:00» по московскому времени, Брокер осуществляет закрытие позиций Клиента в течение этого торгового дня.
- ✓ в случае если ННР2 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.

7. Закрытие позиций Клиента при снижении ННР2 ниже 0 Брокер совершает на анонимных торгах.

8. В случае если ННР1 принял значение ниже 0, Брокер направляет Клиенту уведомление о снижении значения ННР1 ниже 0 до окончания основной торговой сессии проведения организованных торгов ценными бумагами в день, в который наступило указанное обстоятельство.

9. Внесение изменений и/или дополнений в настоящее Положение производится ООО ИК "Тренд" в одностороннем порядке с учетом требований законодательства Российской Федерации.

10. Положение, а также изменения и дополнения к нему раскрываются ООО ИК "Тренд" на интернет-сайте www.ic-trend.ru в соответствии с требованиями Указания № 4928-У.