

Первому заместителю
Председателя Банка России
Чистюхину В.В.

Заместителю Председателя
Банка России
Габунии Ф.Г.

Исх. № 99 от 10 февраля 2022 года

Уважаемый Владимир Викторович!

Уважаемый Филипп Георгиевич!

Информируем Вас о том, что Совет директоров НАУФОР обсудил планы начать проведение организованных торгов в выходные дни и, в целом, поддержал данную инициативу. Тем не менее, организованные торги в выходные дни требуют изменения брокерами ряда процессов взаимодействия с клиентами, и в связи с этим Совет директоров НАУФОР счел целесообразной подготовку НАУФОР (или, если это будет сочтено возможным – Банком России) следующих рекомендаций:

1. Определять во внутреннем документе, устанавливающем порядок закрытия позиций клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, ограничительное время закрытий позиций таким образом, чтобы соответствующее ограничительное время приходилось на наиболее ликвидный период торгов, отнесенный биржей (биржами), организующей (организующими) торги ценными бумагами в выходные дни, к соответствующему торговому дню. Например, в случае проведения торгов, отнесенных биржей к одному торговому дню, в субботу, воскресенье и понедельник, рекомендовать устанавливать ограничительное время на какое-либо время, приходящееся на период проведения торгов в рамках основной торговой сессии в понедельник.

2. В случае принятия в соответствии с пунктом 15 Указания Банка России от 26.11.2020 № 5636-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента» решений о мерах по снижению размера минимальной маржи и/или увеличению стоимости портфеля клиента не осуществлять действий, направленных на снижение размера минимальной маржи и/или увеличение стоимости портфеля клиента, в период времени, приходящийся на наименее ликвидные периоды торгов текущего торгового дня, в том числе:

2.1. Не рекомендовать совершать действия, предусмотренные пунктом 4 статьи 3 Федерального закона от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» в период времени, приходящийся на наименее ликвидные периоды торгов в рамках одного торгового дня, определенного биржей, проводящей организованные торги в выходные дни.

2.2. В случае использования для целей снижения размера минимальной маржи и/или увеличения стоимости портфеля клиента условных поручений, предусмотренных договорными отношениями с клиентами, рекомендовать предусмотреть в договоре:

условия, согласно которым соответствующие условные поручения подаются со сроком исполнения в наиболее ликвидный период торгов в течение торговой сессии до окончания текущего торгового дня, в том числе в случае, когда торговый день приходится на несколько календарных дней; либо

условия, согласно которым соответствующие условные поручения подаются исключительно в наиболее ликвидный период торгов в течение торговой сессии текущего торгового дня (например, в основную торговую сессию понедельника для торгового дня понедельника, включающего периоды проведения торгов в субботу, воскресенье и понедельник).

Рекомендация, предусмотренная пунктом 2, не распространяется на случаи, когда клиент в явном виде выражает свою волю на совершение брокером действий, направленных на снижение размера минимальной маржи и/или увеличение стоимости портфеля клиента, в периоды времени, не относящиеся к наиболее ликвидному периоду торгов в течение торговой сессии текущего торгового дня, например, выражает свою волю на совершение указанных действия в течение субботы и/или воскресенья, в которые проводятся организованные торги в рамках торгового дня понедельника.

3. Рекомендовать предусмотреть в договоре с клиентами порядок исполнения иных условных поручений, чем указанные в пункте 2, в периоды времени, не относящиеся к наиболее ликвидному периоду торгов в течение торговой сессии текущего торгового дня, и информировать клиентов об установленном порядке исполнения поручений.

С уважением,

Президент

А.В. Тимофеев