

Правила обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок

1. Общие положения

1.1. Настоящее Приложение 20 Правила обслуживания клиентов при приеме и исполнении необеспеченных сделок к Порядку обслуживания клиентов Банка «СКС» (ООО) на финансовых рынках устанавливает общие правила и условия предоставления Банком услуг на рынке ценных бумаг (далее – Правила обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок), связанных с исполнением сделок и операций Клиентов, приводящих к возникновению необеспеченных сделок.

1.2. Банк предоставляет право Клиентам совершать необеспеченные сделки, если в тексте Заявления о заключении договоров (по форме Приложения 1, 1а к Порядку обслуживания клиентов Банка «СКС» (ООО) на финансовых рынках) содержится указание Клиента о возможности подачи Поручений на Необеспеченные сделки.

1.3. Условия, зафиксированные настоящими Правилами обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок, применяются в отношении ценных бумаг российских и иностранных эмитентов, выпущенные в Российской Федерации, так и за пределами Российской Федерации квалифицированными в качестве ценных бумаг, в том числе: на организованном рынке ценных бумаг, а также на неорганизованных торгах (на внебиржевом рынке), действующих на территории Российской Федерации и/или иностранных государств.

Условия, зафиксированные настоящими Правилами обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок, не распространяются на взаимоотношения Банка «СКС» (ООО) и Клиента:

- при совершении сделок купли-продажи иностранной валюты в рамках Договора на брокерское обслуживание;
- при совершении сделок в рамках Договора на ведение индивидуального инвестиционного счёта.

1.4. Дополнительным соглашением к Порядку обслуживания клиентов Банка «СКС» (ООО) на финансовых рынках Банк «СКС» (ООО) и Клиент (далее совместно именуемые – Стороны) вправе установить особенности совершения необеспеченных сделок, в том числе, но, не ограничиваясь, особенности резервирования денежных средств и ценных бумаг для исполнения необеспеченных сделок, а также особенности заключения Банком «СКС» (ООО) сделок переноса позиций и сделок закрытия позиций Клиента. В таком случае условия настоящих Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок применяются к правоотношениям Банка «СКС» (ООО) и Клиента в той части и объеме, если иное не предусмотрено указанным дополнительным соглашением.

1.5. При заключении и исполнении необеспеченных сделок Стороны руководствуются Правилами ТС, правилами клиринга, законодательством Российской Федерации и иным применимым правом, а также настоящими Правилами обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок и условиями Порядка обслуживания клиентов Банка «СКС» (ООО) на финансовых рынках.

1.6. Присоединяясь к Порядку обслуживания клиентов Банка «СКС» (ООО) на финансовых рынках, Клиент тем самым подтверждает факт ознакомления с действующими Правилами обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок, Порядком закрытия позиций, а также с нормативными правовыми актами Российской Федерации.

В случае если, Клиент в соответствии с условиями настоящих Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок действует за счет третьих лиц, Клиент тем самым подтверждает, что ознакомил указанных третьих лиц в полном объеме с Правилами обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок, с информацией о рисках клиентов, в том числе о рисках которые связаны с совершением необеспеченных сделок (совершением сделок, приводящих к непокрытой позиции), а также с Порядком закрытия позиций. Декларация о рисках, Порядок закрытия позиций опубликованы на официальной странице Банка в сети Интернет по адресу www.skssbank.ru (далее – Сайт Банка):

- Декларация о рисках (Приложение 4 к Порядку обслуживания клиентов Банка «СКС» (ООО) на финансовых рынках);
- Порядок закрытия позиций (Приложение 21 к Порядку обслуживания клиентов Банка «СКС» (ООО) на финансовых рынках).

1.7. Клиент, действующий в качестве брокера за счет третьего лица (третьих лиц), настоящим подтверждает, что Клиент самостоятельно несет ответственность за соблюдение Единых требований и

условий договора с третьим лицом, за счет которого Клиент действует по Договору на брокерское обслуживание, в том числе в отношении соблюдения Клиентом условий и порядка расчета показателей, предусмотренных Едиными требованиями, в отношении соблюдения Клиентом условий и порядка отнесения указанного третьего лица к соответствующей категории клиентов, предусмотренной Едиными требованиями.

Банк не несет ответственности, в том числе, перед Клиентом, указанным третьим лицом, если соответствующие действия/бездействия Банка в отношении Клиента, повлекли нарушение Клиентом Единых требований и/или условий договора с третьим лицом, за счет которого действует Клиент по Договору на брокерское обслуживание убытки и/или иные негативные последствия для Клиента и/или третьего лица, за счет которого действует Клиент по Договору на брокерское обслуживание.

1.8. Клиент настоящим подтверждает, что ознакомлен в полном объеме с информацией о рисках клиентов, в том числе о рисках которые связаны с совершением необеспеченных сделок (совершением сделок, приводящих к непокрытой позиции). Декларация о рисках опубликована на официальной странице Банка в сети Интернет по адресу www.sksbank.ru и является Приложением 4 к Порядку обслуживания клиентов Банка «СКС» (ООО) на финансовых рынках. Все риски, связанные с совершением необеспеченных сделок (возникновением непокрытых позиций) несет исключительно Клиент.

1.9. Клиент обязуется самостоятельно или через уполномоченных лиц отслеживать внесение изменений в Правила обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок, Порядком закрытия позиций, а также нормативные правовые акты Российской Федерации и незамедлительно сообщать указанные изменения третьим лицам, за счет которых действует Клиент, а также соблюдать указанные Правила обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок с учетом внесенных изменений, обеспечить соблюдение третьими лицами, за счет которых действует Клиент, Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок с учетом всех таких изменений.

Порядок внесения изменений и/или дополнений в Правила обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок, Порядком закрытия позиций аналогичен порядку, указанному в пункте 30 Порядка обслуживания клиентов Банка «СКС» (ООО) на финансовых рынках.

Любые изменения и дополнения в Правила обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок с момента вступления их в силу равно распространяются на всех Клиентов, в том числе заключивших Договор на брокерское обслуживание ранее даты вступления изменений в силу.

2. Термины и определения

Анонимные торги - организованные торги, сделки в которых совершаются на основе заявок на покупку и заявок на продажу ценных бумаг по наилучшим из указанных в них ценам при том, что заявки адресованы всем участникам торгов и информация, позволяющая идентифицировать подавших заявки участников торгов, не раскрывается в ходе торгов другим участникам.

Единые требования - Указание Банка России от 08.10.2018 № 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».

Законодательство – федеральные законы и иные нормативные правовые акты Российской Федерации, в том числе Банка России.

Закрытие позиций – действия Банк по снижению размера минимальной маржи и (или) увеличению стоимости портфеля клиента, за исключением действий Банка, совершенных на основании поручения (требования) Клиента, направленного (переданного) Банку для совершения сделки, в котором явно указаны ценные бумаги и их количество.

КПУР – Клиент, отнесенный Банком в категорию Клиентов с повышенным уровнем риска.

Ликвидные ценные бумаги – перечень Ценных бумаг, стоимость которых учитывается при расчёте показателей Норматива покрытия риска при исполнении поручений клиента (НПР1) и Норматива покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента (НПР2). Список Ликвидных ценных бумаг устанавливается Банком самостоятельно, но при учете требований Законодательства (в т.ч. Едиными требованиями). Текущий список Ликвидных ценных бумаг, публикуется на Сайте Банка. Банк оставляет за собой право дополнительно использовать другие каналы связи с Клиентом при его информировании о текущем списке Ликвидных ценных бумаг, в том числе об его изменении, путем

направления уведомления клиенту по электронной почте, указанной в Заявлении о заключении договоров, через программное обеспечение QUIK, Личный кабинет инвестора и/или любым иным способом обмена Сообщениями, предусмотренным Порядком. Текущий список Ликвидных ценных бумаг может быть представлен в виде составной части списка Ценных бумаг для совершения Необеспеченных сделок.

Банк вправе определить отдельный список Ликвидных ценных бумаг для отдельной категории клиентов, предусмотренной п.7.2 настоящих Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок, и/или отдельной группы клиентов. Банк вправе определить отдельный список Ликвидных ценных бумаг для отдельного клиента. В указанном случае Банк предоставляет доступ к текущему списку Ликвидных ценных бумаг для соответствующего Клиента путем направления Клиенту такого списка по электронной почте по адресу, указанному Клиентом в Заявлении о заключении договоров, а также любым иным способом, которым могут направляться Сообщения в соответствии с Порядком, если иное не следует из текста дополнительного соглашения с Клиентом.

Изменения в список Ликвидных ценных бумаг доводятся Банком до сведения Клиентов путем размещения соответствующих изменений и (или) новых редакций списка на Сайте Банка. Такие изменения вступают в силу на следующий за днем их размещения на Сайте Банка рабочий день, если иное не установлено Банком.

Начальная маржа, Минимальная маржа – расчетные показатели, определяемые по формулам и в порядке, установленном Едиными требованиями, которые отражают совокупную максимальную и минимальную оценку стоимости Портфеля Клиента с учетом риска уменьшения цены (курса) входящих в Портфель Клиента ценных бумаг и денежных средств.

Необеспеченная сделка – сделка купли-продажи ценных бумаг (за исключением сделки купли-продажи Валютных инструментов), заключаемая Банком по поручению Клиента в рамках Договора, результатом заключения и/или исполнения которой является возникновение или увеличение в абсолютном выражении Непокрытой позиции. Заключение Необеспеченных сделок регулируется настоящими Правилами обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок.

Непокрытая позиция – отрицательное значение любой Плановой позиции (в денежных средствах или в любых Ценных бумагах).

НПР1 - норматив покрытия риска при исполнении поручений Клиента, рассчитываемый по формуле и в порядке, установленном Едиными требованиями. При снижении НПР1 ниже нуля совершение Клиентом Необеспеченных сделок ограничивается Банком. Показатель применяется к Клиентам, отнесенным Банком к Клиентам со стандартным или повышенным уровнем риска.

НПР2 - норматив покрытия риска при изменении стоимости Портфеля Клиента, рассчитываемый по формуле и в порядке, установленном Едиными требованиями. При снижении НПР2 ниже нуля Банк совершает действия по снижению размера Минимальной маржи, и/или увеличению стоимости Портфеля клиента. Показатель применяется к Клиентам, отнесенным Банком к Клиентам со стандартным или повышенным уровнем риска.

Перечень иностранных бирж - перечень иностранных бирж, предусмотренный пунктом 4 статьи 51.1 Федерального закона от 22.04.1996 г. № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг».

Плановая позиция – позиция Клиента, уменьшенная на величину Активных (принятых, но пока не исполненных Банком) поручений на сделки и/или уменьшенная/увеличенная на величину исполненных поручений на сделки, в т.ч. Сделки РЕПО, срок расчетов по которым пока не наступил, а также включая принятые, но неисполненные Неторговые поручения на операции с денежными средствами или ценными бумагами. Плановая позиция определяется в отношении каждой ценной бумаги. Плановая позиция по ценным бумагам определяется в разрезе эмитентов, видов, типов ценных бумаг.

Значение Плановой позиции определяется в порядке, установленном в соответствии с законодательством Российской Федерации (в том числе Едиными требованиями).

Портфель Клиента – совокупность Активов Клиента, учитываемых на Лицевом (брокерского) счета Клиента и счете/разделах торгового счета депо Клиента, прав требований и обязательств из сделок, заключенных за счет Клиента на определенном финансовом рынке (рынке ценных бумаг; валютном рынке), а также задолженность Клиента перед Банком по Договору на брокерское обслуживание. Стоимость Портфеля Клиента определяется в рублях как сумма Плановых позиций Клиента по денежным средствам и по Ценным бумагам, определенных в порядке, установленном Едиными требованиями. Портфель Клиента группируется и ведется отдельно по каждому Договору на брокерское обслуживание в разрезе рынка ценных бумаг.

Права и обязанности по всем сделкам Клиента на рынке ценных бумаг, а также по Специальным сделкам РЕПО, равно как и все Активы Клиента, используемые для осуществления

расчетов по таким сделкам, включаются в состав отдельного Портфеля Клиента (далее – Портфель «Фондовый рынок»), в состав Портфеля Клиента «Фондовый рынок» включаются:

- денежные средства Клиента, учитываемые на Лицевом (брокерского) счете Клиента в валюте Российской Федерации и иностранной валюте, предназначенные для расчетов по сделкам в торговой системе ПАО Московская Биржа (Фондовый рынок ПАО Московская Биржа), в том числе, но, не ограничиваясь, сделок купли-продажи иностранных ценных бумаг в торговой системе ПАО Московская Биржа (Фондовый рынок ПАО Московская Биржа) с расчетами в иностранной валюте;

- денежные средства Клиента, учитываемые на Лицевом (брокерского) счете Клиента в валюте Российской Федерации и иностранной валюте, предназначенные для расчетов по внебиржевым сделкам с ценными бумагами;

- Ценные бумаги Клиента, учитываемые на счете/разделе торгового счета депо, в том числе ценные бумаги, зарезервированные для совершения сделок в торговой системе ПАО Московская Биржа (Фондовый рынок ПАО Московская Биржа) включая иностранные ценные бумаги, а также иностранные ценные бумаги и иностранные финансовые инструменты, квалифицированные в качестве ценных бумаг в соответствии с нормативными правовыми актами Российской Федерации, ценные бумаги, предназначенные для совершения внебиржевых сделок;

- любые права требования и обязательства (как в деньгах, так и в Ценных бумагах) по сделкам, заключенным на основании Поручений Клиента на рынке ценных бумаг (как по сделкам купли-продажи, так и по Сделкам РЕПО);

- любые права требования и обязательства (как в деньгах, так и в Ценных бумагах) по Специальным сделкам РЕПО, независимо от места заключения этих сделок;

- задолженность Клиента перед Банком по уплате вознаграждения за оказание услуг по заключенному между Банком и Клиентом Договору на брокерское обслуживание и Депозитарному договору, и по возмещению понесенных Банком при исполнении поручений Клиента необходимых расходов, а также за заключение Специальных сделок РЕПО;

- иная задолженность Клиента перед Банком, возникающая в связи с оказанием услуг по заключенному между Банком и Клиентом Договору на брокерское обслуживание и Депозитарному договору.

В составе Портфеля Клиента «Фондовый рынок» не включаются и не учитываются:

- денежные средства и/или ценные бумаги, заблокированные на Лицевом (брокерском) счете, счете депо Клиента (третьего лица, за счет которого действует Клиент) либо операции с которым приостановлены, ограничены иным образом, в том числе в связи с решением, постановлением государственного, муниципального органа, их должностных лиц, суда, Банка России;

- денежные средства, включая иностранную валюту, предназначенные для совершения сделок с Валютными инструментами согласно Правилам обслуживания Клиента на валютном рынке, предусмотренным Приложением 17 к Порядку, включая любые права требования и обязательства по сделкам, заключенным на основании Поручений Клиента на валютном рынке по передаче денежных средств, включая иностранную валюту, по указанным сделкам;

- задолженность Клиента перед Банком по уплате вознаграждения за оказание услуг по заключению сделок с Валютными инструментами в торговой системе Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС» (Валютный рынок ПАО Московская Биржа), и по возмещению понесенных Банком при исполнении поручений Клиента необходимых расходов.

Постоянное поручение (длящееся Поручение) – Поручение Клиента, предусматривающее возможность неоднократного его исполнения при наступлении условий, предусмотренных Договором на брокерское обслуживание.

Рыночная цена - цена Ценной бумаги, равная цене последней сделки купли-продажи по указанной Ценной бумаге, зафиксированной на момент проведения оценки в ТС, определенной на усмотрение Банка. В целях совершения Необеспеченных сделок на фондовом рынке Рыночная цена Ценных бумаг при ее определении после или в момент завершения расчетов в ТС принимается равной цене последней сделки купли-продажи такого же вида (типа) Ценных бумаг, зафиксированной по окончании Торговой сессии в ТС Фондовый рынок ПАО Московская Биржа.

Специальная Сделка РЕПО – Сделка РЕПО, заключаемая Банком в интересах и за счет Клиента и направленная на перенос времени исполнения обязательств по Непокрытой позиции.

Ставка по Специальной Сделке РЕПО - процентная ставка на дату заключения Специальной Сделки РЕПО, определяемая распоряжением уполномоченного лица Банка и публикуемая на Сайте Банка по адресу www.sksbank.ru. Банк вправе установить индивидуальную процентную ставку на дату заключения Специальной Сделки РЕПО, путем подписания соответствующего соглашения, заключенного между Банком и Клиентом без последующей публикации такой ставки на Сайте Банка.

Требование о закрытии позиции – требование о погашении всех или части обязательств Клиента, возникших в связи с возникновением у Клиента Непокрытой позиции, путем внесения Клиентом денежных средств или Ценных бумаг либо путем заключения сделок с Ценными бумагами, направляемое Банком Клиенту в случаях, установленных настоящими Правилами обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок.

Урегулирование сделки - процедура исполнения обязательств сторонами по заключенной сделке, которая включает в себя прием и поставку Ценных бумаг, оплату приобретенных Ценных бумаг, прием оплаты за проданные Ценные бумаги, оплату расходов по тарифам Банка и тарифам третьих лиц, участие которых необходимо и/или допустимо по условиям Договора на брокерское обслуживание для заключения и урегулирования сделки, иные процедуры, необходимые для исполнения обязательств.

Ценные бумаги для совершения Необеспеченных сделок – ценные бумаги, в отношении которых возможно возникновение и/или увеличение Непокрытой позиции. Список Ценных бумаг для совершения Необеспеченных сделок устанавливается Банком самостоятельно в соответствии с требованиями Законодательства (Единых требований), и публикуется на Сайте Банка. Банк оставляет за собой право дополнительно использовать другие каналы связи с Клиентом при его информировании о текущем списке Ценных бумаг для совершения Необеспеченных сделок, в том числе об его изменении, путем направления уведомления клиенту по электронной почте, указанной в Заявлении о заключении договоров, через программное обеспечение QUIK, Личный кабинет инвестора и/или любым иным способом обмена Сообщениями, предусмотренные Порядком и при наличии технической возможности. Изменения в список Ценных бумаг для совершения Необеспеченных сделок доводятся Банком до сведения Клиентов путем размещения соответствующих изменений и (или) новых редакций списка на Сайте Банка. Такие изменения вступают в силу на следующий за днем их размещения на Сайте Банка рабочий день, если иное не установлено Банком. Изменение величины ранее установленной ставки риска не является изменением состава Ценных бумаг для совершения Необеспеченных сделок и применяется Банком с момента утверждения уполномоченным органом новой ставки риска, если иное не установлено Банком.

3. Порядок приема и исполнения поручений на Необеспеченные сделки

3.1. Любое поданное Клиентом Поручение на совершение сделки, исполнение которого влечет за собой возникновение Непокрытой позиции, рассматривается Банком как Поручение на совершение Необеспеченной сделки.

До подачи любого Поручения на совершение сделки Клиент должен осуществить контроль соответствия размера соответствующего Актива Плановой позиции Клиента по своему Портфелю «Фондовый рынок» с целью исключения возможности ошибочного направления Банку Поручения, которое будет интерпретировано и исполнено Банком как Поручение на Необеспеченную сделку в соответствии с Правилами обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок.

3.2. Клиент вправе совершать сделки, приводящие к появлению (увеличению) Непокрытой позиции (Необеспеченные сделки) путем подачи поручения на совершение сделки в соответствии с условиями Порядка в случае, если в Заявлении о заключении договоров Клиентом указана возможность заключения Необеспеченных сделок с ценными бумагами.

3.3. Исполнение Поручений Клиента, влекущих за собой возникновение или увеличение в абсолютном выражении Непокрытой позиции по Ценной бумаге, допускается только в случае, если указанная Ценная бумага включена в список Ценных бумаг для совершения Необеспеченных сделок. Перечень Ценных бумаг для совершения Необеспеченных сделок устанавливается Банком самостоятельно и предоставляется Клиенту для ознакомления на Сайте Банка, а также любым иным способом, которым могут направляться Сообщения в соответствии с Порядком.

Банк вправе определить также отдельный список Ценных бумаг для совершения Необеспеченных сделок для отдельной категории клиентов, предусмотренной п.7.2 настоящих Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок, и/или отдельной группы клиентов.

Банк вправе определить отдельный список Ценных бумаг для совершения Необеспеченных сделок для отдельного клиента. В указанном случае Банк предоставляет доступ к текущему списку Ценных бумаг для совершения Необеспеченных сделок для соответствующего Клиента путем направления Клиенту такого списка по электронной почте по адресу, указанному Клиентом в Заявлении о заключении договоров, а также любым иным способом, которым могут направляться Сообщения в соответствии с Порядком, если иное не следует из текста дополнительного соглашения с Клиентом.

3.4. При совершении сделки за счет Клиента на Анонимных торгах Банка не допускается возникновение или увеличение Непокрытой позиции, возникновение или увеличение временно непокрытой позиции по ценной бумаге, если цена этой сделки:

- на 5 (пять) или более процентов ниже цены закрытия соответствующих ценных бумаг, определенной организатором торговли за предыдущий торговый день в соответствии с Положением Банка России от 17 октября 2014 года № 437-П «О деятельности по проведению организованных торгов» (далее - Положением Банка России от 17 октября 2014 года № 437-П), и
- ниже последней текущей цены, рассчитанной организатором торговли в соответствии с Положением Банка России от 17 октября 2014 года № 437-П, о которой Банк знал или должен был знать на момент подачи им организатору торговли заявки (поручения) на ее совершение; и
- ниже цены последней сделки, вошедшей в расчет указанной текущей цены.

Требования настоящего пункта не распространяются на сделки, обязательства по которым допущены к клирингу с участием центрального контрагента, в отношении которого Банком России принято решение о признании качества управления центральным контрагентом удовлетворительным.

3.5. Непокрытая позиция и (или) временно непокрытая позиция может возникнуть у Клиента в случае подачи им Неторгового поручения о выводе денежных средств или Ценных бумаг из Портфеля «Фондовый рынок». Банк имеет право принять и исполнить такое Неторговое поручение в случае, если соблюдены все требования настоящих Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок.

Временно непокрытая позиция – Непокрытая позиция, определяемая до истечения срока исполнения любого обязательства при положительном Значении Плановой позиции.

3.6. Банк оставляет за собой исключительное право самостоятельно принимать решение о приеме, отклонении или частичном исполнении Поручения Клиента или Неторгового поручения, если объем такого Поручения превышает соответствующую Плановую Позицию Клиента. Банк оставляет за собой право не исполнять принятое Поручение (Неторговое поручение) в той ее части, исполнение которой приведет к возникновению или увеличению Непокрытой позиции, даже при условии, что данное Поручение (Неторговое поручение) не нарушает требований настоящих Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок. Клиент соглашается с тем, что Банк имеет право частично исполнить любое Поручение клиента, исполнение которого может привести к возникновению Непокрытой позиции.

3.7. Непокрытая позиция по денежным средствам или по одной из Ценных бумаг может возникнуть у Клиента не только путем исполнения Банком Поручений на заключение Необеспеченных сделок или Неторговых поручений, но также в следующих случаях:

- в случае если за счет средств Клиента исполняются обязанности по уплате обязательных платежей, в том числе в связи с исполнением Банком обязанностей налогового агента, решения органов государственной власти;
- в случае начисления и (или) уплаты за счет Клиента Банку и (или) третьим лицам в связи со сделками, заключенными Банком за счет Клиента, сумм штрафов, пеней, процентов, неустоек, убытков, расходов и вознаграждений, в том числе по договору Банка с Клиентом, предметом которого не является оказание брокерских услуг;
- в иных случаях, установленных Законодательством (в т.ч. Едиными требованиями).

Возникновение Непокрытых позиций на основании вышеуказанных обстоятельств возможно в отношении любых Клиентов Банка. Взаимоотношения с такими Клиентами осуществляется в порядке, предусмотренном настоящими Правилами обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок.

3.8. Подавая поручение на заключение Необеспеченной сделки, Клиент понимает, что его убытки по такой сделке теоретически могут быть неограниченными и даже превысить стоимость Активов Клиента.

4. Порядок заключения Специальных Сделок РЕПО

4.1. Стороны договорились о совершении Банком за счет Клиента Сделок РЕПО в соответствии с условиями Постоянного поручения, содержащимися в настоящем пункте. Любой Клиент, подавший Поручение на заключение Необеспеченной сделки, считается подавшим поручение на заключение Специальной Сделки РЕПО (далее – Постоянное поручение).

4.2. Постоянное поручение считается поданным для его исполнения Банком в случае возникновения у Клиента любой Непокрытой позиции, то есть в случае возникновения любого обязательства, которое должно быть исполнено за счет Активов Клиента в Портфеле «Фондовый рынок», но для исполнения, которого недостаточно Активов в этом Портфеле Клиента (в том числе

Активов, которые должны быть получены к моменту исполнения этого обязательства по уже заключенным, но еще неисполненным сделкам) (далее – Обязательство по Непокрытой позиции).

4.3. Постоянное поручение действует в течение всего срока действия договорных отношений Сторон в рамках настоящих Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок либо до даты внесения изменений, связанных с отказом Клиента от совершения Необеспеченных сделок в рамках Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок.

4.4. Клиент, подав указанным способом Постоянное поручение, уполномочивает Банк совершить за счет Клиента Сделку РЕПО, в результате расчетов по Первой части которой будут зарезервированы денежные средства/ценные бумаги, необходимые для исполнения Обязательства по Непокрытой позиции Клиента.

4.5. Настоящим Клиент дает Поручение Банку заключить в интересах Клиента одну или несколько Специальных Сделок РЕПО по переносу обязательств Клиента на следующих условиях:

4.5.1. Банк имеет право заключить Специальную Сделку РЕПО только после того, как до дня исполнения Обязательства по Непокрытой позиции останется меньше 2 (Двух) Торговых дней. При этом Банк имеет возможность заключить Специальную Сделку РЕПО как за 1 (Один) Торговый день до даты исполнения Обязательства по Непокрытой позиции, так и в день исполнения этого Обязательства.

4.5.2. Предметом Первой части Специальной Сделки РЕПО является покупка или продажа Ценных бумаг, направленная на погашение Обязательств по Непокрытой позиции, имеющих к моменту заключения Специальной сделки РЕПО.

4.5.3. При Непокрытой позиции по денежным средствам предметом Специальной Сделки РЕПО являются Ценные бумаги, находящиеся на Торговом счете депо Клиента, в том числе, среди Ценных бумаг, не входящих в перечень Ликвидных ценных бумаг.

При заключении Специальной Сделки РЕПО Ценные бумаги, в том числе иностранные ценные бумаги, являющиеся предметом Сделки, определяются Банком самостоятельно.

Наименование эмитента – соответствует эмитентам свободных Ценных бумаг, учитываемых на Торговом счете депо Клиента или являющихся предметом права требования по ранее заключенным в интересах Клиента сделкам, срок исполнения обязательств по которым текущий Торговый день.

Вид, категория (тип), выпуск, транш, серия, иная информация – соответствует виду, категории (типу), выпуску, траншу, серии, иной информации любых ценных бумаг, находящихся на Торговом счете депо Клиента или являющихся предметом права требования по ранее заключенным в интересах Клиента сделкам, срок исполнения обязательств по которым текущий Торговый день.

Количество Ценных бумаг – соответствует количеству свободных Ценных бумаг (только целые части свободных ценных бумаг), учитываемых на Торговом счете депо Клиента или являющихся предметом права требования по ранее заключенным в интересах Клиента сделкам, срок исполнения обязательств по которым текущий Торговый день, но не более необходимого для исполнения обязательств.

4.5.4. При Непокрытой позиции по Ценным бумагам предметом Специальных Сделок РЕПО являются Ценные бумаги, по которым у Клиента имеется Непокрытая позиция по Ценным бумагам. Количество Ценных бумаг в Специальной Сделке РЕПО соответствует величине Непокрытой позиции по Ценным бумагам.

Наименование эмитента - соответствует эмитенту Ценной бумаги, в отношении которой у Клиента есть обязательства по поставке и для исполнения которых у Клиента полностью или частично недостаточно Ценных бумаг, находящихся в распоряжении Брокера (или которые поступят в распоряжение Брокера не позднее текущего Торгового дня).

Вид, категория (тип), выпуск, транш, серия, иная информация – соответствует виду, категории (типу), выпуску, траншу, серии, иной информации Ценных бумаг, в отношении которых у Клиента есть обязательства по поставке и для исполнения которых у Клиента полностью или частично недостаточно ценных бумаг, находящихся на Торговом счете депо Клиента или которые поступят на Торговый счет депо Клиента не позднее текущего Торгового дня.

Количество Ценных бумаг – соответствует количеству Ценных бумаг, необходимому для исполнения обязательств по поставке (для погашения Непокрытой позиции по Ценным бумагам).

4.5.5. Срок Специальной Сделки РЕПО равен количеству календарных дней до начала следующего Торгового дня.

4.5.6. Расчеты по Первой части Специальной Сделки РЕПО производятся в день, когда должно быть исполнено соответствующее Обязательство по Непокрытой позиции.

4.5.7. Расчеты по Второй части Специальной Сделки РЕПО производятся на следующий Торговый день после исполнения обязательств по первой части Специальной Сделки РЕПО.

4.5.8. Первая часть Специальной Сделки РЕПО исполняется по рыночной цене Ценной бумаги,

выступающей предметом такой сделки, определенной на момент ее заключения.

4.5.9. Специальные Сделки РЕПО, Первой частью которых является покупка Ценных бумаг, заключаются таким образом, что сумма Второй части определяется как сумма Первой части, уменьшенная на Ставку Специальной Сделки РЕПО из расчета срока указанной сделки. Информация о действующей Ставке Специальной Сделки РЕПО размещается на Сайте Банка. Банк вправе заключить Специальную Сделку РЕПО на более выгодных для Клиента условиях.

4.5.10. Специальные Сделки РЕПО, Первой частью которых является продажа Ценных бумаг, заключаются таким образом, что сумма Второй части определяется как сумма Первой части, увеличенная на Ставку Специальной Сделки РЕПО из расчета срока указанной сделки. Информация о действующей Ставке Специальной Сделки РЕПО размещается на Сайте Банка. Банк вправе заключить Специальную Сделку РЕПО на более выгодных для Клиента условиях.

4.5.11. Специальные Сделки РЕПО могут заключаться Банком, как на организованном рынке, так и на Внебиржевом рынке на усмотрение Банка. Банк заключает Специальные Сделки РЕПО только при наличии предложений со стороны третьих лиц, в том числе с третьими лицами, являющимися аффилированными по отношению к Банку.

Банк вправе выступать в качестве обеих сторон по Специальной Сделке РЕПО в случае, если в наличии у Банка будет встречное поручение от другого Клиента на заключение такой сделки.

4.6. Урегулирование Специальных Сделок РЕПО, заключенных на Внебиржевом рынке, производится Банком за счет денежных средств, зачисленных на Лицевой (брокерский) счет и зарезервированных для совершения сделок на ТС Фондовый рынок ПАО Московская Биржа и/или предназначенных для расчетов на Внебиржевом рынке, и Ценных бумаг, учитываемых на соответствующем разделе Торгового счета депо, предназначенном для расчетов.

Денежные средства и Ценные бумаги, поступившие Клиенту по Специальной Сделке РЕПО, соответственно резервируются на Лицевом (брокерском) счете для совершения сделок на ТС Фондовый рынок ПАО Московская Биржа и/или предназначенных для расчетов на Внебиржевом рынке и зачисляются на соответствующий раздел Торгового счета депо, предназначенный для расчетов.

4.7. Банк имеет право не совершать Специальную Сделку РЕПО либо не совершать Специальную Сделку РЕПО в отношении определенных Ценных бумаг, если до 15 часов 00 минут московского времени дня исполнения Обязательства по Непокрытой позиции будет направлено Клиенту уведомление об отказе от заключения Специальных Сделок РЕПО любым способом, которым могут направляться Сообщения. Указанное уведомление одновременно является Требованием о закрытии позиции (полным либо частичным) Банка к Клиенту, которое должно быть исполнено Клиентом до 16 часов 00 минут московского времени соответствующего Торгового дня или в иной срок, указанный в нем.

4.8. В случае если у Клиента есть Обязательство по Непокрытой позиции (в Ценных бумагах), которое должно быть исполнено в дату:

- составления списка лиц, имеющих право на участие в общем собрании акционеров или имеющих право на получение доходов по этим Ценным бумагам (далее для целей п. 4 настоящих Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок – «Список»), если это Рабочий день

- предшествующий составлению Списка, если день, на который составляется Список, не является Рабочим днем

то Банк в этот день не совершает Специальную Сделку РЕПО, предметом которой является приобретение по первой части Специальной Сделки РЕПО таких Ценных бумаг.

В этом случае Клиент обязан до 16 часов 00 минут московского времени соответствующего дня исполнить свои обязательства по Непокрытой позиции (в Ценных бумагах), то есть внести Ценные бумаги на соответствующий раздел Торгового счета депо либо подать поручения на заключение Сделок по покупке Ценных бумаг.

4.9. В случае если первая часть Специальной Сделки РЕПО, предметом которой является продажа Ценных бумаг по первой части сделки РЕПО, должна быть исполнена в дату составления Списка по этим Ценным бумагам (если это Рабочий день) либо в дату, предшествующий составлению Списка (если день, на который составляется Список, не является Рабочим днем), то Банк вправе заключить такую Специальную Сделку РЕПО на следующих условиях:

- все расчеты по первой части Специальной Сделки РЕПО осуществляются в дату Т;

- расчеты по поставке Ценных бумаг по второй части Специальной Сделки РЕПО осуществляются в дату исполнения обязательств по первой части Специальной сделки РЕПО - в день Т;

- расчеты по оплате денежных средств по второй части Специальной Сделки РЕПО

осуществляются не позднее начала следующего Торгового дня;

- Ставка Специальной Сделки РЕПО рассчитывается за количество календарных дней, прошедших с момента исполнения первой части Специальной Сделки РЕПО до момента исполнения обязательства по оплате денежных средств по Второй части Специальной Сделки РЕПО.

Клиент самостоятельно отслеживает факт раскрытия эмитентом Ценных бумаг информации о корпоративных действиях, в том числе о составлении Списка.

Банк не несет ответственности за убытки Клиента, возникшие в результате заключения Банком Специальной Сделки РЕПО, в результате которой Ценная бумага, являвшаяся предметом сделки, отсутствовала на Торговом счете депо Клиента на дату составления Списка, в том числе для целей ее приобретения эмитентом Ценных бумаг.

4.10. В случаях формирования списка лиц, имеющих право на получение от эмитента денежных средств, а также иного имущества, в том числе Доходов по ценным бумагам, переданных по первой части Специальной Сделки РЕПО или в иных случаях, установленных законодательством Российской Федерации, в период после исполнения обязательств по передаче Ценных бумаг по первой части Специальной Сделки РЕПО и до исполнения обязательств по передаче Ценных бумаг по второй части Специальной Сделки РЕПО порядок действия Клиента определен в п.п. 21.1.14, 21.1.19- 21.1.21 Порядка.

4.11. Неисполнение Клиентом обязательства по резервированию денежных средств или Ценных бумаг для целей исполнения условия «Маржин колл» (п. 21.1.4 Порядка) или для целей исполнения второй части Сделки РЕПО (п. 21.1.9 Порядка) рассматривается в качестве основания для заключения Специальных Сделок РЕПО в соответствии с настоящим пунктом Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок.

5. Контроль за размером Портфеля Клиента и его соответствия Начальной и Минимальной марже

5.1. Банк в течение Торгового дня осуществляет постоянный расчет стоимости Портфеля «Фондовый рынок», а также значений нормативов НПП1, НПП2, размера Начальной маржи и Минимальной маржи.

5.2. Расчет стоимости Портфеля «Фондовый рынок», а также значений нормативов НПП1, НПП2, размера Начальной маржи и Минимальной маржи осуществляется в соответствии с приложением к Единым требованиям с учетом значений и показателей, определяемых организатором торговли, Клиринговой организацией и Правилами ТС и следующими положениями:

- показатель $Q_{i,broker}^L$ (пункт 7 приложения к Единым требованиям), используемый для расчета размера Плановых позиций и Портфеля Клиента, включает в себя задолженность Клиента перед Банком по выплате вознаграждения и возмещению всех расходов, связанных с осуществлением Банком операций на рынке ценных бумаг;

- при определении показателя $P_{i,j}$ (пункт 13 приложения к Единым требованиям) используется информация о цене торгуемой i -й ценной бумаги по последнему заключенному договору (далее - цена последней сделки), предоставляемой предусмотренным договором о брокерское обслуживание организатором торговли участникам торгов в соответствии с Положением Банка России от 17 октября 2014 года № 437-П.

Цена $P_{i,j}$ по облигации определяется с учетом накопленного процентного (купонного) дохода.

Банк самостоятельно осуществляет выбор российского организатора торговли или иностранного организатора торговли (иностранной биржи), информация которого используется для определения цены i -ой ценной бумаги.

Для целей закрытия позиций Клиента приоритетным источником информации о ценах ценных бумаг является ПАО Московская Биржа, если иная информация не доведена до сведения Клиента.

Если источником информации о ценах или котировках, в соответствии с которыми Банк будет осуществлять Закрытие позиций Клиента, является информационная система Блумберг (Bloomberg), то настоящим Клиент предоставляет Банку право использовать в целях определения цены i -ой ценной бумаги полученную Банком информацию о ценах или котировках из информационной системы Блумберг (Bloomberg) любые по выбору Банка котировки «BGN» («BGN Bid»; «BGN Ask»; «Last Trade»).

Настоящим Клиент заявляет и подтверждает, что в случае возникновения споров выписка из перечня информации, полученной Банком через информационную систему «Блумберг» (Bloomberg), подписанная уполномоченным представителем Банка, является надлежащим доказательством

соответствующей котировки по данным информационной системы «Блумберг» (Bloomberg) на соответствующую дату в соответствии с Едиными требованиями.

- S_n - n -е множество с зависимыми ценами не используется для расчета показателей Начальной маржи и Минимальной маржи;

- значения начальных и минимальных ставок риска по ценным бумагам (D_{ij}^+ , D_{ij}^- , D_{nj}^+ , D_{nj}^-), используемые для расчета показателей размера Начальной маржи и Минимальной маржи, определяются Банком самостоятельно в отношении различных категорий Клиентов, могут изменяться им в любое время, но при этом не могут быть ниже ставок, определяемых в соответствии с требованиями пунктов 17-19 приложения к Единым требованиям. Для расчета показателей размера Начальной маржи и Минимальной маржи используется значения ставок риска применяемых и рассчитанных Клиринговой организацией. Если в отношении i -ой ценной бумаги применяется или рассчитана более чем одна ставка Клиринговой организации, в том числе в связи с тем, что такие ставки применяются или рассчитаны несколькими Клиринговыми организациями, Банк самостоятельно определяет используемую им ставку. При определении ставок Клиринговой организации приоритет имеют ставки риска, раскрытие НКЦ в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» по адресу: <https://www.nationalclearingcentre.ru>, если иная информация не доведена до сведения Клиента.

Банк вправе использовать для каждого отдельного Клиента установленные Банком значения начальных ставок риска.

Значения начальных и минимальных ставок риска по ценным бумагам предоставляются Клиенту для ознакомления на Сайте Банка. При наличии технической возможности Банк предоставляет доступ Клиенту к такой информации посредством Личного кабинета инвестора, программного обеспечения QUIK, а также любым иным способом, которым могут направляться Сообщения в соответствии с Порядком.

5.3. Клиент, имеющий Непокрытую позицию, обязан в течение Торгового дня проверять/контролировать стоимость своего Портфеля «Фондовый рынок», а также значения Начальной маржи и Минимальной маржи для оперативного реагирования на изменение этих показателей.

5.4. В случае если НПП1 принял значение ниже 0 (Нуля), Банк направляет Клиенту уведомление о снижении значения НПП1 ниже 0 (Нуля) по электронной почте по адресу, указанному Клиентом в Заявлении о заключении договоров, в течение одного часа с момента осуществления указанного расчета. Такое уведомление содержит информацию о стоимости портфеля Клиента, о размере начальной маржи и о размере минимальной маржи на момент возникновения основания для направления уведомления, а также информацию о действиях Банка, если значение НПП2 будет ниже 0 (Нуля).

При наличии технической возможности Банк информирует Клиента каждый час времени проведения организованных торгов не менее одного раза о текущей стоимости портфеля Клиента, размере начальной и размере минимальной маржи, посредством программного обеспечения QUIK, а также предоставляет доступ к такой информации через Личный кабинет инвестора.

В случае повторного и (или) последующего в течение торгового дня принятия НПП1 значения ниже 0 (Нуля) Банк вправе не направлять уведомление (последующее уведомление) об этом Клиенту.

5.5. Банк не допускает возникновение отрицательного значения НПП1 или его снижения относительно своего предыдущего отрицательного значения.

5.6. Требования п. 5.5 Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок не применяются в следующих случаях:

- если отрицательное значение НПП1 или его снижение относительно своего предыдущего отрицательного значения произошло не в результате совершения Банком действий в отношении Портфеля Клиента;

- в случае, предусмотренном п. 5.9 Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок (при осуществлении Банком закрытия Позиции Клиента до приведения НПП1 или НПП2 в соответствие);

- в случае положительного значения НПП1, определенного Банком в соответствии с Едиными требованиями на момент принятия Поручения Клиента, исполнение которого привело к отрицательному значению НПП1, или, если исполнение этого поручения поставлено в зависимость от наступления предусмотренных в нем обстоятельств, - на момент наступления таких обстоятельств, исходя из Плановых позиций в Портфеле Клиента, скорректированных Банком с учетом принятых, но не исполненных к указанному моменту поручений этого Клиента;

- в случае начисления Банком и (или) уплаты за счет Клиента Банку и (или) третьим лицам в

связи со сделками, заключенными Банком за счет Клиента, сумм штрафов, пеней, процентов, неустоек, убытков, расходов и вознаграждений, в том числе по договору Банка с Клиентом, предметом которого не является оказание брокерских услуг;

- в случае если за счет средств Клиента исполняются обязанности Клиента по уплате обязательных платежей, в том числе в связи с исполнением Банком обязанностей налогового агента, или в связи с исполнением решения органов государственной власти;

- в случае заключения Банком за счет Клиента договоров репо;

- в случае удовлетворения клиринговой организацией требований, обеспеченных индивидуальным клиринговым обеспечением, в результате неисполнения или ненадлежащего исполнения Банком обязательств из сделок, совершенных за счет Клиента;

- в случае исключения Банком ценной бумаги из перечня Ликвидных ценных бумаг;

- в случае изменения Банком значений начальной ставки риска и (или) относительной ставки риска изменения цен, предусмотренных Едиными требованиями;

- в случае принятия Банком Поручения Клиента одновременно на совершение двух или более сделок, подлежащих исполнению в один и тот же день при условии:

- в соответствии с таким Поручением Клиента его частичное исполнение не допускается;

- заключение любой из этих сделок приведет к увеличению размера Начальной маржи относительно стоимости Портфеля Клиента;

- заключение всех сделок, указанных в Поручении, приведет к снижению размера Начальной маржи относительно ее первоначального размера.

5.7. Минимально допустимое числовое значение НПП2 устанавливается в размере 0 (Нуль).

В случае если НПП2 принимает значение ниже 0 (Нуля), Банк в сроки, предусмотренные п. 5.8 Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок и Порядком закрытия позиций, предпринимает меры по снижению размера Минимальной маржи и (или) увеличению стоимости Портфеля Клиента за исключением случаев:

- если значение размера Минимальной маржи равно 0 (Нулю);

- если до их совершения норматив НПП2 принял положительное значение, за исключением случаев, когда иное предусмотрено дополнительным соглашением к Договору.

К закрытию Позиций Клиента не относятся действия Банка, совершенные на основании Поручения Клиента, направленного (переданного) Банку для совершения сделки (заключения договора) за счет Клиента, в котором указаны конкретные ценные бумаги и их количество.

5.8. Банк осуществляет Закрытие позиций клиента при снижении НПП2 ниже 0 (Нуля) в следующие сроки.

5.8.1. В случае если НПП2 принимает значение ниже 0 (Нуля) в течение Торгового дня до ограничительного времени закрытия позиций (ограничительное время - 16 ч. 00 мин. 00 сек. по московскому времени каждого Торгового дня), Банк осуществляет закрытие позиций Клиента в течение этого Торгового дня.

5.8.2. В случае если НПП2 принимает значение ниже 0 (Нуля) в течение Торгового дня после ограничительного времени закрытия позиций, Банк осуществляет закрытие Позиций Клиента не позднее ограничительного времени закрытия позиций клиента ближайшего Торгового дня, следующего за Торговым днем, в котором наступило это обстоятельство.

5.8.3. В случае если до закрытия позиций Клиента организованные торги ценными бумагами были приостановлены и их возобновление произошло после ограничительного времени закрытия Позиций, Банк осуществляет закрытие позиций Клиента не позднее ограничительного времени закрытия позиций ближайшего Торгового дня, следующего за Торговым днем, в котором НПП2 принял значение ниже 0 (Нуля).

5.9. Банк осуществляет Закрытие позиций Клиента при снижении НПП2 ниже 0 (Нуля) с соблюдением следующих требований.

5.9.1. В отношении Клиентов, отнесенных Банком к категории клиентов со стандартным уровнем риска, Банк осуществляет Закрытие позиций до достижения НПП1 нулевого значения (при положительном значении размера Начальной маржи).

5.9.2. В отношении Клиентов, отнесенных Банком к категории клиентов с повышенным уровнем риска, Банк осуществляет Закрытие позиций таких Клиентов до достижения НПП2 нулевого значения (при положительном значении размера Минимальной маржи).

5.10. Закрытие позиций при снижении НПП2 ниже 0 (Нуля) Банк совершает на Анонимных торгах, за исключением случая, предусмотренного п. 5.11 настоящих Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок.

5.11. Закрытие позиций Клиента не на Анонимных торгах допускается только в случае соблюдения Банком следующих требований.

5.11.1. покупка ценных бумаг (за исключением облигаций) осуществляется по цене, не превышающей максимальную цену сделки с такими ценными бумагами, совершенной на Анонимных торгах в течение последних 15 (Пятнадцати) минут, предшествующих принятию Банком поручения Клиента на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, - в течение последних 15 (Пятнадцати) минут до их приостановления;

5.11.2. продажа ценных бумаг (за исключением облигаций) осуществляется по цене не ниже минимальной цены сделки с такими ценными бумагами, совершенной на Анонимных торгах в течение последних 15 (Пятнадцати) минут, предшествующих принятию Банком поручения Клиента на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, - в течение последних 15 (Пятнадцати) минут до их приостановления;

5.11.3. покупка облигаций осуществляется по цене, не превышающей максимальную цену сделки с такими облигациями, совершенной на Анонимных торгах в течение последних 15 (Пятнадцати) минут, предшествующих принятию Банком поручения Клиента на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, - в течение последних 15 (Пятнадцати) минут до их приостановления;

5.11.4. покупка облигаций осуществляется по цене не выше лучшей котировки на продажу таких облигаций, опубликованной в информационной системе Блумберг (Bloomberg) или в информационной системе Томсон Рейтерс (Thomson Reuters), более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по этой облигации, рассчитанной в соответствии с Едиными требованиями;

5.11.5. продажа облигаций осуществляется по цене не ниже минимальной цены сделки с такими облигациями, совершенной на Анонимных торгах в течение последних 15 (Пятнадцати) минут, предшествующих принятию Банком поручения Клиента на совершение сделки, или, если эти торги приостановлены, - в течение последних 15 (Пятнадцати) минут до их приостановления;

5.11.6. продажа облигаций осуществляется по цене не ниже лучшей котировки на покупку таких облигаций, опубликованной в информационной системе Блумберг (Bloomberg) или в информационной системе Томсон Рейтерс (Thomson Reuters), более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по этой облигации, рассчитанной в соответствии с Едиными требованиями.

В случае если источником информации о ценах или котировках, в соответствии с которыми Банк будет осуществлять закрытие позиций Клиента, является информационная система Блумберг (Bloomberg), то настоящим Клиент предоставляет Банку право использовать при закрытии позиций Клиента в соответствии с п.п. 5.11.4, 5.11.6 настоящих Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок информацию о ценах или котировках из информационной системы Блумберг (Bloomberg) полученную Банком на момент совершения действий по закрытию позиций любые по выбору Банка котировки «BGN» («BGN Bid»; «BGN Ask»; «Last Trade»). Настоящим Клиент заявляет и подтверждает, что в случае возникновения споров выписка из перечня информации, полученной Банком через информационную систему «Блумберг» (Bloomberg), подписанная уполномоченным представителем Банка, является надлежащим доказательством соответствующей котировки по данным информационной системы «Блумберг» (Bloomberg) на соответствующую дату.

В случае соблюдения одного из вышеуказанных требований Банк имеет право для целей Закрытия позиций Клиента заключать сделки не на Анонимных торгах (на Внебиржевом рынке), причем Банк вправе выступать в качестве обеих сторон по таким сделкам в случае, если в наличии у Банка будет встречное поручение от другого Клиента на заключение такой сделки.

5.12. Документ, определяющий порядок закрытия позиций, размещен на Сайте Банка (Приложение 21 к Порядку обслуживания клиентов Банка «СКС» (ООО) на финансовых рынках).

6. Особые случаи закрытия позиций Банком

6.1. Клиент поручает Банку до окончания текущей Торговой сессии в ТС Фондовый рынок ПАО Московская Биржа закрыть все или часть Непокрытых позиций Клиента, т.е. совершить в интересах и за счет Клиента Сделки купли-продажи Ценных бумаг в случаях, если Клиент не исполнил свои обязательства, установленные п. 4.7 и 4.8 настоящих Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок. При этом Закрытие позиций осуществляется Банком, начиная с 16 часов 00 минут московского времени и до окончания Торговой сессии ТС Фондовый рынок ПАО Московская Биржа.

6.2. При недостаточности денежных средств Клиента для совершения сделок по покупке Ценных бумаг в целях закрытия Непокрытых позиций по Ценным бумагам Банк вправе предварительно продать любые Ценные бумаги с Плановой позиции Клиента.

6.3. В случаях, установленных настоящим пунктом 6 Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок, закрытие Непокрытых позиций Клиента осуществляется Банком независимо от стоимости Портфеля «Фондовый рынок», значений нормативов НПР1, НПР2, размера Начальной маржи и Минимальной маржи.

6.4. Банк по своему усмотрению выбирает ценные бумаги, в том числе иностранные ценные бумаги, подлежащие отчуждению/приобретению в целях закрытия позиций или переноса позиций, в том числе, среди ценных бумаг, не входящих в перечень Ликвидных ценных бумаг.

6.5. Банк вправе в одностороннем порядке без дополнительных распоряжений Клиента осуществлять закрытие Непокрытых позиций Клиента в случае (включая, но не ограничиваясь):

- наличия у Банка сведений о направлении в Арбитражный суд заявления о признании Клиента банкротом в соответствии с порядком, предусмотренным Федеральным законом от 26.10.2012 г. № 127-ФЗ «О несостоятельности (банкротстве)»;

- наличия официальной информации о смерти Клиента физического лица или признании безвестно отсутствующим или недееспособным;

- исключения Банком Клиента из Реестра лиц, признанных квалифицированными инвесторами, в порядке, установленном, нормативными правовыми актами Российской Федерации и Регламентом Банка о признании лиц квалифицированными инвесторам Банком «СКС» (ООО);

- поступления заявления Клиента об ограничении совершения Необеспеченных сделок;

- исключения Ценных бумаг из списка Ценных бумаг для совершения Необеспеченных сделок в день вступления таких изменений в силу;

- в иных случаях, которые предусмотрены Порядком.

7. Порядок отнесения клиентов к различным категориям клиентов

7.1. В целях определения условий совершения Необеспеченных сделок с ценными бумагами Клиент может быть отнесен Банком к одной из категорий риска в порядке и на условиях, предусмотренных Едиными требованиями .7.2. Клиент может быть отнесен к следующим категориям клиентов:

7.2.1. Клиент без права заключения Необеспеченных сделок – Клиент, не соответствующий требованиям п. 1.2 Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок. Непокрытые позиции у такого Клиента могут возникнуть только в случаях, установленных п. 3.7 Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок.

Стоимость Портфеля Клиента, нормативы НПР1, НПР2, размер Начальной маржи и размер Минимальной маржи рассчитываются в отношении такого Клиента в порядке, установленном для Клиента со стандартным уровнем риска.

7.2.2. Клиент со стандартным уровнем риска (КСУР) - Клиент, соответствующий требованиям п. 1.2 Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок, но при этом не отнесенный к Клиентам с повышенным уровнем риска и Клиентам с особым уровнем риска.

Стоимость Портфеля Клиента, нормативы НПР1, НПР2, размер Начальной маржи и размер Минимальной маржи рассчитываются в отношении такого Клиента в порядке, предусмотренном Едиными требованиями для клиентов со стандартным уровнем риска с учетом особенностей, установленных п. 5.1-5.2 Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок.

7.2.3. Клиент с повышенным уровнем риска (КПУР) – клиент, соответствующий требованиям п. 1.2 Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок, которому присвоен статус КПУР в соответствии с требованиями пункта 7.5 Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок.

Стоимость Портфеля Клиента, нормативы НПР1, НПР2, размер Начальной маржи и размер Минимальной маржи рассчитываются в отношении такого Клиента в порядке, предусмотренном Едиными требованиями.

В отношении Клиентов с повышенным уровнем дополнительным соглашением между Банком и Клиентом условия оказания услуг могут быть изменены, в том числе, могут быть предусмотрены иные особенности оказания услуг, расчета показателей, условия приема и (или) исполнения поручений, закрытия и/или переноса позиций.

7.2.4. Клиент с особым уровнем риска (КОУР) – клиент (юридическое лицо, как резиденты, так нерезиденты, в том числе действующие за счет третьего лица (третьих лиц)).

Стоимость Портфеля Клиента, нормативы НПР1, НПР2, размер Начальной маржи и размер Минимальной маржи рассчитываются в отношении такого Клиента в порядке, предусмотренном Едиными требованиями.

В отношении Клиентов с особым уровнем риска дополнительным соглашением между Банком и Клиентом условия оказания услуг могут быть изменены, в том числе, могут быть предусмотрены иные особенности оказания услуг, расчета показателей, условия приема и (или) исполнения поручений, закрытия и/или переноса позиций.

7.3. Клиент – юридическое лицо относится Банком к категории КПУР и исключается из указанной категории на основании обращения, полученного Банком любым из способов, описанных в разделе II Порядка, либо по решению Банка, принятому Банком самостоятельно.

7.4. Клиент - физическое лицо относится Банком к категории клиентов со стандартным уровнем риска или к категории клиентов с повышенным уровнем риска.

7.5. Клиент – физическое лицо относится Банком к категории КПУР и исключается из указанной категории на основании обращения Клиента, полученного Банком одним из способов, описанных в разделе II Порядка, либо по решению Банка, принятому Банком самостоятельно, при условии, что в отношении данного Клиента выполняется одно из следующих условий:

- сумма денежных средств и стоимость Ценных бумаг (в том числе иностранной валюты) физического лица, учитываемая на счетах внутреннего учета, открытых Банком такому физическому лицу, составляет не менее 3 000 000 (Трех миллионов) рублей по состоянию на день, предшествующий дню, с которого это физическое лицо в соответствии с Договором на брокерское обслуживание считается отнесенным к категории клиентов с повышенным уровнем риска (КПУР);

- сумма денежных средств (в том числе иностранной валюты) и стоимость Ценных бумаг физического лица, учитываемая на счетах внутреннего учета, открытых Банком такому физическому лицу, составляет не менее 600 000 (Шестисот тысяч) рублей по состоянию на день, предшествующий дню, с которого это физическое лицо в соответствии с Договором на брокерское обслуживание считается отнесенным к категории клиентов с повышенным уровнем риска (КПУР). При этом физическое лицо является клиентом Банка (брокеров) в течение последних 180 дней, предшествующих дню принятия указанного решения, из которых не менее 5 (Пяти) дней за счет этого лица Банком (брокерами) заключались договоры с ценными бумагами или договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами.

Для подтверждения факта нахождения Клиента на брокерском обслуживании в течение последних 180 дней и факта заключения сделок Банк использует данные внутреннего учета либо (в случае, если Клиент находился на обслуживании у другого брокера) требует от Клиента предоставления отчета брокера, заверенного печатью и подписью другого брокера, а также копии документа подтверждающего заключение брокерского договора с другим брокером.

7.6. Для целей п. 7.5 Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок стоимость Ценных бумаг и денежных средств определяется следующим образом:

7.6.1 Стоимость Ценных бумаг физического лица, допущенных к организованным торгам организатором торговли, определяется исходя из цены закрытия этих ценных бумаг, определенной организатором торговли по состоянию на торговый день, предшествующий дню, с которого это физическое лицо в соответствии с Договором на брокерское обслуживание считается отнесенным к категории клиентов с повышенным уровнем риска.

Стоимость ценных бумаг клиента Банка, прошедших процедуру листинга на иностранной бирже, входящей в Перечень иностранных бирж, определяется по цене закрытия по ценной бумаге, рассчитываемой такой иностранной биржей по состоянию на день, предшествующий дню, с которого это физическое лицо в соответствии с Договором на брокерское обслуживание считается отнесенным к категории клиентов с повышенным уровнем риска.

Стоимость ценных бумаг, которая не может быть определена в соответствии с настоящим пунктом принимается равной 0 (Нулю).

7.6.2. Денежные средства физического лица в иностранной валюте пересчитываются Банком по курсу иностранной валюты по отношению к рублю, исходя из информации о последнем курсе соответствующей иностранной валюты к рублю, сложившемся в ходе организованных торгов иностранной валютой, за исключением случаев, предусмотренных Едиными требованиями.

. Для подтверждения соответствия Клиента требованиям, предъявляемым Банком к Клиентам с повышенным уровнем риска, Банк вправе использовать по своему усмотрению информацию из документов, подтверждающих такое соответствие, в том числе полученных от третьих лиц.

7.7. Банк вправе по своему усмотрению не относить Клиента к категории клиента с повышенным уровнем риска и/или к категории клиента с особым уровнем риска, в том числе, в случае соответствия Клиента условиям, при которых Банк вправе отнести клиента к соответствующей

категории.

7.8. Банк вправе предъявлять дополнительные требования к форме, содержанию, перечню и (или) реквизитам документов, исходящих от третьих лиц и предоставляемых Клиентом для подтверждения соответствия Клиента условиям, при которых Банк вправе отнести Клиента к соответствующей категории клиентов, в том числе, Банк вправе отказаться принимать или не принимать документы, исходящие от третьих лиц и предоставляемые Банку для подтверждения соответствия Клиента условиям, при которых Банк вправе отнести Клиента к соответствующей категории клиента, в том числе, без объяснения причин.

7.9. По умолчанию Банк относит Клиента – физического лица к категории КСУР, Клиента – юридическое лицо к категории КОУР.

В случае отнесения Банком Клиента к категории КПУР, Банк уведомляет об этом Клиента по электронной почте по адресу, указанному Клиентом в Заявлении о заключении договоров. При наличии технической возможности Банк предоставляет доступ Клиенту к такой информации посредством Личного кабинета инвестора, программного обеспечения QUIK.

7.10. Клиент считается отнесенным к категории клиентов со стандартным/особым уровнем риска с одной из следующих дат (при условии не отнесения к категории клиентов с повышенным уровнем риска):

1) с даты заключения Клиентом Договора на брокерское обслуживание с Банком, если в тексте Заявления о заключении договоров (по форме Приложения 1, 1а к Порядку обслуживания клиентов Банка «СКС» (ООО) на финансовых рынках) содержится указание Клиента о возможности подачи Поручений на Необеспеченные сделки;

2) с даты исключения Клиента из реестра клиентов с повышенным уровнем риска.

Клиент считается отнесенным к категории клиентов с повышенным уровнем риска с даты внесения Банком соответствующей записи в реестр клиентов с повышенным уровнем риска.

7.11. При самостоятельном изменении Банком категории риска Клиента, Банк уведомляет Клиента о таком изменении не позднее 1 (Одного) рабочего дня, предшествующего дню изменения, путем направления соответствующей информации по электронной почте по адресу, указанному Клиентом в Заявлении о заключении договоров. При наличии технической возможности Банк предоставляет доступ Клиенту к такой информации посредством Личного кабинета инвестора, программного обеспечения QUIK.

7.12. При изменении категории риска Клиента на основании его обращения, Банк не позднее 2 (Двух) рабочих дней с даты получения такого обращения и в случае необходимости документов, предусмотренных п. 7.5 Правил обслуживания при приеме и исполнении необеспеченных сделок, рассматривает обращение Клиента и уведомляет Клиента:

– о применении изменения категории риска

или

– об отказе в применении изменения категории риска.

Банк уведомляет Клиента не позднее 1 (Одного) рабочего дня, предшествующего дню принятия решения по электронной почте по адресу, указанному Клиентом в Заявлении о заключении договоров. При наличии технической возможности Банк предоставляет доступ Клиенту к такой информации посредством Личного кабинета инвестора, программного обеспечения QUIK.

8. Особенности оказания услуг Клиентам, отнесенным к категории клиентов с особым уровнем риска

8.1. Банк вправе определить отдельный список Ликвидных ценных бумаг, список Ценных бумаг для совершения Необеспеченных сделок для каждого отдельного клиента, отнесенного к категории клиентов с особым уровнем риска.

Банк предоставляет доступ к любому текущему списку для Клиентов, отнесенных к категории клиентов с особым уровнем риска по электронной почте, указанной в Заявлении о заключении договоров, через программное обеспечение QUIK, а также любым иным способом, которым могут направляться Сообщения в соответствии с Порядком.

Совершение Банком по поручению Клиента, отнесенному к категории клиента с особым уровнем риска, сделок и/или операций влекущих возникновение или увеличение непокрытой позиции по ценным бумагам, допускается исключительно по ценным бумагам, включенным в Список ценных бумаг для совершения Необеспеченных сделок для Клиентов, отнесенных к категории клиентов с особым уровнем риска.

8.2. Клиент, отнесенный Банком к категории клиентов с особым уровнем риска:

- принимает на себя обязательство самостоятельно осуществлять расчет показателей: стоимость Портфеля, Начальная маржа, Минимальная маржа, НПП1, НПП2;

- подтверждает отсутствие у Банка обязанности по уведомлению Клиента о значениях показателей: стоимость Портфеля, Начальная маржа, Минимальная маржа, о принятия НПП1 значения ниже 0 (Нуля);

- подтверждает право Банка на предоставление доступ Клиенту к информации о стоимости Портфеля, Начальной марже, Минимальной марже, НПП1, НПП2 посредством программного обеспечения QUIK, путем направления уведомления по электронной почте, указанной в Заявлении о заключении договоров, а также любым иным способом, которым могут направляться Сообщения в соответствии с Порядком.

В случае повторного и (или) последующего в течение торгового дня принятия НПП1 значения ниже 0 (Нуля) Банк вправе не направлять уведомление (последующее уведомление) об этом Клиенту.

8.3. Клиент - юридическое лицо (резидент), отнесенный к категории клиентов с особым уровнем риска, обязуется ежеквартально предоставлять Банку бухгалтерский баланс и отчет о финансовых результатах по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября и 31 декабря в срок, не позднее одного месяца следующего за днем окончания срока сдачи такой отчетности.

Клиент - юридическое лицо (нерезидент), отнесенный к категории клиентов с особым уровнем риска, обязуется ежегодно предоставлять Банку финансовую отчетность, составленную в соответствии с Международными стандартами финансовой отчетности в срок не позднее шести месяцев следующих после даты окончания финансового года в государстве, резидентом которого является такой Клиент.

В случае непредставления отчетности, Банк вправе изменить категорию Клиента на категорию с меньшим уровнем риска. Банк уведомляет об этом Клиента по электронной почте по адресу, указанному Клиентом в Заявлении о заключении договоров. При наличии технической возможности Банк предоставляет доступ Клиенту к такой информации посредством программного обеспечения QUIK.

9. Оплата услуг Банка

Клиент выплачивает Банку вознаграждение в соответствии с действующими Тарифами (Приложение 12 к Порядку).

10. Налогообложение

Осуществляется в порядке, установленном Налоговым кодексом Российской Федерации.

11. Заключительные положения

При прекращении действия Договора на брокерское обслуживание в целом или в части оказания услуг при приеме и исполнении необеспеченных сделок все Позиции Клиента должны быть закрыты до даты прекращения Договора на брокерское обслуживание в целом или в части оказания услуг при приеме и исполнении необеспеченных сделок путем досрочного исполнения сделок. Если Банк не получит от Клиента поручение на совершение сделок, то Клиент настоящим поручает Банку закрыть все Позиции Клиента в дату прекращения Договора на брокерское обслуживание в целом или в части оказания услуг при приеме и исполнении необеспеченных сделок с целью прекращения по ним требований и обязательств по необеспеченным сделкам.