

Приложение 8
к Соглашению о порядке обслуживания
на срочном рынке клиентов ООО «Компания БКС»

Спецификация
внебиржевого опционного контракта тип «Бинарный опцион Пут»

г. Новосибирск

I. Общие положения

- 1.1. Настоящая спецификация внебиржевого опционного контракта тип «Бинарный опцион Пут» (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 «Бинарный опцион Пут» (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. **Премия** – сумма денежных средств, уплачиваемая Держателем Подписчику в сроки и в размере, указанным в настоящей Спецификации. Премия не подлежит возврату Держателю и/или Клиенту в случае прекращения обязательств по Контракту, в том числе в результате расторжения Контракта.
- 2.4. **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.
- 2.5. **Биржа ММВБ** – организатор торговли, осуществляющий расчет Индекса РТС в соответствии с Методикой расчета Индексов Московской Биржи
- 2.6. **Ожидаемая доходность**¹ – параметр, устанавливаемый Клиентом при подаче поручения на заключение Контракта и используемый исключительно в целях определения обязательств Подписчика в соответствии с условиями настоящей Спецификации. Ожидаемой доходности может выражаться дробным числом.
- 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 «Бинарный опцион Пут».
- 3.2. Базисным (базовым) активом Контракта может выступать фьючерсный контракт, заключаемый в торговой системе ОАО Московская Биржа (на Срочном рынке), в том числе:
 - 3.2.1. фьючерсный контракт, базисным активом которого является ценная бумага (ценные бумаги),
 - 3.2.2. фьючерсный контракт, базисным активом которого является индекс РТС, рассчитываемый Биржей ММВБ на основании совокупности цен на ценные бумаги (фондовых индексов)/ иной индекс, рассчитываемый Биржей ММВБ,
 - 3.2.3. фьючерсный контракт, базисным активом которого является курс доллара США по отношению к рублю Российской Федерации,
 - 3.2.4. фьючерсный контракт, базисным активом которого является курс ЕВРО по отношению к рублю Российской Федерации,
 - 3.2.5. фьючерсный контракт, базисным активом которого является курс ЕВРО по отношению к доллару США,
 - 3.2.6. фьючерсный контракт, базисным активом которого является аффинированное золото в слитках.

¹ ООО «Компания БКС» не обещает и не гарантирует эффективности работы (доходности вложений, получения дохода от инвестирования денежных средств) на внебиржевом срочном рынке. Наименование параметра (показателя) «Ожидаемая доходность» используется исключительно для удобства, облегчения ссылок на него и не должно толковаться как гарантия получения дохода по внебиржевому опционному контракту тип «Бинарный опцион Пут», финансовый результат Клиента по указанной сделке определяется в соответствии с условиями Регламента, Приложения № 6 к Регламенту и настоящей Спецификации.

При подаче Клиентом поручения на заключение внебиржевого опционного контракта тип «Бинарный опцион Пут» с использованием системы Интернет-Трейддинг (системы QUIK) показатель «Ожидаемая доходность» указывается в форме заявки в поле «Цена».

- 3.3. Базисным (базовым) активом Контракта является финансовый инструмент, указанный Клиентом в поручении в качестве базисного (базового) актива Контракта, в том числе в форме кода (обозначения) базового актива в составе кода (обозначения) Контракта, на заключение которого Клиентом подано соответствующее поручение, при условии соблюдения положений настоящей Спецификации.
- 3.4. Код (обозначение) Контракта формируется по следующим правилам:

<Тип Контракта><обозначение базового актива Контракта><дата исполнения Контракта><отклонение>

- 3.4.1. тип Контракта, заключенного на условиях, установленных настоящей Спецификацией, обозначается символом «Р»;
- 3.4.2. обозначение базового актива Контракта представляет собой код (обозначение) базового актива, установленное ОАО Московская Биржа;
- 3.4.3. дата исполнения Контракта указывается в формате «день месяц год» следующим образом: ДДМГ, где ДД – число месяца исполнения Контракта (арабскими цифрами), М – буква, обозначающая месяц исполнения Контракта², Г – последняя цифра в обозначении года исполнения Контракта (арабской цифрой);
- 3.4.4. отклонение представляет собой величину в процентах, необходимую для определения цены исполнения Контракта, и указывается со знаком «плюс» или со знаком «минус»,

Пример.

Код (обозначение) «PRIZ401U4+0» означает, что базовым активом данного Контракта является фьючерсный контракт, обращающийся на ОАО Московская Биржа, подлежащий исполнению в декабре 2014 года, базисным активом которого, в свою очередь, является Индекс РТС, рассчитываемый Биржей ММВБ. Отклонение «+ 0%», дата исполнения Контракта – 01 сентября 2014г.

Код (обозначение) «PGDH403H4-4» означает, что базовым активом данного Контракта является фьючерсный контракт, обращающийся на ОАО Московская Биржа, подлежащий исполнению в марте 2014 года, базисным активом которого, в свою очередь, является аффинированное золото в слитках. Отклонение «-4%», дата исполнения Контракта – 03 марта 2014г.

- 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 одного Контракта составляет 1000 (Одна тысяча) рублей, независимо от того, какой фьючерсный контракт является базисным активом Контракта.
- 3.8. Цена исполнения Контракта определяется в следующем порядке: цена исполнения Контракта равна последней к моменту подачи Клиентом поручения (заявки) на заключение Контракта цене фьючерсного контракта, заключенного на торгах ОАО Московская Биржа (на Срочном рынке), являющегося базисным активом Контракта, увеличенной (уменьшенной) на величину отклонения следующим образом:

Цена исполнения Контракта = Цена базисного актива * (1 + отклонение/100%), где

Цена базисного актива – последняя, к моменту подачи поручения (заявки) Клиента на заключение Контракта, цена фьючерсного контракта, заключенного в дату подачи указанного поручения (заявки) Клиента на торгах ОАО Московская Биржа (на Срочном рынке), являющегося базисным активом Контракта. В случае если в торговый день, в который подано поручение (заявка) Клиента на заключение Контракта, на торгах ОАО Московская Биржа (на Срочном рынке) не было заключено ни одного фьючерсного контракта, являющегося базисным активом Контракта, Ценой базисного актива является расчетная цена указанного фьючерсного контракта (торговля которым осуществляется на ОАО Московская Биржа), опубликованная на сайте ОАО Московская Биржа (www.moex.com и (или) www.rts.micex.ru) и рассчитанная ОАО Московская Биржа по итогам расчетного периода, ближайшего к моменту подачи поручения (заявки) Клиента на заключения Контракта.,

Отклонение – величина в процентах, указанная в составе кода (обозначения) Контракта. Отклонение может принимать положительное значение, или отрицательное значение, или равняться 0. В случае если отклонение является отрицательной величиной, при расчете цены исполнения Контракта величина отклонения используется со знаком «минус».

- 3.9. Цена исполнения Контракта не подлежит уплате Подписчиком Держателю и/или Держателем Подписчику и используется исключительно в целях определения обязательств Подписчика в соответствии с условиями настоящей Спецификации.

² Месяц исполнения в коде (обозначении) Контракта указываются согласно следующему соответствию:

Месяц	Обозначение	Месяц	Обозначение	Месяц	Обозначение	Месяц	Обозначение
Январь	F	Апрель	J	Июль	N	Октябрь	V
Февраль	G	Май	K	Август	Q	Ноябрь	X
Март	H	Июнь	M	Сентябрь	U	Декабрь	Z

- 3.10. Цена исполнения Контракта исчисляется в единицах измерения, аналогичных единицам измерения цены фьючерсного контракта, являющегося базисным активом Контракта, согласно Спецификации данного фьючерсного контракта, утвержденной ОАО Московская Биржа (лицом, правопреемником которого является ОАО Московская Биржа), в том числе:
- 3.10.1. цена исполнения Контракта, базисным активом которого является **фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является ценная бумага (ценные бумаги)**, исчисляется в рублях Российской Федерации.
 - 3.10.2. цена исполнения Контракта, базисным активом которого является **фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является индекс, рассчитываемый Биржей ММВБ**, исчисляется в пунктах
 - 3.10.3. цена исполнения Контракта, базисным активом которого является **фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является курс иностранной валюты по отношению к рублю Российской Федерации**, исчисляется в рублях Российской Федерации.
 - 3.10.4. цена исполнения Контракта, базисным активом которого является **фьючерсный контракт, базисным активом которого, в свою очередь, является аффинированное золото в слитках**, исчисляется в долларах США.
- 3.11. Срок действия Контракта составляет период с даты заключения Контракта до даты исполнения Контракта (включительно).
- 3.12. Информация о величине последней к моменту подачи Клиентом поручения (заявки) на заключение Контракта цене фьючерсного контракта, заключенного на торгах ОАО Московская Биржа (на Срочном рынке), являющегося базисным активом Контракта, отражается в системе QUIK, в случае заключения Клиентом Соглашения об использовании системы «QUIK» (Приложение № 8 к Регламенту). Клиент обязан самостоятельно отслеживать изменение цены фьючерсного контракта, являющегося базисным активом Контракта.
- 3.13. В случае если по основаниям, предусмотренным Регламентом и/или Соглашением об использовании системы «QUIK» (Приложение № 8 к Регламенту) использование Клиентом системы «QUIK» невозможно, в том числе при приостановлении исполнения обязательств по Соглашению об использовании системы «QUIK», неработоспособности системы QUIK, либо Клиентом не заключено Соглашение об использовании системы «QUIK» (Приложение № 8 к Регламенту), Клиент обязан обращаться в ООО «Компания БКС» по телефону для получения информации о ценах фьючерсного контракта, заключаемого на торгах ОАО Московская Биржа (на Срочном рынке), являющегося базисным активом Контракта, в том числе о величине последней к моменту подачи Клиентом поручения (заявки) на заключение Контракта цене данного фьючерсного контракта.
- 3.14. Клиент признает, что все последствия, возникшие в результате отсутствия у Клиента информации о цене фьючерсного контракта, заключаемого на торгах ОАО Московская Биржа (на Срочном рынке), являющегося базисным активом Контракта, в том числе о величине последней к моменту подачи Клиентом поручения (заявки) на заключение Контракта цене указанного фьючерсного контракта, несет Клиент и принимает на себя все возникающие в связи с этим риски. В случае нарушения Клиентом обязанности, установленной п.3.12, п.3.13 настоящей Спецификации, и наличия спора между ООО «Компания БКС» и Клиентом в связи с исполнением прав и обязанностей Сторон по Соглашению, и/или Регламенту, Клиент не вправе ссылаться на то, что он не знал или не мог знать о цене фьючерсного контракта, заключаемого на торгах ОАО Московская Биржа (на Срочном рынке), являющегося базисным активом Контракта, в том числе о величине последней к моменту подачи Клиентом поручения (заявки) на заключение Контракта цене указанного фьючерсного контракта.

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 меньше либо равно цене исполнения Контракта 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 меньше или равно цене исполнения Контракта и Держатель уведомил Подписчика о намерении (требовании) осуществить Право в порядке, установленном настоящей Спецификацией (и Контрактом соответственно). Окончательная расчетная цена Контракта определяется на дату исполнения Контракта по следующей формуле:

$$C_t = r \times P_r, \text{ где}$$

C_t – окончательная расчетная цена Контракта;

- r - ожидаемая доходность в соответствии с поручением Клиента;
- P_r – премия в соответствии с настоящей Спецификацией.

- 4.6. Значение базисного актива, являющегося **фьючерсным контрактом**, обращающимся в торговой системе ОАО Московская Биржа (на Срочном рынке), определяется как расчетная цена фьючерсного контракта, указанного в поручении Клиента в качестве базисного актива Контракта, торговля которым осуществляется на ОАО Московская Биржа (на Срочном рынке), рассчитанная ОАО Московская Биржа на дату определения значения базисного актива по итогам вечернего расчетного периода, опубликованная на сайте ОАО Московская Биржа (www.moex.com и (или) www.rts.micex.ru), выраженная в единицах измерения в соответствии с Правилами, Спецификацией данного фьючерсного контракта. 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.moex.com и (или) www.rts.micex.ru), выраженная в единицах измерения в соответствии с Правилами, Спецификацией данного фьючерсного контракта.
- 4.7. Порядок определения значения базисного актива, предусмотренный в п.4.6 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.4.6 настоящей Спецификации, не применяется для определения цены исполнения Контракта.
- 4.8. ООО «Компания БКС» не несет ответственность за недостоверность, неполноту и/или несвоевременное отражение и/или обновление информации о расчетных ценах фьючерсных контрактов, необходимых для определения значения базисного актива в порядке, предусмотренном п.4.6 настоящей Спецификации, опубликованной на сайте ОАО Московская Биржа, а также за сбои в работе указанного сайта.
- 4.9. Если значение базисного актива на дату исполнения Контракта будет больше цены исполнения Контракта, Держатель не вправе требовать от Подписчика выплаты окончательной расчетной цены Контракта и обязательство Подписчика по оплате Держателю окончательной расчетной цены Контракта не возникает.
- 4.10. Исполнение обязательств Подписчика по выплате окончательной расчетной цены Контракта производится Подписчиком не позднее 1 (Одного) банковского дня по истечении срока действия Контракта, при условии надлежащего исполнения Держателем обязательства по выплате Премии.
- 4.11. 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 Премии, 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.4.10 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.