

Утверждено
Генеральным директором ООО «АТОН»
Звездочкиным А.М.



Приказ № 278 от «21» октября 2026 г.
Начало действия «21» октября 2026г.

Порядок закрытия позиций клиентов, в отношении которых ООО «АТОН» совершает действия, приводящие к возникновению непокрытых позиций по ценным бумагам и (или) денежным средствам, а также заключает сделки со срочными контрактами FORTS, и отнесенных ООО «АТОН» к категории клиентов с начальным, стандартным или повышенным уровнем риска.

Согласно Указанию Банка России от 12.02.2024 г. № 6681-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных за счет клиента» (далее — «Указание») ООО «АТОН» (далее — «Брокер» или ООО «АТОН») настоящим устанавливает порядок принятия мер, в том числе совершения сделок и иных операций, по снижению размера минимальной и начальной маржи, рассчитанных в соответствии с приложением к Указанию, и (или) увеличению стоимости портфеля клиента (далее — «Портфель клиента»), определяемого в соответствии с Указанием, (далее — «закрытие позиций») в зависимости от категории риска клиента в случае, если норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента (далее — «НПР2» и «НПР1») принимает значение меньше 0 (далее — «Порядок закрытия позиций клиента» или «Порядок»)

1) Порядок закрытия позиций клиентов, отнесенных к категории клиентов с начальным уровнем риска

Для клиентов с начальным уровнем риска (далее «КНУР») Брокер устанавливает следующий порядок закрытия позиций:

1) При снижении стоимости портфеля ниже соответствующего размера минимальной маржи (снижение норматива покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента (НПР2) ниже 0), ООО «АТОН» в день, в который наступило указанное обстоятельство, вправе в целях снижения указанного размера минимальной маржи и/или увеличения стоимости Портфеля клиента совершить сделки по продаже или покупке ликвидных ценных бумаг и/или иностранных валют в количестве достаточном для того, чтобы в результате закрытия позиций клиента стоимость Портфеля клиента была равна размеру начальной маржи или превышала ее на размер, не превышающий размер торгового лота. При наличии различных ликвидных ценных бумаг и/или иностранных валют ООО «АТОН» вправе самостоятельно определить, какие именно ценные бумаги и/или иностранные валюты будут объектом сделок.

2) Если после реализации всех ликвидных ценных бумаг и/или иностранных валют у клиента остается отрицательное значение показателя НПР2 или в случае отсутствия у клиента ликвидных

ценных бумаги/или иностранных валют, которые могут быть объектом сделок, направленных на закрытие позиций, ООО «АТОН» совершает сделки с ценными бумагами и/или иностранными валютами, не включенными в список ценных бумаг и иностранных валют, которые могут приниматься в качестве обеспечения по необеспеченным сделкам. Сделки по продаже/покупке ценных бумаг либо иностранных валют совершаются с количеством не меньшим, чем это необходимо для достижения положительного значения плановой позиции по соответствующему имуществу, а в случае недостаточного количества ценных бумаги/или иностранных валют — до достижения максимально возможной стоимости Портфеля клиента. При наличии различных ценных бумаги/или иностранных валют ООО «АТОН» вправе самостоятельно определить, какие именно ценные бумаги и/или иностранные валюты будут реализованы.

2) Порядок закрытия позиций клиентов, отнесенных к категории клиентов со стандартным уровнем риска

Для клиентов со стандартным уровнем риска (далее «КСУР») Брокер устанавливает следующий порядок закрытия позиций:

1) При снижении стоимости портфеля ниже соответствующего размера минимальной маржи (снижение норматива покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента (НПР2) ниже 0), ООО «АТОН» в день, в который наступило указанное обстоятельство, вправе в целях снижения указанного размера минимальной маржи и/или увеличения стоимости Портфеля клиента совершить сделки по продаже или покупке ликвидных ценных бумаг и/или иностранных валют в количестве достаточном для того, чтобы в результате закрытия позиций клиента стоимость Портфеля клиента была равна размеру начальной маржи или превышала ее на размер, не превышающий размер торгового лота. При наличии различных ликвидных ценных бумаг и/или иностранных валют ООО «АТОН» вправе самостоятельно определить, какие именно ценные бумаги и/или иностранные валюты будут объектом сделок.

2) Если после реализации всех ликвидных ценных бумаг и/или иностранных валют у клиента остается отрицательное значение показателя НПР2 или в случае отсутствия у клиента ликвидных ценных бумаги/или иностранных валют, которые могут быть объектом сделок, направленных на закрытие позиций, ООО «АТОН» совершает сделки с ценными бумагами и/или иностранными валютами, не включенными в список ценных бумаг и иностранных валют, которые могут приниматься в качестве обеспечения по необеспеченным сделкам. Сделки по продаже/покупке ценных бумаг либо иностранных валют совершаются с количеством не меньшим, чем это необходимо для достижения положительного значения плановой позиции по соответствующему имуществу, а в случае недостаточного количества ценных бумаги/или иностранных валют — до достижения максимально возможной стоимости Портфеля клиента. При наличии различных ценных бумаги/или иностранных валют ООО «АТОН» вправе самостоятельно определить, какие именно ценные бумаги и/или иностранные валюты будут реализованы.

3) Порядок закрытия позиций клиентов, отнесенных ООО «АТОН» к категории клиентов с повышенным уровнем риска

Для клиентов с повышенным уровнем риска (далее «КПУР») Брокер устанавливает следующий порядок закрытия позиций:

1) При снижении стоимости портфеля ниже соответствующего размера минимальной маржи (снижение норматива покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента (НПР2) ниже 0), ООО «АТОН» в день, в который наступило указанное обстоятельство, вправе в целях снижения указанного размера минимальной маржи и/или увеличения стоимости Портфеля клиента совершить сделки по продаже или покупке ликвидных ценных бумаг и иностранных валют в количестве достаточном для того, чтобы в результате закрытия позиций клиента стоимость Портфеля клиента была равна размеру минимальной маржи или превышала ее, но не достигая значения начальной маржи. При наличии различных ликвидных ценных бумаг, либо иностранных валют ООО «АТОН» вправе самостоятельно определить, какие именно ценные бумаги, либо иностранные валюты будут объектом сделок, направленных на закрытие позиций.

2) Если после реализации всех ликвидных ценных бумаг у клиента остается отрицательное значение показателя НПР2 или в случае отсутствия у клиента ликвидных ценных бумаг и/или иностранных валют, которые могут быть объектом сделок, направленных на закрытие позиций, ООО «АТОН» совершает сделки по продаже ценных бумаг и/или иностранных валют, не включенных в список ценных бумаг и иностранных валют, которые могут приниматься в качестве обеспечения по необеспеченным сделкам. Реализация ценных бумаг, либо иностранных валют осуществляется в количестве не меньшем, чем это необходимо для достижения положительного значения плановой позиции по соответствующему имуществу, а в случае недостаточного количества ценных бумаг и/или иностранных валют — до достижения максимально возможной стоимости Портфеля клиента. При наличии различных ценных бумаг и/или иностранных валют ООО «АТОН» вправе самостоятельно определить, какие именно ценные бумаги и/или иностранные валюты будут реализованы.

4) Порядок закрытия клиентов на срочном рынке FORTS

Вне зависимости от группы риска клиента Брокер устанавливает следующий порядок закрытия позиций:

1) При снижении стоимости портфеля ниже соответствующего размера начальной маржи (снижение норматива покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента (НПР1) ниже 0), ООО «АТОН» в день, в который наступило указанное обстоятельство, вправе в целях снижения указанного размера начальной маржи совершить сделки по продаже или покупке фьючерсных или опционных договоров в количестве достаточном для того, чтобы в результате закрытия позиций клиента стоимость Портфеля клиента была равна размеру начальной маржи или превышала ее. При этом допускается кратковременное увеличение отрицательного значения НПР1, если это необходимо для осуществления закрытия позиций клиента.

2) При наличии различных срочных контрактов ООО «АТОН» вправе самостоятельно определить, какие именно контракты будут объектом сделок.

5) Порядок закрытия позиций клиентов, которым ООО «АТОН» не оказывает услуги по совершению необеспеченных сделок

В случае возникновения в Портфеле клиента отрицательного значения плановой позиции у клиентов, не подписавших заявление на оказание услуг по совершению в интересах клиента необеспеченных сделок, в том числе сделок Т+ на условиях частичного обеспечения, ООО «АТОН»

совершает сделки по продаже ценных бумаг и/или иностранных валют, в том числе не включенных в список ценных бумаг и иностранных валют, которые могут приниматься в качестве обеспечения по необеспеченным сделкам. Реализация ценных бумаг либо иностранных валют осуществляется в количестве не меньшем, чем это необходимо для достижения положительного значения плановой позиции по соответствующему имуществу, а в случае недостаточного количества ценных бумаг и/или иностранных валют — до достижения максимально возможной стоимости Портфеля клиента. При наличии различных ценных бумаг и/или иностранных валют ООО «АТОН» вправе самостоятельно определить, какие именно ценные бумаги и/или иностранные валюты будут реализованы.

б) Сроки закрытия позиций клиентов.

Вне зависимости от категории риска клиента (КНУР, КСУР или КПУР) Брокер осуществляет закрытие позиций клиента при снижении ННР2, либо ННР1 (для срочного рынка FORTS), ниже 0 в следующие сроки:

1) В случае если ННР2 или ННР1 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня до 16:00:00 (ограничительное время закрытия позиций), Брокер осуществляет закрытие позиций клиента в течение этого торгового дня.

2) В случае если ННР2 или ННР1 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня после 16:00:00 Брокер осуществляет закрытие позиций клиента не позднее 16:00:00 ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором наступило это обстоятельство.

3) В случае если до закрытия позиций клиента организованные торги ценными бумагами (иностранной валютой), либо срочными контрактами были приостановлены и их возобновление произошло после 16:00:00, брокер должен осуществить закрытие позиций клиента не позднее 16:00:00 ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором ННР2 или ННР1 принял значение ниже 0. В целях Закрытия позиций время окончания любого торгового дня определяется как 23:59:59 текущего дня.