



**Акционерное Общество
«Инвестиционная компания
«РИКОМ-ТРАСТ»
(АО «ИК «РИКОМ-ТРАСТ»)**

ПОЛОЖЕНИЕ

10.07.2019 № 14

Москва

УТВЕРЖДАЮ

Президент АО ИК «РИКОМ-ТРАСТ»



И.А. Першин

10.07.2019

О порядке закрытия позиций

В соответствии с п. 18 [Указания Банка России от 08.10.2018 N 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"](#) настоящее Положение устанавливает порядок закрытия позиций клиентов, отнесенных к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска.

1. Настоящее Положение определяет порядок действий брокера (АО «ИК «РИКОМ-ТРАСТ»), в случае, когда у клиента значение минимального уровня маржи оказывается ниже нуля.

2. Минимально допустимое числовое значение норматива покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента, отнесенного брокером к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска (далее - НПР2) устанавливается в размере 0.

3. В случае, если НПР2 принимает значение меньше 0, брокер в сроки, предусмотренные настоящим Положением, должен предпринять меры по снижению размера минимальной маржи и (или) увеличению стоимости портфеля клиента (далее - закрытие позиций), за исключением, если значение размера минимальной маржи равно 0 или если до совершения действий по закрытию позиций НПР2 принял положительное значение.

4. Под закрытием позиций клиента понимается:

- уменьшение открытых позиций клиента без поручения клиента до положительного значения начальной маржи для клиентов со стандартным уровнем риска;

- уменьшение открытых позиций клиента без поручения клиента до положительного значения минимальной маржи для клиентов с повышенным уровнем риска.

5. 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.

6. Ограничительное время закрытия позиций устанавливается 16:00:00 московского времени.

7. Брокер должен осуществлять 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 должен осуществить 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 должен осуществить 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 должен осуществить закрытие позиций клиента не позднее ограничительного времени закрытия позиций ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором НПР2 принял значение ниже 0.

8. Брокер должен осуществить закрытие позиций клиента при снижении НПР2 ниже 0 с соблюдением следующих требований:

- в отношении клиентов, отнесенных брокером к категории клиентов со стандартным уровнем риска, брокер должен осуществить закрытие позиций до достижения НПР1 нулевого значения (при положительном значении размера начальной маржи), если достижение большего значения НПР1 не предусмотрено договором о брокерском обслуживании;

- в отношении клиентов, отнесенных брокером к категории клиентов с повышенным уровнем риска, брокер должен осуществить закрытие позиций таких клиентов до достижения НПР2 нулевого значения (при положительном значении размера минимальной маржи), если достижение большего значения НПР2 не предусмотрено договором о брокерском обслуживании.

9. При осуществлении брокером закрытия позиции клиента до приведения НПР2 выше нулевого значения (при положительном значении размера минимальной маржи) допускается снижение значения НПР1 относительно своего предыдущего отрицательного значения.

10. Закрытие позиций клиента при снижении НПР2 ниже 0 брокер должен совершать на анонимных торгах. Закрытие позиций клиента не на анонимных

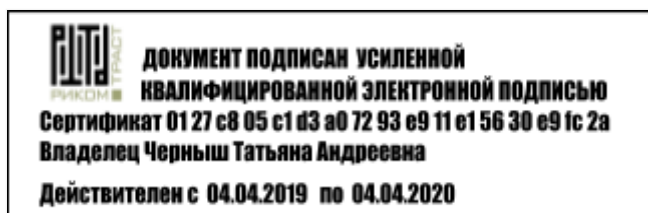
торгах допускается только в случае соблюдения брокером требований п. 23 [Указания Банка России от 08.10.2018 N 4928-У](#).

11. При закрытии позиций клиента брокер руководствуется следующими приоритетами:

- позиции по инструментам сокращаются последовательно, начиная с инструментов с наименьшей ставкой риска;
- закрытие позиций осуществляется по сложившимся на момент закрытия рыночным ценам.

12. Брокер обязан разместить настоящее Положение на своем официальном сайте в сети "Интернет" по адресу www.ricom.ru.

Вице-президент



Т.А. Черныш