

Условия совершения Сделок с неполным покрытием

СТАТЬЯ 1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1.1 Настоящие Условия совершения Сделок с неполным покрытием (далее – «Условия» или «настоящие Условия») являются приложением к Регламенту обслуживания Клиентов ООО ИК «Фридом Финанс» (далее – «Регламент обслуживания») и являются его неотъемлемой частью.

1.2 Предметом настоящих Условий являются взаимоотношения между ООО ИК «Фридом Финанс» и Клиентом при совершении Сделок с неполным покрытием с Ценными бумагами и/или иностранной валютой, заключению фьючерсных договоров, а также своп-договоров, указанных в абзаце третьем пункта 5 Указания Банка России от 16 февраля 2015 года № 3565-У "О видах производных финансовых инструментов", базисным активом которых является иностранная валюта, условия приема и исполнения поручений Клиентов на совершение таких сделок, а также порядок закрытия и переноса Брокером позиций Клиента. Отношения Брокера и Клиента при совершении Сделок с неполным покрытием, не урегулированные настоящими Условиями, регулируются действующим законодательством, в том числе Указанием Банка России от 26.11.2020 N 5636-У "О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок за счет клиента", (далее – «Указание»).

1.3 В случае наличия противоречий между настоящими Условиями и действующим законодательством применяются положения действующего законодательства.

1.4 Услуги по совершению Сделок с неполным покрытием оказываются Клиенту – физическому лицу, не являющемуся квалифицированным инвестором, и не совершавшему таких сделок до 01.10.2021 года, при условии положительного результата тестирования в отношении такого вида Сделок, осуществляемого Брокером согласно положений Федерального закона «О рынке ценных бумаг», «Базового стандарта защиты прав и интересов физических и юридических лиц - получателей финансовых услуг, оказываемых членами саморегулируемых организаций в сфере финансового рынка, объединяющих брокеров (в новой редакции)», в порядке, установленном Регламентом обслуживания (Приложение 7 «Порядок тестирования Клиента»).

1.5 Требования к размеру гарантийного обеспечения и иных показателей, предназначенных для контроля за возникающими рисками и для оценки способности Клиента исполнить обязательства по срочным сделкам в рамках «Выделенного счета срочного рынка», а также порядок закрытия позиций по срочному инструменту,

осуществляются согласно Приложению №5 «Условия обслуживания Выделенного счета срочного рынка Клиента».

СТАТЬЯ 2. ТЕРМИНЫ И ОПРЕДЕЛЕНИЯ

2.1 Непокрытая позиция по ДС – отрицательная величина плановой позиции по денежным средствам, в том числе в иностранной валюте, определяемая в стоимостном выражении в соответствии с Указанием. При определении Непокрытой позиции по ДС учитывается в том числе задолженность Клиента по оплате Вознаграждения Брокера, суммы неустоек, убытков, Расходов.

2.2 Непокрытая позиция по ЦБ – отрицательная величина плановой позиции по Ценным Бумагам, возникшая в результате заключения Брокером Сделок Продажи с неполным покрытием в интересах Клиента, определяемая в количественном выражении, а также в стоимостном выражении в соответствии с Указанием.

2.3 Сделка РЕПО – сделка, представляющая собой совокупность двух имеющих противоположную направленность и одновременно заключаемых сделок купли-продажи равного количества Ценных Бумаг одного выпуска одного типа (категории) и вида, которые исполняются последовательно.

2.4 Первая часть РЕПО – первая по времени исполнения сделка купли-продажи из совокупности сделок, составляющих Сделку РЕПО;

2.5 Вторая часть РЕПО – вторая по времени исполнения сделка купли-продажи из совокупности сделок, составляющих Сделку РЕПО.

2.6 Первоначальный продавец – сторона, являющаяся продавцом Ценных Бумаг по Первой части РЕПО (выступает покупателем по Второй части РЕПО);

2.7 Первоначальный покупатель – сторона, являющаяся покупателем Ценных Бумаг по Первой части РЕПО (выступает продавцом Ценных Бумаг по Второй части РЕПО);

2.8 Сделка – в настоящих Условиях означает Сделку, как она определена в Регламенте обслуживания, так и Сделку с неполным покрытием, если в тексте настоящих Условий специально не указано иное.

2.9 Сделка валютный своп – сделка, представляющая собой две взаимосвязанные разнонаправленные сделки купли-продажи иностранной валюты. По условиям Сделки валютный своп покупатель, заключая сделку спот по покупке иностранной валюты за российские рубли и одновременно заключает другую сделку спот по продаже этой иностранной валюты за российские рубли, и наоборот, продавец, заключая сделку спот по продаже иностранной валюты за российские рубли одновременно заключает другую

сделку спот по покупке иностранной валюты за российские рубли. При этом сумма в иностранной валюте обеих сделок совпадает.

2.10 Перечень ликвидных ценных бумаг – размещаемый на Сайте Брокера и/или доводимый до сведения Клиента в электронных брокерских системах перечень Ценных Бумаг, по которым допускается возникновение или увеличение в абсолютном выражении отрицательного значения плановой позиции, и (или) по которым положительное значение плановой позиции не принимается равным 0. Указанные Ценные Бумаги принимаются Брокером в качестве обеспечения обязательств Клиента, в том числе по предоставленным Брокером займам.

2.10.1 В случае если Ценная Бумага, указанная в Перечне ликвидных ценных бумаг, была погашена или выкуплена эмитентом, конвертирована в иные ценные бумаги, или выпуск такой ценной бумаги был аннулирован, то такая ценная бумага считается исключенной из Перечня ликвидных ценных бумаг с момента наступления такого события.

2.11 Перечень ликвидных иностранных валют – размещаемый на Сайте Брокера и/или доводимый до сведения Клиента в электронных брокерских системах перечень иностранных валют, по которым допускается возникновение или увеличение в абсолютном выражении отрицательного значения плановой позиции, и (или) по которым положительное значение плановой позиции не принимается равным 0. Указанные иностранные валюты принимаются Брокером в качестве обеспечения обязательств Клиента, в том числе по предоставленным Брокером займам.

2.12 Брокер определяет отдельный перечень ликвидных ценных бумаг и иностранных валют, единый для всех клиентов, отнесенных брокером к категории клиентов со стандартным или повышенным уровнем риска, с которыми договором о брокерском обслуживании не предусмотрено определение отдельного перечня ликвидных ценных бумаг и иностранных валют.

2.13 Для клиентов, являющихся квалифицированными инвесторами, Брокер определяет отдельный перечень ликвидных ценных бумаг и иностранных валют, единый для всех таких клиентов, отнесенных Брокером к квалифицированным инвесторам, с которыми договором о брокерском обслуживании не предусмотрено определение отдельного перечня ликвидных ценных бумаг и иностранных валют.

2.14 Стоимость Портфеля Клиента – величина, определяемая в порядке, установленном Указанием. При расчете Стоимости Портфеля Клиента учитываются суммы Вознаграждений, неустоек, убытков и подлежащих возмещению Расходов, на которые Брокер вправе рассчитывать согласно Договору обслуживания, а также любые иные обязательства Клиента, возникшие в результате исполнения Договора обслуживания.

2.15 Размер Начальной маржи – величина, определяемая в порядке, установленном Указанием. Для определения размера Начальной маржи Брокер не использует зависимость между изменением цен ценных бумаг, курсов иностранных валют, цен фьючерсных договоров и изменениями базовых индикаторов.

2.16 НПР1 – норматив покрытия риска при исполнении поручений клиента, отнесенного Брокером к категории клиентов со стандартным уровнем риска (КСУР) или клиентов с повышенным уровнем риска (КПУР), представляет собой разницу между Стоимостью Портфеля Клиента и размером начальной маржи. Минимально допустимое числовое значение НПР1 устанавливается в размере 0, за исключением случаев, установленных Указанием.

2.17 Размер Минимальной маржи – величина, определяемая в порядке, установленном Указанием, представляет из себя половину от размера Начальной маржи.

2.18 НПР2 – норматив покрытия риска при изменении стоимости портфеля клиента, отнесенного Брокером к категории КСУР или КПУР, представляет собой разницу между Стоимостью Портфеля Клиента и размером минимальной маржи. Минимально допустимое числовое значение НПР2 устанавливается в размере 0, за исключением случаев, установленных Указанием.

2.19 Ограничительное время закрытия позиций – 16 часов 00 минут по московскому времени каждого торгового дня, до которого снижение значения НПР2 ниже 0 влечет закрытие позиций клиента в течение этого торгового дня.

2.20 Офсетная сделка – сделка, влекущая за собой прекращение прав и обязанностей по ранее открытой позиции в связи с возникновением противоположной позиции по такому же срочному контракту.

2.21 Закрытие позиций – меры, принятые Брокером по снижению размера минимальной маржи и (или) увеличению стоимости Портфеля Клиента, в случае если НПР2 принимает значение меньше 0.

2.22 Иные термины и определения, прямо не определенные в настоящих Условиях, имеют значение, которое им придается в Договоре обслуживания, Регламенте обслуживания и действующем законодательстве.

СТАТЬЯ 3. ОБЩИЕ УСЛОВИЯ

3.1 Сделки с неполным покрытием совершаются Брокером на основании Приказов (поручений) Клиента на Покупку с неполным покрытием и Приказов Клиента на Продажу с неполным покрытием.

3.2 Брокер вправе исполнять Поручения Клиентов на совершение Сделок с неполным покрытием путем продажи только тех Ценных Бумаг, которые включены в Перечень ликвидных Ценных Бумаг.

3.3 Брокер уведомляет Клиента об изменении Перечня ликвидных Ценных Бумаг путем размещения Перечня ликвидных Ценных Бумаг в новой редакции на Сайте Брокера и (или) в Электронных Брокерских Системах (Система ТРЕЙДЕРНЕТ и/или Система QUIK).

3.4 Клиент обязуется не распоряжаться принадлежащими ему и учитываемыми на его Счете депо Клиента Ценными Бумагами из Перечня ликвидных Ценных Бумаг, а также принадлежащими ему и учитываемыми на Брокерском счете Клиента иностранными валютами из Перечня ликвидных иностранных валют в части, необходимой для исполнения обязательств перед Брокером на период до проведения расчетов с Брокером по результатам Сделок с неполным покрытием.

3.5 Брокеру предоставлено право на продажу учитываемых на Счете депо Клиента Ценных Бумаг в размере, достаточном для проведения расчетов по денежным обязательствам, возникшим вследствие совершения Сделок с неполным покрытием.

3.6 Брокеру также предоставлено право распоряжения Денежными средствами Клиента с целью приобретения Ценных Бумаг и (или) иностранной валюты в размере, достаточном для проведения расчетов по возникшим вследствие совершения Сделок с неполным покрытием обязательствам по поставке Ценных Бумаг и (или) иностранной валюты.

3.7 Брокер на протяжении всего времени проведения организованных торгов предоставляет Клиенту защищенный доступ с использованием Электронных Брокерских Систем (Система ТРЕЙДЕРНЕТ и/или Система QUIK) к информации о Стоимости Портфеля Клиента, размере начальной, размере минимальной маржи, НПР1 и НПР2.

3.8 Ставки риска, используемые Брокером для расчета размеров начальной и минимальной маржи (далее – «Ставки риска»), определяются Брокером самостоятельно на основании ставок риска, публикуемых клиринговыми организациями.

3.9 Ставки риска, доводятся до Клиента с использованием Электронной Брокерской системы и/или публикуются на Сайте Брокера.

3.10 В случае изменения значений Ставок риска, новые значения Ставок риска применяются Брокером для расчета размеров начальной и минимальной маржи с момента, указанного в объявлении, опубликованном на Сайте Брокера.

СТАТЬЯ 4. ПОРЯДОК ПРИНЯТИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ПРИКАЗОВ КЛИЕНТА НА ЗАКЛЮЧЕНИЕ СДЕЛОК С НЕПОЛНЫМ ПОКРЫТИЕМ

4.1 Приказ Клиента на Продажу с неполным покрытием может быть подан только в отношении Ценных Бумаг, входящих в Перечень ликвидных Ценных бумаг. Ограничение, установленное настоящим пунктом, не применяется в отношении клиентов, отнесенных к категории клиентов с особым уровнем риска (КОУР).

4.2 Независимо от наличия условий, необходимых для совершения Сделок с неполным покрытием, установленных Указанием, Брокер вправе, но не обязан принять к исполнению Приказ Клиента на Покупку с неполным покрытием или Приказ на Продажу с неполным покрытием.

4.3 Заключение Сделки с неполным покрытием подтверждается Отчетом Брокера, предоставляемым Клиенту в соответствии с Регламентом обслуживания.

4.4 Поручения Клиента на совершение сделок с неполным покрытием и (или) Срочных сделок не принимаются Брокером, в случае если в результате исполнения такого поручения Стоимость Портфеля Клиента станет меньше соответствующего ему размера Начальной маржи, определяемого в соответствии с Указанием.

4.5 Клиент вправе самостоятельно до момента востребования Брокером осуществить закрытие Непокрытой позиции по ДС, иностранной валюте или Непокрытой позиции по ЦБ путем зачисления Денежных Средств, иностранной валюты или соответствующих Ценных Бумаг на Счет депо Клиента или путем совершения Сделки, приводящей к увеличению Стоимости портфеля и (или) снижению значений Начальной и Минимальной маржи.

4.6 В случае если Стоимость Портфеля Клиента стала меньше размера начальной маржи (НПР1 принял значение меньше 0), Брокер вправе направить Клиенту уведомление об этом по электронному адресу Клиента. В случае возникновения обстоятельств, препятствующих доступу Клиента с использованием Электронной Брокерской Системы к информации о Стоимости Портфеля Клиента, размере начальной и размере минимальной маржи, НПР1, НПР2 и снижения Стоимости Портфеля Клиента ниже размера начальной маржи Брокер направляет Клиенту на электронный адрес Клиента уведомление, содержащее сведения о Стоимости Портфеля Клиента, размере начальной и размере минимальной маржи, а также информацию о действиях Брокера, если значение НПР2 будет ниже 0, в срок не позднее окончания времени проведения организованных торгов дня, в котором наступили указанные выше обстоятельства.

4.7 Основанием закрытия Непокрытой позиции по ДС и/или Непокрытой позиции по ЦБ является наступление любого из следующих обстоятельств:

снижение Стоимости Портфеля Клиента ниже размера минимальной маржи (НПР2 принял значение меньше 0), рассчитываемых Брокером в отношении Портфеля Клиента по правилам, установленных Указанием; или

если Стоимость Портфеля Клиента на момент закрытия торговой сессии составляет менее 1000 рублей; или

соответствие Клиента признакам лица иностранного государства, совершающего недружественные действия, установленным нормативно-правовыми актами Российской Федерации; или

Получение Брокером сведений или документов, свидетельствующих о смерти Клиента; или

наступление иных обстоятельств, предусмотренных Регламентом обслуживания или Договором обслуживания.

4.8 Настоящим Клиент безотзывно поручает Брокеру в случае наступления обстоятельства, являющегося основанием закрытия Непокрытой позиции, без дополнительных поручений Клиента осуществить продажу минимально необходимого количества ценных бумаг, иностранной валюты или заключить офсетную сделку по фьючерсным контрактам, находящихся в Портфеле Клиента, либо осуществить покупку за счет Клиента Ценных бумаг или иностранной валюты.

4.9 В случае наступления обстоятельства, являющегося основанием закрытия Непокрытой позиции Клиента Брокер принудительно закрывает все или часть позиций Клиента посредством продажи необходимого количества ценных бумаг, иностранной валюты или посредством заключения офсетной сделки по фьючерсным контрактам, находящихся в Портфеле Клиента (в случае непокрытой позиции по денежным средствам), либо посредством покупки за счет Клиента ценных бумаг или иностранной валюты, (в случае непокрытой позиции по ценным бумагам и (или) иностранной валюты).

4.10 В целях обеспечения возможности принудительного закрытия позиции Брокер вправе снять (отменить) все или часть неисполненных заявок, поданных организаторам торгов на основании Приказов Клиента.

4.11 При осуществлении закрытия позиций Клиентов Брокер самостоятельно (по своему усмотрению) определяет очередность покупки/продажи финансовых инструментов (ценных бумаг, фьючерсных контрактов) и (или) иностранной валюты, руководствуясь списком ликвидных ценных бумаг (иностранной валюты), опубликованным на сайте Брокера.

4.12 В случае отсутствия у Клиента Ликвидных ценных бумаг, которые могут быть объектом сделок, направленных на закрытие позиций, Клиент безотзывно поручает Брокеру совершить сделки по продаже ценных бумаг, допущенных к организованным торгам, но не включенных в перечень ликвидных ценных бумаг, опубликованный на сайте Брокера. Реализация ценных бумаг осуществляется в количестве минимально необходимом для восстановления Стоимости портфеля до размера Начальной маржи, а в случае недостаточности количества ценных бумаг – до достижения максимально возможной Стоимости портфеля Клиента. При наличии различных ценных бумаг Брокер вправе самостоятельно определить, какие именно Ценные бумаги будут реализованы. Сделки совершаются по рыночной цене в соответствии с требованиями Указания.

4.13 Закрытие позиций может не применяться, если значение размера минимальной маржи равно 0.

4.14 Брокер не совершает действия по закрытию позиций клиента, если до их совершения НПР2 принял положительное значение (или если размер Минимальной маржи стал больше Стоимости портфеля).

4.14.1 Брокер осуществляет закрытие позиций клиента при снижении НПР2 ниже 0 в следующие сроки.

4.14.2 В случае если НПР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня до ограничительного времени закрытия позиций, Брокер осуществляет закрытие позиций клиента в течение этого торгового дня.

4.14.3 В случае если НПР2 принимает значение ниже 0 в течение торгового дня после ограничительного времени закрытия позиций, Брокер осуществляет закрытие позиций клиента не позднее ограничительного времени закрытия позиций клиента ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором наступило это обстоятельство.

4.14.4 В случае если до закрытия позиций клиента организованные торги ценными бумагами (иностранной валютой) были приостановлены и их возобновление произошло после ограничительного времени закрытия позиций, Брокер осуществляет закрытие позиций клиента не позднее ограничительного времени закрытия позиций ближайшего торгового дня, следующего за торговым днем, в котором НПР2 принял значение ниже 0.

4.15 Брокер осуществляет закрытие позиций клиента при снижении НПР2 ниже 0 с соблюдением следующих требований.

4.16.1. В отношении Клиентов, отнесенных Брокером к категории КСУР и КПУР, Брокер осуществляет закрытие позиций до достижения НПР1 нулевого значения (при положительном значении размера начальной маржи).

4.16 При осуществлении Брокером закрытия позиции Клиента допускается снижение значения НПР1 относительно своего предыдущего отрицательного значения.

4.17 Для Клиента, являющегося квалифицированным инвестором, дополнительным основанием закрытия Непокрытых позиций Клиента по ЦБ является получение Брокером от лица, оказывающего Брокеру брокерские услуги во Внешних торговых системах (далее – Вышестоящий брокер), требования о закрытии непокрытых позиций, открытых Брокеру в Вышестоящем брокере по ценным бумагам, соответствующим Непокрытым позициям Клиента или прекращение предоставления Вышестоящим брокером возможности для открытия Непокрытых позиций по ценным бумагам, соответствующим Непокрытым позициям Клиента.

В случае наступления предусмотренного настоящим пунктом основания Клиент безотзывно уполномочивает Брокера без предварительных уведомлений и дополнительных указаний Клиента совершить действия, направленные на закрытие таких Непокрытых позиций Клиента по ЦБ, путем направления Брокером за счет Клиента заявок (поручений) на покупку Ценных бумаг, по которым у Клиента открыта Непокрытая позиция, по текущим рыночным ценам на анонимных торгах Внешней торговой системы, на которой обращаются соответствующие ценные бумаги.

Закрытие Непокрытых позиций Клиента в случае, предусмотренном настоящим пунктом, производится Брокером в срок, начиная с момента наступления основания для такого закрытия до окончания первого часа следующей торговой сессии.

Клиент подтверждает отсутствие каких-либо претензий и требований к Брокеру в случае совершения Брокером предусмотренных настоящим пунктом Сделок.

4.18 При закрытии позиций, осуществляемом Брокером в результате снижения Стоимости Портфеля Клиента ниже размера Минимальной маржи, величина, на которую Стоимость Портфеля Клиента в результате закрытия Брокером позиций должна превышать размер начальной маржи, определяется исходя из минимального количества лотов закрываемых позиций, необходимых для обеспечения превышения Стоимости Портфеля Клиента над размером начальной маржи.

4.19 При направлении Приказа Клиента на покупку Ценных Бумаг, по которым открыта Непокрытая позиция (откуп Ценных Бумаг), Брокер исполняет такой Приказ за счет собственных Денежных средств Клиента (планового остатка Денежных средств Клиента), учитываемых на Брокерском счете Клиента.

4.20 Брокер имеет право отказать в принятии Приказов на Покупку с неполным покрытием и Приказов на Продажу с неполным покрытием к исполнению, а также прекратить исполнение таких Приказов по исключительному усмотрению Брокера, даже

если исполнение таких Приказов не нарушает условия совершения таких Сделок, установленные Указанием.

СТАТЬЯ 5. КЛИЕНТЫ С ПОВЫШЕННЫМ УРОВНЕМ РИСКА

5.1 Брокер вправе с соблюдением условий, предусмотренных действующим законодательством, отнести Клиента к категории Клиентов с повышенным уровнем риска (КПУР) (для клиентов – физических или юридических лиц) или к категории Клиентов с особым уровнем риска (КОУР) (для клиентов - юридических лиц). Клиенты, не отнесенные к категории Клиентов с повышенным уровнем риска или к категории Клиентов с особым уровнем риска, относятся к категории Клиентов со стандартным уровнем риска.

5.2 Брокер вправе отнести Клиента к категории Клиентов с повышенным уровнем риска в порядке и при соблюдении условий, предусмотренных Указанием. По заявлению Клиента-юридического лица Брокер вправе отнести Клиента к категории Клиентов с повышенным уровнем риска при соблюдении таким Клиентом условий, предусмотренных действующим законодательством для отнесения клиентов – физических лиц к категории Клиентов с повышенным уровнем риска. Брокер вправе не относить Клиента к категории Клиентов с повышенным уровнем риска без объяснения причин независимо от соблюдения условий, предусмотренных Указанием.

5.3 Последствия отнесения Клиента к категории Клиентов с повышенным уровнем риска определены Указанием. Брокер вправе вводить дополнительные условия, при соблюдении которых он вправе отнести Клиента к категории Клиентов с повышенным уровнем риска.

5.4 Информация об отнесении Клиента к категории клиентов с повышенным уровнем риска доводится до сведения Клиента с использованием Электронной брокерской Системы и/или путем указания сведений в Отчете Брокера.

5.5 Клиент вправе отказаться от статуса Клиента с повышенным уровнем риска, направив Брокеру соответствующее заявление любым доступным способом. В случае такого отказа повторное отнесение Клиента к категории Клиентов с повышенным уровнем риска осуществляется Брокером только на основании отдельного заявления Клиента.

СТАТЬЯ 6. ПОРЯДОК ПЕРЕНОСА НЕПОКРЫТОЙ ПОЗИЦИИ КЛИЕНТА ПО ЦБ

6.1 В случае отсутствия на Брокерском счете Клиента на момент окончания Дневной торговой сессии Рабочего дня, в который наступает срок исполнения обязательств по Сделкам (далее – «День Т») достаточного для исполнения обязательств по таким Сделкам Свободного остатка Ценных Бумаг Клиент поручает Брокеру без дополнительных указаний

Клиента осуществить перенос Непокрытой позиций Клиента по ЦБ путем заключения сделки РЕПО в порядке, определенном настоящей статьей.

6.2 Сделки РЕПО в соответствии с настоящими Условиями совершаются Брокером с третьими лицами от своего имени за счет и в интересах Клиента.

6.3 Клиент настоящим поручает и уполномочивает Брокера в случае отсутствия на Брокерском счете Клиента на момент окончания Дневной торговой сессии Рабочего дня, в который наступает срок исполнения обязательств по Сделкам (далее – «День Т») достаточного для исполнения обязательств по таким Сделкам Свободного остатка Ценных Бумаг, совершить в порядке, предусмотренном настоящими Условиями, одну или несколько Сделок РЕПО за счет Денежных средств Клиента для поступления в результате исполнения Первой части РЕПО на счет Депо Клиента Ценных Бумаг в размере, достаточном для исполнения обязательств по Сделкам, срок исполнения которых наступил, с последующим списанием в день Т+1 указанных Ценных Бумаг со счета Депо Клиента при исполнении Второй части РЕПО (произвести перенос Непокрытой позиции по ЦБ).

6.4 Клиент поручает Брокеру заключить одну или несколько Сделок РЕПО за счет Ценных Бумаг Клиента в случае отсутствия на счете Клиента Денежных средств в размере, достаточном для совершения сделки РЕПО по приобретению Ценных бумаг в соответствии с пунктами 6.1-6.2 настоящих Условий. По результатам исполнения Первой части Сделки РЕПО в соответствии с настоящим пунктом Брокер производит списание в безакцептном порядке вырученных Денежных средств в размере, необходимом для проведения расчетов по Сделкам РЕПО, совершаемым Брокером в соответствии с пунктами 6.1-6.2 настоящих Условий.

6.5 В соответствии с Первой частью РЕПО Брокер осуществляет перечисление Денежных средств, а контрагент по Сделке РЕПО осуществляет встречную поставку Ценных Бумаг для поступления на счет Депо Клиента Ценных Бумаг в размере Непокрытой позиции по ЦБ Клиента.

6.6 Брокер заключает сделки РЕПО в соответствии с настоящими Условиями на следующих условиях исполнения обязательств:

6.7 Обязательство по передаче Ценных Бумаг по Первой части РЕПО подлежит исполнению в день заключения сделки РЕПО (день Т) по завершению Торговой сессии.

Обязательство по передаче Ценных Бумаг по Второй части РЕПО подлежит исполнению до начала Торговой сессии в день Т+1, то есть в Рабочий день, следующий за днем Т.

Обязательство по перечислению Денежных средств по Первой части РЕПО подлежит исполнению в день Т по завершению Торговой сессии.

Обязательство по перечислению Денежных средств по Второй части РЕПО подлежит исполнению в день Т+1 до начала Торговой сессии.

6.7.1 Эмитент, вид, категория, выпуск Ценных Бумаг по Сделке РЕПО, в которой Брокер выступает в качестве первоначального покупателя, соответствуют эмитенту, виду, категории, выпуску Ценных Бумаг, в отношении которых у Клиента имеется Непокрытая позиция по ЦБ.

6.7.2 Цена приобретения одной Ценной Бумаги по Первой части РЕПО принимается равной цене закрытия в день Т.

6.7.3 Цена отчуждения одной Ценной Бумаги по Второй части РЕПО равна: Цена приобретения одной Ценной Бумаги по Первой части сделки РЕПО $\times (100\% - R)^n$, где R – ставка расходов Клиента при переносе Непокрытых позиций Клиента, определяемая Приложением №2 к Регламенту обслуживания; n – количество календарных дней между первой частью РЕПО и второй частью РЕПО.

6.7.4 Количество Ценных Бумаг Клиента по Сделке РЕПО, в которой Брокер выступает в качестве первоначального покупателя, принимается равным количеству Ценных бумаг составляющих Непокрытую позицию по ЦБ по Сделкам, срок исполнения которых наступил.

6.8 В случае полного погашения (за исключением конвертации) переданных по договору репо облигаций до исполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО обязательства по второй части Сделки РЕПО прекращаются без исполнения их в натуре в следующем порядке:

Обязательство первоначального покупателя и первоначального продавца по поставке и оплате Ценных бумаг по второй части Сделки РЕПО прекращаются полностью;

Первоначальный покупатель в сроки, установленные для исполнения обязательств по Второй части сделки РЕПО, уплачивает первоначальному продавцу разницу между Ценами отчуждения одной Ценной Бумаги по Первой и Второй части РЕПО.

6.9 Брокер вправе совершать Сделки РЕПО в соответствии с настоящей статьей на Внебиржевом рынке, при этом такая сделка может быть исполнена как за счет Денежных средств и/или Ценных бумаг Клиента, зарезервированных для сделок, осуществляемых через организатора торговли, так и за счет иных Денежных средств и/или Ценных Бумаг на Брокерском счете/счете Депо, без каких – либо дополнительных указаний со стороны Клиента.

СТАТЬЯ 7. ПОРЯДОК ПЕРЕНОСА НЕПОКРЫТОЙ ПОЗИЦИЙ КЛИЕНТА ПО ДС

7.1 Отсутствие на момент окончания Дневной торговой сессии Рабочего дня, в который наступает срок исполнения любых денежных обязательств Клиента в российских рублях, в том числе по Сделкам с неполным покрытием, обязательств по возврату маржинальных займов и уплате процентов по ним, обязательств Клиента по оплате Вознаграждения и возмещению расходов Брокера (далее – «День Т»), Свободного остатка Денежных средств, достаточного для исполнения таких обязательств, признается офертой Клиента Брокеру на выдачу Клиенту маржинального займа в форме денежных средств в сумме, равной разнице между суммой Свободного остатка Денежных средств Клиента и величиной денежных обязательств, срок исполнения которых наступил. Акцепт оферты Клиента на выдачу маржинального займа и выдача маржинального займа подтверждаются Отчетом Брокера.

7.2 Срок возврата Брокеру Суммы маржинального займа, предоставленного Брокером Клиенту в соответствии с условиями настоящего пункта: до начала торгов в день Т+1.

7.3 Не позднее дня срока возврата Брокеру Суммы Маржинального займа Заемщик обязан уплатить Займодавцу проценты за пользование Суммой Маржинального займа в размере, определяемом по формуле: $S \times (100\% - R)^n - S$, где S – сумма Маржинального займа, R – ставка расходов Клиента при переносе Непокрытых позиций Клиента, определяемая Приложением №2 к Регламенту обслуживания; n – количество календарных дней между днями Т и Т+1. Начисленные в указанном в настоящем абзаце порядке проценты увеличивают стоимость Непокрытой позиции по ДС для целей последующих расчетов.

7.4 В случае отсутствия на момент окончания Торговой сессии Рабочего дня, в который наступает срок исполнения денежных обязательств Клиента в иностранной валюте, (далее – «День Т»), Свободного остатка Денежных средств в иностранной валюте, достаточного для исполнения обязательств Клиента, Клиент поручает Брокеру заключить за счет Клиента Сделку валютный своп в следующем порядке и на следующих условиях:

7.4.1 Сделка валютный своп заключается Брокером вне внутреннего валютного рынка Российской Федерации путем подачи поручения на заключение сделки валютный своп небанковской организации финансового рынка, расположенной за пределами территории Российской Федерации, заключившей с Брокером соглашение на оказание брокерских услуг (вышестоящий брокер).

7.4.2 Сумма сделки своп по покупке иностранной валюты: минимально необходимая для обеспечения исполнения денежных обязательств Клиента в иностранной валюте, срок исполнения которых наступил в день Т.

7.4.3 даты исполнения обязательств по сделкам первой и второй сделкам спот, входящим в Сделку валютный своп: день Т и рабочий день, следующий за днем заключения Сделки (день Т+1) соответственно;

7.4.4 Цена покупки по первой сделке спот, входящей в Сделку валютный своп – курс Банка России на день заключения первой сделки своп.

7.4.5 Цена сделки валютный своп при переносе непокрытой позиции по иностранной валюте – величина, рассчитываемая исходя из ставки 0,001% за каждый день между первой и второй сделками спот, входящей в Сделку валютный своп.

7.4.6 Цена продажи по второй сделке спот, входящей в Сделку валютный своп, равна цене покупки по первой сделке спот, входящей в Сделку своп, уменьшенной на цену Сделки валютный своп.

7.4.7 Поставка иностранной валюты (первая часть Сделки своп) на Брокерский счет Клиента по заключенной сделке производится в день заключения Сделки (день Т).

7.4.8 Списание иностранной валюты (вторая часть Сделки валютный своп) с Брокерского счета Клиента производится в рабочий день, следующий за днем заключения Сделки (день Т+1).

СТАТЬЯ 8. КОМПЕНСАЦИЯ ДИВИДЕНДОВ ПРИ СОВЕРШЕНИИ СДЕЛОК РЕПО ДЛЯ ПЕРЕНОСА НЕПОКРЫТЫХ ПОЗИЦИЙ КЛИЕНТА

8.1 В случае совершения Брокером в дату, определенную эмитентом Ценных Бумаг в качестве даты составления списка лиц, имеющих право на получение дивидендов, Сделки РЕПО для переноса Непокрытой позиции по ЦБ, в которой Брокер выступает первоначальным покупателем в интересах Клиента, Брокер удерживает с Брокерского счета такого Клиента и зачисляет на Брокерский счет Клиента, за счет которого Брокер выступал в качестве первоначального продавца, сумму денежных средств в размере, определяемом по формуле: $R = (\text{количество Ценных Бумаг по Первой части Сделки репо}) * \text{сумма дивидендов, исходя из размера, утвержденного общим собранием акционеров Эмитента, причитающихся на 1 Ценную Бумагу} / 0,87$.

8.2 Удержание, определенное в пункте 8.1. настоящих Условий, производится Брокером не ранее даты исполнения Первой части Сделки РЕПО.

8.3 Не позднее трех рабочих дней с даты исполнения Эмитентом Ценных Бумаг обязательства по выплате дивидендов Брокер:

- производит расчет суммы корректировки по следующей формуле: $R - R * (D2 / D1)$, где R – величина, рассчитанная согласно пункту 8.1, величины D1 и D2 определены в порядке, установленном пунктом 5 статьи 275 Налогового кодекса РФ.
- списывает с Брокерского счета Клиента, за счет которого Брокер выступал в Сделке РЕПО в качестве первоначального продавца, сумму корректировки, рассчитанной согласно абзацу второму настоящего пункта;
- зачисляет сумму корректировки, рассчитанной согласно абзацу второму настоящего пункта, на Брокерский счет Клиента, за счет которого Брокер выступал в качестве первоначального покупателя в Сделке РЕПО.

СТАТЬЯ 9. ВОЗНАГРАЖДЕНИЕ БРОКЕРА

Размер, порядок и условия выплаты Вознаграждения Брокера при осуществлении Сделок с неполным покрытием и Сделок РЕПО для переноса Непокрытых позиций Клиента, сделок по выдаче маржинальных займов определяются Договором обслуживания и Приложением №2 к Регламенту обслуживания «Тарифы на услуги Брокера».