

**Соглашение
о порядке обслуживания на срочном рынке
клиентов Акционерного общества «БКС Банк»**

РАЗДЕЛ 1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1.1 Настоящее Приложение № 3 к Регламенту оказания брокерских услуг Акционерного общества «БКС Банк» содержит существенные условия Соглашения о порядке обслуживания на срочном рынке клиентов Акционерного общества «БКС Банк» (далее – Соглашение).

Предметом настоящего Соглашения является оказание услуг по совершению срочных сделок на основании поручений Клиента в секции срочных сделок (на срочном рынке) соответствующего организатора торговли, а также по заключению на основании поручений Клиента внебиржевых опционных, форвардных договоров (контрактов). Оказание услуг по настоящему Соглашению производится по срочным контрактам, базовым активом которых являются эмиссионные ценные бумаги, валюта, товары, фондовые сводные индексы и другие виды активов в соответствии с нормативными правовыми актами Российской Федерации.

1.2 Условия, зафиксированные в настоящем Соглашении, вступают в силу в составе Договора об оказании брокерских услуг, заключенного с Клиентом. Одностороннее расторжение настоящего Соглашения (отказ) по инициативе Клиента признается Сторонами односторонним расторжением Договора (отказом Клиента от Договора).

С момента заключения настоящего Соглашения все Активы Клиента, в том числе, ценные бумаги и денежные средства, принадлежащие Клиенту и/или приобретаемые/получаемые Брокером для Клиента, в результате совершения сделок, в том числе сделок с ценными бумагами, срочных сделок, являются предоставленными в обеспечение выполнения Клиентом обязательств, которые возникают в связи с заключением Брокером по поручению Клиента срочных сделок, обязательств по выплате Клиентом Брокеру вознаграждения и расходов.

1.3. Особенности обслуживания в секции срочных сделок каждой Биржи определяются в соответствии с Правилами соответствующей Биржи, опубликованными по соответствующим ссылкам.

- Публичное акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС» (ПАО Московская Биржа) - <https://www.moex.com/> ;

1.4. При совершении сделок на срочном рынке Брокер и Клиент руководствуются Правилами Биржи и Клиринговой организации (Клирингового центра), настоящим Соглашением.

1.4. Клиент настоящим подтверждает факт его ознакомления в полном объеме с действующими Правилами, Спецификациями срочных контрактов Биржи.

1.5. Все термины и определения используются в понятии, указанном в настоящем Соглашении, в Регламенте, Правилах ТС.

1.6. **Биржа** - организатор торговли, обеспечивающий оказание услуг по заключению срочных сделок на основании лицензий, выданных уполномоченным органом.

1.7. **Правила ТС, Правила** – правила совершения срочных сделок в секции срочных сделок, правила торговли, условия сделок, заключаемых с Клиринговой организацией, правила клиринга, а также иные внутренние документы, решения Дирекции, Совета директоров и иных уполномоченных органов и должностных лиц Биржи или Клиринговой организации (Клирингового центра), принятые по вопросам организации торгов в секции срочных сделок (на срочном рынке), в том числе устанавливающие принципы и алгоритм расчета гарантийного обеспечения.

1.8. **Срочный контракт** – фьючерсный контракт (фьючерс) или опционный контракт (опцион), допущенный в установленном Правилами порядке к обращению на Бирже, а также форвардный, опционный контракт, заключаемый на внебиржевом срочном рынке (внебиржевой опционный контракт, внебиржевой форвардный контракт).

1.9. **Спецификация** – документ, совместно, в том числе, с Правилами Биржи определяющий все существенные условия биржевой срочной сделки и порядок ее исполнения.

1.10. **Позиция (открытая позиция)** – (1) учетная запись в разделе регистра учета открытых позиций Клиринговой организацией (Клирингового центра), выражающая совокупность прав и обязанностей данного Клиента, возникших в результате совершения на основании его поручений срочных сделок (2) совокупность прав и обязанностей данного Клиента, возникших в результате совершения на основании его поручений внебиржевых опционных, форвардных контрактов (для внебиржевых опционных, форвардных контрактов).

1.11. **Вариационная маржа** - денежные средства, обязанность уплаты которых возникает у одной из сторон фьючерсного (опционного) контракта, за исключением внебиржевого опционного, форвардного контракта, в результате изменения текущей рыночной цены (текущего значения) базового актива или цены фьючерсного (опционного) контракта.

1.12. **Гарантийное обеспечение** - активы Клиента, требуемые для обеспечения всех его открытых позиций по срочным сделкам (за исключением внебиржевых опционных, форвардных контрактов) и активных заявок.

1.13. **Доля ликвидных средств гарантийного обеспечения** - отношение денежной части гарантийного обеспечения к его общей величине.

1.14. **Клиентский счет** – совокупность данных учетных регистров (счетов внутреннего учета), которые ведет Брокер во внутреннем учете, в связи с отдельным договором на оказание брокерских услуг, содержащих совокупность данных об Активах Клиента, внесенных Клиентом в качестве средств

гарантийного обеспечения, а также прав и обязательств по совершенным срочным сделкам за счет Активов Клиента.

1.15. **Сальдо клиентского счета** - сумма Активов Клиента, свободных от любых обязательств, переданных Брокеру для совершения биржевых срочных сделок.

1.16. **Лимит Клиента** – денежные средства и/или ценные бумаги Клиента, зарезервированные Клиентом для совершения срочных сделок на определенной Бирже, либо на внебиржевом срочном рынке.

1.17. **Лимиты колебаний цен сделок** – границы ценового коридора, в рамках которого Брокер может исполнять поручения Клиента на совершение сделок со срочными контрактами, устанавливаются Биржей для каждого (каждой серии) срочного контракта, (лота) в виде максимально допустимого в течение данной торговой сессии отклонения цен сделок от расчетной цены, определенной по итогам предыдущей торговой сессии в соответствии с Правилами Биржи.

1.18. **Ограничения по числу открытых позиций** - максимально допустимое количество позиций по срочному контракту (набору срочных контрактов), установленное Биржей в Спецификации или Клиринговой организацией (Клиринговым центром) в Правилах.

1.19. **Торговый день** - период времени, в течение которого Биржа предоставляет возможность заключения срочных контрактов в соответствии с Правилами.

1.20. **Текущая вариационная маржа** – вариационная маржа, рассчитываемая по формуле:

$TBM = VMo + VMt$, где

TBM - текущая вариационная маржа (сумма денежных средств, рассчитываемая брокером в течение торгового дня в отношении позиций Клиента по фьючерсным (маржируемым опционным) контрактам);

VMo – текущая вариационная маржа по фьючерсным (маржируемым опционным) контрактам, по которым расчет вариационной маржи Клиринговым центром не осуществлялся к моменту расчета указанной текущей вариационной маржи, которая определяется по формуле:

$VMo = t_1 * ((CT_1 - C_1) * W_1 / R_1) + t_2 * ((CT_2 - C_2) * W_2 / R_2) + \dots + t_n * ((CT_n - C_n) * W_n / R_n)$, где

t_1, t_2, \dots, t_n – количество соответствующих фьючерсных (маржируемых опционных) контрактов;

CT_1, CT_2, \dots, CT_n – текущая цена соответствующего фьючерсного (маржируемого опционного) контракта (цена, зафиксированная в торговой системе последней к моменту расчета текущей вариационной маржи);

C_1, C_2, \dots, C_n – цена заключения фьючерсного (маржируемого опционного) контракта;

W_1, W_2, \dots, W_n – стоимость минимального шага цены соответствующего фьючерсного (маржируемого опционного) контракта, руб.;

R_1, R_2, \dots, R_n – минимальный шаг цены соответствующего фьючерсного (маржируемого опционного) контракта.

VMt – текущая вариационная маржа по фьючерсным (маржируемым опционным) контрактам, по которым расчет вариационной маржи Клиринговым центром осуществлялся к моменту расчета указанной текущей вариационной маржи, которая определяется по формуле:

$VMt = t_1 * ((CT_1 - PC_1) * W_1 / R_1) + t_2 * ((CT_2 - PC_2) * W_2 / R_2) + \dots + t_n * ((CT_n - PC_n) * W_n / R_n)$, где

t_1, t_2, \dots, t_n – количество соответствующих фьючерсных (маржируемых опционных) контрактов;

CT_1, CT_2, \dots, CT_n – текущая цена соответствующего фьючерсного (маржируемого опционного) контракта (цена, зафиксированная в торговой системе последней к моменту расчета текущей вариационной маржи);

PC_1, PC_2, \dots, PC_n – Расчетная цена соответствующего фьючерсного (маржируемого опционного) контракта, определенная по итогам Расчетного периода, последнего по отношению к моменту расчета текущей вариационной маржи;

W_1, W_2, \dots, W_n – стоимость минимального шага цены соответствующего фьючерсного (маржируемого опционного) контракта, руб.;

R_1, R_2, \dots, R_n – минимальный шаг цены соответствующего фьючерсного (маржируемого опционного) контракта.

Расчетная цена фьючерсного (маржируемого опционного) контракта определяется Биржей в порядке и сроки, установленные Правилами. Минимальный шаг цены и стоимость минимального шага цены фьючерсного (маржируемого опционного) контракта определяется согласно положениям Спецификации соответствующего контракта.

1.21. **Активная заявка** - зарегистрированная торговой системой заявка на покупку/продажу срочных контрактов, которая не исполнена полностью и не отозвана, не снята.

1.22. **Лот фьючерсного контракта** – ценные бумаги определенного вида (категории, типа), являющиеся базовым активом фьючерсного контракта, в количестве, установленном Спецификацией соответствующего фьючерсного контракта.

РАЗДЕЛ 2. ПРАВА КЛИЕНТА

2.1. Брокер совершает срочные сделки на соответствующей Бирже на основании следующих типов поручений, получаемых от Клиента:

- купить /продать определенный срочный контракт по текущей цене,
- купить /продать определенный срочный контракт по фиксированной цене,

- купить /продать определенный срочный контракт по цене не выше (не ниже) указанной в случае достижения ценой контракта определенного уровня, указанного в заявке (стоп-лимитированная заявка),
 - исполнить опционный контракт.
- 2.1 Поручение Клиента на куплю-продажу фьючерсных контрактов должно содержать:
- имя (наименование) Клиента,
 - раздел регистра учета позиций Клиента (код Клиента),
 - вид поручения,
 - тип поручения (купить/продать),
 - название контракта и срок исполнения,
 - количество контрактов,
 - требование к цене,
 - контрагент (для адресного поручения),
 - цена условия исполнения заявки (для стоп-лимитированных заявок),
 - срок действия поручения (для стоп-лимитированных заявок).
- 2.2 Поручение Клиента на куплю-продажу, исполнение биржевых опционных контрактов должно содержать:
- имя (наименование) Клиента,
 - раздел регистра учета позиций Клиента (код Клиента),
 - вид поручения (адресное/безадресное/котировочное/встречное),
 - название, тип опциона и срок действия опциона,
 - цена исполнения опциона,
 - тип поручения (купить/продать(исполнить)),
 - количество опционов,
 - размер премии,
 - контрагент (для адресного поручения),
 - цена условия исполнения заявки (для стоп-лимитированных заявок),
 - срок действия поручения (для стоп-лимитированных заявок).
- 2.3. Брокер заключает внебиржевые опционные, форвардные контракты на основании поручений, получаемых от Клиента, в соответствии с условиями, установленными в поручении, при наличии контрагента, согласного заключить внебиржевой срочный контракт на соответствующих условиях. Поручение на заключение внебиржевого опционного, форвардного контракта должно содержать все существенные условия контракта определенного типа, порядок его исполнения, включая обязательства Сторон по внебиржевому опционному, форвардному контракту, порядок их возникновения, изменения и прекращения.
- 2.4. Поручения на совершение срочных сделок должны быть направлены Клиентом с учетом положений п.п.3.3., 3.5, 3.6. настоящего Соглашения, лимитов колебаний цен сделок, а также иных лимитов и ограничений, установленных Биржей или Клиринговой Организацией (Клиринговым центром), уровня сальдо клиентского счета.
- 2.5. Брокер имеет право исполнить определенное количество поручений Клиента путем подачи меньшего или большего количества соответствующих заявок.
- 2.6. Брокер имеет право:
- 2.6.1. не заключать срочную сделку;
- 2.6.2. вправе не принимать к исполнению и/или не исполнять поручение на совершение биржевой, внебиржевой срочной сделки в случае недостаточности активов на клиентском счете Клиента для исполнения указанного поручения, и/или надлежащего исполнения Клиентом обязанности, установленной п.3.3. настоящего Соглашения, и/или выплаты вознаграждения Брокеру, и/или возмещения необходимых расходов Брокеру. В случае недостаточности активов на клиентском счете Клиента для надлежащего исполнения Клиентом обязанности, установленной п.3.3 настоящего Соглашения, Клиент предоставляет Брокеру право не исполнять поручение/поручения Клиента на совершение биржевой, внебиржевой срочной сделки/сделок, в том числе путем снятия соответствующей активной заявки/активных заявок Клиента.

РАЗДЕЛ 3 №. ГАРАНТИЙНОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ

- 3.1. Размер гарантийного обеспечения рассчитывается Брокером по каждой открытой позиции Клиента, активной заявке Клиента самостоятельно с учетом правил соответствующей Биржи, Клиринговой организации (Клирингового центра) и прочих Правил и размера гарантийного обеспечения для позиции по соответствующему срочному контракту, установленного Брокером.
- 3.2. Размер гарантийного обеспечения определяется Брокером до начала торгового дня, определяемого согласно соответствующим Правилам, по результатам торгов предыдущего торгового дня; до возобновления торгов, приостановленных для проведения дневного клирингового сеанса, по результатам дневного клирингового сеанса; после возобновления торгов, приостановленных в случае изменения соответствующей Клиринговой организацией (Клиринговым центром), Биржей значения показателя, используемого при

расчете базового размера гарантийного обеспечения. Брокер также вправе определять размер гарантийного обеспечения в любой момент в течение торгового дня.

3.3. Клиент обязан поддерживать на клиентском счете количество активов, не меньше установленного Брокером размера гарантийного обеспечения для всех позиций, открытых Клиентом, и активных заявок Клиента, и суммы текущей вариационной маржи, рассчитанной в соответствии с п.1.21 настоящего Соглашения и имеющей отрицательное значение, в том числе возникшей в результате осуществления Брокером принудительного закрытия позиций Клиента в соответствии с разделом 5, 6 настоящего Соглашения.

3.4. Средства гарантийного обеспечения могут быть внесены Клиентом как денежными средствами, так и, по согласованию с Брокером, ценными бумагами. Порядок внесения, определения учетной стоимости, видов и размера средств, передаваемых Клиентом в виде денежной и неденежной части гарантийного обеспечения устанавливается Правилами соответствующей Клиринговой организации (Клирингового центра) и/или Биржи и дополнительно согласуется Клиентом с Брокером в каждом конкретном случае. Для резервирования неденежных активов, в том числе их части, в качестве средств гарантийного обеспечения Клиент также должен предоставить Брокеру соответствующее заявление.

3.5. Брокер вправе в одностороннем порядке увеличивать или уменьшать любой момент в течение торгового дня размер гарантийного обеспечения, устанавливаемый соответствующей Клиринговой организацией (Клиринговым центром) или Биржей, без дополнительного уведомления Клиента. Увеличение или уменьшение размера гарантийного обеспечения может осуществляться, в том числе, путем применения соответствующего коэффициента к размеру гарантийного обеспечения, устанавливаемого Клиринговой организацией (Клиринговым центром) или Биржей. Брокер вправе в одностороннем порядке определять, в том числе увеличивать/уменьшать, значение данного коэффициента. Значение указанного коэффициента равно 1 (единице), если иное не установлено дополнительным соглашением с Клиентом либо, в соответствии с настоящим пунктом, Брокером.

3.6. Брокер имеет право без дополнительного уведомления Клиента уменьшить лимит денежных средств Клиента, доступных для работы на Бирже на 10%, в т. ч. в случае:

- возникновения на рынке ситуации, содержащей повышенный риск неисполнения обязательств;
- систематического появления по итогам торгового дня и/или по итогам дневного клирингового сеанса отрицательного сальдо клиентского счета;
- систематического (три и более раз) нарушения Клиентом исполнения п.4.2 настоящего Соглашения;
- систематического переноса Клиентом открытых позиций на следующую торговую сессию и/или на период с момента возобновления торгов, приостановленных для проведения дневного клирингового сеанса, до окончания торговой сессии, в случае, если свободные денежные средства Клиента составляют менее 10% от величины гарантийного обеспечения открытых позиций Клиента.

3.7. Информация о размере гарантийного обеспечения, установленного Брокером по всем открытым позициям Клиента и активным заявкам Клиента в соответствии с настоящим Соглашением и/или дополнительным соглашением Сторон, отражается в системе QUIK. Клиент обязан ежедневно в течение дня, в том числе на начало торгового дня, по результатам дневного клирингового сеанса; по результатам вечернего клирингового сеанса, после возобновления торгов, приостановленных в случае изменения соответствующей Клиринговой организацией (Клиринговым центром), Биржей значения показателя, используемого при расчете базового размера гарантийного обеспечения, самостоятельно отслеживать размер гарантийного обеспечения по всем открытым позициям Клиента и активным заявкам Клиента, установленный Брокером, достаточность активов Клиента для обеспечения указанного размера гарантийного обеспечения. В случае если использование Клиентом системы «QUIK» в целях исполнения обязанности, предусмотренной п.3.7 настоящего Соглашения, невозможно, в том числе при приостановлении исполнения обязательств по Приложению № 5 к Регламенту, Клиент обязан обращаться к Брокеру по телефону для получения вышеуказанной информации. Настоящим Клиент признает, что все последствия, возникшие в результате отсутствия у Клиента вышеуказанной информации несет Клиент и принимает на себя все возникающие в связи с этим риски. В случае нарушения Клиентом обязанности, установленной п.3.7. настоящего Соглашения, и наличия спора с Брокером в связи с исполнением прав и обязанностей Сторон по настоящему Соглашению и /или Регламенту, Клиент не вправе ссылаться на то, что он не знал или не мог знать о размере гарантийного обеспечения по всем открытым позициям Клиента и активным заявкам Клиента, установленного Брокером, достаточности/недостаточности активов Клиента для обеспечения указанного размера гарантийного обеспечения.

РАЗДЕЛ 4. ПОРЯДОК ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ВЗАИМРАСЧЕТОВ

4.1. Брокер производит все необходимые перечисления, связанные с оплатой услуг по настоящему Соглашению, включая уплату биржевого сбора, списание и начисление вариационной маржи без предварительного уведомления Клиента в соответствии с Правилами соответствующей Биржи, Клиринговой организации (Клирингового центра) и условиями настоящего Соглашения.

4.2. В целях снижения рыночных рисков при совершении срочных сделок Клиент обязан внести на свой брокерский счет средства в требуемом размере,

- 4.2.1. если сальдо клиентского счета, с учетом положений п.3.5, п.3.6. настоящего Соглашения, меньше значения гарантийного обеспечения, установленного в соответствии с настоящим Соглашением для всех позиций, открытых Клиентом, и активных заявок Клиента,
- 4.2.2. доля ликвидных средств гарантийного обеспечения не удовлетворяет требованиям, установленным Правилами соответствующей Биржи.
- 4.3. В целях снижения рыночных рисков при совершении срочных сделок Клиент обязан закрыть необходимое количество позиций по срочным контрактам не позднее 30 минут после проведения клирингового сеанса, по итогам которого сальдо клиентского счета с учетом положений п. 3.5, п.3.6. настоящего Соглашения, меньше значения гарантийного обеспечения, установленного в соответствии с настоящим Соглашением для всех позиций, открытых Клиентом, и активных заявок Клиента, или доля его ликвидных средств гарантийного обеспечения не удовлетворяет требованиям, установленным Правилами соответствующей Биржи или Клиринговой организации (Клирингового центра).
- 4.4. В случае приостановления торгов организатором торговли на основании и в порядке, установленном Правилами, нормативными правовыми актами Российской Федерации, за исключением приостановления торгов, осуществленного в целях проведения клиринговой сессии, и нарушения Клиентом, после возобновления данных торгов, п. 3.3 настоящего Соглашения, Клиент обязан в целях устранения указанного нарушения незамедлительно закрыть необходимое количество позиций по срочным контрактам.
- 4.5. Клиент обязан самостоятельно отслеживать состояние своего клиентского счета и своевременно принимать необходимые меры для поддержания на клиентском счете достаточного количества активов, то есть для соблюдения Клиентом обязанностей, предусмотренных, в том числе, п.п.3.3., 4.2.-4.4. настоящего Соглашения.
- 4.6. Брокер уведомляет Клиента о необходимости исполнения обязательств, установленных в п.п. 4.2.-4.4 настоящего Соглашения, а также о возможном принудительном закрытии позиций Клиента посредством направления сообщения одним из следующих способов по своему усмотрению: через систему «QUIK», по электронной почте, указанной в анкете Клиента, по телефону, и/или иными дополнительными способами, которые могут быть согласованы Клиентом и Брокером. Клиент считается уведомленным с момента направления Брокером сообщения Клиенту.
- 4.7. В случае направления Клиентом поручения на возврат (вывод) либо на перевод средств, Брокер в целях сохранения значения гарантийного обеспечения имеет право на свое усмотрение отклонить такое поручение целиком, либо исполнить его частично таким образом, чтобы обеспечить наличие на клиентском счете надлежащий размер гарантийного обеспечения, установленный в соответствии с настоящим Соглашением.
- 4.8. Настоящим Брокер уведомляет Клиента о возможном внесении изменений в Правила соответствующей Биржи или Клиринговой организации (Клирингового центра), в Спецификации срочных контрактов Биржи. С целью обеспечения гарантированного ознакомления Клиента до вступления в силу изменений в Правила, в Спецификации срочных контрактов Биржи настоящим Соглашением установлена обязанность Клиента не реже одного раза в неделю самостоятельно или через уполномоченных лиц обращаться по ссылкам, предусмотренным п.1.3. настоящего Соглашения, за сведениями об изменениях, произведенных в Правилах соответствующей Биржи или Клиринговой организации (Клирингового центра), Спецификациях срочных контрактов Биржи.

РАЗДЕЛ 5. УСЛОВИЯ ПРИНУДИТЕЛЬНОГО ЗАКРЫТИЯ ПОЗИЦИЙ

- 5.1. Если Клиент не исполняет и/или ненадлежащим образом исполняет п.п. 3.3., 4.2.-4.4. настоящего Соглашения, с учетом положений п.п. 3.5, 3.6. настоящего Соглашения, Брокер вправе без поручения Клиента закрыть все позиции Клиента или часть позиций Клиента по текущим ценам Биржи, в объеме, необходимом для покрытия задолженности, обязательств Клиента, включая обязательства Клиента по уплате вариационной маржи по сделкам, заключенным Брокером в соответствии с разделом 5 настоящего Соглашения, с учетом положений п.п. 3.5, 3.6. настоящего Соглашения, установленного Брокером в соответствии с настоящим Соглашением размера гарантийного обеспечения для всех позиций, открытых Клиентом, и активных заявок Клиента;
- 5.2. Брокер вправе без поручения Клиента закрыть часть позиций Клиента, если Клиент нарушает установленные Биржей ограничения по числу открытых позиций.
- 5.3. При принудительном закрытии позиций Клиента Брокер не несет ответственности за любые убытки, причиненные Клиенту данными действиями.
- 5.4. Брокер вправе по своему усмотрению не реализовывать полномочия, установленные настоящим разделом Соглашения

РАЗДЕЛ 6. ПОРЯДОК ЗАКЛЮЧЕНИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ ФОРВАРДНЫХ КОНТРАКТОВ, ВНЕБИРЖЕВЫХ ОПЦИОННЫХ КОНТРАКТОВ

- 6.1. Настоящий раздел Соглашения определяет условия, на которых Брокер принимает поручения Клиента на заключение на внебиржевом срочном рынке форвардных контрактов (далее – форвардный контракт, форвардные контракты), а также на заключение опционных договоров (контрактов) (далее по

тексту настоящего раздела Соглашения – опционный контракт (внебиржевой опционный контракт), опционные контракты) от имени Брокера и за счет Клиента, с учетом условий настоящего раздела Соглашения.

6.2. Клиент обязан обеспечить наличие на брокерском счете, с учетом положений настоящего Соглашения, денежных средств, свободных от любых обязательств, в размере, достаточном для исполнения Брокером поручения Клиента на заключение внебиржевого опционного контракта, форвардного контракта, в том числе, обязательств по выплате начальной вариационной маржи (начальной цены контракта), премии, а также для выплаты в полном объеме вознаграждения Брокера.

6.3. Брокер вправе не принимать к исполнению и/или не исполнять поручение на заключение внебиржевого опционного контракта, форвардного контракта, в случае если на момент подачи Клиентом Брокеру указанного поручения, учитывающихся на брокерском счете Клиента денежных средств, свободных от любых обязательств, недостаточно для исполнения указанного поручения, в том числе, для выплаты начальной вариационной маржи (начальной цены контракта), премии, и/или для выплаты в полном объеме вознаграждения Брокера.

6.4. Клиент вправе направить Брокеру поручение на заключение форвардного контракта или опционного контракта в виде оригинала документа, либо, при наличии технической возможности, с использованием системы «QUIK», при соблюдении требований, установленных Регламентом и Приложениями к нему.

6.5. Процедура принудительного закрытия позиций по внебиржевым опционным контрактам, форвардным контрактам не предусмотрена.

6.6. Направляя поручение на заключение форвардного контракта или опционного контракта, Клиент тем самым подтверждает:

6.6.1. что о рисках, описанных в Декларации о рисках, связанных с инвестированием на финансовом рынке (Приложение № 6а к Регламенту), в Декларации о рисках, связанных с заключением договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются ценные бумаги иностранных эмитентов или индексы, рассчитанные по таким ценным бумагам (Приложение № 6в к Регламенту), ознакомлен;

6.6.2. что он полностью осознает тот факт, что инвестирование в форвардные контракты и/или опционные контракты (производные финансовые инструменты) связано с различными ценовыми, рыночными, валютными, кредитными, операционными, техническими, налоговыми, правовыми, системными рисками, а также с риском потери ликвидности и риском эмитента;

6.6.3. что с рисками, связанными с заключением форвардного контракта и опционного контракта ознакомлен, в том числе уведомлен о возможности неполучения прибыли и/или базисного актива по форвардному контракту и/или опционному контракту, о возможности возникновения убытков для Клиента в связи с неблагоприятным для Клиента изменением значений базисного актива форвардного (опционного) контракта и (или) наступлением обстоятельства, являющегося базисным активом форвардного (опционного) контракта;

6.6.4. свое понимание и согласие с тем, что Брокер не несет ответственности в случаях, предусмотренных п.п. 6.9. – 6.11. настоящего Соглашения;

6.7. Направляя поручение на заключение форвардного (опционного) контракта с расчетами в иностранной валюте, Клиент тем самым подтверждает, что он ознакомлен с содержанием нормативно-правовых актов, устанавливающих требования к совершению сделок покупки-продажи иностранной валюты и проведению иных операций с иностранной валютой (далее – валютное законодательство Российской Федерации), ознакомлен с мерами ответственности за нарушение требований валютного законодательства Российской Федерации, обязуется соблюдать требования валютного законодательства Российской Федерации, а также подтверждает, что самостоятельно несет полную ответственность за соблюдение указанных требований.

6.8. Направляя поручение на заключение форвардного (опционного) контракта, базисным активом которого являются иностранные ценные бумаги, Клиент тем самым подтверждает, (1) что он понимает сущность и правовую природу данных ценных бумаг, (2) что он ознакомлен с документами, регулирующими порядок эмиссии и обращения данного базисного актива, (3) что он понимает, что информация об указанных ценных бумагах может быть представлена на языке, которым Клиент не владеет, и что Клиент самостоятельно несет все расходы, понесенные Клиентом, не владеющим или недостаточно владеющим языком, на котором представлена информация в документах, регулирующими порядок эмиссии и обращения базисного актива, для перевода данной информации на родной язык Клиента или на язык, которым он владеет.

6.9. Брокер не несет ответственности за возможные убытки Клиента в результате заключения по поручению Клиента внебиржевого опционного контракта и (или) форвардного контракта, в том числе за убытки Клиента, связанные с неблагоприятным для Клиента изменением значений базисного актива соответствующего контракта, и (или) наступлением обстоятельства, являющегося базисным активом форвардного (опционного) контракта, за возможные убытки Клиента в результате невозможности заключения Брокером форвардного контракта и (или) опционного контракта по поручению Клиента, либо в результате расторжения внебиржевого опционного контракта, форвардного контракта, в том числе в

одностороннем порядке по заявлению другой стороны по соответственно опционному контракту, форвардному контракту.

6.10. Брокер не несет ответственности за любые корпоративные события, дефолты, банкротство и неплатежеспособность эмитентов базисных активов, в том числе те, которые прямо или косвенно могут повлечь убытки, в связи с проведением расчетов по форвардному (опционному) контракту, заключенному Брокером в интересах и за счет Клиента на основании поручения Клиента.

6.11. В случае указания Клиентом в поручении на заключение форвардного контракта или опционного контракта на использование определенной информационной системы (например, информационной системы «Блумберг» (Bloomberg)) для определения обязательств по форвардному (опционному) контракту, Брокер не несет ответственности за содержание, неполноту, недостоверность, несвоевременное обновление информации в такой информационной системе, а также последствия использования данной информации, Брокер не несет ответственности за какие-либо убытки, связанные с использованием или невозможностью использования соответствующей информационной системы, в том числе в связи с возникновением неисправностей и отказов оборудования, обновлений, сбоев и ошибок в работе указанной Клиентом в поручении информационной системы и/или сети Интернет. Брокер не несет ответственности за инвестиционные решения, принятые Клиентом (уполномоченным лицом Клиента) на основе информации о базисном активе из информационной системы.

6.12. Направление Клиентом Брокеру поручения на заключение форвардного контракта или опционного контракта с указанием на использование определенной информационной системы для определения обязательств по форвардному (опционному) контракту, означает признание Клиентом распечатки (выписки) из указанной информационной системы, подписанной уполномоченным лицом Брокера и/или уполномоченным лицом владельца информационной системы (обладателя исключительных прав на информацию, опубликованную в указанной информационной системе), в качестве достаточного доказательства определенного размера цены (значения) базисного актива на дату определения значения базисного актива, иных параметров базисного актива, пригодного для предъявления при разрешении споров, в том числе в суде.

6.13. Подача Клиентом поручения на заключение Брокером внебиржевого опционного контракта, форвардного контракта означает согласие Клиента с условиями подачи поручения и заключения соответствующего внебиржевого опционного контракта, форвардного контракта, предусмотренными настоящим Соглашением.

6.14. В случае если ценные бумаги, являющиеся базисным активом внебиржевого опционного контракта/форвардного контракта (базисным активом *i* внебиржевого опционного контракта/форвардного контракта), перестают обращаться на бирже, указанной поручении Клиента на заключение соответствующего опционного контракта/форвардного контракта (далее - Поручение) в качестве биржи для определения значения базисного актива (базисного актива *i*), для данного базисного актива (базисного актива *i*) значение базисного актива (базисного актива *i*) определяется по правилам определения значения базисного актива (базисного актива *i*), предусмотренных Поручением и опционным контрактом (форвардным контрактом), на основании соответствующей цены, рассчитанной (определенной) любой иной биржей (организатором торговли) по усмотрению контрагента по опционному (форвардному) контракту. В случае если указанные правила расчета не применимы для расчета в отношении биржи (организатора торговли), выбранного по усмотрению контрагента по опционному (форвардному) контракту, то стороны опционного (форвардного) контракта согласовывают порядок определения значения базисного актива (базисного актива *i*) для данного базисного актива (базисного актива *i*), действуя разумно, добросовестно и коммерчески обоснованно, в соответствии с действительной общей волей сторон, сущностью и целью опционного (форвардного) контракта.

6.15. В случае если в отношении ценных бумаг, являющихся базисным активом внебиржевого опционного контракта/форвардного контракта (базисным активом *i* внебиржевого опционного контракта/форвардного контракта), произошло в период с даты заключения соответствующего контракта до даты исполнения контракта (включительно) любое из следующих событий (далее - Событие): конвертация указанных ценных бумаг, дробление указанных ценных бумаг, консолидация указанных ценных бумаг, иное корпоративное событие (включая слияние, поглощение, выделение в отношении эмитента базисного актива), в результате которого владелец указанных ценных бумаг становится владельцем иных ценных бумаг (и/или иностранных финансовых инструментов, не квалифицированных в качестве ценных бумаг), либо корзины ценных бумаг (и/или иностранных финансовых инструментов, не квалифицированных в качестве ценных бумаг) (далее - Иные ценные бумаги) в целях определения значения базисного актива (базисного актива *i*) применяются следующие условия:

6.15.1. базисный актив (базисный актив *i*) подлежит замене на Иные ценные бумаги, и

6.15.2. значение базисного актива (базисного актива *i*) определяется по правилам определения значения базисного актива (базисного актива *i*), установленных Поручением, опционным контрактом (форвардным контрактом) и настоящим Соглашением, но в отношении Иных ценных бумаг, полагающихся владельцу одной ценной бумаги, являющейся указанным базисным активом (базисным активом *i*), и условиями соответствующего События (включая, но не ограничиваясь, подлежащие применению коэффициенты), с

учетом количества указанных Иных ценных бумаг и условий соответствующего События (далее – значение (цена) Иных ценных бумаг), и

6.15.3. в случае если валюта Иных ценных бумаг не совпадает с валютой базисного актива (базисного актива i) для определения значения (цены) Иных ценных бумаг в валюте базисного актива (базисного актива i) используется курс, рассчитанный следующим образом:

как отношение объявленного Центральным Банком РФ на дату определения значения базисного актива (базисного актива i) официального курса валюты базисного актива (базисного актива i) по отношению к рублю РФ, опубликованному на сайте Центрального Банка РФ <http://www.cbr.ru>, к объявленному Центральным Банком РФ на эту же дату официальному курсу валюты Иных ценных бумаг по отношению к рублю РФ, опубликованному на сайте Центрального Банка РФ <http://www.cbr.ru>. При этом если валюта Иных ценных бумаг или валюта базисного актива (базисного актива i) – рубль РФ, то в целях расчета под официальным курсом валюты Иных ценных бумаг (курса валюты базисного актива (базисного актива i)) по отношению к рублю РФ понимается 1 (единица).

6.16. Пункты 6.14. – 6.15. настоящего Соглашения (включая все входящие в них подпункты) подлежат применению, если иное не предусмотрено Поручением.

РАЗДЕЛ 7. ОСОБЕННОСТИ ПОРЯДКА ИСПОЛНЕНИЯ ПОСТАВОЧНЫХ СРОЧНЫХ КОНТРАКТОВ

7.1. В случае заключения Клиентом поставочного фьючерсного контракта, предусматривающего поставку базового актива путем заключения сделки в торговой системе ПАО Московская Биржа (фондовый рынок и рынок депозитов) в соответствии с Правилами ТС, Спецификацией данного контракта (далее – фьючерсный контракт T+), иного срочного контракта, базовым активом которого является поставочный фьючерсный контракт T+ (далее именуемые - поставочный срочный контракт T+), Клиент обязан обеспечить возможность исполнения такого контракта, в том числе быть зарегистрированным в торговой системе ПАО Московская Биржа (фондовый рынок и рынок депозитов) не позднее дня, являющегося последним днем обращения (заключения) такого срочного контракта.

7.2. В случае заключения Клиентом поставочного фьючерсного контракта T+, базовым активом которого являются ценные бумаги, не входящие в Перечень ликвидных ценных бумаг Брокера, не позднее, чем за 3 (Три) часа до окончания торгового дня Биржи, являющегося последним днем обращения (заключения) данного срочного контракта, Клиент, имеющий открытые позиции по такому контракту, вправе предоставить Брокеру с использованием способов обмена сообщениями, предусмотренных Регламентом, уведомление о возможности исполнения такого контракта (далее - Уведомление о поставке). Уведомление о поставке является поручением Клиента на заключение Брокером на условиях, установленных Правилами ТС и Спецификацией, сделок в целях исполнения указанного поставочного фьючерсного контракта T+.

Настоящим Клиент предоставляет Брокеру право отказать в исполнении указанного поручения и не осуществлять исполнение поставочного фьючерсного контракта T+, в случае отсутствия, на момент рассмотрения Брокером Уведомления о поставке, активов Клиента, зарезервированных для совершения, исполнения сделок в торговой системе ПАО Московская Биржа (фондовый рынок и рынок депозитов), свободных от любых обязательств в размере, необходимом для исполнения сделок, заключаемых в целях исполнения данного поставочного фьючерсного контракта T+. В указанном случае Клиент, имеющий открытую позицию по такому поставочному фьючерсному контракту T+, обязуется закрыть позицию по данному срочному контракту не позднее чем за 3 (Три) часа до окончания торгового дня, являющегося последним днем обращения (заключения) указанного контракта.

Не направляя Уведомления о поставке, Клиент тем самым подтверждает отсутствие у него намерения и возможности исполнения такого срочного контракта согласно Правилам и Спецификации. Отсутствие Уведомления о поставке рассматривается Брокером как обязательство Клиента закрыть все позиции по поставочному фьючерсному контракту T+, базовым активом которого являются ценные бумаги, не входящие в Перечень ликвидных ценных бумаг Брокера, не позднее чем за 3 (Три) часа до окончания торгового дня, являющегося последним днем обращения (заключения) данного контракта.

7.3. Клиент настоящим предоставляет Брокеру право заключить в последний день обращения (заключения) поставочного срочного контракта T+, базовым активом которого являются ценные бумаги, не входящие в Перечень ликвидных ценных бумаг брокера, либо базовым активом которого является поставочный фьючерсный контракт T+ на ценные бумаги, не входящие в Перечень ликвидных ценных бумаг брокера, но не ранее чем за 3 (Три) часа до окончания указанного дня, срочную сделку (сделки), направленные на закрытие позиции по данному поставочному срочному контракту T+, по текущим рыночным ценам, в случае если:

- по состоянию на начало последнего дня обращения указанного срочного контракта Клиент имеет открытую позицию (позиции) по данному контракту (и/или открыл позицию (позиции) по данному контракту в последний день обращения контракта) и Брокером не получено Уведомление о поставке в отношении указанного поставочного фьючерсного контракта (контрактов) T+ / поручение на исполнение опционного контракта в соответствии с п. 7.4 настоящего Соглашения, либо

- по состоянию на начало последнего дня обращения такого срочного контракта Клиент имеет открытую позицию (позиции) по данному контракту (и/или открыл позицию (позиции) по данному контракту в последний день обращения контракта) и Брокер в соответствии с п. 7.2 настоящего Соглашения отказал в исполнении Уведомления о поставке в отношении указанного поставочного срочного контракта (контрактов) T+, либо

- по состоянию на начало последнего дня обращения такого срочного контракта Клиент имеет открытую позицию (позиции) по данному контракту (и/или открыл позицию (позиции) по данному контракту в последний день обращения контракта) и Брокер в соответствии с п. 7.4 настоящего Соглашения отказал в исполнении поручение на исполнение опционного контракта в отношении указанного поставочного срочного контракта (контрактов) T+.

9.4. В случае заключения Клиентом опционного контракта, базовым активом которого является поставочный фьючерсный контракт T+ на ценные бумаги, не входящие в Перечень ликвидных ценных бумаг брокера, не позднее, чем за 3 (Три) часа до окончания торгового дня Биржи, являющегося последним днем обращения (заключения) данного опционного контракта, Клиент, имеющий открытые позиции по такому контракту, вправе предоставить Брокеру поручение на исполнение данного опционного контракта. Указанное поручение на исполнение опционного контракта является поручением Клиента на заключение Брокером на условиях, установленных Правилами ТС и Спецификацией, сделок в целях исполнения указанного контракта.

Настоящим Клиент предоставляет Брокеру право не принимать и/или отказать в исполнении указанного поручения на исполнение опционного контракта и не осуществлять исполнение опционного контракта, базовым активом которого является поставочный фьючерсный контракт T+ на ценные бумаги, не входящие в Перечень ликвидных ценных бумаг брокера, в случае отсутствия, на момент рассмотрения Брокером поручения на исполнение данного опционного контракта, активов Клиента, зарезервированных для совершения, исполнения сделок в торговой системе ПАО Московская Биржа (фондовый рынок и рынок депозитов), свободных от любых обязательств в размере, необходимом для исполнения сделок, заключаемых в целях исполнения поставочного фьючерсного контракта T+, являющегося базовым активом данного опционного контракта. В указанном случае Клиент, имеющий открытую позицию по такому опционному контракту, обязуется закрыть позицию по данному срочному контракту не позднее чем за 3 часа до окончания торгового дня, являющегося последним днем обращения (заключения) указанного контракта.

Не направляя в соответствии с настоящим пунктом Соглашения поручения на исполнение опционного контракта, указанного в настоящем пункте Соглашения, Клиент тем самым подтверждает отсутствие у него намерения и возможности исполнения такого срочного контракта согласно Правилам ТС и Спецификации. Отсутствие поручения на исполнение опционного контракта, базовым активом которого является поставочный фьючерсный контракт T+ на ценные бумаги, не входящие в Перечень ликвидных ценных бумаг Брокера, рассматривается Брокером как обязательство Клиента закрыть все позиции по такому контракту не позднее чем за 3 (Три) часа до окончания торгового дня, являющегося последним днем обращения (заключения) контракта.

7.5. Поручение Клиента на заключение поставочного фьючерсного контракта T+ (за исключением поставочного срочного контракта T+, базовым активом которого являются ценные бумаги, не входящие в Перечень ликвидных ценных бумаг брокера) одновременно является поручением Клиента на заключение Брокером сделок в соответствии с Правилами ТС, Спецификацией в целях исполнения обязательств по поставке по данному срочному контракту, в случае не наступления условий, предусмотренных настоящим Соглашением, влекущих прекращение обязательств по такому срочному контракту.

Поручение Клиента на заключение поставочного срочного контракта T+, базовым активом которого являются ценные бумаги, не входящие в Перечень ликвидных ценных бумаг брокера, одновременно является условным поручением Клиента на заключение Брокером сделок, предусмотренных п. 7.3 настоящего Соглашения, в случаях предусмотренных п. 7.3. настоящего Соглашения, и является поданным в дату наступления соответствующего условия.

Поручение Клиента на заключение срочного контракта, базовым активом которого является поставочный фьючерсный контракт T+ (за исключением поставочного срочного контракта T+, базовым активом которого являются ценные бумаги, не входящие в Перечень ликвидных ценных бумаг брокера), одновременно является условным поручением Клиента на заключение Брокером на условиях, установленных Правилами ТС и Спецификацией, в целях исполнения обязательств по поставке по данному срочному контракту, поставочного фьючерсного контракта T+, а также сделок в целях исполнения указанного поставочного фьючерсного контракта T+, в случае, когда Правилами и/или Спецификацией не предусмотрена необходимость направления для исполнения контракта заявления (требования) об исполнении контракта. Данное условное поручение является поданным в дату наступления соответствующего условия.

7.6. Брокер, в случае неполучения Уведомления о поставке в отношении поставочного фьючерсного контракта T+ в соответствии с п. 7.2 настоящего Соглашения, либо поручения на исполнение опционного контракта в соответствии с п. 7.4 настоящего Соглашения, вправе ограничить возможность подачи клиентом с использованием системы Интернет-трейдинг поручений по соответствующим поставочным срочным

контрактам Т+, не ранее чем за 3 (Три) часа до окончания торгового дня Биржи, являющегося последним днем обращения (заключения) соответствующего срочного контракта. При этом клиент вправе подавать поручения по указанным срочным контрактам с использованием системы Интернет-трейдинг, а также с использованием иных способов обмена сообщениями, акцептованных клиентом, в порядке, установленном Регламентом, в режиме «только закрытие позиций».

7.7. Брокер не несет ответственность за любые убытки, причиненные Клиенту или третьим лицам, за счет которых действует Клиент, исполнением поручения Клиента на заключение каких-либо из сделок, предусмотренных п. 7.3 настоящего Соглашения, согласно соответственно п. 7.3 настоящего Соглашения.

7.8. В случае заключения Клиентом поставочного фьючерсного контракта Т+, базовым активом которого являются облигации федерального займа, не позднее, чем до начала дневного клирингового сеанса (дневной клиринговой сессии) торгового дня Биржи, являющегося последним днем обращения (заключения) данного срочного контракта, Клиент, имеющий открытые короткие позиции по такому контракту, вправе предоставить Брокеру по телефону или с использованием системы Интернет-трейдинг информацию о выпуске облигаций, который необходимо использовать при исполнении обязательства по поставке (далее - Уведомление о выборе базового актива для поставки).

Брокер вправе не принимать к исполнению и/или не исполнять Уведомление о выборе базового актива для поставки в отношении поставочных фьючерсных контрактов Т+, указанных в данном Уведомлении о выборе базового актива для поставки, в случае получения Брокером указанного уведомления с нарушением срока и/или способа предоставления уведомления, указанных в абзаце 1 настоящего пункта Соглашения.

Не направляя Уведомления о выборе базового актива для поставки, Клиент, имеющий открытые короткие позиции по поставочному фьючерсному контракту Т+, тем самым подтверждает свое согласие на исполнение поставочного фьючерсного контракта Т+, базовым активом которого являются облигации федерального займа, согласно Правилам и Спецификации в порядке, предусмотренном для случаев не предоставления Клиринговому центру продавцом по такому срочному контракту информации о выпуске облигаций, которая должна быть использована при исполнении обязательства по поставке.

7.9. В случае заключения по поручению и за счет Клиента поставочного фьючерсного контракта, базовым активом которого являются драгоценные металлы, иной товар, допущенный к организованным торгам Биржи, Клиент обязуется не позднее, чем за 2 (два) торговых дня торговой системы ПАО Московская Биржа (Срочный рынок), предшествующих торговому дню торговой системы ПАО Московская Биржа (Срочный рынок), в который производится исполнение такого фьючерсного контракта, по которым у Клиента имеются открытые позиции, самостоятельно подать поручение(-я) на закрытие указанных позиций по указанному фьючерсному контракту, и предоставляет Брокеру право не принимать и/или отказать в исполнении иного поручения Клиента на заключение указанного фьючерсного контракта с надвигающимся сроком исполнения, не являющегося поручением на закрытие позиций Клиента по нему или не являющегося заявкой «Календарный спред».

В случае неисполнения Клиентом обязанности, предусмотренной настоящим пунктом Соглашения, настоящее Соглашение является надлежащим образом поданным поручением Клиента на закрытие всех открытых позиций Клиента по фьючерсному контракту, базовым активом которого являются драгоценные металлы, иной товар, допущенный к организованным торгам Биржи, с надвигающимся сроком исполнения по текущим ценам в период торговой сессии торгового дня торговой системы ПАО Московская Биржа (Срочный рынок), в течение которой ООО «Компания БКС» совершило действия по закрытию позиций Клиента.

РАЗДЕЛ 8. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

6.1. В случае, если по результатам торговой сессии у Клиента есть возражения, обусловленные технической, арифметической или иного рода ошибкой, совершенной не по вине Брокера, Клиент может заявить свои возражения по результатам этой торговой сессии не позднее 10 часов по московскому времени торгового дня, следующего за днем проведения указанной торговой сессии, если более ранний срок не установлен Правилами Биржи или Клиринговой организации (Клирингового центра). Возражения составляются в письменной форме и подписываются Клиентом. Возражения должны содержать изложение причин и существа возникших разногласий. Если Клиент не представил Брокеру возражений по результатам торговой сессии в срок и порядке, установленные в настоящем пункте Соглашения, то Клиент считается безусловно и полностью согласным с результатами данной торговой сессии.

6.2. Брокер не несет ответственности за возможные убытки Клиента в результате заключения по поручению Клиента срочных контрактов, в том числе, внебиржевого, форвардного опционного контракта, в том числе за убытки Клиента, связанные с неблагоприятным для Клиента изменением значений базисного актива, за возможные убытки Клиента в результате невозможности заключения Брокером срочных контрактов, в том числе, внебиржевых опционных, форвардных контрактов по поручению Клиента, либо в результате расторжения срочных контрактов, в том числе, в одностороннем порядке по заявлению другой стороны по срочному контракту.