Приложение № 1

к Регламенту брокерского обслуживания ПАО РОСБАНК

**Порядок принудительного закрытия позиций**

1. Настоящий Порядок принудительного закрытия позиций («Порядок») определяет содержание и последовательность действий ПАО РОСБАНК («Банк»), направленных на принудительное закрытие Непокрытыхпозиций Инвесторов со стандартным, повышенным и особым уровнем риска.
2. Порядок разработан в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России и Регламентом брокерского обслуживания ПАО РОСБАНК («Регламент»).
3. Все термины, используемые в тексте Порядка с большой буквы, имеют те же значения, что и в Регламенте, если иное не установлено Порядком.
4. Необходимость принудительного закрытия Непокрытых позиций Инвесторов Банком может интерпретироваться как сознательный отказ Инвестора от самостоятельного управления рисками по открытому Инвестору Банком Брокерскому счету. При этом во всех случаях принудительного закрытия ответственность за любые убытки возлагается на Инвестора.
5. Банк назначает должностное лицо (ответственного работника), ответственное за совершение действий по принудительному закрытию позиций Инвесторов. Ответственный работник Банка осуществляет контроль Непокрытых позиций Инвестора в режиме реального времени с 10:00 до 18:40 с использованием QUIK.
6. В связи с заключением и исполнением Необеспеченных Сделок Банк обязан рассчитывать на каждый день Стоимость Портфеля Инвестора, Размер начальной маржи и Размер минимальной маржи и сообщать указанные величины Инвестору посредством QUIK. Информационное сообщение, рассылаемое Банком посредством QUIK, имеет исключительно информационный характер. Информация о текущей Стоимости портфеля Инвестора и размере Начальной и Минимальной маржи, изложенная в информационном сообщении, действительна только на момент его направления. Банк оставляет за собой право дополнительно использовать любые другие каналы связи с Инвестором. В зависимости от Стоимости Портфеля Инвестора Банк налагает ограничения на совершение Сделок и допустимых операций с Портфелем Инвестора.
7. Стоимость Портфеля Инвестора, Размер начальной маржи и Размер минимальной маржи рассчитываются исходя из уровня риска, установленного Инвестору в соответствии с Указанием (Инвестор со стандартным уровнем риска, Инвестор с повышенным уровнем риска или Инвестор с особым уровнем риска), и дисконтирующих коэффициентов, установленных Банком в разрезе Приемлемых ЦБ. При этом дисконтирующие коэффициенты рассчитываются на основе наименьших коэффициентов, рассчитанных и публикуемых НКЦ в соответствии с требованиями, установленными российским законодательством.
8. При снижении Стоимости Портфеля Инвестора ниже Размера начальной маржи и/или ниже Размера минимальной маржи Банк вправе направить Инвестору по электронной почте, указанной Инвестором в Анкете Инвестора, специальное сообщение о резервировании денежных средств и/или Приемлемых ЦБ в обеспечение исполнения обязательств Инвестора. Банк оставляет за собой право использовать другие каналы связи с Инвестором. Получение поручения на отмену не снимает с Инвестора ответственности за контролирование Стоимости Портфеля Инвестора.
9. При снижении Стоимости Портфеля Инвестора ниже Размера минимальной маржи Банк имеет право и настоящим уполномочен Инвестором совершить операции, направленные на снижение Размера минимальной маржи. При этом операции совершаются с учетом требований, установленных российским законодательством. Невозможность совершения Банком указанных операций не снимает с Инвестора ответственности за исполнение обязательств Инвестора по заключенным по его поручению Сделкам и открытым позициям. Банк не несет ответственности за любые убытки Инвестора, возникшие вследствие совершения указанных операций.
10. Банк вправе в любой момент потребовать снижения Размера минимальной маржи и/или увеличения Стоимости Портфеля Инвестора путем предъявления Инвестору соответствующего требования посредством QUIK и/или других каналов связи, согласованных с Инвестором, в том числе, по адресу электронной почты Инвестора, указанному в последней представленной в Банк версии Анкеты Инвестора. Инвестор обязан исполнить требование Банка не позднее конца Рабочего дня, следующего за днем направления Банком требования, если иной срок не предусмотрен таким требованием.

В случае если Инвестор не исполнил требование Банка о снижении Размера минимальной маржи и/или увеличении Стоимости Портфеля, Банк имеет право и настоящим уполномочен Инвестором совершить операции, направленные на увеличение Стоимости Портфеля Инвестора и/или снижение Размера минимальной маржи. При этом операции совершаются с учетом требований, установленных Указанием. Невозможность совершения Банком указанных операций не снимает с Инвестора ответственности за исполнение обязательств по заключенным по его поручению сделкам и открытым позициям. Банк не несет ответственности за любые убытки Инвестора, возникшие вследствие совершения указанных операций.

1. При снижении Стоимости Портфеля Инвестора ниже Размера начальной маржи Инвестор обязан:

- осуществить резервирование денежных средств на Брокерском счете путем перевода денежных средств на Брокерский счет с расчетного (текущего) счета, открытого в Банке или иной кредитной организации / резервирование Приемлемых ЦБ на Торговом разделе счета депо путем перевода ЦБ из стороннего депозитария на Торговый раздел счета депо в Банке; и/или

- Подать Заявки на полное/частичное закрытие позиций для снижения Размера начальной маржи и/или увеличения Стоимости Портфеля Инвестора таким образом, чтобы Стоимость Портфеля Инвестора превысила Размер начальной маржи. Заключение Сделки СпецРЕПО не является выполнением указанных обязательств.

К закрытию позиций Инвестора не относятся действия Банка, совершенные на основании Заявки (поручения) Инвестора о совершении Сделки за счет Инвестора, в котором указаны конкретные ЦБ и срок исполнения такой Сделки.

1. Перед тем, как приступить к принудительному закрытию позиций (совершению сделок), Банк аннулирует все ранее принятые от Инвестора Заявки (поручения). До завершения всех процедур по совершению сделок по принудительному закрытию Банк приостанавливает прием новых Заявок (поручений) Инвестора.
2. В отношении Инвесторов, отнесенных Банком к категории клиентов со стандартным уровнем риска, Банк осуществляет закрытие позиций Инвестора при достижении НПР1 нулевого значения (при положительном значении Размера начальной маржи).
3. Банк в соответствии с пунктом 4.15 Регламента обязан осуществлять закрытие позиций Инвестора при снижении показателя НПР2 ниже 0 в следующие сроки:

(1) в случае если НПР2 принимает значение ниже «0» в течение Торгового дня до Ограничительного времени закрытия позиций, Банк обязан осуществить закрытие позиций Инвестора в течение этого Торгового дня;

(2) в случае если НПР2 принимает значение ниже «0» в течение Торгового дня после Ограничительного времени закрытия позиций, Банк обязан осуществить закрытие позиций Инвестора не позднее Ограничительного времени закрытия позиций Инвестора ближайшего Торгового дня, следующего за Торговым днем, в котором наступило это обстоятельство.

В случае если до закрытия позиций Инвестора организованные торги ЦБ были приостановлены, и их возобновление произошло после Ограничительного времени закрытия позиций, Банк обязан осуществить закрытие позиций Инвестора не позднее Ограничительного времени закрытия позиций ближайшего Торгового дня, следующего за Торговым днем, в котором НПР2 принял значение ниже «0».

1. Закрытие позиций может осуществляться Банком совокупно в отношении Портфеля Инвестора либо в отношении позиций в отдельных Активах. Расчет плановых позиций и процедура закрытия применяются в отношении каждого Портфеля Инвестора. При этом Банк вправе самостоятельно и по своему усмотрению определять состав и количество Активов, за счет которых совершаются действия по принудительному закрытию позиций Инвестора.
2. Банк не осуществляет закрытие позиций Инвестора, если значение размера Минимальной маржи равно 0.
3. Банк не осуществляет закрытие позиций Инвестора, если до их совершения НПР2 принял положительное значение.
4. Настоящий Порядок дополняет положения Регламента и является их неотъемлемой частью. Иные условия и особенности закрытия позиций Инвесторов могут быть предусмотрены в Регламенте. В случае возникновения противоречий между положениями Порядка и положениями Регламента (в том числе в результате внесения в Регламент изменений и/или дополнений), то к отношениям Банка и Инвестора в связи с принудительным закрытием позиций Инвестора применяется настоящий Порядок.
5. Банк вправе в одностороннем порядке вносить изменения и дополнения в Порядок и/или утверждать Порядок в новой редакции. Действующая редакция Порядка раскрывается на Сайте Банка в сети Интернет.