

Утверждено
приказом Генерального директора
КИТ Финанс (АО)
№48 от «23» сентября 2024г.

Положение о порядке закрытия позиций клиентов при совершении сделок с ценными бумагами, иностранной валютой и фьючерсными контрактами в КИТ Финанс (АО)

1. Общие положения.

1.1. Настоящее Положение определяет порядок закрытия (сокращения) позиций клиентов КИТ Финанс (АО) (далее - Компания) по портфелям, в состав которых входят обязательства из сделок с ценными бумагами и задолженность клиента по маржинальным сделкам, при:

- совершении сделок с ценными бумагами за счет денежных средств (в том числе в иностранной валюте) и (или) ценных бумаг клиента, которые в соответствии с договором о брокерском обслуживании находятся в распоряжении (или должны поступить в распоряжение) Компании, в случае недостаточности денежных средств и (или) ценных бумаг клиента для исполнения обязательств из таких сделок;
- заключении фьючерсных договоров, а также своп-договоров, базисным активом которых является валюта

1.2. Настоящий документ разработан в соответствии с положениями Указания Центрального Банка Российской Федерации № 5636-У от 26.11.2020 г.

1.3. Ответственность за соблюдение данного Положения несет Управление брокерских операций Компании.

2. Порядок утверждения Положения и внесения в него изменений.

2.1. Настоящее Положение утверждается приказом Генерального директора Компании.

2.2. Настоящее Положение может быть дополнено и изменено приказом Генерального директора Компании.

2.3. Если в результате изменения законодательства Российской Федерации отдельные статьи настоящего Положения вступают с ним в противоречие, Положение применяется в части, не противоречащей действующему законодательству.

3. Порядок закрытия позиций клиента.

3.1. При принудительном сокращении клиентских позиций Компания руководствуется Указанием Банка России от 26.11.2020 г. № 5636-У, а также Регламентом оказания брокерских услуг Компании.

3.2. Данное Положение закрытия позиций клиентов относится к Фондовому рынку, а также к Валютному и Срочному рынку при использовании Единой Денежной позиции (ЕДП). Порядок и правила закрытия позиций отдельно на Фондовом, Срочном и Валютном рынке определяются Регламентом Компании.

3.3. При совершении действий, приводящих к возникновению непокрытых позиций по ценным бумагам и денежным средствам клиента со стандартным или повышенным уровнем риска (СУР и ПУР), устанавливаются следующие нормативы:

- норматив покрытия риска при исполнении поручений клиента (далее - **НПР1**), рассчитываемый как разность между стоимостью портфеля клиента и величиной начальной маржи.

- норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента (далее – **НПР2**), рассчитываемый как разность между стоимостью портфеля клиента и величиной минимальной маржи.

3.4. Компания осуществляет закрытие позиций при снижении показателя НПР2 ниже 0. Закрытие позиций осуществляется таким образом, чтобы показатель НПР1 достиг нулевого значения (при положительном значении размера начальной маржи).

Данное правило распространяется на категории клиентов с повышенным уровнем риска (ПУР) и категории клиентов со стандартным уровнем риска (СУР). При закрытии позиций клиентов с ПУР, значение НПР2 может достигать значений больше нуля.

3.5 Компания по своему усмотрению выбирает ценные бумаги, производные финансовые инструменты, иностранную валюту, подлежащую покупке/продаже в целях закрытия позиций.

3. 6. Принудительное сокращение позиций осуществляется в следующие сроки. Если показатель НПР2 принял значение ниже 0 в течение торгового дня до Ограничительного времени, то в течение этого торгового дня. Если показатель НПР2 принял значение ниже 0 в течение торгового дня после Ограничительного времени, то закрытие позиций осуществляется не позднее Ограничительного времени ближайшего торгового дня.

3.7. Компания устанавливает 16:00 по Московскому времени как Ограничительное время закрытия позиций.