Приложение № 1

УТВЕРЖДЕНО
Приказом Генерального директора
АО «ИК «Ай Ти Инвест»
от « 18 » декабря 2023 г. № 23-18/12-8

Порядок закрытия позиций клиентов, совершающих сделки с ценными бумагами и заключающих фьючерсные договоры за счет денежных средств и (или) ценных бумаг, которые находятся в распоряжении АО «ИК «Ай Ти Инвест» в случае недостаточности денежных средств и (или) ценных бумаг для исполнения обязательств из таких сделок

Версия 3.0.

г. Москва, 2023 г.

Содержание

1. Общие положения……3
2. Термины и определения……3
3. Условия закрытия позиций клиентов……4

1. Общие положения

1.1. Настоящий «Порядок закрытия позиций клиентов, совершающих сделки с ценными бумагами и заключающих фьючерсные договоры за счет денежных средств и (или) ценных бумаг, которые находятся в распоряжении АО «ИК «Ай Ти Инвест» в случае недостаточности денежных средств и (или) ценных бумаг для исполнения обязательств из таких сделок» (далее – Порядок) определяет в АО «ИК «Ай Ти Инвест» (далее – Брокер) условия и порядок закрытия позиций клиентов, совершающих сделки с ценными бумагами и заключающих фьючерсные договоры за счет денежных средств и (или) ценных бумаг, которые находятся в распоряжении Брокера в случае недостаточности денежных средств и (или) ценных бумаг для исполнения обязательств из таких сделок

1.2. Настоящий Порядок разработан в соответствии с Указанием Банка России от 26.11.2020 г. № 5636-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента» (далее – Указание).

2. Термины и определения

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

В случае наступления обстоятельства, являющегося основанием Закрытия позиции Брокер принудительно закрывает все или часть позиций клиента посредством продажи необходимого количества ценных бумаг, иностранной валюты или посредством заключения Офсетной сделки по фьючерсным контрактам, находящимся в портфеле клиента (в случае непокрытой позиции по денежным средствам), либо посредством покупки за счет клиента ценных бумаг или иностранной валюты, (в случае непокрытой позиции по ценным бумагам и (или) иностранной валюты).

В целях обеспечения возможности принудительного Закрытия позиции Брокер вправе снять (отменить) все или часть неисполненных поручений (заявок) клиента.

При Закрытии позиций клиентов, подлежащих принудительному закрытию, Брокер самостоятельно (по своему усмотрению) определяет очередность покупки/продажи финансовых инструментов (ценных бумаг, фьючерсных контрактов) и (или) иностранной валюты, руководствуясь списком Ликвидных ценных бумаг (иностранной валюты), опубликованным на сайте Брокера.

В случае отсутствия у клиента Ликвидных ценных бумаг, которые могут быть объектом сделок, направленных на Закрытие позиций, Брокер вправе совершать сделки по продаже ценных бумаг, допущенных к организованным торгам, не включенных в список Ликвидных ценных бумаг, опубликованный на сайте Брокера. Реализация ценных бумаг осуществляется в количестве не меньшем, чем это необходимо для восстановления стоимости портфеля до размера не ниже начальной маржи, а в случае недостаточности количества ценных бумаг - до достижения максимально возможной стоимости портфеля клиента. При наличии различных ценных бумаг Брокер вправе самостоятельно определить, какие именно ценные бумаги будут реализованы. Такие сделки должны совершаться по рыночной цене на момент заключения сделки.

Ликвидные ценные бумаги – ценные бумаги, предоставляемых в качестве обеспечения обязательств клиента перед брокером, публикуемые на сайте Брокера и удовлетворяющие критериям ликвидности, установленным п. 4 Указания;

НПР1 – норматив покрытия риска при исполнении поручений клиента, отнесенного Брокером к категории клиентов со стандартным уровнем риска (КСУР) или повышенным уровнем риска (КПУР), рассчитывается по формуле:

НПР1 = S – M_0, где:

S - стоимость портфеля клиента, рассчитываемая в соответствии с п. 2 приложения к Указанию;

M_0 – размер начальной маржи (НМ), рассчитываемый в соответствии с п. 15 приложения к Указанию.

НПР2 – норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента, отнесенного брокером к категории КСУР или КПУР, рассчитывается по формуле:

НПР2 = S - Mx, где:

S – стоимость портфеля клиента, рассчитываемая в соответствии с п. 2 приложения к Указанию;

M_X – размер минимальной маржи (ММ), рассчитываемый в соответствии с п. 15 приложения к

Указанию.

Ограничительное время Закрытия позиций – 17 часов 00 минут 00 секунд по московскому времени каждого торгового дня, до которого снижение значения НПР2 ниже 0 влечет Закрытие позиций клиента в течение этого торгового дня.

Офсетная сделка – сделка, влекущая за собой прекращение прав и обязанностей по ранее открытой позиции в связи с возникновением противоположной позиции по такому же срочному контракту.

3. Условия закрытия позиций клиентов

Минимально допустимое числовое значение НПР2 устанавливается в размере 0.

Закрытие позиций не применяется, если значение размера минимальной маржи равно О.

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

К Закрытию позиций клиента 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 их количество или фьючерсный договор, его базисный актив и срок исполнения такого договора.

Брокер осуществляет Закрытие позиций клиента при снижении НПР2 ниже 0 в следующие сроки.

В случае если НПР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня до Ограничительного времени Закрытия позиций, Брокер осуществляет Закрытие позиций клиента в течение этого торгового дня.

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 клиента ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором наступило это обстоятельство.

В случае если до Закрытия позиций клиента организованные торги ценными бумагами (иностранной валютой) были приостановлены и их возобновление произошло 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 НПР2 принял значение ниже 0.

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

В отношении клиентов, отнесенных Брокером к категории клиентов со стандартным (КСУР), Брокер осуществляет Закрытие позиций до достижения НПР1 нулевого значения (при положительном значении размера начальной маржи).

В отношении клиентов, отнесенных Брокером к категории клиентов с повышенным уровнем риска (КПУР), Брокер должен осуществить Закрытие позиций таких клиентов до достижения НПР2 нулевого значения (при положительном значении размера минимальной маржи).

При осуществлении Брокером Закрытия позиции клиента допускается снижение значения НПР1 относительно своего предыдущего отрицательного значения.

Закрытие позиций клиента при снижении НПР2 ниже 0 Брокер совершает на анонимных торгах, за исключением следующего случая.

Закрытие позиций клиента не на анонимных торгах допускается только при соблюдении Брокером следующих требований.

Покупку иностранной валюты Брокер осуществляет при соблюдении одного из следующих условий:

- Покупка осуществляется по цене, не превышающей максимальную цену сделки с такой иностранной валютой, совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут, предшествующих закрытию клиентской позиции, или, если эти торги приостановлены -в течение последних 15 минут до их приостановления;
- Покупка осуществляется по цене не выше лучшей котировки на продажу иностранной валюты, опубликованной в информационной системе Блумберг (Bloomberg), более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по этой иностранной валюте, предусмотренной п. 18 приложения к Указанию.

Покупку иностранной валюты не на анонимных торгах Брокер осуществляет в отсутствие проведения анонимных торгов этой иностранной валютой либо в объеме меньшем, чем минимальный размер биржевого лота, предусмотренный правилами организованных торгов этой

иностранной валютой.

Продажу иностранной валюты Брокер осуществляет при соблюдении одного из следующих условий:

- Продажа осуществляется по цене не ниже минимальной цены сделки с такой иностранной валютой, совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут, предшествующих Закрытию позиции клиента, или, если эти торги приостановлены - в течение последних 15 минут до их приостановления;
- Продажа осуществляется по цене не ниже минимальной цены сделки с указанными облигациями и (или) иностранной валютой, совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут, предшествующих действиям Брокера, направленным на совершение сделки, или, если анонимные торги приостановлены, – в течение последних 15 минут до их приостановления;
- Продажа осуществляется по цене не ниже лучшей котировки на покупку указанных облигаций и (или) иностранной валюты, информация о которой опубликована в информационной системе Блумберг (Bloomberg), или в информационной системе Рефинитив (Refinitiv) либо предоставлена НКО АО НРД, или АО «Интерфакс», или ООО «Сбондс.ру», более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по облигации (иностранной валюте), предусмотренной пунктом 20 Приложения № 1 к Указанию.

Продажу иностранной валюты не на анонимных торгах Брокер осуществляет в отсутствие проведения анонимных торгов этой иностранной валютой либо в объеме меньшем, чем минимальный размер биржевого лота, предусмотренный правилами организованных торгов этой иностранной валютой.

Генеральный директор

В.В. Грицук

Прошито, пронумеровано и
скреплено печатью 5 листов.

ГЕНЕРАЛЬНЫЙ ДИРЕКТОР
АО «ИК «АЙ ТИ ИНВЕСТ»
ГРИЦУК В.В.