



**УТВЕРЖДЕН**

приказом АО «БКС Банк»

от 10.10.2019 г. № 1510

Действует с 16.10.2019

**ПОРЯДОК  
ЗАКРЫТИЯ ПОЗИЦИЙ КЛИЕНТОВ  
АКЦИОНЕРНОГО ОБЩЕСТВА «БКС Банк»**

г. Москва

1. Настоящий Порядок закрытия позиций клиентов Акционерного общества «БКС Банк» (далее – Порядок) разработан в соответствии с требованиями Указания Банка России от 08.10.2018 г. № 4928-У «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» (далее – Требования) и определяет порядок действий Акционерного общества «БКС Банк» (далее – АО «БКС Банк», Брокер) по снижению размера минимальной маржи, рассчитанного в соответствии с Требованиями и Регламентом оказания брокерских услуг Акционерного общества «БКС Банк» (далее - Регламент), и (или) увеличению стоимости соответствующего портфеля клиента (далее – закрытие позиций Клиента).

АО «БКС Банк» размещает настоящий Порядок в открытом доступе на официальном интернет-сайте Брокера в информационно-телекоммуникационной сети Интернет по адресу <https://bcs-bank.com/> с целью обеспечения ознакомления неограниченного круга лиц с настоящим Порядком. Положения настоящего Порядка подлежат применению с учетом условий Договора об оказании брокерских услуг, заключенного Клиентом с АО «БКС Банк», в том числе Регламента оказания брокерских услуг Акционерного общества «БКС Банк» и приложений к нему.

2. 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.

3. Настоящий Порядок не распространяется на совершение действий по закрытию позиций Клиента по фьючерсным и опционным контрактам, совершаемых Брокером в соответствии с Соглашением о порядке обслуживания на срочном рынке клиентов Акционерного общества «БКС Банк» (Приложение № 3 к Регламенту).

4. Термины и сокращения, используемые в настоящем Порядке, употребляются в значениях, определенных в Регламенте, Требованиями, иными нормативно-правовыми актами Российской Федерации.

5. Принятие Брокером мер по закрытию позиций в портфеле Клиента осуществляется в порядке и на условиях, предусмотренных Регламентом, с учетом категории клиентов, к которой отнесен Клиент, в отношении которого совершаются указанные действия.

6. Брокер определяет в качестве ограничительного времени, до которого снижение значения НПР2 ниже 0 (нуля) влечет закрытие позиций Клиента в течение текущего торгового дня следующее время: 16 часов 00 минут 00 секунд (московское время).

В целях настоящего пункта Порядка под текущим торговым днем понимается промежуток времени с 08 часов 00 минут 00 секунд по 23 часа 59 минут 59 секунд (московское время) дня, в который проводятся организованные торги хотя бы в одной торговой системе (хотя бы на одной площадке), где зарезервированы денежные средства и/или ценные бумаги, входящие в состав соответствующего портфеля Клиента, и/или в которой по поручению и за счет Клиента заключены сделки, права требования и обязательства из которых включены в состав соответствующего портфеля Клиента.

7. Сотрудник (сотрудники), ответственный(-ые) за совершение действий по закрытию позиций клиентов Брокера, определяется(-ются) приказом (далее – Ответственные сотрудники).

8. В случае снижения значения показателя НПР2 ниже 0 (нуля) одновременно в течение торгового дня / в течение короткого промежутка времени текущего торгового дня до наступления ограничительного времени у нескольких клиентов Брокера, Ответственные сотрудники принимают меры по закрытию позиций таких Клиентов последовательно с учетом следующих критериев:

- в первую очередь совершаются действия по закрытию позиций Клиентов, отнесенных Брокером к категории клиентов со стандартным и повышенным уровнями риска;
- закрытие позиций от наименьшего значения показателя УДС к наибольшему, отражаемого в используемом Ответственными сотрудниками для целей принятия мер по закрытию позиций

терминальном модуле риск-менеджера «CoLibri FM»/«CoLibri FX»/«CoLibri SM» ПО системы QUIK. Показатель УДС рассчитывается в следующем порядке:

$$\text{УДС} = \frac{\text{НПР2}}{M_x}, \text{ где}$$

**НПР2,  $M_x$**  – показатели, рассчитываемые Брокером в соответствии с Требованиями.

Выписка(-и) файлов серверной части системы QUIK, подписанная (-ые) уполномоченным лицом АО «БКС Банк», является(-ются) пригодным и достаточным для предъявления при разрешении конфликтных ситуаций и/или споров в досудебном порядке и/или суде, третейском суде, государственных и муниципальных органах, организациях доказательством принятия показателя УДС соответствующего значения в конкретный момент времени.

9. При совершении действий по закрытию позиций Клиента Ответственные сотрудники учитывают:

- цены финансовых инструментов в портфеле Клиента/финансовых инструментов, подлежащих зачислению в портфель Клиента;
- минимальный размер биржевого лота финансовых инструментов в портфеле Клиента/финансовых инструментов, подлежащих зачислению в портфель Клиента;
- ликвидность финансовых инструментов в портфеле Клиента/финансовых инструментов, подлежащих зачислению в портфель Клиента;
- сроки совершения сделок, заключаемых в целях закрытия позиций Клиента, и проведения расчетов ним;
- возможные расходы Клиента, связанные с заключением сделок по закрытию позиций;
- иные обстоятельства, имеющие значение при совершении действий по закрытию позиций.

10. Ответственные сотрудники по своему усмотрению, без согласования с Клиентом и/или его предварительного уведомления, выбирают ценные бумаги, иностранную валюту, подлежащие отчуждению/приобретению в целях закрытия позиций или переноса позиций, в том числе, среди ценных бумаг и иностранных валют, не входящих в Перечень ликвидных ценных бумаг и иностранных валют.

11. Внесение изменений и дополнений в настоящий Порядок, производится Брокером в одностороннем порядке. Все изменения и дополнения к настоящему Порядку утверждаются приказом.

12. Все изменения и дополнения в настоящий Порядок вступают в силу с даты опубликования на официальном сайте АО «БКС Банк» в информационно-телекоммуникационной сети Интернет по адресу <https://bcs-bank.com/> в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» новой редакции настоящего Порядка.

13. Клиент в целях своевременного ознакомления с изменениями и дополнениями настоящего Порядка обязуется не реже одного раза в неделю самостоятельно или через уполномоченных лиц обращаться к Брокеру (на официальный сайт АО «БКС Банк») за сведениями об изменениях, произведенных в Порядок.