

Приложение 3
к Соглашению о порядке обслуживания
на срочном рынке клиентов ООО «Компания БКС»

Спецификация
внебиржевого опционного контракта тип «Колл-спрэд» («Call-spread»)

г. Новосибирск

I. Общие положения

- 1.1. Настоящая спецификация внебиржевого опционного контракта тип «Колл-спрэд» («Call-spread») (далее - Спецификация) определяет стандартные условия указанного опционного контракта, заключаемого ООО «Компания БКС» в интересах и по Поручению Клиента.
- 1.2. Спецификация совместно с Регламентом оказания услуг на рынке ценных бумаг ООО «Компания БКС» (далее - Регламент), Соглашением о порядке обслуживания на срочном рынке клиентов ООО «Компания БКС» (Приложение № 6 к Регламенту) определяет обязательства Сторон по внебиржевому опционному контракту тип «Колл-спрэд» («Call-spread») (далее – Контракт), а также порядок их возникновения, изменения и прекращения.

II. Термины и определения

- 2.1. **Держатель** – ООО «Компания БКС», действующее от своего имени, но за счет, по поручению и в интересах Клиента, получающее в результате заключения Контракта право требования исполнения обязательств по оплате окончательной расчетной цены Контракта в случаях, предусмотренных настоящей Спецификацией (далее – Право).
- 2.2. **Подписчик** – лицо, с которым ООО «Компания БКС» заключит опционный контракт, принявшее на себя в результате заключения Контракта обязанность по оплате окончательной расчетной цены Контракта в случаях, предусмотренных настоящей Спецификацией при условии осуществления Права требования Держателем.
- 2.3. **Номинальная цена Контракта** – сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, устанавливаемая Клиентом при подаче поручения на заключение Контракта.
- 2.4. **Премия** – сумма денежных средств, уплачиваемая Держателем Подписчику в сроки, указанные в настоящей Спецификации. Премия не подлежит возврату Держателю и/или Клиенту в случае прекращения обязательств по Контракту, в том числе в результате расторжения Контракта.
- 2.5. **Окончательная расчетная цена Контракта** – сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, которую Подписчик обязуется уплатить Держателю в срок, указанный в настоящей Спецификации, рассчитываемая в соответствии с условиями настоящей Спецификации на дату исполнения Контракта в зависимости от изменения значения базисного актива в течение срока действия Контракта, при условии надлежащего исполнения Держателем обязательства по выплате Премии.
- 2.6. **Биржа ММВБ** – организатор торговли, осуществляющий расчет Индекса РТС в соответствии с Методикой расчета Индексов Московской Биржи.
- 2.7. Иные термины и определения, используемые в настоящей Спецификации, используются в том понимании и толковании как они указаны в Регламенте оказания услуг на рынке ценных бумаг ООО «Компания БКС» (далее - Регламент), Соглашении о порядке обслуживания на срочном рынке клиентов ООО «Компания БКС» (Приложение № 6 к Регламенту), а термины, не определенные указанными документами – в значениях, определенных в соответствии с законодательством Российской Федерации.

III. Стандартные условия Контракта

- 3.1. Наименование Контракта: внебиржевой опционный контракт тип «Колл-спрэд» («Call-spread»)
- 3.2. Базисным (базовым) активом Контракта может выступать:
 - 3.2.1. ценная бумага (ценные бумаги) российского эмитента,
 - 3.2.2. индекс, рассчитываемый Биржей ММВБ на основании совокупности цен на ценные бумаги (фондовых индексов),
 - 3.2.3. одна тройская унция аффинированного золота в слитках,
 - 3.2.4. курс иностранной валюты по отношению к рублю Российской Федерации,
 - 3.2.5. индекс S&P500, рассчитываемый Standard & Poor's Financial Services LLC,
 - 3.2.6. индекс FTSE, рассчитываемый FTSE International Limited,
 - 3.2.7. индекс EuroStoxx50, рассчитываемый Stoxx Limited,
 - 3.2.8. индекс DAX, рассчитываемый Deutsche Borse AG,
 - 3.2.9. фьючерсный контракт, базисным активом которого является ценная бумага (ценные бумаги),
 - 3.2.10. фьючерсный контракт, базисным активом которого является индекс, рассчитываемый Биржей ММВБ на основании совокупности цен на ценные бумаги (фондовых индексов),
 - 3.2.11. фьючерсный контракт, базисным активом которого является курс доллара США по отношению к рублю Российской Федерации,
 - 3.2.12. фьючерсный контракт, базисным активом которого является одна тройская унция аффинированного золота в слитках,
 - 3.2.13. фьючерсный контракт, базисным активом которого является нефть West Texas Intermediate Light Sweet Crude Oil (WTI),
 - 3.2.14. фьючерсный контракт, базисным активом которого является индекс S&P500, рассчитываемый Standard & Poor's Financial Services LLC,

- 3.2.15. фьючерсный контракт, базисным активом которого является индекс FTSE, рассчитываемый FTSE International Limited,
 - 3.2.16. фьючерсный контракт, базисным активом которого является индекс EuroStoxx50, рассчитываемый Stoxx Limited,
 - 3.2.17. фьючерсный контракт, базисным активом которого является индекс DAX, рассчитываемый Deutsche Borse AG.
- 3.3. Базисным (базовым) активом Контракта является Инструмент, включенный в Список инструментов, указанный Клиентом в поручении в качестве базисного (базового) актива Контракта.
- 3.4. Код (обозначение) Контракта формируется по следующим правилам:

<Тип Контракта>_<обозначение базового актива Контракта>

- 3.4.1. тип Контракта, заключенного на условиях, установленных настоящей Спецификацией, обозначается символами «Call Spread»;
- 3.4.2. обозначение базового актива Контракта представляет собой:
 - 3.4.2.1. код (обозначение) базового актива, принятое у соответствующего организатора торговли:
 - ЗАО «ФБ ММВБ» - для базового актива, указанного в п.3.2.1 настоящей Спецификации;
 - ОАО Московская Биржа - для базового актива, указанного в п.3.2.2, п.п.3.2.9 – 3.2.12 настоящей Спецификации;
 - Чикагской товарной биржи (Chicago Mercantile Exchange) - для базового актива, указанного в п.п.3.2.13, 3.2.14 настоящей Спецификации;
 - Лондонской международной биржи финансовых фьючерсов и опционов (London International Financial Futures and Options Exchange) - для базового актива, указанного в п.3.2.15 настоящей Спецификации;
 - Eurex - для базового актива, указанного в п.п.3.2.16-3.2.17 настоящей Спецификации;
 - 3.4.2.2. обозначение в соответствии со Списком инструментов - для базового актива, указанного п.п.3.2.3, 3.2.4 настоящей Спецификации;
 - 3.4.2.3. обозначение индекса, принятое соответствующей организацией, рассчитывающей данный индекс - для базового актива, указанного п.п.3.2. - 3.2.8 настоящей Спецификации.

Пример.

Код (обозначение) «Call Spread_SPH1» означает, что базовым активом данного Контракта является фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является индекс S&P500, рассчитываемый Standard & Poor's Financial Services LLC. Месяц исполнения Контракта – март. Год исполнения Контракта – 2011г.

Код (обозначение) «Call Spread_GAZP» означает, что базовым активом данного Контракта является одна обыкновенная именная акция ОАО «Газпром».

- 3.5. Контракт является расчетным срочным контрактом и не предусматривает поставку базисного актива.
- 3.6. Контракт является европейским, что означает, что Держатель вправе осуществить Право только в дату исполнения Контракта.
- 3.7. Премия устанавливается Клиентом при подаче поручения в рублях Российской Федерации.
- 3.8. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2 устанавливаются Клиентом при подаче поручения на заключение Контракта. Цена исполнения Контракта 1 и/или цена исполнения Контракта 2 не подлежат уплате Подписчиком Держателю и/или Держателем Подписчику и используется исключительно в целях определения обязательств Подписчика в соответствии с условиями настоящей Спецификации.
- 3.9. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **ценная бумага**, указываются в рублях Российской Федерации.
- 3.10. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **индекс, рассчитываемый Биржей ММВБ** на основании совокупности цен на ценные бумаги (фондовых индексов), указываются в пунктах.
- 3.11. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **одна тройская унция аффинированного золота в слитках**, указываются в долларах США.
- 3.12. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **курс иностранной валюты по отношению к рублю Российской Федерации**, указываются в рублях Российской Федерации.
- 3.13. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является ценная бумага (ценные бумаги)**, указываются в рублях Российской Федерации.
- 3.14. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является индекс, рассчитываемый Биржей ММВБ** на основании совокупности цен на ценные бумаги (фондовых индексов), указываются в пунктах

- 3.15. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является курс доллара США по отношению к рублю Российской Федерации**, указываются в рублях Российской Федерации.
- 3.16. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является одна тройская унция аффинированного золота в слитках**, указываются в долларах США.
- 3.17. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является нефть West Texas Intermediate Light Sweet Crude Oil (WTI)**, указываются в долларах США.
- 3.18. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является индекс S&P500, рассчитываемый Standard & Poor's Financial Services LLC**, указываются в пунктах
- 3.19. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является индекс FTSE, рассчитываемый FTSE International Limited**, указываются в пунктах.
- 3.20. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является индекс EuroStoxx50, рассчитываемый Stoxx Limited**, указываются в пунктах.
- 3.21. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является индекс DAX, рассчитываемый Deutsche Borse AG**, указываются в пунктах.
- 3.22. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **индекс S&P500, рассчитываемый Standard & Poor's Financial Services LLC**, указываются в пунктах.
- 3.23. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **индекс FTSE, рассчитываемый FTSE International Limited**, указываются в пунктах.
- 3.24. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **индекс EuroStoxx50, рассчитываемый Stoxx Limited**, указываются в пунктах.
- 3.25. Цена исполнения Контракта 1, цена исполнения Контракта 2, базисным активом которого является **индекс DAX, рассчитываемый Deutsche Borse AG**, указываются в пунктах.
- 3.26. Номинальная цена Контракта указывается в рублях Российской Федерации. Номинальная цена Контракта не подлежит уплате Подписчиком Держателю и/или Держателем Подписчику и используется исключительно в целях расчета окончательной расчетной цены Контракта в соответствии с условиями настоящей Спецификации.

4. Основания возникновения и порядок исполнения обязательства Держателя по оплате Премии и обязательства Подписчика по оплате окончательной расчетной цены Контракта:

- 4.1. Не позднее дня, следующего за датой заключения Контракта, Держатель уплачивает Подписчику Премию. Премия не подлежит возврату Держателю и/или Клиенту в случае прекращения обязательств по Контракту, в том числе в результате расторжения Контракта.
- 4.2. Держатель вправе требовать исполнения Подписчиком обязательств по оплате окончательной расчетной цены Контракта на условиях, установленных Контрактом, если значение базисного актива на дату исполнения Контракта будет больше цены исполнения Контракта 1 и Держатель уведомил Подписчика о намерении (требовании) осуществить Право.
- 4.3. Контракт является надлежащим уведомлением Подписчика о намерении (требовании) Держателя осуществить Право, если Держатель до даты исполнения Контракта не уведомил Подписчика об ином.
- 4.4. Подписчик обязуется уплатить Держателю окончательную расчетную цену Контракта, если значение базисного актива на дату исполнения Контракта будет больше цены исполнения Контракта 1 и Держатель уведомил Подписчика о намерении (требовании) осуществить Право в порядке, установленном Контрактом. Окончательная расчетная цена Контракта определяется на дату исполнения Контракта.
- 4.4.1. Если значение базисного актива на дату исполнения Контракта будет больше цены исполнения Контракта 1 и меньше или равно значению цены исполнения Контракта 2, окончательная расчетная цена Контракта определяется по следующей формуле:

$$C_t = N \times \frac{(I_t - I_1)}{I_1}, \text{ где}$$

- C_t – окончательная расчетная цена Контракта;
- N – номинальная цена Контракта в соответствии с поручением Клиента;
- I_1 – цена исполнения Контракта 1 в соответствии с поручением Клиента;
- I_t – значение базисного актива, определяемое на дату исполнения Контракта.

4.4.2. Если значение базисного актива на дату исполнения Контракта будет больше цены исполнения Контракта 2, окончательная расчетная цена Контракта определяется по следующей формуле:

$$Ct = N \times \left(\frac{r}{100} \times \frac{t}{365} \right), \text{ где}$$

- Ct – окончательная расчетная цена Контракта;
 N – номинальная цена Контракта в соответствии с поручением Клиента;
 t – срок действия Контракта в соответствии с поручением Клиента, в календарных днях;
 r – ожидаемая доходность в соответствии с настоящим Контрактом, в процентах годовых

- 4.5. Значение базисного актива, являющегося **ценной бумагой**, определяется как средневзвешенная цена базисного актива, рассчитываемая ЗАО «ФБ ММВБ» по результатам торгового дня на основании данных основных торгов в ЗАО «ФБ ММВБ» на день определения значения базисного актива. В случае, если ЗАО «ФБ ММВБ» не осуществляло расчет средневзвешенной цены базисного актива на основании данных основных торгов по результатам дня, на который определяется значение базисного актива, то значение базисного актива определяется на основании средневзвешенной цены базисного актива, рассчитанной ЗАО «ФБ ММВБ» по результатам предшествующего торгового дня на основании данных основных торгов в ЗАО «ФБ ММВБ». В случае, если ЗАО «ФБ ММВБ» не осуществляло расчет средневзвешенной цены базисного актива на основании данных основных торгов по результатам предшествующего торгового дня, то значение базисного актива определяется на основании средневзвешенной цены базисного актива, рассчитанной ЗАО «ФБ ММВБ» на основании данных основных торгов в ЗАО «ФБ ММВБ» по результатам ближайшего предыдущего торгового дня по отношению ко дню, на который определяется значение базисного актива.
- 4.6. Значение базисного актива, являющегося **индексом, рассчитываемым Биржей ММВБ** на основании совокупности цен на ценные бумаги (фондовых индексов), определяется как значение, рассчитываемое по формуле $\frac{X_{\max} + X_{\min}}{2}$, где X_{\max} – максимальное значение индекса, рассчитываемого Биржей ММВБ по результатам торгового дня, на который определяется значение базисного актива, X_{\min} – минимальное значение индекса, рассчитываемого Биржей ММВБ по результатам торгового дня, на который определяется значения базисного актива. В случае, если Биржа ММВБ не осуществляла расчет максимального и/или минимального значений индекса по результатам дня, на который определяется значение базисного актива, то значение базисного актива определяется на основании максимального и минимального значений индекса, рассчитанных Биржей ММВБ по результатам предшествующего дня. В случае, если Биржа ММВБ не осуществляла расчет максимального и/или минимального значений индекса по результатам предшествующего дня, то значение базисного актива определяется на основании максимального и минимального значений индекса, рассчитанных Биржей ММВБ по результатам ближайшего предыдущего дня по отношению ко дню, на который определяется значение базисного актива.
- 4.7. Значение базисного актива, являющегося **одной тройской унцией аффинированного золота в слитках**, определяется как значение утреннего фиксинга на базисный актив на лондонском рынке наличного металла на дату определения значения базисного актива (опубликованное по официальным данным «The London Gold Market Fixing Limited»), выраженное в долларах США за одну тройскую унцию. Если на дату определения значения базисного актива значение утреннего фиксинга на базисный актив не было установлено в вышеуказанном порядке, то значение базисного актива определяется как ближайшее предыдущее значение фиксинга на базисный актив на лондонском рынке наличного металла (опубликованное по официальным данным «The London Gold Market Fixing Limited»), выраженное в долларах США за одну тройскую унцию.
- 4.8. Значение базисного актива, являющегося **курсом иностранной валюты по отношению к рублю Российской Федерации**, определяется как объявленный Центральным Банком Российской Федерации на день определения значения базисного актива официальный курс указанной иностранной валюты по отношению к рублю Российской Федерации, опубликованный на сайте Центрального Банка Российской Федерации www.cbr.ru.
- 4.9. Значение базисного актива, являющегося **фьючерсным контрактом, базисным активом которого, в свою очередь, является ценная бумага (ценные бумаги)**, определяется как расчетная цена фьючерсного контракта на ценные бумаги, указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на ОАО Московская Биржа, рассчитанная ОАО Московская Биржа на дату определения значения базисного актива по итогам вечернего расчетного периода, опубликованная на сайте ОАО Московская Биржа (www.rts.micex.ru), выраженная в рублях Российской Федерации. Если на дату определения значения базисного актива значение базисного актива не было установлено в вышеуказанном порядке, то значение базисного актива определяется как ближайшая предыдущая расчетная цена указанного фьючерсного контракта (торговля которым осуществляется на ОАО Московская Биржа), рассчитанная ОАО Московская Биржа по

итогах вечернего расчетного периода, опубликованная на сайте ОАО Московская Биржа (www.rts.micex.ru), выраженная в рублях Российской Федерации.

- 4.10. Значение базисного актива, являющегося **фьючерсным контрактом, базисным активом которого, в свою очередь, является индекс, рассчитываемый Биржей ММВБ** на основании совокупности цен на ценные бумаги (фондовых индексов), определяется как расчетная цена фьючерсного контракта на индекс, рассчитываемый Биржей ММВБ на основании совокупности цен на ценные бумаги (фондовых индексов) (указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на ОАО Московская Биржа), рассчитанная ОАО Московская Биржа на дату определения значения базисного актива по итогам вечернего расчетного периода, опубликованная на сайте ОАО Московская Биржа (www.rts.micex.ru), выраженная в пунктах. Если на дату определения значения базисного актива значение базисного актива не было установлено в вышеуказанном порядке, то значение базисного актива определяется как ближайшая предыдущая расчетная цена указанного фьючерсного контракта (торговля которым осуществляется на ОАО Московская Биржа), рассчитанная ОАО Московская Биржа по итогам вечернего расчетного периода, опубликованная на сайте ОАО Московская Биржа (www.rts.micex.ru), выраженная в пунктах.
- 4.11. Значение базисного актива, являющегося **фьючерсным контрактом, базисным активом которого, в свою очередь, является курс доллара США по отношению к рублю Российской Федерации**, определяется как расчетная цена фьючерсного контракта на курс доллара США по отношению к рублю Российской Федерации (указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на ОАО Московская Биржа), рассчитанная ОАО Московская Биржа на дату определения значения базисного актива по итогам вечернего расчетного периода, опубликованная на сайте ОАО Московская Биржа (www.rts.micex.ru), выраженная в рублях Российской Федерации. Если на дату определения значения базисного актива значение базисного актива не было установлено в вышеуказанном порядке, то значение базисного актива определяется как ближайшая предыдущая расчетная цена указанного фьючерсного контракта (торговля которым осуществляется на ОАО Московская Биржа), рассчитанная ОАО Московская Биржа по итогам вечернего расчетного периода, опубликованная на сайте ОАО Московская Биржа (www.rts.micex.ru), выраженная в рублях Российской Федерации.
- 4.12. Значение базисного актива, являющегося **фьючерсным контрактом, базисным активом которого, в свою очередь, является одна тройская унция аффинированного золота в слитках**, определяется как расчетная цена фьючерсного контракта на аффинированное золото в слитках (указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на ОАО Московская Биржа), рассчитанная ОАО Московская Биржа на дату определения значения базисного актива по итогам вечернего расчетного периода, опубликованная на сайте ОАО Московская Биржа (www.rts.micex.ru), выраженная в долларах США. Если на дату определения значения базисного актива значение базисного актива не было установлено в вышеуказанном порядке, то значение базисного актива определяется как ближайшая предыдущая расчетная цена указанного фьючерсного контракта (торговля которым осуществляется на ОАО Московская Биржа), рассчитанная ОАО Московская Биржа по итогам вечернего расчетного периода, опубликованная на сайте ОАО Московская Биржа (www.rts.micex.ru), выраженная в долларах США.
- 4.13. Значение базисного актива, являющегося **фьючерсным контрактом, базисным активом которого является нефть West Texas Intermediate Light Sweet Crude Oil (WTI)**, определяется как расчетная цена фьючерсного контракта на нефть West Texas Intermediate Light Sweet Crude Oil (WTI) (указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на Чикагской товарной бирже (Chicago Mercantile Exchange)) на дату определения значения базисного актива, опубликованная на сайте Chicago Mercantile Exchange (www.cmegroup.com), выраженная в долларах США. Если на дату определения значения базисного актива значение базисного актива не было установлено в вышеуказанном порядке, то значение базисного актива определяется как ближайшая предыдущая расчетная цена фьючерсного контракта на нефть West Texas Intermediate Light Sweet Crude Oil (WTI) (указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на Чикагской товарной бирже (Chicago Mercantile Exchange)), опубликованная на сайте Chicago Mercantile Exchange (www.cmegroup.com), выраженная в долларах США. Дата определения значения базисного актива определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).
- 4.14. Значение базисного актива, являющегося **фьючерсным контрактом, базисным активом которого является индекс S&P500, рассчитываемый Standard & Poor's Financial Services LLC**, определяется как расчетная цена фьючерсного контракта на индекс S&P500, рассчитываемый Standard & Poor's Financial Services LLC (указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на Чикагской товарной бирже (Chicago Mercantile Exchange)), на дату определения значения базисного актива, опубликованная на сайте Chicago Mercantile Exchange (www.cmegroup.com), выраженная в пунктах. Если на дату определения значения базисного актива значение базисного актива не было установлено в вышеуказанном порядке, то значение базисного актива определяется как ближайшая предыдущая расчетная цена фьючерсного контракта на индекс S&P500, рассчитываемый Standard & Poor's Financial Services LLC (указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на Чикагской товарной бирже (Chicago Mercantile Exchange)), опубликованная на сайте Chicago Mercantile Exchange

(www.cmegroup.com), выраженная в пунктах. Дата определения значения базисного актива определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).

- 4.15. Значение базисного актива, являющегося **фьючерсным контрактом, базисным активом которого является индекс FTSE, рассчитываемый FTSE International Limited**, определяется как расчетная цена фьючерсного контракта на индекс FTSE, рассчитываемый FTSE International Limited (указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на Лондонской международной бирже финансовых фьючерсов и опционов (London International Financial Futures and Options Exchange)), на дату определения значения базисного актива, опубликованная на сайте London International Financial Futures and Options Exchange (www.euronext.com), выраженная в пунктах. Если на дату определения значения базисного актива значение базисного актива не было установлено в вышеуказанном порядке, то значение базисного актива определяется как ближайшая предыдущая расчетная цена фьючерсного контракта на индекс FTSE, рассчитываемый FTSE International Limited (указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на Лондонской международной бирже финансовых фьючерсов и опционов (London International Financial Futures and Options Exchange)), опубликованная на сайте London International Financial Futures and Options Exchange (www.euronext.com), выраженная в пунктах. Дата определения значения базисного актива определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).
- 4.16. Значение базисного актива, являющегося **фьючерсным контрактом, базисным активом которого является индекс EuroStoxx50, рассчитываемый Stoxx Limited**, определяется как расчетная цена фьючерсного контракта на индекс EuroStoxx50, рассчитываемый Stoxx Limited (указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на Eurex), на дату определения значения базисного актива, опубликованная на сайте Eurex (www.eurexchange.com), выраженная в пунктах. Если на дату определения значения базисного актива значение базисного актива не было установлено в вышеуказанном порядке, то значение базисного актива определяется как ближайшая предыдущая расчетная цена фьючерсного контракта на индекс EuroStoxx50, рассчитываемый Stoxx Limited (указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на Eurex), опубликованная на сайте Eurex (www.eurexchange.com), выраженная в пунктах. Дата определения значения базисного актива определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).
- 4.17. Значение базисного актива, являющегося **фьючерсным контрактом, базисным активом которого является индекс индекс DAX, рассчитываемый Deutsche Borse AG**, определяется как расчетная цена фьючерсного контракта на индекс DAX, рассчитываемый Deutsche Borse AG (указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на Eurex), на дату определения значения базисного актива, опубликованная на сайте Eurex (www.eurexchange.com), выраженная в пунктах. Если на дату определения значения базисного актива значение базисного актива не было установлено в вышеуказанном порядке, то значение базисного актива определяется как ближайшая предыдущая расчетная цена фьючерсного контракта на индекс DAX, рассчитываемый Deutsche Borse AG (указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на Eurex), опубликованная на сайте Eurex (www.eurexchange.com), выраженная в пунктах. Дата определения значения базисного актива определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).
- 4.18. Значение базисного актива, являющегося **индексом S&P500, рассчитываемым Standard & Poor's Financial Services LLC**, определяется как значение индекса S&P500, рассчитанное Standard & Poor's Financial Services LLC по результатам торгового дня, на который определяется значение базисного актива, опубликованное в информационной системе "Блумберг" (Bloomberg) (на странице SPX Index) и/или на сайте Standard & Poor's Financial Services LLC (www.standardandpoors.com), выраженное в пунктах. В случае, если Standard & Poor's Financial Services LLC не осуществляло расчет значения индекса S&P500 по результатам дня, на который определяется значение базисного актива, то значение базисного актива определяется как значение индекса S&P500, рассчитанное Standard & Poor's Financial Services LLC по результатам ближайшего предшествующего дня, опубликованное в информационной системе "Блумберг" (Bloomberg) (на странице SPX Index) и/или на сайте Standard & Poor's Financial Services LLC (www.standardandpoors.com), выраженное в пунктах. Дата определения значения базисного актива определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).
- 4.19. Значение базисного актива, являющегося **индексом FTSE, рассчитываемым FTSE International Limited**, определяется как значение индекса FTSE, рассчитанное FTSE International Limited по результатам торгового дня, на который определяется значение базисного актива, опубликованное в информационной системе "Блумберг" (Bloomberg) (на странице UKX Index) и/или на сайте FTSE International Limited (www.ftse.com), выраженное в пунктах. В случае, если FTSE International Limited не осуществляло расчет значения индекса FTSE по результатам дня, на который определяется значение базисного актива, то значение базисного актива определяется как значение индекса FTSE, рассчитанное FTSE International Limited по результатам ближайшего предшествующего дня, опубликованное в информационной системе "Блумберг" (Bloomberg) (на странице UKX Index) и/или на сайте FTSE International Limited (www.ftse.com), выраженное в пунктах. Дата определения значения базисного актива определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).

- 4.20. Значение базисного актива, являющегося **индексом EuroStoxx50, рассчитываемым Stoxx Limited**, определяется как значение индекса EuroStoxx50, рассчитанное Stoxx Limited по результатам торгового дня, на который определяется значение базисного актива, опубликованное в информационной системе "Блумберг" (Bloomberg) (на странице SX5E Index) и/или на сайте Stoxx Limited (www.stoxx.com), выраженное в пунктах. В случае, если Stoxx Limited не осуществляло расчет значения индекса EuroStoxx50 по результатам дня, на который определяется значение базисного актива, то значение базисного актива определяется как значение индекса EuroStoxx50, рассчитанное Stoxx Limited по результатам ближайшего предшествующего дня, опубликованное в информационной системе "Блумберг" (Bloomberg) (на странице SX5E Index) и/или на сайте Stoxx Limited (www.stoxx.com), выраженное в пунктах. Дата определения значения базисного актива определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).
- 4.21. Значение базисного актива, являющегося **индексом DAX, рассчитываемым Deutsche Borse AG**, определяется как значение индекса DAX, рассчитанное Deutsche Borse AG по результатам торгового дня, на который определяется значение базисного актива, опубликованное в информационной системе "Блумберг" (Bloomberg) (на странице DAX Index) и/или на сайте Deutsche Borse AG (www.dax-indices.com), выраженное в пунктах. В случае, если Deutsche Borse AG не осуществляло расчет значения индекса DAX по результатам дня, на который определяется значение базисного актива, то значение базисного актива определяется как значение индекса DAX, рассчитанное Deutsche Borse AG по результатам ближайшего предшествующего дня, опубликованное в информационной системе "Блумберг" (Bloomberg) (на странице DAX Index) и/или на сайте Deutsche Borse AG (www.dax-indices.com), выраженное в пунктах. Дата определения значения базисного актива определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).
- 4.22. Порядок определения значения базисного актива, предусмотренный в п.п.4.5 – 4.21 настоящей Спецификации, применяется для определения значения базисного актива в течение срока действия Контракта на соответствующую дату, для определения значения базисного актива в дату исполнения Контракта. Порядок определения значения базисного актива, предусмотренный в п.п.4.5 – 4.21 настоящей Спецификации, не применяется для определения цены исполнения Контракта 1, цены исполнения Контракта 2.
- 4.23. ООО «Компания БКС» не несет ответственность за недостоверность, неполноту и/или несвоевременное отражение и/или обновление информации о значениях индексов, расчетных ценах фьючерсных контрактов, курсах валют, значений утреннего фиксинга на 1 (одну) тройскую унцию аффинированного золота в слитках, необходимой для определения значения базисного актива в порядке, предусмотренном п.п.4.5 – 4.21 настоящей Спецификации, опубликованной на сайтах ОАО Московская Биржа, ЗАО «ФБ ММВБ», иных сайтах, указанных в п.4.7 – 4.21 настоящей Спецификации, и/или в информационной системе "Блумберг" (Bloomberg), а также за сбой в работе указанных сайтов и/или системы.
- 4.24. Под средним Гринвичским временем (Greenwich Mean Time (GMT)) понимается среднее солнечное время начального меридиана, в качестве которого условно принимается меридиан, проходящий через Гринвич (Лондон, Великобритания). Среднее Гринвичское время (Greenwich Mean Time (GMT)) рассчитывается следующим образом, с учетом установленного законодательством Российской Федерации порядком исчисления времени на территории Российской Федерации:
- 4.24.1. московское время минус четыре часа - с даты, приходящейся на дату ежегодно осуществляемого перевода часовой стрелки на 1 час вперед (последнее воскресенье марта соответствующего года), до даты, приходящейся на дату, предшествующую дате ежегодно осуществляемого перевода часовой стрелки на 1 час назад (последнее воскресенье октября соответствующего года), включительно;
- 4.24.2. московское время минус три часа - с даты, приходящейся на дату ежегодно осуществляемого перевода часовой стрелки на 1 час назад (последнее воскресенье октября соответствующего года), до даты, приходящейся на дату, предшествующую дате ежегодно осуществляемого перевода часовой стрелки на 1 час вперед (последнее воскресенье марта соответствующего года), включительно;
- 4.24.3. московское время минус три часа - в случае если в соответствии с законодательством Российской Федерации перевод времени (часовой стрелки) не осуществляется.
- 4.25. Если значение базисного актива на дату исполнения Контракта будет меньше или равно цене исполнения Контракта 1, обязательство Подписчика по оплате Держателю окончательной расчетной цены Контракта не возникает, и Держатель не вправе требовать от Подписчика выплаты окончательной расчетной цены Контракта.
- 4.26. Исполнение обязательств Подписчика по выплате окончательной расчетной цены Контракта производится Подписчиком не позднее 2 (двух) банковских дней по истечении срока действия Контракта, при условии надлежащего исполнения Держателем обязательства по выплате Премии.
- 4.27. Исполнение обязательств Сторон по расчетам осуществляется в рублях Российской Федерации.

5. Ответственность Сторон и порядок прекращения контракта

- 5.1. Каждая Сторона Контракта несет ответственность за ущерб, причиненный ею другой Стороне в результате виновного неисполнения или ненадлежащего исполнения обязанностей, предусмотренных Контрактом.

- 5.2. В случае нарушения Держателем сроков перечисления Подписчику денежных средств, составляющих Премию, Держатель выплачивает Подписчику неустойку (пени) в размере 0,5 (Ноль целых пять десятых) процентов от суммы, подлежащей перечислению, за каждый день просрочки.
- 5.3. Пени, указанная в п. 5.2 настоящей Спецификации, может быть удержана Подписчиком из суммы, причитающейся Держателю, в безакцептном порядке в момент исполнения обязательств в соответствии с п.4.25 настоящей Спецификации.
- 5.4. Стороны несут ответственность за соблюдение конфиденциальности информации, ставшей известной в процессе исполнения Контракта, в течение всего срока действия Контракта, а также после его прекращения (расторжения), в соответствии с действующим законодательством Российской Федерации.
- 5.5. Сторона, виновная в разглашении конфиденциальной информации, возмещает другой Стороне понесенный в связи с этим разглашением ущерб в полном объеме.
- 5.6. Обязательства по Контракту полностью прекращаются в результате надлежащего исполнения Контракта.
- 5.7. Контракт может быть расторгнут Подписчиком в одностороннем порядке, в случае неисполнения либо ненадлежащего исполнения Держателем обязательства по уплате Премии.
- 5.8. Контракт не может быть расторгнут Держателем в одностороннем порядке.
- 5.9. Ко всем правоотношениям, возникающим из Контракта, в том числе в связи с его изменением, расторжением, неисполнением или ненадлежащим исполнением, или возникающим в связи с незаключенностью Контракта, недействительностью Контракта, подлежит применению законодательство Российской Федерации, иные нормативные правовые акты Российской Федерации.

6. Особые условия

- 6.1. ООО «Компания БКС» вправе вносить изменения и/или дополнения в настоящую Спецификацию в соответствии с порядком внесения изменений и дополнений, установленном Регламентом оказания услуг на рынке ценных бумаг Общества с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис».
- 6.2. Внесение изменений и/или дополнений в настоящую Спецификацию в соответствии с п.6.1 настоящей Спецификации не влечет изменение прав и обязанностей Сторон Контракта, заключенного ООО «Компания БКС» на основании поручения Клиента до вступления в силу данных изменений и/или дополнений.