

**«УТВЕРЖДЕНО»**  
**Общим собранием участников**  
**Общества с ограниченной ответственностью**  
**Инвестиционная компания «Хамстер-Инвест»**  
**(Протокол № 2022/04/15 от «15» апреля 2022г.)**

**ПОРЯДОК**  
**работы с непокрытыми позициями клиентов**  
**ООО ИК «Хамстер-Инвест»**

## **1. Общие положения**

1.1. Настоящий Порядок работы с непокрытыми позициями клиентов ООО ИК «Хамстер-Инвест» (далее – Порядок) является внутренним документом ООО ИК «Хамстер-Инвест» (далее – Брокер) и определяет порядок работы с непокрытыми позициями клиентов на финансовых рынках в рамках Договора обслуживания на финансовых рынках (брокерского договора), заключенного Клиентом путем присоединения к Регламенту обслуживания на финансовых рынках ООО ИК «Хамстер-Инвест» (далее – Регламент), в том числе определяет порядок закрытия позиций клиентов, отнесенных Брокером к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска.

1.2. Порядок разработан на основании законодательства Российской Федерации, нормативных правовых актов Банка России в области рынка ценных бумаг, Регламента.

## **2. Термины и сокращения**

2.1. В Порядке используются следующие термины и сокращения:

**Закрытие позиций** – меры по снижению размера минимальной маржи и (или) увеличению стоимости портфеля Клиента. Размер минимальной маржи и стоимость портфеля Клиента рассчитываются по формулам, приведенным в Приложении к Указанию № 5636-У.

**Клиент** – любое юридическое или физическое лицо, заключившее с Брокером Договор обслуживания на финансовых рынках.

**Клиент с повышенным уровнем риска (КПУР)** – Клиент - физическое лицо, отнесенный Брокером к данной категории, отвечающий одному из требований, указанных в пункте 30 Указания № 5636-У или Клиент - юридическое лицо, не отнесенный Брокером к категории Клиентов с особым уровнем риска (КОУР).

**Клиент со стандартным уровнем риска (КСУР)** – любой Клиент - физическое лицо, не отнесенный Брокером к категории КПУР.

**Минимальная маржа** – показатель, рассчитываемый в соответствии с Указанием № 5636-У, при этом при снижении Стоимости Портфеля Клиента ниже минимальной маржи Брокер вправе совершить действия, направленные на снижение минимальной маржи и/или увеличение Стоимости Портфеля Клиента.

**Начальная маржа** – показатель, рассчитываемый в соответствии с Указанием № 5636-У, при этом Брокер не совершает в отношении Портфеля Клиента действий, в результате которых Стоимость Портфеля Клиента станет меньше соответствующего ему размера Начальной маржи, или в результате которых положительная разница между размером начальной маржи и Стоимостью Портфеля Клиента увеличится.

**НПР1** – норматив покрытия риска при исполнении поручений Клиента, отнесенного Брокером к категориям Клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, рассчитываемый по формуле, установленной Указанием № 5636-У. Разница между стоимостью портфеля и размером начальной маржи.

**НПР2** – норматив покрытия риска при изменении Стоимости портфеля Клиента, отнесенного Брокером к категориям Клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, рассчитываемый по формуле, установленной Указанием № 5636-У. Разница между стоимостью портфеля и размером минимальной маржи.

**Ограничительное время закрытия позиций** – определенное Брокером время каждого торгового дня, до которого снижение значения НПР2 ниже 0 влечет закрытие позиций Клиента в течение этого торгового дня.

**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 определения, не определенные настоящим Порядком, используются в значениях, установленных нормативными документами, регулирующими обращение ценных бумаг и срочных инструментов, иностранной валюты, драгоценных металлов, иными нормативными правовыми актами Российской Федерации, в том числе Указанием № 5636-У, а также Регламентом.

### **3. Основные принципы работы с непокрытыми позициями Клиентов.**

3.1. При осуществлении действий, приводящих к возникновению непокрытых позиций Клиентов, а также при закрытии позиций Клиентов Брокера работники Брокера руководствуются настоящим Положением.

3.2. В случаях, не предусмотренных настоящим Порядком, работники Брокера руководствуются иными внутренними документами Брокера, регламентирующими порядок оказания Брокером брокерских услуг Клиентам, в том числе Регламентом, Указанием № 5636-У и законодательством Российской Федерации.

3.3. Расчет НПП1 и НПП2 осуществляется Брокером при помощи программного обеспечения ИТС QUIK согласно приложению к Указанию № 5636-У.

3.4. Брокер не должен допускать возникновения отрицательного значения НПП1 или его снижения относительно своего предыдущего отрицательного значения за исключением случаев, предусмотренных Указанием № 5636-У.

3.5. В случае если НПП1 принял значение ниже 0, Брокер направляет Клиенту уведомление о снижении значения НПП1 ниже 0 по форме, предусмотренной в Приложении 1 к настоящему Порядку, способом, установленным для обмена сообщениями в Регламенте. Уведомление содержит информацию о стоимости портфеля Клиента, о размере начальной маржи и о размере минимальной маржи, а также информацию о действиях Брокера, если НПП2 будет ниже 0.

3.6. В случае если НПП2 принимает отрицательное значение, Брокер осуществляет закрытие позиций Клиентов в порядке и сроки, описанные в пункте 4 настоящего Порядка.

Требования вышеуказанного абзаца настоящего пункта не применяются, если значение размера НПП2 равно 0.

Брокер не осуществляет действия по закрытию позиций Клиента, если до их совершения НПП2 принял положительное значение.

### **4. Порядок закрытия позиций Клиентов**

4.1. Ограничительное время закрытия позиций – 12:00:00 по московскому времени каждого торгового дня. Время окончания любого торгового дня определяется как 18:45:00 текущего дня.

4.2. Брокер осуществляет закрытие позиций Клиента при снижении НПП2 ниже 0 в следующие сроки:

4.3. В случае если НПП2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня до Ограничительного времени закрытия позиций, Брокер закрывает позиции Клиента в течение этого торгового дня (время окончания любого торгового дня определяется как 18:45:00 текущего дня).

4.4. В случае если НПП2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня после Ограничительного времени закрытия позиций, Брокер закрывает позиции Клиента не позднее Ограничительного времени закрытия позиций ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором наступило это обстоятельство.

4.5. В случае если до закрытия позиций Клиента организованные торги ценными бумагами (иностранной валютой, драгоценными металлами) 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 НПП2 принял значение ниже 0.

4.6. Брокер осуществляет закрытие позиций Клиента при снижении НПП2 ниже 0 с соблюдением следующих требований:

4.6.1. В отношении Клиентов, отнесенных Брокером к категории КСУР, Брокер осуществляет закрытие позиций до достижения НПП1 нулевого значения (при положительном значении размера начальной маржи), если достижение большего значения НПП1 не предусмотрено Регламентом.

4.6.2. В отношении Клиентов, отнесенных Брокером к категории КПУР, Брокер осуществляет закрытие позиций до достижения НПП2 нулевого значения (при положительном значении размера минимальной маржи), если достижение большего значения НПП2 не предусмотрено Договором.

4.6.3. При осуществлении Брокером закрытия позиции Клиента до приведения НПП1 или НПП2 в соответствие с пунктами 4.6.1, 4.6.2 настоящего Порядка допускается снижение значения НПП1 относительно своего предыдущего отрицательного значения.

4.7. В результате совершения Брокером сделок при закрытии позиций НПП1 должен достигнуть значения больше нуля или уровня, определяемого Брокером самостоятельно при помощи программного обеспечения ИТС QUIK.

4.8. Риск возможных убытков и прочих неблагоприятных для Клиента последствий, связанных с осуществлением Брокером сделки при закрытии позиции Клиента по сделке, несет Клиент. Подавая Брокеру поручение на совершение Сделки с неполным покрытием, Клиент подтверждает свою осведомленность о наличии риска возникновения у него убытков и выражает свое согласие с данным обстоятельством.

4.9. Закрытие позиций Клиента при снижении НПП2 ниже 0 Брокер совершает на анонимных торгах, за исключением случая, предусмотренного пунктом 4.10 настоящего Порядка.

4.10. Закрытие позиций Клиента не на анонимных торгах Брокер может осуществлять при соблюдении следующих требований:

4.10.1. Покупку ценных бумаг (за исключением облигаций) и (или) драгоценных металлов Брокер осуществляет 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 действиям Брокера, направленным на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления.

4.10.2. Покупку облигаций и (или) иностранной валюты Брокер осуществляет при соблюдении одного из следующих условий:

- 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 действиям Брокера, направленным на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления;

- покупка осуществляется по цене не выше лучшей котировки на продажу таких облигаций и (или) иностранной валюты, опубликованной в информационной системе Блумберг (Bloomberg), более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по этой облигации (иностранной валюте), предусмотренной пунктом 18 Приложения к Указанию № 5636-У.

4.10.3. Покупку иностранной валюты в соответствии с абзацами вторым и третьим пункта 4.10.2 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.

4.10.4. Продажу ценных бумаг (за исключением облигаций) и (или) драгоценных металлов Брокер осуществляет 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 действиям брокера, направленным на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления.

4.10.5. Продажу облигаций и (или) иностранной валюты Брокер осуществляет при соблюдении одного из следующих условий:

- 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 действиям брокера, направленным на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления;

- продажа осуществляется по цене не ниже лучшей котировки на покупку таких облигаций и (или) иностранной валюты, опубликованной в информационной системе Блумберг (Bloomberg), более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по этой облигации (иностранной валюте), предусмотренной пунктом 18 Приложения к Указанию № 5636-У.

4.10.6. Продажу иностранной валюты в соответствии с абзацами вторым и третьим подпункта 4.10.5 настоящего Порядка 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.

4.10.7. Если источник информации о ценах или котировках, в соответствии с которыми Брокером будет осуществляться закрытие позиций клиента, является информационной системой Блумберг (Bloomberg), то применяются котировки системы Bloomberg Generic Quotes (BGN).

4.11. Брокер не осуществляет закрытие позиций Клиента, если значение размера минимальной маржи равно 0. Брокер не осуществляет действия по закрытию позиций Клиента, если до их совершения НПР2 принял положительное значение.

## **5. Прочие положения**

5.1. Внесение изменений и/или дополнений в настоящее Положение производится Брокером в одностороннем порядке с учетом требования законодательства Российской Федерации, нормативных правовых актов Банка России и Регламента.

**УВЕДОМЛЕНИЕ**  
**о снижении значения НПП1 ниже нуля**

Договор обслуживания на финансовых рынках № \_\_\_\_\_ от \_\_\_\_\_

Уважаемый клиент!

Настоящим уведомляем Вас о снижении по Вашему портфелю в ООО ИК «Хамстер-Инвест» норматива покрытия риска (НПП1) ниже нуля.

Просим Вас в срок до \_\_\_\_\_ совершить действия, направленные на увеличение стоимости Вашего портфеля путем закрытия позиций, либо внесения денежных средств на Ваш торговый счет в размере указанного ниже требования.

В случае невыполнения требования и снижения показателя НПП2 ниже нуля Брокер осуществит принудительное закрытие позиций в соответствии с Указанием Банка России от 26.11.2020 N 5636-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиентов».

**Параметры портфеля:**

Счет/субсчет:

Секция рынка:

Стоимость портфеля:

Размер начальной маржи:

Размер минимальной маржи:

Размер требования:

Дата и время направления уведомления: \_\_\_\_\_