

«УТВЕРЖДЕНО»
Общим собранием участников
Общества с ограниченной ответственностью
Инвестиционная компания «Хамстер-Инвест»
(Протокол № 2025/03/31 от «31» марта 2025г.)

ПОРЯДОК
закрытия позиций клиентов ООО ИК «Хамстер-Инвест»
на фондовом, валютном и срочных рынках
(редакция вступает в силу с «01» апреля 2025 года)

г. Москва

1. Общие положения

1.1. Настоящий «Порядок закрытия позиций клиентов ООО ИК «Хамстер-Инвест» на фондовом, валютном и срочных рынках» (далее – Порядок) является внутренним документом ООО ИК «Хамстер-Инвест» (далее – Брокер) и определяет порядок закрытия позиций клиентов, отнесенных к категории клиентов со стандартным, повышенным и особым уровнем риска в рамках предоставления ООО ИК «Хамстер-Инвест» брокерских услуг на фондовом, валютном и срочном рынках.

1.2. Порядок разработан в соответствии с требованиями Указания Банка России от 12.02.2024 № 6681-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента» (далее - Указание Банка России № 6681-У).

1.3. Настоящий Порядок распространяется на клиентов со стандартным, повышенным и особым уровнем риска, заключивших с Брокером договор обслуживания на финансовых рынках.

2. Термины и определения

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

КНУР – клиент с начальным уровнем риска

КСУР - клиент со стандартным уровнем риска

КПУР – клиент с повышенным уровнем риска

КОУР – клиент с особым уровнем риска

Начальная маржа – величина, используемая с целью управления возникающими рисками при совершении Брокером торговых операций в интересах клиента. Рассчитывается в соответствии с Указанием Банка России № 6681-У

Минимальная маржа – величина, при снижении стоимости ликвидного портфеля клиента ниже которой Брокер осуществляет принудительное закрытие позиций клиента. Рассчитывается в соответствии с Указанием Банка России № 6681-У

Непокрытая позиция - отрицательное (в абсолютном выражении) значение плановой позиции клиента

НПР1 – норматив покрытия риска при исполнении поручений клиента. Рассчитывается в соответствии с Указанием Банка России № 6681-У

НПР2 – норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента. Рассчитывается в соответствии с Указанием Банка России № 6681-У

Ограничительное время закрытия позиций (Ограничительное время) – установленное Брокером время каждого Торгового дня, до наступления которого снижение НПР2 ниже 0 влечет к принудительному закрытию позиций клиента Брокером в течение этого Торгового дня

Регламент – Регламент обслуживания на финансовых рынках ООО ИК «Хамстер-Инвест»

Стоимость ликвидного портфеля клиента - сумма рублевой оценки плановой позиции по денежным средствам клиента и рыночной стоимости плановой позиции по ценным бумагам клиента, входящих в списки ликвидных ценных бумаг и иностранных валют, рассчитанных в рублях РФ. Стоимость ликвидного портфеля клиента рассчитывается в соответствии с Указанием Банка России № 6681-У

Список ликвидных ценных бумаг - устанавливаемый для определенной категории клиентов перечень ценных бумаг, соответствующих требованиям, установленным законодательством Российской Федерации, которые Брокер учитывает при расчете Начальной и Минимальной маржи, с указанием признака, означающего, что по этой ценной бумаге может возникать непокрытая и/или необеспеченная позиция. Доступ к актуальному перечню ликвидных ценных бумаг предоставляется Брокером клиентам в порядке, предусмотренном договором о брокерском обслуживании.

Термины и определения, не определенные настоящим Порядком, используются в значениях, установленных Указанием Банка России № 6681-У и Регламентом.

3. Основные принципы работы с непокрытыми позициями

3.1. Брокер, совершающий действия, приводящие к возникновению непокрытых позиций клиента, должен соблюдать следующие нормативы:

- норматив покрытия риска при исполнении поручений клиента (НПР1);
- норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента (НПР2).

Минимально допустимое числовое значение НПР1 устанавливается в размере 0.

Минимально допустимое числовое значение НПР2 устанавливается в размере 0.

3.2. Брокер не допускает возникновения непокрытых позиций клиента, отнесенного к категории, КНУР. Клиент, отнесенный Брокером к категории КНУР, вправе совершать торговые и неторговые операций только на условиях 100% обеспечения.

3.3. Брокер не должен допускать возникновения отрицательного значения НПР1 или его снижения относительно своего предыдущего отрицательного значения за исключением случаев, предусмотренных Указанием Банка России № 6681-У.

3.4. Информирование клиентов о Стоимости ликвидного портфеля, размере Начальной маржи, размере Минимальной маржи, а также о величине показателей НПР1 и НПР2 осуществляется посредством ИТС «Quik», если иные способы оповещения не указаны в договоре о брокерском обслуживании. При недостатке средств гарантийного обеспечения значения НПР1 или НПР1 и НПР2 имеют отрицательное значение.

3.5. В случае если НПР1 принял значение ниже 0, Брокер направляет клиенту уведомление о снижении значения НПР1 ниже 0 по форме, предусмотренной приложением №1 к настоящему Порядку, способом, установленным Регламентом для обмена сообщениями. Уведомление содержит информацию о Стоимости ликвидного портфеля клиента, размере Начальной маржи, размере Минимальной маржи, значениях НПР1 и НПР2, а также информацию о действиях Брокера, если НПР2 будет примет значение ниже 0.

3.6. В случае если НПР2 принимает значение ниже 0, Брокер осуществляет принудительное закрытие позиций клиента в порядке и сроки, установленные разделом 4 настоящего Порядка.

3.7. Требования пункта 3.6. настоящего Порядка не применяются, если значение размера Минимальной маржи равно 0.

4. Порядок закрытия позиций клиентов

4.1. В соответствии с Указанием Банка России № 6681-У Брокер устанавливает 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 НПР2 ниже 0 в следующие сроки:

4.2.1. В случае если НПР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня до Ограничительного времени закрытия позиций, Брокер осуществляет принудительное закрытие позиции клиента в течение указанного торгового дня.

4.2.2. В случае если НПР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня после Ограничительного времени закрытия позиций, Брокер осуществляет принудительное закрытие позиции клиента не позднее Ограничительного времени закрытия позиций ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором НПР2 принял значение ниже 0.

4.2.3. В случае если до закрытия позиций клиента организованные торги ценными бумагами и (или) производными финансовыми инструментами, и (или) 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 НПП2 принял значение меньше 0.

4.3. Брокер осуществляет закрытие позиций клиентов категории КСУР и КПУР при снижении НПП2 ниже 0 с соблюдением следующих требований:

4.3.1. В отношении клиентов, отнесенных Брокером к категории КСУР, Брокер осуществляет закрытие позиций указанных клиентов до достижения НПП1 нулевого значения (при положительном значении размера Начальной маржи), если достижение большего значения НПП1 не предусмотрено договором брокерского обслуживания.

4.3.2. В отношении клиентов, отнесенных Брокером к категории КПУР, Брокер осуществляет закрытие позиций указанных клиентов до достижения НПП2 нулевого значения (при положительном значении размера минимальной маржи), если достижение большего значения НПП2 не предусмотрено договором брокерского обслуживания.

4.3.3. Если в ликвидном портфеле клиента присутствует более одного инструмента на момент осуществления закрытия позиций, выбор инструмента (ов) для закрытия позиции клиента осуществляется на усмотрение Брокера.

4.3.4. При осуществлении Брокером закрытия позиции клиента до приведения НПП1 или НПП2 в соответствие с требованиями подпунктов 4.3.1, 4.3.2 настоящего Порядка, допускается снижение значения НПП1 относительно своего предыдущего отрицательного значения.

4.4. В отношении клиентов, отнесенных Брокером к категории КОУР, Брокер осуществляет закрытие позиций указанных клиентов при снижении значения НПП2 ниже 0 до уровня, указанного в соглашении, подписанном с клиентом.

4.4.1. Если в ликвидном портфеле клиента присутствует более одного инструмента на момент осуществления закрытия позиций, выбор инструмента (ов) для закрытия позиции клиента осуществляется на усмотрение Брокера.

4.4.2. Брокер имеет право осуществить закрытие позиций клиента до достижения НПП2 минимально возможного положительного значения или иного значения, определенного в соглашении с клиентом.

4.5. Брокер не допускает действий по закрытию позиций клиента, если до их совершения НПП2 принял положительное значение, за исключением случаев, когда иное предусмотрено договором о брокерском обслуживании.

4.6. Закрытие позиций клиента при снижении НПП2 ниже 0 не на торгах на основе безадресных заявок допускается только в следующих случаях:

4.6.1. Покупка ценных бумаг (за исключением облигаций) и (или) драгоценных металлов осуществляется по цене, не превышающей максимальной цены сделки с такими ценными бумагами и (или) драгоценными металлами, совершенной на торгах на основе безадресных заявок, в течение последних 15 минут, предшествующих действиям Брокера, направленным на совершение сделки, или, если эти торги на основе безадресных заявок приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления.

4.6.2. Покупка облигаций и (или) иностранной валюты осуществляется при соблюдении одного из следующих условий:

- покупка осуществляется по цене, не превышающей максимальную цену сделки с такими облигациями и (или) иностранной валютой, совершенной на торгах на основе безадресных заявок в течение последних 15 минут, предшествующих действиям Брокера, направленным на совершение сделки, или, если эти торги на основе безадресных заявок 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, информация о которой опубликованна в информационной системе Блумберг

(Bloomberg) или в информационной системе «Рефинитив» (Refinitiv) либо представлена небанковской кредитной организацией акционерным обществом «Национальный расчетный депозитарий» (далее - НКО АО НРД), или акционерным обществом «Интерфакс» (далее - АО «Интерфакс»), или обществом с ограниченной ответственностью «Сбондс.ру», более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по облигации (иностранной валюте), предусмотренной пунктами 39-42 приложения к Указанию Банка России № 6681-У.

4.6.3. Покупка иностранной валюты в соответствии с абзацами вторым и третьим пункта 4.6.2 настоящего Порядка осуществляется в отсутствие проведения торгов на основе безадресных заявок указанной иностранной валютой либо в объеме меньшем, чем минимальный размер биржевого лота, предусмотренный правилами организованных торгов указанной иностранной валютой.

4.6.4. Продажа ценных бумаг (за исключением облигаций) и (или) драгоценных металлов осуществляется по цене не ниже минимальной цены сделки с указанными ценными бумагами и (или) драгоценными металлами, совершенной на торгах на основе безадресных заявок в течение последних 15 минут, предшествующих действиям Брокера, направленным на совершение сделки, или, если торги на основе безадресных заявок приостановлены, - в течение последних 15 минут до их приостановления.

4.6.5. Продажа облигаций и (или) иностранной валюты осуществляется при соблюдении одного из следующих требований:

- продажа осуществляется по цене не ниже минимальной цены сделки с указанными облигациями и (или) иностранной валютой, совершенной на торгах на основе безадресных заявок в течение последних 15 минут, предшествующих действиям Брокера, направленным на совершение сделки, или, если торги на основе безадресных заявок 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 представлена НКО АО НРД, или АО «Интерфакс», или «Сбондс.ру», более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по облигации (иностранной валюте), предусмотренной пунктами 39-42 приложения к Указанию Банка России № 6681-У.

4.6.6. Продажа иностранной валюты в соответствии с абзацами вторым и третьим подпункта 4.6.5 настоящего Порядка осуществляется в отсутствие проведения торгов на основе безадресных заявок указанной иностранной валютой либо в объеме меньшем, чем минимальный размер биржевого лота, предусмотренный правилами организованных торгов указанной иностранной валютой.

4.6.7. Закрытие позиций клиента в соответствии с подпунктами 4.6.1-4.6.6 настоящего Порядка осуществляется Брокером в соответствии с ценами (котировками) ценных бумаг и (или) иностранных валют, источник информации о ценах (котировках) которых определен в договоре о брокерском обслуживании, и, если таким источником является информационная система Блумберг (Bloomberg), информационная система Рефинитив (Refinitiv), НКО АО НРД, АО "Интерфакс" или ООО "Сбондс.ру", в договоре о брокерском обслуживании также должно быть указано условное обозначение котировок, применяемое для их идентификации в этой информационной системе.

4.6.8. Закрытие позиций клиентов на срочном рынке осуществляется на торгах на основе безадресных заявок по текущим рыночным ценам, при этом Брокер по своему усмотрению определяет позиции клиента, подлежащие закрытию. Все возможные убытки при этом несет клиент.

5. Заключительные положения

5.1. Внесение изменений и/или дополнений в настоящее Положение осуществляется Брокером в одностороннем порядке с учетом требования законодательства Российской Федерации.

5.2. Брокер раскрывает настоящее Положение, а также изменения и дополнения к нему на сайте Брокера с указанием даты его размещения и даты вступления в силу.

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 № 6681-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента».

Параметры портфеля:

Код портфеля:

Секция рынка:

Стоимость портфеля:

Размер начальной маржи:

Размер минимальной маржи:

Размер требования:

Дата и время направления уведомления: _____