

Приложение № 2
к Соглашению о порядке обслуживания на срочном рынке
клиентов Общества с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис»

**Спецификация
внебиржевого форвардного контракта «Феникс с защитой»**

г. Новосибирск

I. Общие положения

- 1.1. Настоящая спецификация внебиржевого форвардного контракта «Феникс с защитой», являющегося производным финансовым инструментом¹, а именно расчетным форвардным контрактом, определяет стандартные условия указанного контракта, заключаемого ООО «Компания БКС»² от своего имени, но в интересах, за счет и по поручению Клиента (далее – **Спецификация, Контракт и Поручение** соответственно).
- 1.2. Спецификация совместно с Регламентом оказания услуг на рынке ценных бумаг ООО «Компания БКС» (далее – **Регламент**³), Соглашением о порядке обслуживания на срочном рынке клиентов ООО «Компания БКС» (далее – **Приложение № 6 к Регламенту**) определяет права и обязанности Сторон по Контракту, а также порядок их возникновения, изменения и прекращения.
- 1.3. Любые деньги, уплачиваемые какой-либо из Сторон по Контракту не подлежат страхованию в соответствии с Федеральным законом от 23.12.2003 г. № 177-ФЗ «О страховании вкладов в банках Российской Федерации» и государство не дает никаких гарантий сохранности и возврата инвестируемых денег.
- 1.4. Услуги по осуществлению брокерской деятельности не являются услугами по открытию банковских счетов и приему вкладов.
- 1.5. Наименование Спецификации предназначено исключительно для ее индивидуализации среди иных спецификаций, носит исключительно коммерческий характер и не связано с содержанием прав и обязанностей Сторон, а также не предопределяет содержание таких прав и обязанностей.
- 1.6. Содержащаяся в Спецификации информация не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией, а также не является рекламой.
- 1.7. Термины и их определения, прямо не установленные в Спецификации, должны толковаться в соответствии с Регламентом и Приложением № 6 к Регламенту, а при отсутствии в Регламенте и Приложении № 6 к Регламенту каких-либо терминов и их определений, в соответствии с законодательством Российской Федерации.

II. Термины и определения

- 2.1. **Держатель** – лицо, с которым ООО «Компания БКС» заключит Контракт.
- 2.2. **Подписчик** – ООО «Компания БКС», действующее от своего имени, но за счет, по поручению и в интересах Клиента, и получающее в результате заключения Контракта при наступлении указанных в Спецификации условий право требования к Подписчику об уплате Окончательной расчетной цены Контракта (в рублях Российской Федерации), а также Суммы платежа в рублях Российской Федерации.
- 2.3. **Стороны** – Держатель и Подписчик при совместном упоминании по тексту Спецификации.
- 2.4. **Клиент** – физическое лицо, заключившее с ООО «Компания БКС» при посредничестве Банка-Партнера договор о брокерском обслуживании путем присоединения данным лицом к условиям Регламента и всех приложений к нему.
- 2.5. **Банк-Партнер** – кредитная организация, оказывающая ООО «Компания БКС» на основании договора услуги по привлечению физических лиц на брокерское и депозитарное обслуживание в ООО «Компания БКС»
- 2.6. **Начальная цена Контракта (в рублях Российской Федерации)** – сумма денежных средств, уплачиваемая Подписчиком Держателю в рублях Российской Федерации, в срок, указанный в Спецификации, в размере начальной цены Контракта в рублях Российской Федерации, установленном в Поручении.
- 2.7. **Начальная цена Контракта (в валюте Контракта)** – сумма денежных средств в валюте Контракта в размере, аналогичном установленному в Поручении размеру Начальной цены Контракта (в валюте Контракта). Начальная цена Контракта в валюте Контракта не подлежит уплате Подписчиком Держателю и/или Держателем Подписчику и используется исключительно в целях определения размера обязательств по выплате Окончательной расчетной цены Контракта, Сумм платежа.
- 2.8. **Сумма платежа (в валюте Контракта)** – сумма денежных средств в валюте Контракта, рассчитанная в порядке, предусмотренном в Спецификации, на Дату исполнения Контракта и/или на Дату фиксации (расчетную дату) Контракта t_m в зависимости от изменения значений базисных активов в течение срока действия Контракта.

¹ Указание Банка России от 16.02.2015 № 3565-У «О видах производных финансовых инструментов».

² Общество с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис» (ОГРН: 1025402459334; адрес места нахождения: 630099, г. Новосибирск, ул. Советская, д. 37). Более подробная информация размещена на официальном сайте ООО «Компания БКС»: <https://broker.ru/disclosure/general>. Сведения о лицензиях ООО «Компания БКС» на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг: <https://broker.ru/company/license>.

³ Регламент, а также Приложение № 6 к Регламенту размещены в публичном доступе на официальном сайте ООО «Компания БКС»: <https://broker.ru/regulations>.

Сумма платежа (в валюте Контракта) используется исключительно для определения размера обязательств по выплате Суммы платежа (в рублях Российской Федерации).

- 2.9. **Сумма платежа (в рублях Российской Федерации)** – сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, которую Держатель в соответствии с условиями Спецификации обязуется уплатить Подписчику в установленной в Спецификации срок, в случае возникновения у Держателя в соответствии с условиями Спецификации обязанности по выплате Суммы платежа.
- 2.10. **Окончательная расчетная цена Контракта (в валюте Контракта)** – сумма денежных средств в валюте Контракта, рассчитанная в порядке, предусмотренном в Спецификации, на Дату исполнения Контракта в зависимости от изменения значений базисных активов в течение срока действия Контракта, используемая для определения размера обязательств по выплате Окончательной расчетной цены Контракта (в рублях Российской Федерации).
- 2.11. **Окончательная расчетная цена Контракта в рублях Российской Федерации** – сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, которую Держатель обязуется уплатить Подписчику в предусмотренный в Спецификации срок, рассчитываемая на основании Окончательной расчетной цены Контракта (в валюте Контракта), определенной в соответствии с условиями Спецификации на Дату исполнения Контракта.
- 2.12. **Дата фиксации (расчетная дата) Контракта t_m** – любая Дата фиксации (расчетная дата) Контракта, из числа указанных в Поручении, являющаяся датой окончания периода расчета с номером m .
- 2.13. **БА (БА Контракта)** – базисный актив Контракта или базисные активы Контракта (в случае, если в Поручении установлен более чем один базисный актив).

III. Стандартные условия Контракта

- 3.1. Наименование Контракта: внебиржевой форвардный контракт «Феникс с защитой».
- 3.2. БА Контракта может выступать:
 - 3.2.1. ценная бумага (ценные бумаги) российского эмитента.
 - 3.2.2. ценная бумага (ценные бумаги) иностранного эмитента.
- 3.3. Контракт является расчетным срочным контрактом и не предусматривает поставку БА.
- 3.4. Клиентом в Поручении при его подаче устанавливается:
 - 3.4.1. размер Начальной цены Контракта (в валюте Контракта);
 - 3.4.2. размер Начальной цены Контракта (в рублях Российской Федерации);
 - 3.4.3. валюта Контракта;
 - 3.4.4. Дата исполнения Контракта;
 - 3.4.5. Срок действия Контракта (календарные дни);
 - 3.4.6. Дата определения параметров;
 - 3.4.7. Даты фиксации (расчетные даты) Контракта - являющиеся окончанием периода расчёта (с номером j), за исключением последнего периода расчёта в течение срока действия Контракта;
 - 3.4.8. размер первой ожидаемой доходности (% годовых). Первая ожидаемая доходность может составлять значение больше либо равное нулю;
 - 3.4.9. размер второй ожидаемой доходности (% годовых). Вторая ожидаемая доходность может составлять значение больше либо равное нулю;
 - 3.4.10. размер коэффициента защиты;
 - 3.4.11. размер корректирующего коэффициента;
 - 3.4.12. БА;
 - 3.4.13. валюта БА;
 - 3.4.14. биржа для определения значения БА.
- 3.5. Начальное значение БА Контракта определяется в порядке, установленном в Спецификации, на Дату определения параметров.
- 3.6. Уплаченная Подписчиком Держателю Начальная цена Контракта (в рублях Российской Федерации) не подлежит возврату Подписчику и/или Клиенту в случае прекращения обязательств по Контракту, в том числе в результате расторжения Контракта.

4. Основания возникновения обязательств Держателя по уплате Окончательной расчетной цены и/или Суммы платежа и обязательства Подписчика по уплате Начальной цены Контракта (в рублях Российской Федерации)

- 4.1. Не позднее дня, следующего за датой заключения Контракта, Подписчик уплачивает Держателю Начальную цену Контракта (в рублях Российской Федерации).
- 4.2. Держатель обязуется уплатить Подписчику Окончательную расчетную цену Контракта (в рублях Российской Федерации), если значение БА Контракта на Дату исполнения Контракта (если в Поручении зафиксирован более чем один БА, то значения каждого из БА Контракта на Дату исполнения Контракта) будет больше либо равно определенному в соответствии со Спецификацией значения Начального значения БА соответствующего БА. Окончательная расчетная цена Контракта в валюте Контракта рассчитывается в следующем порядке:

$$C_t = C_0 \times \left(1 + \frac{R_2 \times T}{365 \times 100 \%} \right), \text{ где}$$

C_t – Окончательная расчетная цена Контракта (в валюте Контракта);

C_0 – Начальная цена Контракта (в валюте Контракта) в соответствии с Поручением;

R_2 – Вторая ожидаемая доходность в соответствии с Поручением;

T – Срок действия Контракта в календарных днях в соответствии с Поручением.

- 4.3. Держатель обязуется уплатить Подписчику Окончательную расчетную цену Контракта (в рублях Российской Федерации), если значение БА Контракта на Дату исполнения Контракта (если в Поручении зафиксирован более чем один БА, то значения одного БА Контракта или нескольких БА Контракта на Дату исполнения Контракта) будет меньше определенного в соответствии со Спецификацией значения Начального значения БА соответствующего БА. Окончательная расчетная цена Контракта в валюте Контракта рассчитывается в следующем порядке:

$$C_t = C_0 \times \left(S + \frac{R_2 \times T}{365 \times 100 \%} \right), \text{ где}$$

C_t – Окончательная расчетная цена Контракта (в валюте Контракта);

C_0 – Начальная цена Контракта (в валюте Контракта) в соответствии с Поручением;

R_2 – Вторая ожидаемая доходность в соответствии с Поручением;

S – Коэффициент защиты в соответствии с Поручением;

T – Срок действия Контракта в календарных днях в соответствии с Поручением.

- 4.4. Держатель обязуется уплатить Подписчику Сумму платежа (в рублях Российской Федерации), если значение БА Контракта на Дату фиксации (расчетную дату) Контракта t_m и/или на Дату исполнения Контракта (если в Поручении зафиксирован более чем один БА, то значения каждого из БА Контракта на Дату фиксации (расчетную дату) Контракта t_m и/или на Дату исполнения Контракта) будет больше либо равно определенному в соответствии со Спецификацией значения Начального значения БА соответствующего БА. Сумма платежа, подлежащая уплате Держателем Подписчику в соответствии с настоящим пунктом Спецификации, рассчитывается на Дату фиксации (расчетную дату) Контракта t_m и/или Дату исполнения Контракта на основании Суммы платежа (в валюте Контракта), рассчитанной соответственно на Дату фиксации (расчетную дату) Контракта t_m и/или Дату исполнения Контракта в следующем порядке:

$$Cp_m = C_0 \times \frac{R_1}{100 \%} \times \frac{l_m + \sum_{j=1}^{m-1} l_j \times b_j * k}{365}, \text{ где}$$

Cp_m - Сумма платежа (в валюте Контракта);

C_0 – начальная цена Контракта (в валюте Контракта) в соответствии с Поручением;

R_1 - первая ожидаемая доходность в соответствии с Поручением;

$\sum_{j=1}^{m-1}$ – функция последовательного суммирования элементов с порядковыми номерами от $j = 1$

включительно до $j = m - 1$ включительно;

j – порядковый номер периода расчета;

l_j – период расчета (с номером j) в соответствии с Поручением (п. 4.5. Спецификации);

m – номер периода расчета, на дату окончания которого, являющуюся Датой фиксации (расчетной датой) Контракта t_m , либо Датой исполнения Контракта, определяется Сумма платежа. Периодом расчета с номером m (l_m) может являться любой период расчета (с номером j);

b_j – коэффициент выплаты для периода расчета (с номером j), значение которого определяется в порядке, предусмотренном п. 4.6 Спецификации;

k – корректирующий коэффициент в соответствии с Поручением.

4.5. Под **периодом расчета (с номером j)** понимается:

- период времени с Даты определения параметров (не включая указанную дату) до первой в соответствии с Поручением Даты фиксации (расчётной даты) Контракта (включая указанную дату) (порядковый номер данного периода расчета $j=1$), и/или

- период времени с Даты фиксации (расчётной даты) Контракта (t_{j-1}) (не включая указанную дату) до ближайшей следующей Даты фиксации (расчётной даты) Контракта (t_j) (включая указанную дату), и/или

- период времени с последней в соответствии с Поручением Даты фиксации (расчётной даты) Контракта (не включая указанную дату) до Даты исполнения Контракта (включительно).

Порядковый номер периода расчета (j) может принимать значения, указанные в Поручении.

4.6. Коэффициент выплаты для каждого периода расчета (b_j) определяется на Дату фиксации (расчетную дату) Контракта и/или на Дату исполнения Контракта, на которую осуществляется определение Суммы платежа, подлежащей уплате Держателем Подписчику в соответствии с условиями Спецификации, и может составлять значение «1» или «0»:

4.6.1. коэффициент выплаты для периода расчета составляет значение «0», если в соответствии с условиями Спецификации Держатель осуществлял выплату Суммы платежа (Сумм платежа) на условиях, предусмотренных Спецификацией, и данный период расчёта приходится на период времени до указанной выплаты Суммы платежа (Сумм платежа);

4.6.2. коэффициент выплаты для периода расчета составляет значение «1» во всех прочих случаях.

4.7. Сумма Окончательной расчетной цены Контракта (в рублях Российской Федерации) определяется на основании суммы Окончательной расчетной цена Контракта (в валюте Контракта), рассчитанной в порядке, предусмотренном в Спецификации, и официального курса валюты Контракта по отношению к рублю Российской Федерации, объявленного⁴ Банком России на Дату исполнения Контракта.

4.8. Сумма платежа (в рублях Российской Федерации), которую Держатель в соответствии с условиями Спецификации обязуется уплатить Подписчику, уплачивается Держателем:

4.8.1. в течение 2 (двух) рабочих дней, следующих за Датой фиксации (расчётной датой) t_m , если обязательство по выплате Суммы платежа возникло в связи с выполнением условий Поручения на указанную Дату фиксации (расчетную дату) Контракта t_m ;

4.8.2. в течение 2 (двух) рабочих дней, следующих за Датой исполнения Контракта, если обязательство по выплате Суммы платежа возникло на Дату исполнения Контракта.

4.9. Сумма платежа (в рублях Российской Федерации), подлежащая уплате Держателем согласно Спецификации, определяется на основании Суммы платежа (в валюте Контракта), рассчитанной в порядке, предусмотренном Спецификацией, и официального курса валюты Контракта по отношению к рублю Российской Федерации, объявленного⁵ Банком России:

4.9.1. на Дату фиксации (расчётную дату) Контракта t_m , на которую выполняются условия Спецификации (если обязательство по выплате Суммы платежа возникло на Дату фиксации (расчетную дату) Контракта t_m).

4.9.2. на Дату исполнения Контракта (если обязательство по выплате Суммы платежа возникло на Дату исполнения Контракта).

4.10. Значение БА, являющегося ценной бумагой, определяется как:

4.10.1. Для БА, у которого в Поручении в качестве биржи для определения значения БА указана биржа New York Stock Exchange LLC: официальная цена закрытия (official closing price, close price), рассчитываемая биржей New York Stock Exchange LLC в валюте БА на дату определения значения БА по итогам аукциона закрытия (Closing Auction) и опубликованная New York Stock Exchange LLC на официальном сайте New York Stock Exchange LLC (<https://www.nyse.com>). В случае отсутствия на дату определения значения БА официальной цены закрытия, опубликованной New York Stock Exchange LLC на официальном сайте New York Stock Exchange LLC, значение БА определяется как ближайшая предшествующая официальная цена закрытия, рассчитанная биржей New York Stock Exchange LLC по итогам аукциона закрытия и опубликованная New York Stock Exchange LLC на официальном сайте New York Stock Exchange LLC.

⁴ <http://www.cbr.ru>

⁵ <http://www.cbr.ru>

Дата определения значения БА в соответствии с настоящим пунктом Спецификации исчисляется в соответствии с временем, применяемым биржей New York Stock Exchange LLC, исходя из правил данной биржи.

Порядок определения значения БА, предусмотренный настоящим подпунктом Спецификации, применяется для определения значения БА в течение срока действия Контракта на соответствующую дату: для определения Начального значения БА, для определения значения БА в Дату исполнения Контракта, Даты фиксации (расчётные даты) Контракта. При этом Начальное значение БА Контракта определяется в валюте соответствующего БА как значение соответствующего БА Контракта на Дату определения параметров умноженное на значение, указанное в Поручении.

- 4.10.2. Для БА, у которого в Поручении в качестве биржи для определения значения БА указана биржа NASDAQ: официальная цена закрытия (NASDAQ official closing price, NOCP), рассчитываемая биржей NASDAQ в валюте БА на дату определения значения БА по итогам аукциона закрытия (The NASDAQ Closing Cross) и опубликованная NASDAQ на официальном сайте NASDAQ (<http://www.NASDAQ.com>). В случае отсутствия на дату определения значения БА официальной цены закрытия в валюте БА, опубликованной NASDAQ на официальном сайте NASDAQ, значение БА определяется как ближайшая предшествующая официальная цена закрытия, рассчитанная биржей NASDAQ в валюте БА по итогам аукциона закрытия и опубликованная NASDAQ на официальном сайте NASDAQ.

Дата определения значения БА в соответствии с настоящим пунктом Спецификации исчисляется в соответствии с временем, применяемым биржей NASDAQ, исходя из правил данной биржи.

Порядок определения значения БА, предусмотренный настоящим подпунктом Спецификации, применяется для определения значения БА в течение срока действия Контракта на соответствующую дату: для определения Начального значения БА, для определения значения БА в Дату исполнения Контракта, Даты фиксации (расчётные даты) Контракта. При этом Начальное значение БА Контракта определяется в валюте соответствующего БА как значение соответствующего БА Контракта на Дату определения параметров умноженное на значение, указанное в Поручении.

- 4.10.3. Для БА, у которого в Поручении в качестве биржи для определения значения БА указана биржа The Stock Exchange of Hong Kong Limited: цена закрытия (Closing price), рассчитываемая биржей The Stock Exchange of Hong Kong Limited в валюте БА на дату определения значения БА по итогам аукциона закрытия (Closing Auction Session) и опубликованная The Stock Exchange of Hong Kong Limited на официальном сайте The Stock Exchange of Hong Kong Limited (<https://www.hkex.com.hk/>). В случае отсутствия на дату определения значения БА цены закрытия, рассчитываемой биржей The Stock Exchange of Hong Kong Limited по итогам аукциона закрытия в валюте БА, опубликованной The Stock Exchange of Hong Kong Limited на официальном сайте The Stock Exchange of Hong Kong Limited, значение БА определяется как ближайшая предшествующая цена закрытия, рассчитанная биржей The Stock Exchange of Hong Kong Limited в валюте БА по итогам аукциона закрытия и опубликованная The Stock Exchange of Hong Kong Limited на официальном сайте The Stock Exchange of Hong Kong Limited.

Дата определения значения БА в соответствии с настоящим пунктом Спецификации исчисляется в соответствии с временем, применяемым The Stock Exchange of Hong Kong Limited, исходя из правил данной биржи.

Порядок определения значения БА, предусмотренный настоящим подпунктом Спецификации, применяется для определения значения БА в течение срока действия Контракта на соответствующую дату: для определения Начального значения БА, для определения значения БА в Дату исполнения Контракта, Даты фиксации (расчётные даты) Контракта. При этом Начальное значение БА Контракта определяется в валюте соответствующего БА как значение соответствующего БА Контракта на Дату определения параметров умноженное на значение, указанное в Поручении.

- 4.10.4. Для БА, у которого в Поручении в качестве биржи для определения значения БА указана биржа Borsa Italiana: цена закрытия (Closing price), рассчитываемая биржей Borsa Italiana в валюте БА на дату определения значения БА по итогам аукциона закрытия (Closing Auction) и опубликованная Borsa Italiana на официальном сайте Borsa Italiana (<http://www.borsaitaliana.it>). В случае отсутствия на дату определения значения БА цены закрытия, рассчитываемой биржей Borsa Italiana по итогам аукциона закрытия в валюте БА, опубликованной Borsa Italiana на официальном сайте Borsa Italiana, значение БА определяется как ближайшая предшествующая цена закрытия, рассчитанная биржей Borsa Italiana в валюте БА по итогам аукциона закрытия и опубликованная Borsa Italiana на официальном сайте Borsa Italiana.

Дата определения значения БА в соответствии с настоящим пунктом Спецификации исчисляется в соответствии с временем, применяемым Borsa Italiana, исходя из правил данной биржи.

Порядок определения значения БА, предусмотренный настоящим подпунктом Спецификации, применяется для определения значения БА в течение срока действия Контракта на соответствующую дату: для определения

Начального значения БА, для определения значения БА в Дату исполнения Контракта, Даты фиксации (расчётные даты) Контракта. При этом Начальное значение БА Контракта определяется в валюте соответствующего БА как значение соответствующего БА Контракта на Дату определения параметров умноженное на значение, указанное в Поручении.

4.10.5. Для БА, у которого в Поручении в качестве биржи для определения значения БА указана биржа Euronext Paris: цена закрытия (Closing price), рассчитываемая биржей Euronext Paris в валюте БА на дату определения значения БА по итогам аукциона закрытия (Closing Auction) и опубликованная Euronext Paris на официальном сайте Euronext Paris (<https://www.euronext.com/>). В случае отсутствия на дату определения значения БА цены закрытия, рассчитываемой биржей Euronext Paris по итогам аукциона закрытия в валюте БА, опубликованной Euronext Paris на официальном сайте Euronext Paris, значение БА определяется как ближайшая предшествующая цена закрытия, рассчитанная биржей Euronext Paris в валюте БА по итогам аукциона закрытия и опубликованная Euronext Paris на официальном сайте Euronext Paris.

Дата определения значения БА в соответствии с настоящим пунктом Спецификации исчисляется в соответствии с временем, применяемым Euronext Paris, исходя из правил данной биржи.

Порядок определения значения БА, предусмотренный настоящим подпунктом Спецификации, применяется для определения значения БА в течение срока действия Контракта на соответствующую дату: для определения Начального значения БА, для определения значения БА в Дату исполнения Контракта, Даты фиксации (расчётные даты) Контракта. При этом Начальное значение БА Контракта определяется в валюте соответствующего БА как значение соответствующего БА Контракта на Дату определения параметров умноженное на значение, указанное в Поручении.

4.10.6. Для БА, у которого в Поручении в качестве биржи для определения значения БА указана биржа London Stock Exchange plc.: цена закрытия (Closing price), рассчитываемая биржей London Stock Exchange plc. в валюте БА на дату определения значения БА по итогам аукциона закрытия (Closing Auction) и опубликованная London Stock Exchange plc. на официальном сайте London Stock Exchange plc. (<http://www.londonstockexchange.com/>). В случае отсутствия на дату определения значения БА цены закрытия, рассчитываемой биржей London Stock Exchange plc. по итогам аукциона закрытия в валюте БА, опубликованной London Stock Exchange plc. на официальном сайте London Stock Exchange plc., значение БА определяется как ближайшая предшествующая цена закрытия, рассчитанная биржей London Stock Exchange plc. в валюте БА по итогам аукциона закрытия и опубликованная London Stock Exchange plc. на официальном сайте London Stock Exchange plc.

Дата определения значения БА в соответствии с настоящим пунктом Спецификации исчисляется в соответствии с временем, применяемым London Stock Exchange plc., исходя из правил данной биржи.

Порядок определения значения БА, предусмотренный настоящим подпунктом Спецификации, применяется для определения значения БА в течение срока действия Контракта на соответствующую дату: для определения Начального значения БА, для определения значения БА в Дату исполнения Контракта, Даты фиксации (расчётные даты) Контракта. При этом Начальное значение БА Контракта определяется в валюте соответствующего БА как значение соответствующего БА Контракта на Дату определения параметров умноженное на значение, указанное в Поручении.

4.10.7. Для БА, у которого в Поручении в качестве биржи для определения значения БА указана биржа Deutsche Boerse Xetra: официальная цена закрытия (Deutsche Boerse Xetra official closing price), рассчитываемая биржей Deutsche Boerse Xetra в валюте БА на дату определения значения БА по итогам аукциона закрытия (The Deutsche Boerse Xetra Closing Auction) и опубликованная Deutsche Boerse Xetra на официальном сайте Deutsche Boerse Xetra (<http://www.xetra.com/>). В случае отсутствия на дату определения значения БА официальной цены закрытия, в валюте БА, опубликованной Deutsche Boerse Xetra на официальном сайте Deutsche Boerse Xetra, значение БА определяется как ближайшая предшествующая официальная цена закрытия, рассчитанная биржей Deutsche Boerse Xetra в валюте БА по итогам аукциона закрытия и опубликованная Deutsche Boerse Xetra на официальном сайте Deutsche Boerse Xetra.

Дата определения значения БА в соответствии с настоящим пунктом Спецификации исчисляется в соответствии с временем, применяемым биржей Deutsche Boerse Xetra, исходя из правил данной биржи.

Порядок определения значения БА, предусмотренный настоящим подпунктом Спецификации, применяется для определения значения БА в течение срока действия Контракта на соответствующую дату: для определения Начального значения БА, для определения значения БА в Дату исполнения Контракта, Даты фиксации (расчётные даты) Контракта. При этом Начальное значение БА Контракта определяется в валюте соответствующего БА как значение соответствующего БА Контракта на Дату определения параметров умноженное на значение, указанное в Поручении.

4.10.8. Для БА, у которого в Поручении в качестве биржи для определения значения БА указана ПАО Московская Биржа: средневзвешенная цена БА, рассчитываемая ПАО Московская Биржа по результатам торгового дня на основании данных основных торгов в ПАО Московская Биржа на день определения значения БА. В случае если

ПАО Московская Биржа не осуществляло расчет средневзвешенной цены БА на основании данных основных торгов по результатам дня, на который определяется значение БА, то значение БА определяется на основании средневзвешенной цены БА, рассчитанной ПАО Московская Биржа по результатам ближайшего предшествующего торгового дня по отношению ко дню, на который определяется значение БА, на основании данных основных торгов в ПАО Московская Биржа.

Дата определения значения БА в соответствии с настоящим пунктом Спецификации исчисляется в соответствии со временем, применяемым биржей ПАО Московская Биржа, исходя из правил данной биржи.

Порядок определения значения БА, предусмотренный настоящим подпунктом Спецификации, применяется для определения значения БА в Дату исполнения Контракта, Даты фиксации (расчётные даты) Контракта, но не применяется для определения Начального значения БА.

- 4.10.9. Для БА, у которого в Поручении в качестве биржи для определения значения БА указана ПАО Московская Биржа, Начальное значение БА в Дату определения параметров определяется как цена закрытия ценной бумаги, являющейся БА, в Дату определения параметров. Цена закрытия определяется ПАО Московская Биржа согласно Правил проведения торгов по ценным бумагам в ПАО Московская Биржа. В случае если ПАО Московская Биржа не осуществляло расчет цены закрытия БА на основании данных основных торгов по результатам дня, являющегося Датой определения параметров, то значение БА определяется на основании цены закрытия БА, рассчитанной ПАО Московская Биржа по результатам ближайшего предшествующего торгового дня по отношению к Дате определения параметров, на основании данных основных торгов в ПАО Московская Биржа. При этом Начальное значение БА Контракта определяется в валюте соответствующего БА как значение соответствующего БА Контракта на Дату определения параметров умноженное на значение, указанное в Поручении.

Дата определения значения БА в соответствии с настоящим пунктом Спецификации исчисляется в соответствии со временем, применяемым биржей ПАО Московская Биржа, исходя из правил данной биржи.

- 4.11. Исполнение обязательств Держателя по выплате Окончательной расчетной цены Контракта (в рублях Российской Федерации) производится не позднее 2 (двух) рабочих дней, следующих за Датой исполнения Контракта, но только при условии исполнения Подписчиком надлежащим образом обязательства по выплате начальной цены Контракта
- 4.12. 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. 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.
- 5.3. Сторона, виновная в разглашении конфиденциальной информации, возмещает другой Стороне понесенный в связи с этим разглашением ущерб в полном объеме.
- 5.4. Обязательства по Контракту полностью прекращаются в результате надлежащего исполнения Контракта.
- 5.5. Контракт может быть расторгнут Держателем в одностороннем порядке, в том числе в случае неисполнения либо ненадлежащего исполнения Подписчиком обязательств по уплате Начальной цены Контракта (в рублях Российской Федерации).
- 5.6. Контракт не может быть расторгнут Подписчиком в одностороннем порядке.
- 5.7. Ко всем правоотношениям, возникающим из Контракта, в том числе связанным с его подписанием, юридическим действием, исполнением или толкованием, подлежит применению законодательство Российской Федерации.

6. Особые условия

- 6.1. ООО «Компания БКС» вправе вносить изменения и/или дополнения в Спецификацию в соответствии с порядком внесения изменений и дополнений, установленном Регламентом.
- 6.2. Внесение изменений и/или дополнений в Спецификацию 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.