

Приложение 9
к Соглашению о порядке обслуживания на
срочном рынке клиентов ООО «Компания БКС»

Утверждено
общим собранием участников
Общества с ограниченной ответственностью
“Компания Брокеркредитсервис”
Протокол № 22 от «22» августа 2016 года

**Заявление, раскрывающее риски,
связанные с проведением операций на рынке
фьючерсных контрактов и опционов**

Настоящее Заявление, раскрывающее риски, связанные с проведением операций на рынке фьючерсных контрактов и опционов (далее – Заявление), является Приложением №9 и неотъемлемой частью Соглашения о порядке обслуживания на срочном рынке клиентов Общества с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис», являющегося Приложением № 6 к Регламенту оказания услуг на рынке ценных бумаг Общества с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис» (далее – Соглашение и Регламент соответственно).

Факт разъяснения ООО «Компания БКС» (далее – Брокер) Клиенту рисков, связанных с проведением операций на рынке фьючерсных контрактов и опционов, в полном объеме и их приемлемость для Клиента в полном объеме, Клиент подтверждает своей подписью в Заявлении на комплексное обслуживание на рынке ценных бумаг или Заявлении об изменении условий акцепта условий Регламента оказания услуг на рынке ценных бумаг. Кроме того, подавая Брокеру поручение на совершение сделки с фьючерсными контрактами и (или) опционами, Клиент тем самым подтверждает факт ознакомления Клиента с рисками, связанными с проведением операций на рынке фьючерсных контрактов и опционов, факт разъяснения Брокером Клиенту указанных рисков в полном объеме и приемлемость указанных рисков для Клиента в полном объеме.

Настоящее Заявление не раскрывает все риски, связанные с проведением операций на рынке фьючерсных контрактов и опционов, поскольку многие из них даже не могут быть корректно спрогнозированы. Цель настоящего уведомления – предупредить Клиента о возможных убытках, связанных с заключением подобного рода сделок.

Риск потери средств при проведении операций с фьючерсными контрактами и опционами, в том числе внебиржевыми опционными контрактами, может быть существенным. Вам следует всесторонне рассмотреть вопрос о приемлемости для Клиента проведения подобных операций с точки зрения ваших финансовых ресурсов. Вы должны быть осведомлены о следующем:

1) в случае, если на рынке фьючерсных контрактов и опционов складывается ситуация, неблагоприятная для занятой Клиентом на этом рынке позиции, существует вероятность в сравнительно короткий срок потерять все средства, переданные брокеру и предназначенные для внесения в качестве гарантийного обеспечения по позициям открываемым по распоряжениям Клиента на рынке фьючерсных контрактов и опционов;

2) при неблагоприятном для Клиента движении цен для поддержания занятой на рынке позиции от Клиента могут потребовать внести дополнительные средства (для покрытия отрицательной вариационной маржи, внесения дополнительных средств гарантийного обеспечения и т.п.) значительного размера и в короткий срок, и если Клиент не сможет внести эти средства в установленные сроки (в том числе, в связи с тем, что позиция учитывается на индивидуальном инвестиционном счете, открытом Клиенту, для учета на котором не допускается передача ценных бумаг, денежных средств в сумме в совокупности более 400 000 тысяч рублей в течение календарного года с учетом всех ранее переданных денежных средств в течение этого календарного года для учета на индивидуальных инвестиционных счетах, которые были открыты Клиенту другими профессиональными участниками рынка ценных бумаг),

то позиция может быть принудительно закрыта с убытком, и Клиент будет нести самостоятельную ответственность за любые образовавшиеся при этом убытки;

3) если Клиент в ответ на предъявляемое требование к размеру гарантийного обеспечения внес в соответствии с Соглашением– денежные средства в российской и (или) иностранной валюте, ценные бумаги и (или) иное имущество, принимаемое ООО «Компания БКС» в качестве средств гарантийного обеспечения, то после совершения по поручению Клиента сделки Клиент утрачивает право свободного распоряжения указанным имуществом до закрытия позиций Клиента; кроме того, в случаях, предусмотренных

правилами ТС и Соглашением, данное имущество может быть реализовано в целях исполнения обязательств по заключенным на основании поручения Клиента сделкам с фьючерсными контрактами и опционами;

4) вследствие условий, складывающихся на рынке фьючерсных контрактов и опционов, может стать затруднительным или невозможным закрытие открытой позиции Клиента. Это возможно, например, когда при быстром изменении цен торги на рынке фьючерсных контрактов и опционов приостановлены или ограничены;

5) условные заявки (стоп-заявки), направленные на ограничение убытков, не обязательно ограничат потери Клиента до предполагаемого уровня, так как в складывающейся на рынке ситуации может оказаться невозможным исполнить такое поручение по оговоренной цене;

6) покупка опциона сопряжена со значительно меньшим риском, чем торговля фьючерсными контрактами, так как потери Клиента не превысят величину уплаченных за опцион премии, комиссионного вознаграждения брокера и прочих сборов. При продаже опциона риск Клиента сопоставим с риском при сделках с фьючерсными контрактами - при относительно небольших неблагоприятных движениях цен на рынке Клиент подвергается риску потенциально неограниченных убытков, превышающих полученную при продаже опциона премию. Совершение сделок по продаже опционов может быть рекомендовано только опытным инвесторам, обладающим значительными финансовыми возможностями и опытом применения стратегий.

Существуют различные виды опционов, поэтому до начала проведения операций на рынке опционов рекомендуем обсудить с брокером инвестиционные потребности и риски, связанные с такого рода сделками;

7) в случае, если Клиент имеет открытые позиции по опционному контракту и/или активные заявки на куплю-продажу опционного контракта, то может столкнуться с риском резкого увеличения размера требуемого гарантийного обеспечения за n-ое установленное Брокером количество клирингов до экспирации опционного контракта, вследствие чего при отсутствии достаточного размера зарезервированных Клиентом активов могут возникнуть основания для принудительного закрытия Брокером всех или части открытых позиций Клиента и/или для уплаты Клиентом штрафа в порядке, предусмотренном Соглашением о порядке обслуживания клиентов на срочном рынке Общества с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис» (Приложение №6 к Регламенту).

8) до совершения сделки Клиенту следует согласовать с брокером и получить письменное подтверждение о размере комиссионного вознаграждения, а также информацию о размерах иных сборов;

9) брокеры могут проводить операции от своего имени и за свой счет с теми же фьючерсными контрактами и опционами, что и Клиент, что может привести к возникновению конфликта интересов. Брокер должен заранее информировать Клиента о том, что он торгует за свой счет на рынках соответствующих фьючерсных контрактов и опционов.

10) неплатежеспособность брокера или иных привлеченных к контракту посредников может повлечь за собой закрытие позиции Клиента без согласия Клиента. Гарантии исполнения контрактов со стороны Биржи применимы только к взаимным обязательствам между Биржей и брокером.

11) использование Клиентом технологии «единый брокерский счет» сопряжено с ограничениями, предусмотренными Регламентом, приложениями к нему, в том числе, но, не ограничиваясь, Соглашением, одним из которых является ограничение на принятие в качестве средств гарантийного обеспечения денежных средств в иностранной валюте, что может привести к реализации Брокером предусмотренного Соглашением права закрыть все позиции Клиента или часть позиций Клиента, а также удержать с Клиента штраф за нарушение Клиентом обязанностей, предусмотренных Соглашением. Указанные

ограничения продолжают действовать в отношении Клиента до момента прекращения применения Брокером в отношении Клиента технологии «единый брокерский счет».

Риски, которые связанные с проведением операций на рынке фьючерсных контрактов и опционов по генеральному соглашению, предусматривающему открытие и ведение индивидуального инвестиционного счета, существенно превышают риски и являются более значительными, чем риски, связанные с проведением операций на рынке фьючерсных контрактов и опционов по генеральному соглашению, не предусматривающему открытие и ведение индивидуального инвестиционного счета, в частности, но, не ограничиваясь, в связи с:

1) невозможностью передачи ценных бумаг для учета на индивидуальном инвестиционном счете, в том числе, но, не ограничиваясь, для исполнения поставочных срочных контрактов, для внесения в качестве средств гарантийного обеспечения, увеличения сальдо клиентского счета (сальдо брокерского счета) и т.п.

2) в связи с невозможностью передачи денежных средств для учета на индивидуальном инвестиционном счете в сумме в совокупности более 400 000 тысяч рублей в течение календарного года с учетом всех ранее переданных денежных средств в течение этого календарного года для учета на индивидуальных инвестиционных счетах, которые были открыты Клиенту другими профессиональными участниками рынка ценных бумаг, что влечет невозможность передачи денежных средств сверх указанной суммы для учета на индивидуальном инвестиционном счете, в том числе, но, не ограничиваясь, в целях покрытия отрицательной вариационной маржи, в целях внесения средств гарантийного обеспечения, увеличения сальдо клиентского счета (сальдо брокерского счета),

в результате чего при наступлении условий, предусмотренных Соглашением о порядке обслуживания клиентов на срочном рынке Общества с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис» (Приложение №6 к Регламенту), позиции Клиента могут быть принудительно закрыты брокером или перенесены, поручения Клиента на совершение сделок или операций могут быть не приняты и не исполнены брокером, в связи с чем Клиент может понести убытки, ответственность за которые несет исключительно Клиент.