



НАУФОР

2011

Стандартная документация для срочных сделок на финансовых рынках

Исключительное право использования Стандартной документации для срочных сделок на финансовых рынках принадлежит совместно Ассоциации российских банков, Национальной ассоциации участников фондового рынка и Национальной валютной ассоциации. Правообладатели согласны с использованием Стандартной документации в целях заключения сделок.

Ассоциации благодарят за финансовую поддержку при подготовке Стандартной документации для срочных сделок на финансовых рынках ОАО «Банк Москвы», ЗАО «БНП Париба», Внешэкономбанк, ЗАО «ВТБ Капитал», ООО «Голдман Сакс», ГПБ (ОАО), ООО «Дойче Банк», ОАО АКБ «Еврофинанс Моснарбанк», ЗАО «ИК Регион», ЗАО «ИНГ Банк (Евразия)», ЗАО «Калион Русбанк», ЗАО «Коммерцбанк (Евразия)», ЗАО «Королевский Банк Шотландии», ОАО «МДМ-Банк», ОАО АКБ «Металлинвестбанк», ООО «Морган Стэнли Банк», ОАО «НОМОС-Банк», ООО «Ренессанс Брокер», ОАО АКБ «Росбанк», ОАО Сбербанк России, ЗАО «Финансовая компания «Адикс», ЗАО ЮниКредитбанк.

СОДЕРЖАНИЕ

<i>Предисловие к стандартной документации.</i>	7
ПРИМЕРНЫЕ УСЛОВИЯ ДОГОВОРА О СРОЧНЫХ СДЕЛКАХ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ	9
Примерная форма генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках	45
ДОПОЛНИТЕЛЬНОЕ СОГЛАШЕНИЕ К ГЕНЕРАЛЬНОМУ СОГЛАШЕНИЮ О СРОЧНЫХ СДЕЛКАХ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ.	55
СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ КОНВЕРСИОННЫХ СДЕЛОК, СДЕЛОК ВАЛЮТНЫЙ ФОРВАРД, ВАЛЮТНЫЙ ОПЦИОН И ВАЛЮТНЫЙ СВОП	63
Приложения	89
Алфавитно-предметный указатель	111
СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ СРОЧНЫХ СДЕЛОК НА ПРОЦЕНТНЫЕ СТАВКИ И СДЕЛОК СВОПЦИОН	115
Приложения	142
Алфавитно-предметный указатель	165
СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ СРОЧНЫХ СДЕЛОК С АКЦИЯМИ И ФОНДОВЫМИ ИНДЕКСАМИ	169
Алфавитно-предметный указатель	235
СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ СРОЧНЫХ СДЕЛОК С АКЦИЯМИ И ФОНДОВЫМИ ИНДЕКСАМИ (Часть 2).	241
Приложения	243
СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ СРОЧНЫХ СДЕЛОК С ОБЛИГАЦИЯМИ	373
Приложения	405
Алфавитно-предметный указатель	445
СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ ДОГОВОРА О ПОРЯДКЕ УПЛАТЫ ПЛАВАЮЩИХ МАРЖЕВЫХ СУММ	449
Приложения	460

ПРЕДИСЛОВИЕ К СТАНДАРТНОЙ ДОКУМЕНТАЦИИ

Стандартная документация для внебиржевых производных финансовых инструментов в редакции 2011 г. подготовлена по совместной инициативе Ассоциации российских банков, Национальной валютной ассоциации и Национальной ассоциации участников фондового рынка. Настоящее издание включает в себя Примерные условия договора о срочных сделках на финансовых рынках, примерную форму Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках, Стандартные условия конверсионных сделок, сделок валютный опцион и валютный своп, Стандартные условия срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион, Стандартные условия срочных сделок с акциями и фондовыми индексами, Стандартные условия срочных сделок с облигациями и Стандартные условия договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

Перечень документов, входящих в стандартную документацию, не изменился по сравнению с предыдущей версией документации в редакции 2009 г. Тем не менее необходимость в подготовке и публикации новой редакции в такой короткий срок после опубликования первой серии указанных документов вызвана важными причинами. Во-первых, в результате внесенных изменений российское законодательство о рынке ценных бумаг теперь содержит регулирование производных финансовых инструментов и определяет их виды. Во-вторых, закон прямо предусматривает возможность использования генеральных соглашений при заключении более одного договора, являющегося производным финансовым инструментом, в том числе на основе примерных условий договора, утвержденных саморегулируемой организацией профессиональных участников рынка ценных бумаг и согласованных с федеральным органом исполнительной власти по рынку ценных бумаг, и предъявляет новые требования к содержанию таких примерных условий договора. В-третьих, поправки к законодательству о несостоятельности (банкротстве) позволяют проводить ликвидационный неттинг в отношении сделок, регулируемых генеральным соглашением, при условии, среди прочего, что примерные условия договора, применимые к генеральному соглашению, и само генеральное соглашение соответствуют требованиям закона. В-четвертых, либерализация регулирования валютных операций на внутреннем валютном рынке применительно к договорам, являющимся производными финансовыми инструментами, позволила предусматривать возможность расчетов по таким договорам в иностранной валюте и расширить круг наиболее востребованных видов срочных сделок, базовым активом по которым выступает иностранная валюта (напр., валютно-процентный своп). Наконец, практическое использование стандартной документации за два года выявило предпочтения участников рынка в отношении использования или редакции отдельных положений документации. Все из указанных аспектов нашли отражение в новой редакции стандартной документации.

В целом стандартная документация сохраняет свою первоначальную «модульную архитектуру»: в ее центре остается Генеральное соглашение о срочных сделках на финансовых рынках, путем отсылки инкорпорирующее Примерные условия договора о срочных сделках на финансовых рынках. При заключении отдельной сделки (составляющей при этом часть единого договора, включающего Генеральное соглашение и иные регулируемые им сделки) стороны путем отсылки включают в условия такой сделки положения Стандартных условий договора, служащих «рабочим модулем» для договоров с соответствующим базовым активом. Не изменился на данном этапе и набор таких продуктовых приложений (стандартных условий договора для соответствующего базового актива).

Изменения же по большей части коснулись содержания Примерных условий договора. По общему правилу, в русле гражданско-правового принципа свободы договора стороны вправе по взаимному согласию дополнить или изменить Примерные условия договора при заключении

Генерального соглашения. Однако, в соответствии с требованием закона, Примерные условия договора в новой редакции содержат перечень так называемых «Необходимых условий договора» и прямое указание на то, что Генеральное соглашение считается соответствующим Примерным условиям договора, если оно не содержит изменений к таким Необходимым условиям договора. Соблюдение указанного требования необходимо в целях обеспечения применения ликвидационного неттинга при расчете нетто-обязательства в случае банкротства стороны. Необходимые условия договора включают положения, устанавливающие порядок определения нетто-обязательства (именуемого в Примерных условиях договора «Суммой денежного обязательства при прекращении»), срок уплаты суммы такого нетто-обязательства, запрет на включение неустойки и убытков в форме упущенной выгоды при расчете Суммы денежного обязательства при прекращении в случае банкротства стороны, автоматическое прекращение обязательств по всем сделкам на дату, предшествующую отзыву банковской лицензии или признанию стороны банкротом. Кроме того, Примерные условия договора теперь предусматривают необходимость представления сторонами информации о заключенных сделках репозитарию, как того требует законодательство.

Примерные условия договора в редакции 2011 г. были утверждены Советом Директоров Национальной ассоциации участников фондового рынка и согласованы Федеральной службой по финансовым рынкам до опубликования.

Помимо Примерных условий договора существенному пересмотру подверглись Примерные условия соглашения о порядке уплаты вариационной маржи. Теперь этот документ носит название «Стандартные условия договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм» по аналогии с другими продуктовыми приложениями, определяющими стандартные условия договоров, являющихся производными финансовыми инструментами. Такой подход отражает то обстоятельство, что изменение цены (рыночной стоимости) иных производных финансовых инструментов (в данном случае — договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, заключаемых в рамках Генерального соглашения) теперь признается самостоятельным базовым активом для производных финансовых инструментов и что такие договоры могут включаться в расчет нетто-обязательства. Терминология, связанная с вариационной маржой, в новом документе не используется во избежание смешения с биржевой торговлей, в том числе для целей налогового учета.

Новая редакция стандартной документации позволяет использовать ее для внебиржевой торговли самыми различными производными финансовыми инструментами и заключения иных финансовых сделок с учетом требований законодательства о ликвидационном неттинге. Но этот процесс не статичен. Новые продуктовые приложения в ближайшее время пополнят перечень стандартных условий договоров по новым видам базовых активов. Продолжит совершенствоваться режим регулирования срочного финансового рынка, основные контуры которого были заложены в последние два года. По прошествии времени новый цикл развития рынка потребует доработки представленной в настоящем издании стандартной документации. Обеспечивая уже сегодня возможность использования передового международного опыта в области документирования сложных финансовых сделок на срочном рынке, публикация нынешней редакции стандартной документации одновременно закладывает основу и для его будущего развития.

Владимир Хренов

Советник Председателя Правления НАУФОР

Партнер юридической фирмы
«Монастырский, Зюба, Степанов и партнеры»

ПРИМЕРНЫЕ УСЛОВИЯ ДОГОВОРА
О СРОЧНЫХ СДЕЛКАХ
НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ
2011 г.

согласованы ФСФР России 28 декабря 2011 года

This 2011 Model Provisions of Agreement for Derivative Transactions on Financial Markets is based, in part, on selected provisions of the 2002 ISDA Master Agreement, © 2002 International Swaps and Derivatives Association, Inc., («ISDA®») and the 1992 ISDA Master Agreement, ©1992 International Swaps and Derivatives Association, Inc., and are used with its permission. ISDA takes no position as to this Russian-version Model Provisions of Agreement for Derivative Transactions on Financial Markets' suitability for use in any particular transaction. Prospective users should seek independent legal advice before using this instrument.

**ПРИМЕРНЫЕ УСЛОВИЯ ДОГОВОРА О СРОЧНЫХ СДЕЛКАХ
НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ
2011 г.**

Настоящие *примерные условия договора о срочных сделках на финансовых рынках* (далее — «*Примерные условия договора*») и стандартные условия срочных сделок с различными видами базового актива (далее — «*Стандартные условия*», а вместе с Примерными условиями договора — «*Стандартная документация*»), разработаны и утверждены Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, и опубликованы в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков с целью определить отдельные условия договорных отношений сторон (далее — «*Стороны*»), намеревающихся заключать сделки, определенные в пункте 2.2 статьи 2 Примерных условий договора (далее — «*Сделки*»).

1. **ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ**

Стандартная документация

- 1.1. Примерные условия договора устанавливают общий порядок заключения и исполнения Сторонами Сделок, а также основания и порядок прекращения обязательств Сторон по Сделкам и порядок определения суммы денежных средств, подлежащих уплате в связи с прекращением обязательств по Сделкам.
- 1.2. Стандартная документация применяется к отношениям Сторон в связи со Сделками, заключаемыми Сторонами в соответствии с Генеральным соглашением, как оно определено в пункте 1.4 настоящей статьи 1, и имеет для них обязательную силу.
- 1.3. При отсутствии по Сделке Подтверждения, как оно определено в пункте 2.7 статьи 2 Примерных условий договора, Стандартные условия для соответствующего вида Сделок применяются к отношениям Сторон по этой Сделке по умолчанию с учетом условий Сделки, согласованных Сторонами при ее заключении.

Генеральное соглашение о срочных сделках на финансовых рынках

- 1.4. В целях регулирования отношений, возникающих в связи со Сделками, Стороны могут заключить генеральное соглашение о срочных сделках на финансовых рынках (далее — «*Генеральное соглашение*»), предусматривающее, что его отдельные условия определяются настоящими Примерными условиями договора. При этом Стороны могут использовать примерную форму Генерального соглашения, установленную в приложении 1 к Примерным условиям договора.
- 1.5. Генеральное соглашение признается соответствующим настоящим Примерным условиям договора в случае, если применительно к любой из Сторон (но не ее

Связанного лица или Лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны) такое Генеральное соглашение не содержит изменений к (i) подпункту (е) и подпункту (В) подпункта (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора, (ii) пункту 6.2 статьи 6 Примерных условий договора в части недопустимости прекращения обязательств по части Сделок, (iii) пункту 6.3 статьи 6 Примерных условий договора, (iv) пункту 6.9 и подпункту (а) пункта 6.10 статьи 6 Примерных условий договора в части порядка определения Ликвидационной суммы и расчета Суммы денежного обязательства при досрочном прекращении обязательств по Сделкам вследствие наступления Банкротства, указанного в подпункте (е) или подпункте (В) подпункта (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора и (v) пункту 6.12 статьи 6 Примерных условий договора в части срока уплаты Суммы денежного обязательства при прекращении в случае досрочного прекращения обязательств по Сделкам вследствие наступления Банкротства, указанного в подпункте (е) или подпункте (В) подпункта (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора, (далее — *«Необходимые условия договора»*).

- 1.6. В Генеральном соглашении или условиях Сделки (применительно к этой Сделке) Стороны могут по своему усмотрению изменить положения Стандартной документации или договориться о неприменении отдельных положений Стандартной документации. При этом в случае изменения или неприменения Необходимых условий договора Генеральное соглашение не признается соответствующим настоящим Примерным условиям договора.

Единый договор

- 1.7. Генеральное соглашение, Сделки и включенные в них условия Стандартной документации представляют собой в совокупности единый договор между Сторонами.

Преимущественная сила Стандартных условий, Генерального соглашения и Подтверждений

- 1.8. В случае противоречия:
 - (а) между положениями Примерных условий договора и Стандартных условий Стандартные условия имеют преимущественную силу для целей соответствующего вида Сделок;
 - (б) между положениями Генерального соглашения и положениями Стандартной документации Генеральное соглашение имеет преимущественную силу;
 - (в) между Подтверждением по какой-либо Сделке и положениями Генерального соглашения или Стандартной документации Подтверждение имеет преимущественную силу для целей соответствующей Сделки.

Термины, используемые в Примерных условиях договора

- 1.9. Термины, используемые в Примерных условиях договора с заглавной буквы, имеют значение, указанное в статье 12 Примерных условий договора.

2. Сделки. Порядок их заключения, изменения и расторжения по соглашению Сторон. Подтверждение Сделок
- 2.1. Сделка, заключаемая Сторонами в соответствии с Генеральным соглашением, дополняет Генеральное соглашение обязательствами Сторон, предусмотренными условиями Сделки.
- 2.2. К Сделкам, регулируемым Примерными условиями договора, относятся:
 - (а) договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, в том числе: сделки валютный форвард, сделки валютный опцион, сделки валютный своп, сделки на процентные ставки (в том числе сделки процентный своп, включая сделки базисный своп, сделки валютно-процентный своп, сделки процентный форвард, сделки фиксации максимума процентной ставки, сделки фиксации минимума процентной ставки, сделки фиксации максимума и минимума процентной ставки), сделки свопцион, сделки форвард на акции, облигации или фондовые индексы, сделки своп на акции, облигации или фондовые индексы, сделки опцион на акции, облигации или фондовые индексы, сделки товарный своп, сделки товарный опцион или свопцион, сделки фиксации максимума цены товара, сделки фиксации минимума цены товара, сделки фиксации максимума и минимума цены товара, сделки товарный форвард, сделки своп, форвард или опцион на уровень инфляции, сделки, платежи по которым зависят от наступления обстоятельства, свидетельствующего о неисполнении или ненадлежащем исполнении одним или несколькими юридическими лицами, государствами или муниципальными образованиями своих обязанностей и/или иных обстоятельств, предусмотренных федеральным законом или нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и свидетельствующих о неспособности юридических лиц, государств или муниципальных образований исполнять свои гражданско-правовые (договорные) обязанности (в том числе сделки кредитный дефолтный своп и сделки кредитный дефолтный свопцион), договоры об уплате плавающих маржевых сумм, иные аналогичные сделки (включая опционы на названные сделки) и сделки, представляющие собой сочетание названных сделок;
 - (б) договоры, не являющиеся производными финансовыми инструментами, объектом которых является иностранная валюта и (или) ценные бумаги (кроме договоров репо), расчеты по которым производятся не ранее третьего Рабочего дня после даты их заключения, если Стороны предусмотрели это в Генеральном соглашении или Подтверждении; и
 - (в) договоры, перечисленные в подпунктах (а) и (б) настоящего пункта 2.2, со сроком расчетов ранее третьего Рабочего дня после даты их заключения, если Стороны предусмотрели это в Генеральном соглашении или Подтверждении.

Порядок заключения Сделок

- 2.3. Для заключения Сделки Стороны согласовывают существенные условия этой Сделки по Электронным средствам связи, если Генеральным соглашением не

предусмотрено иное. Использование Электронных средств связи при заключении Сделки признается Сторонами соблюдением письменной формы Сделки.

- 2.4. Стороны заключают Сделки по Электронным средствам связи через своих представителей, полномочия которых на заключение Сделки явствуют из обстановки, то есть из факта допуска таких лиц к Электронным средствам связи и ведения ими переговоров о заключении Сделки по этим Электронным средствам связи.
- 2.5. Перечень существенных условий Сделки определяется применимыми Стандартными условиями, если соглашением Сторон не предусмотрено иное.
- 2.6. Сделка считается заключенной с момента достижения Сторонами соглашения по всем ее существенным условиям. День, в который Стороны заключили Сделку, является датой заключения этой Сделки (далее — «*Дата сделки*»).

Подтверждение Сделок

- 2.7. В целях закрепления согласованных условий заключенной Сделки, а также согласования иных условий Сделки Стороны составляют документ или обмениваются документами по форме, установленной в Стандартных условиях для соответствующего вида Сделок, или иной согласованной Сторонами форме (далее — «*Подтверждение*») в порядке, установленном в Генеральном соглашении.
- 2.8. Подтверждение должно включать все существенные условия Сделки, согласованные Сторонами в Дату сделки. Подтверждение может содержать другие условия Сделки, не согласовывавшиеся Сторонами в Дату сделки. В этом случае такие условия подлежат согласованию Сторонами в качестве изменений и дополнений Сделки.
- 2.9. Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между Сторонами в отношении Сделки.
- 2.10. Отсутствие Подтверждения не влияет на факт заключения Сделки или ее действительность. Содержание условий Сделки в этом случае определяется исходя из соглашения Сторон, достигнутого в порядке, установленном пунктами 2.3–2.6 настоящей статьи 2, с учетом пункта 1.3 статьи 1 Примерных условий договора.

Изменение и расторжение Сделок по соглашению Сторон

- 2.11. Соглашение об изменении или расторжении Сделки может быть заключено Сторонами в порядке, установленном настоящей статьёй 2 и Генеральным соглашением для заключения и подтверждения Сделок.

Предоставление информации Репозитарию

- 2.12. Стороны предоставляют информацию о Генеральном соглашении и/или Сделках Репозитарию в соответствии с требованиями и порядком, предусмотренными нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг. В Генеральном соглашении Стороны вправе определить одну из Сторон или третье лицо в качестве Информировующего лица, предоставляющего Репозитарию информацию о Генеральном соглашении и/или Сделках.

3. Порядок исполнения Сделок

Общие положения

- 3.1. Каждая Сторона обязана осуществить платеж или поставку по Сделке в порядке, предусмотренном условиями Сделки и Генерального соглашения.
- 3.2. Обязательство Стороны по осуществлению платежа считается исполненным с момента зачисления суммы, подлежащей уплате этой Стороной, в полном объеме на корреспондентский счет Стороны-получателя платежа (если Сторона-получатель платежа является кредитной организацией) или обслуживающего ее банка (если Сторона-получатель платежа не является кредитной организацией) или на счет Стороны-получателя платежа (если обслуживающим ее банком является другая Сторона и Стороны договорились об осуществлении платежа на такой счет).

Обязательство Стороны по осуществлению поставки считается исполненным с момента, указанного в применимых Стандартных условиях, а при отсутствии такого указания — с момента, признаваемого в соответствии с обычаями делового оборота моментом исполнения данного вида обязательств.

Отлагательное условие

- 3.3. Обязательство каждой из Сторон по осуществлению платежа или поставки по Сделке в установленный условиями Сделки срок возникает при условии, что на момент наступления указанного срока не наступило одно или более из следующих обстоятельств:
 - (а) другая Сторона допускает Нарушение обязательства, наступает Технический дефолт, Банкротство или Потенциальное банкротство другой Стороны и такое обстоятельство продолжает иметь место;
 - (б) применительно к любой из Сторон наступает Иное основание досрочного прекращения, по которому направлено уведомление о досрочном прекращении обязательств по Сделкам в соответствии с пунктом 6.6 статьи 6 Примерных условий договора;
 - (в) наступает и продолжает иметь место иное обстоятельство или обстоятельства, указанные в Генеральном соглашении для целей настоящего пункта 3.3.

Ненаступление любого из обстоятельств, установленных настоящим пунктом 3.3, по состоянию на момент наступления срока исполнения обязательств Сторон по Сделке является отлагательным условием для обязательств соответствующей Стороны или Сторон.

Встречное исполнение обязательств

- 3.4. Без ущерба для действия пункта 3.3 настоящей статьи 3 и до прекращения обязательств по Сделкам в соответствии со статьей 6 Примерных условий договора либо в ином порядке, в случае Нарушения обязательства, Технического дефолта, Банкротства, Потенциального банкротства или возникновения Иного основания

досрочного прекращения, по которому направлено уведомление о досрочном прекращении обязательств по Сделкам в соответствии с пунктом 6.6 статьи 6 Примерных условий договора, исполнение обязательств Ненарушившей стороны или Затронутой стороны по любой Сделке становится обусловленным исполнением Нарушившей стороной или Затронутой стороной обязательств по всем Сделкам.

Платежный неттинг

- 3.5. Если в какую-либо дату Стороны обязаны уплатить друг другу суммы:
- (А) в одной и той же валюте и
 - (Б) по одной и той же Сделке,
- то в эту дату обязательства обеих Сторон уплатить такие суммы прекращаются автоматически и расчеты производятся в соответствии с пунктом 3.6 настоящей статьи 3.
- 3.6. Если при проведении платежного неттинга в соответствии с пунктом 3.5 настоящей статьи 3 общая сумма обязательства одной Стороны превышает общую сумму обязательства другой Стороны, обязательство первой Стороны прекращается в части, равной сумме обязательства другой Стороны, а обязательство последней прекращается полностью. По инициативе любой из Сторон Стороны сверяют подлежащую уплате разницу между суммами обязательств Сторон до совершения соответствующего платежа.

Недопустимость зачета

- 3.7. Возникшие из разных Сделок обязательства Сторон по совершению в пользу друг друга платежей в одну и ту же дату не могут быть прекращены зачетом и прекращаются только по соглашению Сторон, если Генеральным соглашением не предусмотрено иное.

4. Заявления и заверения Сторон

- 4.1. В день заключения Генерального соглашения, в каждую дату, в которую соответствующей Стороной подписывается Документ об обеспечении, а также в каждую Дату сделки каждая из Сторон делает заявления и предоставляет другой Стороне заверения по вопросам, указанным в настоящей статье 4. В Генеральном соглашении или Подтверждении Стороны могут предусмотреть дополнительные заявления или заверения.

Заявления Сторон

- 4.2. **Статус юридического лица.** Сторона является юридическим лицом, созданным в соответствии с законодательством Российской Федерации.
- 4.3. **Правоспособность и полномочия.** Сторона:
- (а) обладает правоспособностью для заключения Генерального соглашения, в том числе каждой из Сделок, и подписания Документа об обеспечении, а также исполнения своих обязательств по ним;

- (б) выполнила все требования по одобрению и (или), если требуется в соответствии с законом или учредительными документами Стороны, утверждению, получению согласия на заключение, уведомлению и (или) согласованию с органами управления Стороны Генерального соглашения, в том числе каждой из Сделок, и Документа об обеспечении;
 - (в) предприняла все необходимые действия по надлежащему оформлению полномочий лиц на заключение Генерального соглашения, в том числе каждой из Сделок, и подписание Документа об обеспечении и каждого Подтверждения.
- 4.4. **Отсутствие нарушения или противоречия.** Заключение и исполнение Стороной Генерального соглашения, в том числе каждой из Сделок, а также подписание и исполнение Стороной Документа об обеспечении не противоречат законодательству, учредительным документам этой Стороны, актам судебного или иного государственного органа либо органа местного самоуправления, применимым к этой Стороне, либо обязательным для этой Стороны положениям договоров и односторонних сделок.
- 4.5. **Разрешения государственных органов.** Все разрешения, согласия и одобрения государственных органов, которые Сторона обязана получить для заключения и исполнения Генерального соглашения, в том числе каждой из Сделок, а также подписание и исполнения Документа об обеспечении, были ею получены и действуют, и все их условия соблюдаются.
- 4.6. **Лицензии.** Сторона имеет все лицензии, необходимые для осуществления ее деятельности в целом, для заключения и исполнения Генерального соглашения, в том числе каждой из Сделок, а также подписание и исполнения Документа об обеспечении, и соблюдает все лицензионные требования и условия.
- 4.7. **Отсутствие отдельных событий.** В отношении Стороны не имеет место какое-либо событие, составляющее Нарушение обязательств, Технический дефолт, Банкротство, Потенциальное банкротство или (насколько известно Стороне) Иное основание досрочного прекращения. Заключение и исполнение Стороной Генерального соглашения, в том числе каждой из Сделок, а также подписание и исполнение Стороной Документа об обеспечении не приведут к возникновению любого из таких событий.
- 4.8. **Отсутствие судебных и иных разбирательств.** Против Стороны, лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, если оно указано в этом качестве в Генеральном соглашении (далее — «**Лицо, предоставляющее обеспечение**» или, применительно к Стороне, «**Лицо, предоставляющее обеспечение исполнения обязательств этой Стороны**»)), или связанного с этой Стороной лица, если оно указано в этом качестве в Генеральном соглашении (далее — «**Связанное лицо**»)), не подано исковых или иных заявлений в суд, арбитражный суд, третейский суд, государственный или иной орган или организацию либо должностному лицу, которые могут привести к недействительности или невозможности принудительного исполнения Генерального соглашения, в том числе каждой из Сделок, или Документа об обеспечении, подписанного этой Стороной или Лицом, предоставляющим обеспечение, либо

существенно повлиять на способность Стороны или Лица, предоставляющего обеспечение, исполнить обязательства по Генеральному соглашению, в том числе каждой Сделке, или такому Документу об обеспечении.

- 4.9. Достоверность представленной информации. Информация, представленная в письменной форме Стороной или от ее имени либо по ее поручению третьим лицом другой Стороне и определенная в Генеральном соглашении как информация, подпадающая под действие настоящего пункта 4.9, является на дату ее представления достоверной, точной и полной в любом существенном отношении.

Заверения Сторон

- 4.10. Каждая из Сторон обязуется:

- (а) предпринимать все разумные действия по получению разрешений, согласий и одобрений государственных органов, необходимых для исполнения ею обязательств по Генеральному соглашению, в том числе каждой Сделке, и Документу об обеспечении, подписанному этой Стороной, соблюдать условия полученных разрешений, согласий и одобрений, а также предпринимать все меры, необходимые для сохранения их действия;
- (б) соблюдать нормативные правовые и иные акты государственных органов и органов местного самоуправления, несоблюдение которых может оказать существенное неблагоприятное воздействие на ее способность исполнить свои обязательства по Генеральному соглашению и Документу об обеспечении.

5. Основания досрочного прекращения обязательств по Сделкам

Нарушение обязательства

- 5.1. Наступление любого из следующих событий (каждое из которых далее — **«Нарушение обязательства»**) является (с учетом пунктов 5.4–5.6 настоящей статьи 5 и пункта 6.14 статьи 6 Примерных условий договора) основанием досрочного прекращения обязательств Сторон по всем Сделкам в соответствии с пунктом 6.2 статьи 6 Примерных условий договора.

- (а) **Просрочка платежа или поставки.** Просрочка Стороной какого-либо платежа или поставки по Сделке, если указанное нарушение продолжается после истечения следующего Рабочего дня после получения Стороной-должником уведомления о такой просрочке.
- (б) **Иное нарушение Генерального соглашения. Отказ от Генерального соглашения.**
 - (А) Неисполнение или ненадлежащее исполнение Стороной любого обязательства (кроме обязательства по платежу или поставке по Сделке или направлению уведомления об Ином основании досрочного прекращения) по Генеральному соглашению, если такое неисполнение или ненадлежащее исполнение продолжается по истечении тридцати календарных дней после получения этой Стороной уведомления о таком нарушении.

- (Б) Отрицание Стороной факта заключения Генерального соглашения или Сделки, отказ от их исполнения (полностью или частично), оспаривание их действительности.
- (в) ***Нарушение обязательств по Документам об обеспечении.***
- (А) Неисполнение или ненадлежащее исполнение Стороной или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, какого-либо обязательства по Документу об обеспечении, если такое неисполнение или ненадлежащее исполнение продолжает иметь место по истечении применимого Льготного периода.
- (Б) Истечение срока, прекращение, признание недействительным, признание не подлежащим судебной защите или приостановление действия Документа об обеспечении либо права, предоставленного Стороне-кредитору по Документу об обеспечении (кроме случаев, когда возможность такого истечения срока, прекращения или приостановления предусмотрена Документом об обеспечении).
- (В) Отрицание Стороной или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, факта заключения, отказ кем-либо из них от исполнения (полностью или частично) или оспаривание кем-либо из них действительности Документа об обеспечении.
- (г) ***Введение в заблуждение или обман. Предоставление*** Стороной или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, в Генеральном соглашении, Подтверждении или Документе об обеспечении заявления, являющегося существенно неточным, неполным или недостоверным на момент его предоставления.
- (д) ***Нарушение обязательства по Иной срочной сделке.***
- (А) Нарушение Стороной, ее Связанным лицом или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, обязательства по Иной срочной сделке или обязательства по обеспечению исполнения обязательств по такой Иной срочной сделке, в результате которого, после выполнения применимых требований о направлении уведомления и по истечении применимого Льготного периода, у контрагента возникает право потребовать ее досрочного исполнения или расторгнуть Иную срочную сделку.
- (Б) Нарушение Стороной, ее Связанным лицом или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, обязательства (после выполнения применимых требований о направлении уведомления и по истечении применимого Льготного периода, а при отсутствии Льготного периода — по истечении одного Рабочего дня) по осуществлению какого-либо платежа или поставки, причитающейся в последнюю дату платежа или поставки по Иной срочной сделке или обязательства по обеспечению обязательств по такой Иной срочной сделке, либо платежа при досрочном исполнении или расторжении Иной срочной сделки либо генерального соглашения, которым она регулируется.

- (В) Отрицание Стороной, ее Связанным лицом или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, факта заключения, отказ кем-либо из них от исполнения (полностью или частично) или оспаривание кем-либо из них действительности Иной срочной сделки, или обязательства по обеспечению исполнения обязательств по такой Иной срочной сделке.
- (е) **Обращение взыскания или наложение ареста.** Обращение взыскания или наложение ареста на все или существенную часть имущества Стороны, ее Связанного лица или Лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, либо передача такого имущества (всего или его существенной части) на хранение в порядке секвестра. Размер части имущества соответствующего лица, признаваемый Сторонами существенным для целей настоящего подпункта (е), может быть определен в Генеральном соглашении.
- (ж) **Нарушение долговых обязательств (кросс-дефолт).**
- (А) Нарушение Стороной, ее Связанным лицом или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, обязательства или обязательств по Задолженности по долговым обязательствам, вследствие чего такая Задолженность по долговым обязательствам становится срочной к погашению или может быть истребована кредитором (-ами) к досрочному погашению, если сумма основного долга по такой Задолженности по долговым обязательствам, рассчитываемая по совокупности нарушенных обязательств Стороны, ее Связанного лица и (или) Лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, и с учетом суммы, указанной в подпункте (Б) ниже, равна или превышает пороговую сумму (далее — **«Пороговая сумма»**), установленную для этой Стороны в Генеральном соглашении.
- (Б) Просрочка Стороной, ее Связанным лицом или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, одного или нескольких платежей по Задолженности по долговым обязательствам после истечения Льготных периодов и направления уведомлений, если применимо, если сумма просрочки, рассчитываемая по совокупности просроченных Стороной, ее Связанным лицом и (или) Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, платежей и с учетом суммы, указанной в подпункте (А) выше, равна или превышает Пороговую сумму, установленную для этой Стороны в Генеральном соглашении.

Если в Генеральном соглашении Пороговая сумма не установлена для одной или обеих Сторон, то к такой Стороне или к обеим Сторонам настоящий подпункт (ж) не применяется.

(з) **Ликвидация.**

- (А) Принятие решения о ликвидации или назначении ликвидационной комиссии (ликвидатора) Стороны, ее Связанного лица или Лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны,

учредителями (участниками) либо органом соответствующего лица, уполномоченным учредительными документами, или судом.

- (Б) Предъявление уполномоченным государственным органом, Банком России или органом местного самоуправления в суд требования о ликвидации Стороны, ее Связанного лица или Лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, по основаниям, предусмотренным законодательством Российской Федерации.
- (В) Осуществление иных аналогичных мер, действий или процедур по ликвидации, предусмотренных законодательством, применимым к соответствующему лицу.
- (и) **Ограничение на проведение или запрет на осуществление банковских операций.** Если Сторона, ее Связанное лицо или Лицо, предоставляющее обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, является кредитной организацией, введение Банком России ограничения на проведение или запрета на осуществление отдельных банковских операций, предусмотренных выданной Стороне, ее Связанному лицу или Лицу, предоставляющему обеспечение, лицензией на осуществление банковских операций, либо запрета на открытие филиалов.

Несостоятельность (банкротство)

- 5.2. Наступление в отношении Стороны, ее Связанного лица или Лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, любого из следующих событий (далее каждое из которых — **«Банкротство»**) является (с учетом пунктов 5.4–5.6 настоящей статьи 5 и 6.14 статьи 6 Примерных условий договора) основанием досрочного прекращения обязательств по всем Сделкам в соответствии с пунктом 6.2 или 6.3 статьи 6 Примерных условий договора:
- (а) финансовое состояние отвечает признакам несостоятельности (банкротства) и (или) основаниям для осуществления мер по предупреждению банкротства, установленным законодательством Российской Федерации;
 - (б) принимаются меры по предупреждению банкротства, установленные законодательством Российской Федерации;
 - (в) отзывается, аннулируется или приостанавливается лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг либо иная лицензия, имеющая существенное значение для деятельности Стороны, ее Связанного лица или Лица, предоставляющего обеспечение, в том числе такая лицензия, без которой невозможно заключение и исполнение Генерального соглашения, Сделок и Документа об обеспечении;
 - (г) в арбитражный суд подается заявление уполномоченным лицом или органом о признании банкротом (кроме подачи заявления другой Стороной в связи с неисполнением обязательств по Генеральному соглашению); при этом, если заявление подается конкурсным кредитором, такое событие является основанием для прекращения обязательств по Сделкам в соответствии с настоящим пунктом 5.2 только в случае, если арбитражный суд в течение тридцати календарных дней с даты вынесения определения о принятии за-

явления о признании должника банкротом не выносит определения об отказе во введении наблюдения и оставлении заявления без рассмотрения, определения об отказе во введении наблюдения и прекращении производства по делу о банкротстве, определения о возвращении такого заявления, определения о прекращении производства по делу о банкротстве, решения об отказе в признании банкротом либо иного аналогичного судебного акта, результатом которого становится прекращение производства по делу о банкротстве или отказ в возбуждении такого производства;

- (д) вводятся процедуры, применяемые в деле о банкротстве, установленные законодательством Российской Федерации, в том числе наблюдение, финансовое оздоровление, внешнее управление, и (или) назначается арбитражный управляющий либо аналогичный орган/должностное лицо;
- (е) арбитражным судом принимается решение о признании Стороны, ее Священного лица или Лица, предоставляющего обеспечение, банкротом, и открывается конкурсное производство;
- (ж) если Сторона, ее Священное лицо или Лицо, предоставляющее обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, является кредитной организацией, также следующие события:
 - (А) в случаях, предусмотренных законодательством о банкротстве, Банк России требует реорганизации Стороны, ее Священного лица или Лица, предоставляющего обеспечение, либо замены членов совета директоров (наблюдательного совета), единоличного исполнительного органа, его заместителей, членов коллегиального исполнительного органа, главного бухгалтера, заместителей главного бухгалтера Стороны, ее Священного лица или Лица, предоставляющего обеспечение;
 - (Б) в Банк России уполномоченным лицом или органом (за исключением конкурсных кредиторов) направляется заявление или ходатайство об отзыве лицензии на осуществление банковских операций;
 - (В) отзывается, аннулируется лицензия на осуществление банковских операций или приостанавливается ее действие;
 - (Г) Банк России назначает временную администрацию или уполномоченного представителя Банка России в связи с отзывом лицензии на осуществление банковских операций;
- (з) иные аналогичные меры, действия или процедуры, предусмотренные законодательством о несостоятельности (банкротстве), применимым к соответствующему лицу.

Иные основания досрочного прекращения

- 5.3. Наступление в отношении Стороны, ее Священного лица или Лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны (такая Сторона далее именуется «*Затронутая сторона*»), любого из следующих событий: Юридическое ограничение, Непреодолимая сила, Снижение платежеспособности вследствие реорганизации или Дополнительное основание прекращения (далее каждое из которых — «*Иное основание досрочного прекращения*») —

является (с учетом пунктов 5.4–5.6 настоящей статьи 5) основанием досрочного прекращения обязательств Сторон по Затронутым сделкам в соответствии с пунктами 6.4–6.6 статьи 6 Примерных условий договора.

- (а) **Юридическое ограничение** означает принятие нормативного правового акта, решения Конституционного Суда Российской Федерации, решения суда о признании недействительным нормативного акта государственного органа или органа местного самоуправления, предписания или иного обязательного к исполнению документа каким-либо уполномоченным органом власти Российской Федерации или иностранного государства, в том числе Банком России или центральным банком либо органом банковского надзора иностранного государства или каким-либо уполномоченным органом местного самоуправления (за исключением случаев, когда такой документ принимается в ответ на действие или бездействие Стороны), вследствие чего, с учетом возможности исполнения альтернативного обязательства или иных мер, согласованных Сторонами и указанных в Подтверждении или Генеральном соглашении либо определяемых в соответствии с ними, исполнение Стороной или Лицом, предоставляющим обеспечение, каких-либо или всех ее/его обязательств по платежу или поставке, а также иных существенных обязательств по Сделке или Документу об обеспечении или принятие Стороной платежа или поставки становится или станет незаконным.
- (б) **Непреодолимая сила** означает любое из следующих чрезвычайных и непредотвратимых при данных условиях обстоятельств, если вследствие его наступления, с учетом возможности исполнения альтернативного обязательства или иных мер, согласованных Сторонами и указанных в Подтверждении или Генеральном соглашении либо определяемых в соответствии с ними, оказывается невозможным надлежащее исполнение Стороной или Лицом, предоставляющим обеспечение, какого-либо или всех ее/его обязательств по платежу или поставке либо иных существенных обязательств по Сделке или Документу об обеспечении:
- (А) восстание, бунт, революция, вторжение или блокада;
 - (Б) пожар, наводнение или другие стихийные бедствия;
 - (Г) война, гражданская война, военные действия, введение чрезвычайного или военного положения;
 - (Д) иные чрезвычайные и непредотвратимые при данных условиях обстоятельства, наступившие после заключения Сделки или подписания Документа об обеспечении.
- (в) **Снижение платежеспособности вследствие реорганизации** означает, что непосредственно после проведения реорганизации Стороны, ее Связанного лица или Лица, предоставляющего обеспечение, либо передачи всего или существенной части ее/его/их имущества третьему лицу, существенно снижается платежеспособность Стороны, ее Связанного лица или Лица, предоставляющего обеспечение, либо правопреемника Стороны по обязательствам по Генеральному соглашению, правопреемника Лица, предоставляющего обеспечение, по обязательствам по Документу об обеспечении или правопреемника Связанного лица. Размер части имущества соответствующей

щего лица, признаваемый Сторонами существенным для целей настоящего подпункта (в) может быть определен в Генеральном соглашении.

- (г) **Дополнительное основание прекращения.** В Генеральном соглашении или Подтверждении Стороны могут предусмотреть дополнительное основание прекращения обязательств Сторон по Сделкам (далее — **«Дополнительное основание прекращения»**), применимое к обеим Сторонам или одной из них, с указанием Затронутой стороны.

Соотношение оснований досрочного прекращения обязательств по Сделкам

- 5.4. Если какое-либо событие, которое при отсутствии настоящего пункта 5.4 могло бы рассматриваться как Нарушение обязательства, указанное в подпункте (а), подпункте (А) подпункта (б) или подпункте (А) подпункта (в) пункта 5.1 настоящей статьи 5 (в отношении обязательств по поставке или платежу, а также иных имеющих существенное значение обязательств по Генеральному соглашению, какой-либо Сделке или Документу об обеспечении), также составляет Юридическое ограничение или действие Непреодолимой силы, к такому событию применяются последствия, установленные для Юридического ограничения или Непреодолимой силы соответственно.
- 5.5. Кроме случаев, указанных в пункте 5.4 настоящей статьи 5, если какое-либо событие представляет собой Нарушение обязательства, Банкротство или Иное основание досрочного прекращения и одновременно составляет Юридическое ограничение или действие Непреодолимой силы, к такому событию применяются последствия, установленные для Нарушения обязательства, Банкротства или Иного основания досрочного прекращения соответственно.
- 5.6. С учетом пунктов 5.4 и 5.5 настоящей статьи 5, если какое-либо событие, которое при отсутствии настоящего пункта 5.6 могло бы рассматриваться как действие Непреодолимой силы, также составляет Юридическое ограничение, к такому событию применяются последствия, установленные для Юридического ограничения.

6. Досрочное прекращение обязательств по Сделкам.

Ликвидационный неттинг

Дата досрочного прекращения

- 6.1. В случае досрочного прекращения обязательств по Сделкам в соответствии с настоящей статьей 6 вследствие Нарушения обязательства, Банкротства или Иного основания досрочного прекращения, обязательства по соответствующим Сделкам прекращаются в дату, определяемую в соответствии с пунктами 6.2, 6.3 или 6.6 настоящей статьи 6 (далее — **«Дата досрочного прекращения»**).

Досрочное прекращение вследствие Нарушения обязательства или Банкротства

- 6.2. Если происходит и продолжает иметь место Нарушение обязательства или Банкротство (кроме случаев, предусмотренных подпунктом (е) пункта 5.2 и подпунктом (В) подпункта (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий дого-

вора) Стороны (далее — «**Нарушившая сторона**»), другая Сторона (далее — «**Ненарушившая сторона**») вправе досрочно прекратить обязательства по всем Сделкам (при этом прекращение обязательств по части Сделок, заключенных в соответствии с Генеральным соглашением, не допускается) и направить Нарушившей стороне уведомление о соответствующем Нарушении обязательства или Банкротстве, в котором должна быть указана Дата досрочного прекращения, устанавливаемая не позднее двадцати календарных дней после дня направления, но не ранее дня получения этого уведомления.

- 6.3. Если в отношении Стороны наступает Банкротство, указанное в подпункте (е) пункта 5.2 (применительно к юридическим лицам, не являющимся кредитными организациями) или подпункте (В) подпункта (ж) пункта 5.2 (применительно к кредитным организациям) статьи 5 Примерных условий договора, обязательства Сторон по всем Сделкам прекращаются автоматически в Рабочий день, непосредственно предшествующий дню наступления Банкротства. Такая дата считается Датой досрочного прекращения, Сторона, в отношении которой наступило Банкротство, — Нарушившей стороной, а другая Сторона — Ненарушившей стороной.

Досрочное прекращение вследствие возникновения Иного основания досрочного прекращения

- 6.4. **Уведомление.** В случае возникновения Иного основания досрочного прекращения Затронутая сторона обязана немедленно, после того как ей стало об этом известно, уведомить об этом другую Сторону, указав характеристики Иного основания досрочного прекращения и перечень Затронутых сделок, а также представить другой Стороне информацию об Ином основании досрочного прекращения, которую другая Сторона может обоснованно потребовать.
- 6.5. В случае введения Юридического ограничения или возникновения Непреодолимой силы Стороны вправе не исполнять свои обязательства по Затронутым сделкам до истечения Периода ожидания (как он определен ниже) или, если действие Юридического ограничения или Непреодолимой силы прекращается в более раннюю дату, то до такой даты. Если действие Юридического ограничения сохраняется более трех календарных дней, а Непреодолимой силы — более восьми календарных дней (далее — «**Период ожидания**») и в течение этого времени Стороны не достигнут соглашения относительно изменения условий или прекращения Затронутых сделок, то по истечении Периода ожидания отложенные обязательства по Затронутым сделкам становятся подлежащими исполнению и Стороны вправе применить положения пункта 6.6 настоящей статьи 6 о досрочном прекращении.
- 6.6. **Право досрочного прекращения.**
- (а) Любая из Сторон (в случае введения Юридического ограничения, возникновения Непреодолимой силы или наступления Дополнительного основания прекращения, при котором обе Стороны являются Затронутыми сторонами) либо Незатронутая сторона (в случае Снижения платежеспособности вследствие реорганизации или наступления Дополнительного основания прекращения, при котором только одна Сторона является Затронутой сто-

роной) вправе досрочно прекратить обязательства по всем Затронутым сделкам, если Иное основание досрочного прекращения продолжает иметь место (применительно к Юридическому ограничению и Непреодолимой силе — по истечении применимого Периода ожидания), и направить другой Стороне уведомление с указанием Даты досрочного прекращения, устанавливаемой не позднее двадцати календарных дней после дня направления, но не ранее дня получения этого уведомления.

- (б) С учетом положений подпункта (в) настоящего пункта 6.6, в случае введения Юридического ограничения или возникновения Непреодолимой силы и продолжении их действия по истечении применимого Периода ожидания любая из Сторон вправе досрочно прекратить обязательства по части, но не по всем Затронутым сделкам, указав в соответствующем уведомлении Затронутые сделки, обязательства по которым прекращаются досрочно; при этом в уведомлении о прекращении указывается Дата досрочного прекращения, устанавливаемая не позднее двадцати календарных дней после дня направления, но не ранее чем по истечении двух Рабочих дней со дня получения этого уведомления. В этом случае другая Сторона вправе направить встречное уведомление о досрочном прекращении обязательств по всем Затронутым сделкам в указанную первой Стороной Дату досрочного прекращения при условии, что встречное уведомление будет получено первой Стороной не позднее Даты досрочного прекращения.
- (в) В случае, если Юридическое ограничение или Непреодолимая сила относится к исполнению Затронутой стороной или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, обязательств по платежу или поставке или иных существенных обязательств по Документу об обеспечении, такая Затронутая сторона вправе досрочно прекратить обязательства по Затронутым сделкам только в случае получения уведомления от другой Стороны о досрочном прекращении обязательств по части, но не по всем Затронутым сделкам в соответствии с подпунктом (б) настоящего пункта 6.6.

Последствия уведомления о досрочном прекращении обязательств по Сделкам

- 6.7. Если уведомление о досрочном прекращении обязательств по Сделкам направляется в соответствии с пунктом 6.2 или 6.6 настоящей статьи 6, обязательства Сторон по Прекращаемым сделкам прекращаются досрочно в день, указанный в уведомлении в качестве Даты досрочного прекращения, независимо от того, продолжает ли иметь место Нарушение обязательства, Банкротство или Иное основание досрочного прекращения на Дату досрочного прекращения, без ущерба для других положений Генерального соглашения.

Уведомление о сумме денежного обязательства при прекращении

- 6.8. *Уведомление о сумме денежного обязательства при прекращении.* В Дату досрочного прекращения либо в возможно короткий срок после ее наступления Ненарушившая или Незатронутая сторона (в зависимости от основания досрочного прекращения обязательств по Сделкам):

- (а) производит расчет суммы денежного обязательства, подлежащей уплате при досрочном прекращении обязательств по Сделкам (далее — «**Сумма денежного обязательства при прекращении**»), в порядке, установленном пунктом 6.10 настоящей статьи 6, и
- (б) направляет Нарушившей или Затронутой стороне уведомление, содержащее:
 - (А) Сумму денежного обязательства при прекращении на дату расчета;
 - (Б) обоснование расчета (включая котировки, рыночную информацию или информацию из внутренних источников, на основании которых произведен расчет);
 - (В) реквизиты банковского счета, на который должна быть перечислена Сумма денежного обязательства при прекращении, уплачиваемая в пользу этой Стороны.

При наличии двух Затронутых сторон обе Стороны направляют друг другу Уведомления о сумме денежного обязательства при прекращении, в которых вместо Суммы денежного обязательства при прекращении указывают суммы, рассчитанные в соответствии с абзацем первым подпункта (Б) подпункта (б) пункта 6.10 настоящей статьи 6.

Ликвидационная сумма

- 6.9. В целях расчета Суммы денежного обязательства при прекращении, применительно к каждой Прекращаемой сделке (с учетом подпункта (з) настоящего пункта 6.9) Определяющая сторона, действуя разумно и добросовестно, определяет текущую рыночную стоимость (цену) (положительную или отрицательную, как указано ниже) Прекращаемой сделки путем определения суммы, которая подлежала бы уплате при заключении Определяющей стороной замещающей сделки, то есть сделки на условиях, аналогичных условиям Прекращаемой сделки, имеющим значение для определения ее рыночной стоимости (цены), с той же датой (датами) платежа или поставки, что и Прекращаемая сделка (далее в совокупности стоимость замещения всех Прекращаемых сделок — «**Ликвидационная сумма**»).
- (а) Если Определяющая сторона произвела или произвела бы платеж при заключении замещающей сделки, то сумма этого платежа в целях расчета Ликвидационной суммы выражается положительным числом. Если Определяющая сторона получила или получила бы платеж при заключении замещающей сделки, то сумма этого платежа в целях расчета Ликвидационной суммы выражается отрицательным числом.
 - (б) В целях определения Ликвидационной суммы Определяющая сторона должна запросить не менее чем у четырех Дилеров-ориентиров котировки на заключение замещающих сделок, имеющие силу оферты (твердые котировки). Эти котировки могут учитывать платежеспособность Определяющей стороны и условия соглашений (в том числе в части обеспечения исполнения обязательств Определяющей стороны) между Определяющей стороной и представляющим котировку Дилером-ориентиром. При запросе котировок Определяющая сторона вправе дать указание Дилерам-ориен-

тирам при предоставлении котировок исходить из того, что исполнение сторонами обязательств по замещающей сделке обеспечивается в порядке, аналогичном порядку обеспечения исполнения обязательств сторон по Прекращаемой Сделке, если таковые имеются.

- (в) Если предоставлено более трех котировок, используется среднее арифметическое котировок, без учета самого высокого и самого низкого значений. Если предоставлены три котировки, используется котировка, оставшаяся после исключения самой высокой и самой низкой котировок (если более одной котировки имеют одинаковое самое высокое или низкое значение, не учитывается только одна из этих котировок).
- (г) Если предоставлено менее трех котировок, а также если по заключению Определяющей стороны в силу недостаточной ликвидности на соответствующем рынке или иных обстоятельств получение твердых котировок невозможно либо такие котировки не будут отражать справедливую рыночную стоимость Прекращаемой сделки, для определения Ликвидационной суммы Определяющая сторона вправе использовать любую необходимую информацию, в том числе:
 - (А) котировки, не обязывающие Дилера-ориентира заключать замещающую сделку (индикативные котировки);
 - (Б) рыночные показатели или данные, представленные одним или несколькими третьими лицами (в том числе брокерами и (или) дилерами на соответствующих рынках, биржами, информационными агентствами, финансовыми аналитиками и прочими источниками рыночной информации), включая среди прочего процентные ставки, цены, показатели доходности, волатильность, спреда, корреляции и прочие данные, влияющие на расчет Ликвидационной суммы;
 - (В) информацию, указанную в подпунктах (А) и (Б) выше, полученную из внутренних источников (включая Аффилированных лиц Определяющей стороны), если информация такого рода обычно используется Определяющей стороной для оценки подобных сделок.
- (д) При определении Ликвидационной суммы Определяющая сторона вправе учесть, если это не приведет к дублированию сумм, рассчитанных в соответствии с подпунктами (б)–(г) настоящего пункта 6.9, обоснованные издержки или расходы, понесенные в связи с прекращением или восстановлением хеджирования в связи с Прекращаемой сделкой. При этом под хеджированием понимается заключение сделок (в том числе договоров, являющихся производными финансовыми инструментами) при заключении Прекращаемой сделки или Прекращаемых сделок или в течение срока ее или их действия в целях компенсации потерь по Прекращаемой сделке или Прекращаемым сделкам, которые могут возникнуть в результате неблагоприятного изменения цены базового актива или иного показателя по Прекращаемой сделке или Прекращаемым сделкам. Если обратное не предусмотрено Генеральным соглашением и при условии, что это не приведет к дублированию сумм, рассчитанных в соответствии с подпунктами (б)–(г) настоящего пункта 6.9, при определении Ликвидационной суммы Определяющая сторона также вправе учесть (i) расходы, понесенные в результате

досрочного прекращения заемных обязательств (в том числе перед третьими лицами) в связи с досрочным прекращением обязательств по Прекращаемой сделке, (ii) расходы, понесенные в результате досрочного прекращения заемных обязательств (в том числе перед третьими лицами) в связи с прекращением или восстановлением хеджирования в связи с Прекращаемой сделкой, и (iii) свою стоимость использования заемных средств. При этом под стоимостью использования заемных средств понимается приведенная стоимость расходов по уплате процентов, которые Определяющая сторона понесла бы при привлечении заемных средств для финансирования сальдо приведенной стоимости платежей (или поставок) по Прекращаемой сделке, срок которых, если бы не досрочное прекращение обязательств по Прекращаемой сделке, наступил бы после Даты прекращения. При этом для целей расчета приведенной стоимости используется коэффициент дисконтирования, применяемый для будущих платежей в соответствующей валюте, без учета кредитного риска Определяющей стороны.

- (е) Просроченные суммы по Прекращаемой сделке или группе Прекращаемых сделок, а также расходы, указанные в статье 9 Примерных условий договора, не учитываются при расчете Ликвидационной суммы.
- (ж) Ликвидационная сумма определяется на Дату досрочного прекращения, а если это будет невозможно, — на ближайший день после Даты досрочного прекращения, когда это станет возможным.
- (з) В рамках расчета Ликвидационной суммы Определяющая сторона вправе рассчитывать текущую рыночную стоимость какой-либо группы (групп) Прекращаемых сделок и (или) каждой Прекращаемой сделки по отдельности.

Расчет Суммы денежного обязательства при прекращении

6.10. Сумма денежного обязательства при прекращении определяется в соответствии с настоящим пунктом 6.10 с учетом пункта 6.15 настоящей статьи 6.

- (а) **Нарушение обязательства и Банкротство.** В случае досрочного прекращения обязательств по Сделкам вследствие Нарушения обязательства или Банкротства Сумма денежного обязательства при прекращении будет равна сумме (i) Эквивалента в валюте прекращения Ликвидационной суммы (в положительном или отрицательном значении), определенной Ненарушившей стороной, и (ii) разности (А) Эквивалента в валюте прекращения Просроченных сумм, причитающихся Ненарушившей стороне, и (Б) Эквивалента в валюте прекращения Просроченных сумм, причитающихся Нарушившей стороне (формула расчета приводится ниже).

$$\begin{array}{r}
 \text{Сумма денежного} \\
 \text{обязательства} \\
 \text{при прекращении}
 \end{array}
 =
 \begin{array}{r}
 \text{Эквивалент} \\
 \text{в валюте} \\
 \text{прекращения} \\
 \text{Ликвидационной} \\
 \text{суммы}
 \end{array}
 +
 \left(
 \begin{array}{r}
 \text{Эквивалент в} \\
 \text{валюте прекращения} \\
 \text{Просроченных сумм,} \\
 \text{причитающихся} \\
 \text{Ненарушившей} \\
 \text{стороне}
 \end{array}
 -
 \begin{array}{r}
 \text{Эквивалент в} \\
 \text{валюте прекращения} \\
 \text{Просроченных сумм,} \\
 \text{причитающихся} \\
 \text{Нарушившей стороне}
 \end{array}
 \right)$$

Если Сумма денежного обязательства при прекращении имеет положительное значение, Нарушившая сторона обязана уплатить эту сумму Ненарушившей стороне, если отрицательное — Ненарушившая сторона обязана

уплатить абсолютную величину Суммы денежного обязательства при прекращении Нарушившей стороне.

В случае автоматического прекращения обязательств Сторон по всем Сделкам в соответствии с пунктом 6.3 настоящей статьи 6 при расчете Суммы денежного обязательства при прекращении учитываются платежи и (или) поставки, осуществленные одной Стороной в пользу другой Стороны в период с Даты досрочного прекращения до дня уплаты Суммы денежного обязательства при прекращении, определяемого в соответствии с пунктом 6.12 настоящей статьи 6.

В случае досрочного прекращения обязательств по Сделкам вследствие наступления в отношении Стороны Банкротства, указанного в подпунктах (д) и (е) или подпункта (В) подпункта (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора, Сумма денежного обязательства при прекращении не может включать возмещение убытков в форме упущенной выгоды и взыскание неустоек.

(б) **Иные основания досрочного прекращения.** В случае досрочного прекращения обязательств по Затронутым сделкам вследствие Иного основания досрочного прекращения Сумма денежного обязательства при прекращении рассчитывается с учетом следующих особенностей.

(А) *Одна Затронутая сторона.* С учетом подпункта (В) ниже при наличии одной Затронутой стороны Сумма денежного обязательства при прекращении определяется в соответствии с подпунктом (а) настоящего пункта 6.10. При этом ссылки на Нарушившую и Ненарушившую стороны означают ссылки на Затронутую и Незатронутую стороны соответственно.

(Б) *Две Затронутые стороны.* С учетом подпункта (В) ниже при наличии двух Затронутых сторон каждая Сторона определяет сумму, равную Эквиваленту в валюте прекращения Ликвидационной суммы (в положительном или отрицательном значении). Сторона, чья Ликвидационная сумма превышает Ликвидационную сумму другой Стороны, в целях настоящего подпункта (Б) именуется «**Первая сторона**», а другая Сторона — «**Вторая сторона**».

При этом Сумма денежного обязательства при прекращении будет равна сумме (i) половины разницы между суммой, определенной Первой стороной, и суммой, определенной Второй стороной, и (ii) разности (А) Эквивалента в валюте прекращения Просроченных сумм, причитающихся Первой стороне, и (Б) Эквивалента в валюте прекращения Просроченных сумм, причитающихся Второй стороне (формула расчета приводится ниже).

$$\text{Сумма денежного обязательства при прекращении} = \left(\frac{\text{Сумма, определенная Первой стороной} - \text{Сумма, определенная Второй стороной}}{2} \right) + \left(\text{Эквивалент в валюте прекращения Просроченных сумм, причитающихся Первой стороне} - \text{Эквивалент в валюте прекращения Просроченных сумм, причитающихся Второй стороне} \right)$$

Если Сумма денежного обязательства при прекращении имеет положительное значение, Вторая сторона обязана уплатить эту сумму Первой стороне, а если отрицательное — Первая сторона обязана уплатить абсолютную величину Суммы денежного обязательства при прекращении Второй стороне.

- (В) *Среднее значение между ценой спроса и ценой предложения.* Если Иным основанием досрочного прекращения является Юридическое ограничение или Непреодолимая сила, Сумма денежного обязательства при прекращении определяется в соответствии с подпунктом (А) или (Б) настоящего подпункта (б), за исключением того, что для целей определения Ликвидационной суммы Определяющая сторона обязана:
- (аа) при получении котировок от одного и более третьих лиц (или от Аффилированного лица Определяющей стороны) дать указание каждому из этих лиц представить среднее значение между котировками на заключение замещающей сделки для каждой из Сторон без учета платежеспособности Сторон и условий их соглашений (в том числе в части обеспечения исполнения обязательств) с этим лицом;
 - (бб) в остальных случаях — использовать среднее значение между оценочной стоимостью заключения замещающей сделки для одной и для другой Стороны без учета платежеспособности Сторон.

Проценты на Просроченные суммы

- 6.11. Для целей расчета Просроченной суммы по Сделке и в пределах, допускаемых законодательством Российской Федерации, Проценты начисляются на сумму какого-либо денежного обязательства или сумму, равную текущей рыночной стоимости предмета поставки в валюте Просроченной суммы за период со дня (исключая этот день), когда соответствующее обязательство должно было быть исполнено (в том числе, если бы не действие пункта 3.3 статьи 3 Примерных условий договора или пункта 6.5 настоящей статьи 6), по соответствующую Дату досрочного прекращения (включительно).

Дата платежа

- 6.12. Сумма денежного обязательства при прекращении подлежит уплате:
- (а) при досрочном прекращении обязательств по Сделкам вследствие Нарушения обязательства или Банкротства в день получения Нарушившей стороной Уведомления о сумме денежного обязательства при прекращении в соответствии с пунктом 6.8 настоящей статьи 6; при этом в случае прекращения обязательств по Сделкам вследствие наступления Банкротства срок для уплаты Суммы денежного обязательства при прекращении не должен превышать 30 дней с Даты досрочного прекращения;
 - (б) при досрочном прекращении обязательств по Затронутым сделкам вследствие наступления Иного основания досрочного прекращения в течение трех Рабочих дней после получения:

- (А) Затронутой стороной Уведомления о сумме денежного обязательства при прекращении;
- (Б) при наличии двух Затронутых сторон обеими Сторонами Уведомлений о сумме денежного обязательства при прекращении.

6.13. **Проценты на Сумму денежного обязательства при прекращении.** На Сумму денежного обязательства при прекращении, в пределах, допускаемых законодательством Российской Федерации, начисляются Проценты, которые подлежат уплате в Валюте прекращения, за период с Даты досрочного прекращения (исключая эту дату) по день фактической уплаты этой суммы (включительно). Уплата Процентов на Сумму денежного обязательства при прекращении производится в день уплаты Суммы денежного обязательства при прекращении.

Просрочка уплаты Суммы денежного обязательства при прекращении вследствие Юридического ограничения или Непреодолимой силы

6.14. Неуплата Стороной или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, Суммы денежного обязательства при прекращении в установленный срок не является Нарушением обязательства в соответствии с подпунктом (а) или подпунктом (А) подпункта (в) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора, если такая неуплата произошла по причине Юридического ограничения или Непреодолимой силы.

На просроченную Сумму денежного обязательства при прекращении:

- (а) начисляются Проценты как на Просроченную сумму, и такая Сумма денежного обязательства при прекращении включается в состав Просроченной суммы, причитающейся другой Стороне, если в будущем обязательства по Сделкам будут досрочно прекращены в результате Нарушения обязательства, Банкротства, Снижения платежеспособности вследствие реорганизации или Дополнительного основания прекращения, при котором все неисполненные Сделки будут Затронутыми сделками;
- (б) в иных случаях Проценты начисляются в соответствии с пунктом 6.13 настоящей статьи 6.

Уменьшение Суммы денежного обязательства при прекращении путем прекращения встречных требований

6.15. В случае досрочного прекращения обязательств по Сделкам вследствие Нарушения обязательства, Банкротства или Иного основания досрочного прекращения, при котором имеется одна Затронуемая сторона и все неисполненные Сделки являются Затронутыми сделками, Сумма денежного обязательства при прекращении, подлежащая уплате одной Стороной (далее — «*Плательщик*») другой Стороне (далее — «*Получатель платежа*»), может быть по усмотрению Ненарушившей или Незатронутой стороны (далее в настоящем пункте 6.15 — «*Первая сторона*») без предварительного уведомления Нарушившей или Затронутой стороны, в пределах, допускаемых законодательством Российской Федерации, уменьшена на сумму иных требований (далее — «*Прочие требования*») Плательщика к Получателю платежа (независимо от наступления срока их исполне-

ния и валюты, в которой они выражены). Прочие требования подлежат немедленному и полному прекращению в той части, в которой они уменьшают Сумму денежного обязательства при прекращении, подлежащую уплате Плательщиком. Первая сторона обязана уведомить другую Сторону о таком состоявшемся уменьшении Суммы денежного обязательства при прекращении.

В целях настоящего пункта 6.15 Первая сторона вправе пересчитать сумму Прочих требований (или соответствующую часть этой суммы) в валюту, в которой выражена Сумма денежного обязательства при прекращении, по курсу, по которому Первая сторона могла бы, действуя добросовестно и разумно, купить соответствующую сумму в этой валюте (с учетом расходов на конверсию).

Если размер Прочих требований не определен, Первая сторона вправе, действуя добросовестно и разумно, оценить такие Прочие требования с целью определения размера, на который будет уменьшена Сумма денежного обязательства при прекращении. При этом Первая сторона обязана представить другой Стороне отчет об оценке таких Прочих требований.

7. ПРОЦЕНТЫ

7.1. **Проценты по просроченным платежам.** Если Сторона допускает просрочку в исполнении какого-либо денежного обязательства, она обязана уплатить Проценты на сумму задолженности в той же валюте, что и сумма задолженности, за период со дня, когда денежное обязательство должно было быть исполнено (исключая этот день), по (включительно) день фактической уплаты этих денежных средств другой Стороне (за вычетом периода, когда Проценты на сумму задолженности уплачиваются в соответствии с подпунктом (а) или (б) пункта 7.3 настоящей статьи 7). Проценты, предусмотренные настоящим пунктом, являются процентами за пользование чужими денежными средствами и не являются неустойкой.

7.2. **Проценты по просроченным поставкам.** Если Сторона допускает просрочку в исполнении какого-либо обязательства по поставке, она обязана, если условиями Сделки не предусмотрено иное, уплатить Проценты на сумму, равную текущей рыночной стоимости предмета поставки в той же валюте, что и эта сумма, за период со дня, когда обязательство по поставке должно было быть исполнено (исключая этот день), по (включительно) день фактической поставки (за вычетом периода, когда Проценты на эту сумму уплачиваются в соответствии с пунктом 7.4 настоящей статьи 7).

Текущая рыночная стоимость предмета поставки разумно и добросовестно определяется Стороной, которой причиталась поставка, по состоянию на день, в который обязательство по поставке должно было быть исполнено.

7.3. **Проценты на сумму отсроченных платежей.**

(а) Если исполнение денежного обязательства Стороны отсрочено в соответствии с пунктом 6.5 статьи 6 Примерных условий договора, она обязана (при условии, что этой Стороной не допущено Нарушения обязательства и Технического дефолта и в отношении нее не наступило Банкротство или Потенциальное банкротство) уплатить Проценты на сумму отсроченного

платежа в валюте отсроченного платежа за период со дня, когда такой платеж должен был быть совершен (исключая этот день), если бы не действие пункта 6.5 статьи 6 Примерных условий договора, по (включительно) в зависимости от того, что наступит раньше:

(А) день, когда платеж перестанет быть отсроченным в соответствии с пунктом 6.5 статьи 6 Примерных условий договора;

(Б) день в течение Периода ожидания, когда эта Сторона допускает Нарушение обязательства или Технический дефолт либо в отношении нее наступает Банкротство или Потенциальное банкротство.

(б) Если Сторона не исполняет какое-либо денежное обязательство по причине введения Юридического ограничения или возникновения Непреодолимой силы после истечения Периода ожидания, она обязана (при условии, что Юридическое ограничение или Непреодолимая сила продолжает иметь место, этой Стороной не допущено Нарушения обязательства и Технического дефолта и в отношении нее не наступило Банкротство или Потенциальное банкротство) уплатить Проценты на сумму задолженности в той же валюте, что и сумма задолженности, за период:

(А) со дня, когда Сторона не исполнила денежное обязательство из-за введения Юридического ограничения или возникновения Непреодолимой силы (исключая этот день);

(Б) если это наступает позже, со дня, когда исполнение обязательства перестает быть отсроченным в соответствии с пунктом 6.5 статьи 6 Примерных условий договора,

по (включительно) в зависимости от того, что наступит раньше:

(А) день, когда прекращает иметь место Юридическое ограничение или Непреодолимая сила;

(Б) день, когда этой Стороной допущено Нарушение обязательства или Технический дефолт либо в отношении нее наступило Банкротство или Потенциальное банкротство,

за вычетом периода, когда Проценты на сумму задолженности уплачиваются в соответствии с подпунктом (а) настоящего пункта 7.3. Проценты, предусмотренные настоящим пунктом, являются процентами за пользование чужими денежными средствами и не являются неустойкой.

7.4. *Проценты по отсроченным поставкам.* Если:

(а) поставка отсрочена в соответствии с пунктом 6.5 статьи 6 Примерных условий договора;

(б) Сторона не исполняет какого-либо обязательства по поставке по причине введения Юридического ограничения или возникновения Непреодолимой силы, когда истек применимый Период ожидания,

то Сторона, обязанная осуществить поставку, должна уплатить Проценты, если это предусмотрено Генеральным соглашением, в том числе условиями Сделки, в установленном в них размере.

8. РАЗНОЕ

Валюта платежа

- 8.1. Платежи по Сделкам должны осуществляться в валюте, согласованной Сторонами для соответствующего платежа (далее — «*Валюта платежа*»). Денежное обязательство по Сделке в Валюте платежа не может быть прекращено платежом в иной валюте без письменного согласия другой Стороны.

Действие обязательств

- 8.2. Без ущерба для применения пункта 3.3 статьи 3 и пунктов 6.1 и 6.7 статьи 6 Примерных условий договора, обязательства Сторон по Генеральному соглашению сохраняют силу после прекращения какой-либо Сделки.

Уступка прав

- 8.3. Сторона не вправе уступать, передавать, отчуждать или иным образом распоряжаться правами (требованиями), принадлежащими ей на основании Генерального соглашения, без предварительного письменного согласия другой Стороны, за исключением уступки Ненарушившей стороной требований в отношении Суммы денежного обязательства при прекращении в случае досрочного прекращения обязательств по Сделкам.

Существенное изменение обстоятельств

- 8.4. Существенное изменение обстоятельств, из которых Стороны исходили при заключении Генерального соглашения, в том числе каждой из Сделок, не является основанием для его (их) изменения или расторжения.

9. РАСХОДЫ

- 9.1. Нарушившая сторона возмещает Ненарушившей стороне по требованию последней все документально подтвержденные и обоснованные расходы, понесенные Ненарушившей стороной в связи с защитой ее прав по Генеральному соглашению и Документу об обеспечении, включая вознаграждение за юридическую консультацию.

10. УВЕДОМЛЕНИЯ

Получение уведомления

- 10.1. Уведомление или иное сообщение по Генеральному соглашению может направляться любым из способов, перечисленных ниже (при этом уведомления в соответствии со статьями 5 и 6 Примерных условий договора не могут быть направлены по Электронным средствам связи или электронной почте), по адресу или иным реквизитам, указанным в Генеральном соглашении, и считается полученным:

- (а) если составлено на бумажном носителе и доставлено лично или с курьером — в день доставки;
- (б) если составлено на бумажном носителе и отправлено посредством факсимильной связи — в день, когда оно получено в читаемой форме, что должно

быть подтверждено отчетом о передаче факсимильного аппарата Стороны-отправителя, свидетельствующим о том, что сообщение было получено без ошибок при передаче. При получении факсимильного сообщения в нечитаемой форме Сторона-получатель обязана уведомить Сторону-отправителя о таком факте или неисправности факсимильного аппарата в тот же Рабочий день;

- (в) если составлено на бумажном носителе и отправлено по почте с уведомлением о вручении (или иным аналогичным образом с подтверждением доставки) — в день доставки. При этом уведомление считается полученным, если оно направлено Стороной-отправителем по последнему известному ей месту нахождения Стороны-получателя, но не вручено в связи с отсутствием адресата по указанному адресу или по причине отказа Стороны-получателя принять уведомление, о чем орган связи проинформировал Сторону-отправителя;
- (г) если отправлено по Электронным средствам связи — в день получения;
- (д) если отправлено по электронной почте — в день доставки, указанный в общении сервера получателя о доставке электронного письма отправителя.

Если уведомление или иное сообщение по Генеральному соглашению доставлено после окончания Рабочего дня или не в Рабочий день, оно считается полученным в ближайший следующий Рабочий день.

Изменение реквизитов

- 10.2. Сторона вправе изменить адрес или иные реквизиты для направления уведомлений и иных сообщений по Генеральному соглашению, уведомив другую Сторону в порядке, установленном настоящей статьёй 10.
- 10.3. Сторона, чей адрес или иные реквизиты были изменены, несет риск последствий, вызванных отсутствием у другой Стороны сведений о таких изменениях.

11. ПРИМЕНИМОЕ ПРАВО

- 11.1. Генеральное соглашение регулируется законодательством Российской Федерации и подлежит толкованию в соответствии с ним.

12. ОПРЕДЕЛЕНИЯ ТЕРМИНОВ, ИСПОЛЪЗУЕМЫХ В ПРИМЕРНЫХ УСЛОВИЯХ ДОГОВОРА

- 12.1. Термины, используемые в Примерных условиях договора, имеют следующие значения:

Аффилированное лицо означает с учетом Генерального соглашения применительно к любому субъекту юридическое лицо, контролируемое прямо или косвенно этим субъектом, либо контролирующее прямо или косвенно этот субъект, либо находящееся под прямым или косвенным общим контролем вместе с этим субъектом. При этом «**контроль**» над юридическим лицом или субъектом означает владение большинством голосов на общем собрании акционеров/участников юридического лица или субъекта либо правом контроля (в том числе возможностью определять решения, принимаемые юридическим лицом или субъектом), предоставленным в соответствии с договором либо иным образом.

Банкротство имеет значение, определенное в пункте 5.2 статьи 5 Примерных условий договора.

Валюта платежа означает в соответствии с пунктом 8.1 статьи 8 Примерных условий договора валюту, указанную для соответствующего платежа по Сделке.

Валюта прекращения означает валюту Российской Федерации или иную валюту, указанную в этом качестве в Генеральном соглашении.

Генеральное соглашение имеет значение, указанное в пункте 1.4 статьи 1 Примерных условий договора.

Дата досрочного прекращения означает в соответствии с пунктом 6.1 статьи 6 Примерных условий договора день, установленный в соответствии с пунктом 6.2, 6.3 или 6.6 статьи 6 Примерных условий договора, с которого обязательства по Сделкам считаются прекращенными.

Дата сделки имеет значение, указанное в пункте 2.6 статьи 2 Примерных условий договора.

Дилеры-ориентир означает в целях пункта 6.9 статьи 6 Примерных условий договора, если Генеральным соглашением или применимыми Стандартными условиями не предусмотрено иное, ведущих участников рынка базисного (базового) актива (или, применительно к договорам, предусмотренным подпунктами (б) и (в) пункта 2.2 статьи 2 Примерных условий договора, объекта) по соответствующей Сделке, добросовестно и разумно выбранных Определяющей стороной:

- (а) из числа кредитных организаций в отношении валютного и кредитного рынка;
- (б) из числа профессиональных участников рынка ценных бумаг в отношении рынка ценных бумаг.

Документ об обеспечении означает банковскую гарантию, договор поручительства, договор залога или иной документ, предусматривающий обеспечение исполнения обязательств по Генеральному соглашению одной Стороны перед другой Стороной, указанный в этом качестве в Генеральном соглашении.

Дополнительное основание прекращения означает в соответствии с подпунктом (г) пункта 5.3 статьи 5 Примерных условий договора какое-либо дополнительное основание прекращения, применяемое к Стороне, если это предусмотрено в Генеральном соглашении или условиях Сделки.

Задолженность по долгам обязательствам означает любое обязательство (как существующее на дату заключения настоящего Генерального соглашения или Сделки, так и возникшее после такой даты) (i) по возврату заемных денежных средств или уплате купонных, процентных или иных платежей в связи с заимствованием денежных средств по договору займа (в том числе облигационного займа), кредитному договору, договору о выставлении аккредитива или иному аналогичному договору, или (ii) по уплате соответствующих сумм за третье лицо на основании гарантии или договора поручительства или ином аналогичном основании.

Законодательство Российской Федерации означает федеральные законы, иные нормативные правовые акты Российской Федерации, в том числе нормативные правовые акты федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и нормативные акты Центрального банка Российской Федерации.

Затронутая сторона имеет значение, указанное в пункте 5.3 статьи 5 Примерных условий договора.

Затронутые сделки означает:

- (а) применительно к Юридическому ограничению или Непреодолимой силе — все Сделки, затронутые введением Юридического ограничения или возникновением Непреодолимой силы;
- (б) применительно к Снижению платежеспособности вследствие реорганизации и Дополнительному основанию прекращения — все Сделки.

Иная срочная сделка означает для целей подпункта (д) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора с учетом Генерального соглашения:

- (а) договор (а также любое генеральное соглашение, которое к нему относится и любое обязательство по обеспечению исполнения обязательств по нему), заключенный по законодательству Российской Федерации или иностранному праву в настоящем или будущем между (i) одной Стороной, ее Связанным лицом или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, и (ii) другой Стороной, ее Связанным лицом или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, который не является Сделкой по Генеральному соглашению, но представляет собой:
 - (А) договор, являющийся производным финансовым инструментом, в том числе: сделку валютный форвард, сделку валютный опцион, сделку валютный своп, сделку на процентные ставки (в том числе сделку процентный своп, сделку базисный своп, сделку валютно-процентный своп, сделку процентный форвард, сделку фиксации максимума процентной ставки, сделку фиксации минимума процентной ставки, сделку фиксации максимума и минимума процентной ставки), сделку свопцион, сделку форвард на акции, облигации или фондовые индексы, сделку своп на акции, облигации или фондовые индексы, сделку опцион на акции, облигации или фондовые индексы, сделку товарный своп, сделку товарный опцион или свопцион, сделку фиксации максимума цены товара, сделку фиксации минимума цены товара, сделку фиксации максимума и минимума цены товара, сделку товарный форвард, сделку своп, форвард или опцион на уровень инфляции, сделку, платежи по которой зависят от наступления обстоятельства, свидетельствующего о неисполнении или ненадлежащем исполнении одним или несколькими юридическими лицами, государствами или муниципальными образованияами своих обязанностей и/или иных обстоятельств, предусмотренных федеральным законом или нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и свидетельствующих о неспособности юридических лиц, государств или муниципальных образований исполнять свои гражданско-правовые (договорные) обязанности (в том числе сделку кредитный дефолтный своп и сделку кредитный дефолтный свопцион), договор об уплате плавающих маржевых сумм, иную аналогичную сделку (включая опцион на названные сделки) и сделка, представляющая собой сочета-

ние названных сделок, договор репо, договор обратного репо, договор покупки и обратной продажи ценных бумаг («бай/сэлл-бэк»), договор займа ценных бумаг, договор купли-продажи валюты, ценных бумаг, товара или иного финансового инструмента или процентной ставки с отсроченной поставкой, а также

- (Б) любой договор, аналогичный какому-либо из договоров, указанных в подпункте (А) выше, который в настоящее время или в будущем будет регулярно заключаться на финансовых рынках (включая положения, вносимые в такой договор путем отсылки) и являющийся форвардным договором, своп-договором, фьючерсом, опционным договором или иным видом производного финансового инструмента (срочной сделки) (включая любой опцион на названные договоры), платежи по которому зависят от изменения цены, курса, величины или иного показателя какого-либо базисного (базового) актива (объекта);
- (б) договор, представляющий собой любое сочетание названных договоров;
- (в) иной договор, указанный в качестве Иной срочной сделки в Генеральном соглашении, Подтверждении или условиях такого договора.

Иное основание досрочного прекращения означает Юридическое ограничение, Непреодолимую силу, Снижение платежеспособности вследствие реорганизации и Дополнительные основания прекращения.

Информирующее лицо имеет значение, указанное в пункте 2.12 статьи 2 Примерных условий договора

Кросс-дефолт имеет значение, указанное в подпункте (ж) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора.

Ликвидационная сумма имеет значение, указанное в пункте 6.9 статьи 6 Примерных условий договора.

Лицо, предоставляющее обеспечение, применительно к Стороне имеет значение, указанное в Генеральном соглашении.

Льготный период означает срок, предоставленный по условиям обязательства стороне такого обязательства, не исполнившей или исполнившей ненадлежащим образом это обязательство, для исправления нарушения.

Нарушение обязательства имеет значение, указанное в пункте 5.1 статьи 5 Примерных условий договора.

Нарушившая сторона означает в соответствии с пунктом 6.2 статьи 6 Примерных условий договора Сторону, допустившую Нарушение обязательства или в отношении которой наступило Банкротство.

Незатронутая сторона означает при наличии одной Затронутой стороны другую Сторону.

Ненарушившая сторона означает при наличии Нарушившей стороны в соответствии с пунктом 6.2 статьи 6 Примерных условий договора другую Сторону.

Необходимые условия договора означает условия договора, указанные в этом качестве в пункте 1.5 статьи 1 Примерных условий договора.

Непреодолимая сила имеет значение, указанное в подпункте (б) пункта 5.3 статьи 5 Примерных условий договора.

Определяющая сторона означает Сторону, определяющую Ликвидационную сумму.

Период ожидания означает в соответствии с пунктом 6.5 статьи 6 Примерных условий договора три календарных дня при введении Юридического ограничения или восемь календарных дней при возникновении Непреодолимой силы, в течение которых Стороны вправе не исполнять свои обязательства по Затронутым сделкам, если действие Юридического ограничения или Непреодолимой силы не прекратится раньше.

Плательщик означает в соответствии с пунктом 6.15 статьи 6 Примерных условий договора Сторону, обязанную уплатить Сумму денежного обязательства при прекращении.

Подтверждение имеет значение, указанное в пункте 2.7 статьи 2 Примерных условий договора.

Получатель платежа означает в соответствии с пунктом 6.15 статьи 6 Примерных условий договора Сторону, которой причитается Сумма денежного обязательства при прекращении.

Пороговая сумма означает в целях подпункта (ж) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора сумму, указанную в этом качестве в Генеральном соглашении.

Потенциальное банкротство означает событие, действие которого начинается подачей конкурсным кредитором заявления, предусмотренного подпунктом (г) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора, и прекращается с истечением срока для прекращения производства по делу о банкротстве или отказа в возбуждении такого производства, предусмотренного подпунктом (г) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора, если иной срок не установлен в Генеральном соглашении.

Прекращаемые сделки означает применительно к какой-либо Дате досрочного прекращения:

- (а) при досрочном прекращении обязательств по Сделкам вследствие Нарушения обязательства или Банкротства (кроме случаев, указанных в подпункте (б) ниже) — все Сделки, обязательства по которым остаются неисполненными на день получения Нарушившей стороной уведомления о досрочном прекращении обязательств по Сделкам с указанием Даты досрочного прекращения;
- (б) при автоматическом досрочном прекращении обязательств по Сделкам вследствие Банкротства, указанного в подпункте (е) пункта 5.2 или подпункте (В) подпункта (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора — все Сделки, обязательства по которым остаются неисполненными на Дату досрочного прекращения;
- (в) при досрочном прекращении обязательств по Затронутым сделкам вследствие введения Юридического ограничения или наступления Непреодоли-

мой силы — Затронутые сделки, указанные в уведомлении или уведомлениях, направленных Стороной или Сторонами в соответствии с подпунктом (б) пункта 6.6 статьи 6 Примерных условий договора;

- (г) при досрочном прекращении обязательств по Затронутым сделкам вследствие Иного основания прекращения обязательств (кроме Юридического ограничения и Непреодолимой силы) — все Затронутые сделки.

Просроченные суммы, причитающиеся какой-либо Стороне, означает применительно к Дате досрочного прекращения совокупность:

- (а) сумм, срок платежа которых в пользу этой Стороны наступил (или наступил бы, если бы не действие пункта 3.3 статьи 3 или пункта 6.5 статьи 6 Примерных условий договора) в соответствии с пунктом 3.1 статьи 3 Примерных условий договора до Даты досрочного прекращения (включительно) и которые остаются неуплаченными на Дату досрочного прекращения;
- (б) сумм, равных текущей рыночной стоимости предмета поставки по Прекращаемым сделкам, срок поставки которого в пользу этой Стороны наступил (или наступил бы, если бы не действие пункта 3.3 статьи 3 или пункта 6.5 статьи 6 Примерных условий договора) в соответствии с пунктом 3.1 статьи 3 Примерных условий договора до Даты досрочного прекращения (включительно) и в отношении которого обязательство по поставке не было исполнено на Дату досрочного прекращения;
- (в) Сумм денежного обязательства при прекращении, причитающихся к уплате в отношении ранее прекращенных Сделок и остающихся неуплаченными на Дату досрочного прекращения,

в каждом случае включая Проценты, начисленные в соответствии с пунктом 6.11 или 6.13 статьи 6 Примерных условий договора.

Текущая рыночная стоимость предмета поставки по подпункту (б) выше разумно и добросовестно определяется Стороной, обязанной производить расчет по пункту 6.10 статьи 6 Примерных условий договора, на дату, когда обязательство по поставке должно было быть исполнено первоначально. Если в соответствии с пунктом 6.10 статьи 6 Примерных условий договора обе Стороны обязаны производить расчет, текущая рыночная стоимость предмета поставки по подпункту (б) выше будет равна среднему арифметическому Эквивалентов в валюте прекращения значений текущей рыночной стоимости, определенных обеими Сторонами.

Проценты означает проценты, уплачиваемые:

- (а) применительно к пунктам 7.1 и 7.2 статьи 7 Примерных условий договора, в размере стоимости кредитных ресурсов для соответствующего получателя платежа плюс 1% годовых;
- (б) применительно к подпункту (а) пункта 7.3 статьи 7 Примерных условий договора, по средней ставке банковского процента по депозитам овернайт в соответствующей валюте на межбанковском рынке;
- (в) применительно к подпункту (б) пункта 7.3 статьи 7 Примерных условий договора, по ставке, равной среднему арифметическому (А) ставки банков-

ского процента, предлагаемой плательщику крупным банком по депозиту овернайт в соответствующей валюте, и (Б) стоимости кредитных ресурсов для соответствующего получателя платежа;

- (г) применительно к пункту 7.4 статьи 7 Примерных условий договора, по ставке, указанной в Подтверждении или иных положениях Соглашения, в соответствии с которыми она подлежит уплате;
- (д) применительно к пункту 6.11 статьи 6 Примерных условий договора в целях определения Просроченной суммы:
 - (А) в отношении обязательств, подлежащих исполнению платежом или поставкой (в том числе, если бы не действие пункта 3.3 статьи 3 Примерных условий договора) Нарушившей стороны — по ставке, указанной в пункте (а) настоящего определения;
 - (Б) в отношении обязательств, подлежащих исполнению платежом или поставкой (в том числе, если бы не действие пункта 3.3 статьи 3 Примерных условий договора) Ненарушившей стороны — по ставке банковского процента, предлагаемой Ненарушившей стороне крупным банком по депозиту овернайт в соответствующей валюте;
 - (В) в отношении обязательств, отсроченных в соответствии с пунктом 6.5 статьи 6 Примерных условий договора, при отсутствии Нарушившей стороны, в течение Периода ожидания — по ставке, указанной в пункте (б) настоящего определения;
 - (Г) в остальных случаях по наступлении Иного основания досрочного прекращения (кроме случаев начисления процентов в соответствии с подпунктом (В) настоящего пункта (д)) — по ставке, указанной в пункте (в) настоящего определения;
- (е) применительно к пункту 6.13 статьи 6 Примерных условий договора в целях определения Суммы денежного обязательства при прекращении:
 - (А) за период с соответствующей Датой досрочного прекращения (исключая эту дату) по (включительно) день, определяемый в соответствии с пунктом 6.12 статьи 6 Примерных условий договора, когда эта сумма подлежит уплате:
 - (аа) если Сумма денежного обязательства при прекращении подлежит уплате Нарушившей стороной или Ненарушившей стороной — по ставке, указанной в подпункте (Б) пункта (д) настоящего определения;
 - (бб) в остальных случаях — по ставке, указанной в пункте (в) настоящего определения;
 - (Б) за период со дня (определяемого в соответствии с пунктом 6.12 статьи 6 Примерных условий договора (исключая этот день)), когда эта сумма подлежит уплате, по (включительно) день фактической уплаты:
 - (аа) если Сторона не уплачивает Сумму денежного обязательства при прекращении из-за Юридического ограничения или Непреодоли-

мой силы, и до тех пор, пока Сумма денежного обязательства при прекращении остается неуплаченной из-за продолжающегося действия этого события или обстоятельства — по ставке, указанной в пункте (в) настоящего определения;

- (бб) если Сумма денежного обязательства при прекращении подлежит уплате Нарушившей стороной или Ненарушившей стороной (исключая период, к которому применяется подпункт (аа) настоящего подпункта (Б)) — по ставке, указанной в пункте (а) настоящего определения;
- (вв) в остальных случаях — в размере, равном среднему арифметическому значению стоимости кредитных ресурсов для каждой Стороны.

Прочие требования означает в соответствии с пунктом 6.15 статьи 6 Примерных условий договора любые иные требования Плательщика к Получателю платежа, возникшие не на основании Соглашения.

Рабочий день означает:

- (а) для любых целей, кроме поставки по Сделке, день, когда учреждения и подразделения расчетной сети Банка России открыты в г. Москве;
- (б) применительно к любой поставке по Сделке день, когда расчетные и (или) клиринговые системы, необходимые для осуществления соответствующей поставки, открыты для осуществления деятельности, так что поставка может быть осуществлена в соответствии с обычной рыночной практикой, в г. Москве.

Репозитарий означает юридическое лицо, являющееся саморегулируемой организацией профессиональных участников рынка ценных бумаг, клиринговой организацией либо фондовой биржей, указанное в этом качестве в Генеральном соглашении.

Связанное лицо применительно к Стороне имеет значение, указанное в Генеральном соглашении.

Сделка имеет значение, указанное в преамбуле Примерных условий договора.

Снижение платежеспособности вследствие реорганизации имеет значение, указанное в подпункте (в) пункта 5.3 статьи 5 Примерных условий договора.

Стандартные условия имеет значение, указанное в преамбуле Примерных условий договора.

Сумма денежного обязательства при прекращении означает в соответствии с пунктом 6.10 статьи 6 Примерных условий договора сумму нетто-обязательства, подлежащую уплате по наступлении Даты досрочного прекращения в случае досрочного прекращения обязательств по всем или части Сделок.

Технический дефолт означает событие, которое при направлении уведомления и (или) по истечении Льготного периода составило бы Нарушение обязательства.

Уведомление о сумме денежного обязательства при прекращении имеет значение, указанное в пункте 6.8 статьи 6 Примерных условий договора.

Юридическое ограничение имеет значение, указанное в подпункте (а) пункта 5.3 статьи 5 Примерных условий договора.

Эквивалент в валюте прекращения означает:

- (а) применительно к любой сумме в Валюте прекращения — эту сумму в Валюте прекращения;
- (б) применительно к любой сумме в другой валюте (далее в настоящем определении — **«Другая валюта»**), если иное не согласовано Сторонами, — добросовестно и разумно определенную Стороной, производящей расчет по пункту 6.10 статьи 6 Примерных условий договора, сумму в Валюте прекращения, требующуюся для покупки такой суммы в Другой валюте на Дату досрочного прекращения либо более позднюю дату, если Ликвидационная сумма определяется на такую более позднюю дату в соответствии с подпунктом (ж) пункта 6.9 статьи 6 Примерных условий договора, по курсу спот TOD в или около 11 часов в г. Москве на дату определения Ликвидационной суммы.

Электронные средства связи означает используемые Сторонами для проведения переговоров с целью заключения Сделок системы «Reuters-Dealing», «Bloomberg», «Банк-клиент» и другие электронные средства связи, согласованные Сторонами.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1
к Примерным условиям договора о срочных сделках
на финансовых рынках 2011 г.

Примерная форма генерального соглашения о срочных сделках
на финансовых рынках

НАСТОЯЩЕЕ ГЕНЕРАЛЬНОЕ СОГЛАШЕНИЕ О СРОЧНЫХ СДЕЛКАХ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ (далее — «*Генеральное соглашение*») заключено «__» _____ 20__ года

между

- (1) [●] (далее — «*Сторона А*»), созданным и действующим в соответствии с законодательством Российской Федерации, с местонахождением по адресу: [●], Российская Федерация, в лице [президента/председателя правления/генерального директора] [●], действующего на основании [Устава], с одной стороны и
- (2) [●] (далее — «*Сторона Б*»), созданным и действующим в соответствии с законодательством Российской Федерации, с местонахождением по адресу: [●], Российская Федерация, в лице [президента/председателя правления/генерального директора] [●], действующего на основании [Устава], с другой стороны,

далее совместно именуемыми «*Стороны*», а по отдельности — «*Сторона*».

Принимая во внимание, что

Стороны намереваются заключать Сделки, перечисленные в [[подпункте (а)] или [подпунктах: (а) и (б)] или [подпунктах: (а), (б) и (в)] пункта 2.2 статьи 2 Примерных условий договора (определенных ниже), которые будут регулироваться настоящим Генеральным соглашением,

[[Сторона А] или [Сторона Б] действует [за счет, в интересах и по поручению] или [в качестве доверительного управляющего] [●]]

Стороны договорились о следующем:

1. ПРИМЕНЕНИЕ ПОЛОЖЕНИЙ ПРИМЕРНЫХ УСЛОВИЙ ДОГОВОРА И СТАНДАРТНЫХ УСЛОВИЙ. ОПРЕДЕЛЕНИЕ ТЕРМИНОВ, ИСПОЛЪЗУЕМЫХ В ГЕНЕРАЛЬНОМ СОГЛАШЕНИИ
- 1.1. Стороны договариваются о том, что отдельные условия настоящего Генерального соглашения определяются Примерными условиями договора о срочных сделках на финансовых рынках 2011г., разработанными и утвержденными Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциа-

цией и Ассоциацией российских банков, и опубликованными в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее — **«Примерные условия договора»**), с учетом изменений и дополнений, установленных в Генеральном соглашении. При этом для целей применения Примерных условий договора как части настоящего Генерального соглашения ссылки на Сделки в Примерных условиях договора считаются исключительно ссылками на Сделки, заключенные в соответствии с настоящим Генеральным соглашением.

- 1.2. Термины, используемые с заглавной буквы в Генеральном соглашении, имеют значение, указанное в статье 12 Примерных условий договора, если Генеральным соглашением не предусмотрено иное.
- 1.3. Стороны договариваются о том, что Стандартные условия применяются к отношениям Сторон по Сделке в случае ссылки на эти Стандартные условия в Подтверждении или в соответствии с пунктом 1.3 статьи 1 Примерных условий договора.

2. ПОДТВЕРЖДЕНИЕ СДЕЛОК

- 2.1. Для целей пункта 2.7 статьи 2 Примерных условий договора Стороны устанавливают следующий порядок составления Подтверждения.
- 2.2. * [Не позднее следующего Рабочего дня после Даты сделки [или в Дату сделки применительно к сделкам спот] Сторона А направляет Стороне Б посредством факсимильной связи подписанное Подтверждение, содержащее все существенные и иные условия Сделки, а Сторона Б подтверждает свое согласие с правильностью изложения в Подтверждении согласованных условий Сделки и другими условиями Сделки при их наличии, подписав его в указанном месте, и возвращает подписанное Подтверждение Стороне А также посредством факсимильной связи.
- 2.3. Подтверждение, направленное Стороной А, считается принятым Стороной Б при отсутствии очевидной ошибки, если Сторона Б не возражает относительно условий Сделки, содержащихся в Подтверждении, или не направит исправленный вариант Подтверждения посредством факсимильной связи не позднее [следующего] Рабочего дня после его получения [или в тот же день применительно к сделкам спот]**.
- 2.4. Если Сторона Б направляет исправленный вариант Подтверждения в срок, указанный в пункте 2.3 настоящей статьи 2, Сторона А, получив исправленный вариант Подтверждения, вправе не позднее [следующего] Рабочего дня после его получения [или в тот же день применительно к сделкам спот] направить посредством факсимильной связи возражения относительно содержания исправленного варианта Подтверждения.

* Здесь изложен примерный порядок составления Подтверждения для «клиентской» версии Генерального соглашения.

** Положение удаляется, если Генеральное соглашение не будет применяться к сделкам спот

- 2.5. Если Сторона Б не принимает возражений Стороны А относительно содержания исправленного варианта Подтверждения, Сделка считается заключенной в соответствии с пунктом 2.6 статьи 2 Примерных условий договора без учета тех условий, по которым у Сторон остались разногласия, если Стороны не договорятся об ином.
- 2.6. Если Подтверждение, его исправленный вариант или возражения Стороны Б по Подтверждению в иной форме не были направлены Стороной Б в соответствии с пунктом 2.2 или 2.3 настоящей статьи 2, по требованию Стороны А Сторона Б обязана направить подписанное Стороной Б Подтверждение не позднее [следующего] Рабочего дня посредством факсимильной связи либо в порядке и сроки, предусмотренные пунктом 2.7 настоящей статьи 2.
- 2.7. По требованию любой Стороны не позднее [двух] Рабочих дней после Даты сделки [или в Дату сделки применительно к сделкам спот]*, Стороны обязаны обменяться (с курьером или по почте) оригиналами Подтверждений, подписанными уполномоченными представителями Сторон.]

ИЛИ

- 2.2. [Не позднее следующего Рабочего дня после Даты сделки [или в Дату сделки применительно к сделкам спот] Стороны направляют друг другу посредством факсимильной связи [или по системе «S.W.I.F.T.»] Подтверждения, содержащие все существенные и иные условия Сделки.
- 2.3. В случае несовпадения существенных условий Сделки в Подтверждениях, направленных друг другу Сторонами, Сделка считается заключенной на условиях, согласованных Сторонами в порядке, установленном пунктом 2.6 статьи 2 Примерных условий договора. Сторона, направившая Подтверждение, соответствующее таким условиям Сделки, имеет право требовать исправления Подтверждения, направленного другой Стороной.
- 2.4. В случае несовпадения в Подтверждениях условий Сделки, Сделка считается заключенной в соответствии с пунктом 2.6 статьи 2 Примерных условий договора на условиях, совпадающих в обоих Подтверждениях, если Стороны не договорятся об ином.
- 2.5. Если Подтверждение не было направлено одной из Сторон в соответствии с пунктом 2.2 настоящей статьи 2, эта Сторона по требованию другой Стороны обязана не позднее [следующего] Рабочего дня направить Подтверждение по системе «S.W.I.F.T.» либо в порядке и сроки, предусмотренные пунктом 2.6 настоящей статьи 2.
- 2.6. По требованию любой Стороны не позднее [двух] Рабочих дней после Даты сделки [или в Дату сделки применительно к сделкам спот] Стороны обязаны обменяться (с курьером или по почте) оригиналами Подтверждений, подписанными уполномоченными представителями Сторон.]**

* Здесь изложен примерный порядок составления Подтверждения для «клиентской» версии Генерального соглашения.

** Один из вариантов, «клиентский» или «межбанковский», удаляется в зависимости от ситуации

3. Положения о ПРЕКРАЩЕНИИ

3.1. **Связанное лицо** означает:

- (а) применительно к Стороне А для целей:
- (А) подпункта (д) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора [●];
 - (Б) подпункта (е) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора [●];
 - (В) подпункта (ж) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора [●];
 - (Г) подпункта (з) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора [●];
 - (Д) подпункта (и) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора [●];
 - (Е) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора [●];
 - (Ж) подпункта (в) пункта 5.3 статьи 5 Примерных условий договора [●];
- (б) применительно к Стороне Б для целей:
- (А) подпункта (д) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора [●];
 - (Б) подпункта (е) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора [●];
 - (В) подпункта (ж) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора [●];
 - (Г) подпункта (з) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора [●];
 - (Д) подпункта (и) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора [●];
 - (Е) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора [●];
 - (Ж) подпункта (в) пункта 5.3 статьи 5 Примерных условий договора [●].

3.2. **Иная срочная сделка** [имеет значение, указанное в статье 12 Примерных условий договора] [означает [●]*].

3.3. Подпункт (ж) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора (**Нарушение долговых обязательств (кросс-дефолт)**):

Задолженность по долгovým обязательствам [имеет значение, указанное в статье 12 Примерных условий договора] [означает [●]*].

Пороговая сумма означает:

[для Стороны А — [не применяется]/[●].]
[для Стороны Б — [не применяется]/[●].]

3.4. Подпункт (в) пункта 5.3 статьи 5 Примерных условий договора (**Снижение платежеспособности вследствие реорганизации**)

[[не] применяются]* к Стороне А,
[[не] применяются]* к Стороне Б.

3.5. **Валюта прекращения** [имеет значение, указанное в статье 12 Примерных условий договора] [означает [●]*].

3.6. **Дополнительное основание прекращения** [[не] применяется]*. [Дополнительное основание прекращения составляет [●]**.

Для целей указанного Дополнительного основания прекращения Затронутой стороной или Затронутыми сторонами будут [●]**.

* Один из вариантов удаляется в зависимости от ситуации.

** Указывается, если Дополнительное основание расторжения будет применяться.

4. ПРЕДСТАВЛЕНИЕ ДОКУМЕНТОВ

4.1. Стороны обязуются представить следующие документы:

Сторона, представляющая документ	Вид документа	Срок представления	Отметка о применении пункта 4.9 статьи 4 Примерных условий договора
Сторона [А/Б]	[Учредительные документы]		[Да][Нет]*
Сторона [А/Б]	Свидетельство о государственной регистрации**		[Да][Нет]*
Сторона [А/Б]	[Лицензия на осуществление банковских операций] [иная лицензия, имеющая существенное значение для деятельности Стороны [А/Б]]**		[Да][Нет]*
Сторона [А/Б]	Карточка (или альбом) с образцами подписей уполномоченных представителей Стороны [А/Б]***		[Да][Нет]*
Сторона [А/Б]	Документы, подтверждающие полномочия представителей Стороны [А/Б], если Генеральное соглашение подписывается лицом, не являющимся единоличным исполнительным органом Стороны [А/Б]***		[Да][Нет]*
Сторона [А/Б]	Документы, подтверждающие полномочия представителей Стороны [А/Б] на заключение Сделок****		[Да][Нет]*
Сторона [А/Б]	[Разрешения, согласия и одобрения государственных органов, которые Сторона обязана получить в отношении Соглашения или любого из Документов об обеспечении, подписанного этой Стороной.]****		[Да][Нет]*
[●]*****			

4.2. В случае внесения изменений или дополнений в документы, представленные Стороной в соответствии с настоящей статьей 4, либо их отмены или признания утратившими силу эта Сторона обязана незамедлительно уведомить об этом другую Сторону и в разумный срок представить измененные или дополненные документы либо новые документы, принятые или оформленные взамен отмененных или утративших силу.

* Один из вариантов удаляется в зависимости от ситуации.

** Один из вариантов удаляется в зависимости от ситуации.

*** Оформленная в порядке, установленном законодательством Российской Федерации.

**** Копия, удостоверенная способом, указанным Стороной, которой представляется документ.

***** Здесь могут быть указаны иные документы, представляемые одной или обеими Сторонами.

5. РАЗНОЕ

5.1. **Адреса и иные реквизиты Сторон.** Для целей пункта 10.1 статьи 10 Примерных условий договора:

- (а) Реквизиты Стороны А для направления Подтверждений, уведомлений или иных сообщений:

Почтовый адрес:	
Вниманию:	
Телефон:	
Факс:	
Адрес электронной почты:	
[•]	
Особые указания:	

- (б) Реквизиты Стороны Б для направления Подтверждений, уведомлений или иных сообщений:

Почтовый адрес:	
Вниманию:	
Телефон:	
Факс:	
Адрес электронной почты:	
[•]	
Особые указания:	

Каждая Сторона несет ответственность за достоверность своих реквизитов для получения корреспонденции (включая адреса, номера телефонов и факсов, адреса электронной почты и др.), содержащихся в настоящем пункте 5.1.

- 5.2. [**Расчетный агент.** Расчетным агентом является [•], если применительно к Сделке иное не установлено ее условиями.]*

- 5.3. **Документ об обеспечении.** Данные о Документе об обеспечении: [•.] [отсутствует.]**

- 5.4. **Лицо, предоставляющее обеспечение,**

применительно к Стороне А означает [•];] [отсутствует;]*

применительно к Стороне Б означает [•.] [отсутствует.]*

- 5.5. [Комплексный платежный неттинг. Для целей пункта 3.7 статьи 3 Примерных условий договора Стороны договариваются о том, что обязательства Сторон совершить в пользу друг друга платежи в одной и той же валюте в одну и ту же дату, возникшие из разных Сделок, прекращаются автоматически. Если при этом общая сумма обязательства одной Стороны превышает общую сумму обя-

* Указывается, если применимо.

** Один из вариантов удаляется в зависимости от ситуации..

зательства другой Стороны, обязательство первой Стороны прекращается в части, равной сумме обязательства другой Стороны, а обязательство последней прекращается полностью. По инициативе любой из Сторон Стороны сверяют подлежащую уплате разницу между суммами обязательств Сторон до совершения соответствующего платежа.]*

5.6. **Аффилированное лицо** [имеет значение, указанное в статье 12 Примерных условий договора.] [означает [●].]**

5.7. **Отсутствие судебных разбирательств.** Для целей пункта 4.8 статьи 4 Примерных условий договора **Связанное лицо** означает

применительно к Стороне А [●];
применительно к Стороне Б [●].

5.8. **Дополнительное заявление или заверение** [[не] применяется]**.

(а) [Для целей статьи 4 Примерных условий договора Дополнительные заявления составляют:

(А) [Сторона Б заключает каждую Сделку с хозяйственной целью, заключающейся в управлении рисками, возникающими в процессе ее предпринимательской деятельности.

(Б) Сторона Б в полной мере понимает характер Сделок, признает все потенциальные последствия и риски, связанные с ними (включая среди прочего возможную прибыль или убытки, возникающие вследствие колебаний цен, ставок, валютных курсов и иных рыночных показателей, а также юридические и иные риски в связи со Сделками).]

(В) [●].]

(б) [Для целей статьи 4 Примерных условий договора Дополнительные заверения составляют:

(А) [каждая Сторона обязуется незамедлительно уведомлять другую Сторону о своем Нарушении обязательства, Техническом дефолте, Банкротстве, Потенциальном банкротстве или известном ей Ином основании досрочного прекращения;]***

(Б) [●].]

5.9. **Рабочий день** [имеет значение, указанное в статье 12 Примерных условий договора.] [означает [●].]****

* Стороны включают это положение, если намерены применять комплексный платежный неттинг

** Указывается, если применимо.

*** Стороны могут включить это положение, если они готовы принять на себя обязательство уведомлять контрагента о наступлении любого из указанных событий.

**** Один из вариантов удаляется в зависимости от ситуации. Если одна из Сторон находится или состоит на обслуживании в кредитной организации либо поставка по Сделке должна быть осуществлена через расчетную и (или) клиринговую систему, находящихся не в г. Москве, а в ином субъекте Российской Федерации, определение Рабочего дня может нуждаться в изменении в Генеральном соглашении или условиях Сделки

- 5.10. **Электронные средства связи** [имеет значение, указанное в статье 12 Примерных условий договора[, а также включает [●]*].] [означает [●].]**
- 5.11. **Репозитарий** для целей пункта 2.12 статьи 2 Примерных условий договора означает: [●].

Информация о Генеральном соглашении и о Сделках будет предоставляться в Репозитарий [Стороной А и Стороной Б] *или* [Информирующим лицом, указанным в настоящем пункте 5.11 ниже, действующим от имени Стороны А и Стороны Б]. [Информирующим лицом является [Сторона А] *или* [Сторона Б] *или* [Информирующим лицом, не являющимся ни одной из Сторон, а именно [наименование, адрес местонахождения и ОГРН третьего лица, являющегося юридическим лицом]].

Каждая Сторона настоящим выражает свое безотзывное и безусловное согласие на передачу информации в объеме, установленном нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг, [другой Стороной] *или* [Информирующим лицом] Репозитарию. [[Сторона Б] *и/или* [Сторона А] настоящим уполномочивает [Сторону А] *или* [Сторону Б] *или* [Информирующее лицо] на передачу информации, указанной в данном абзаце Репозитарию [*и Информирующему лицу*].

[В случае ненадлежащего и (или) несвоевременного исполнения Информирующим лицом его обязательств по предоставлению информации от имени [[Стороны Б] *и/или* [Стороны А]], [последняя] *или* [каждая из Сторон] вправе временно приостановить *или* отозвать полномочия на предоставление информации у Информирующего лица и осуществить предоставление информации в Репозитарий самостоятельно, уведомив Репозитарий о допущенном Информирующим лицом нарушении.].

[Отношения [Стороны А] *и/или* [Стороны Б] с Информирующим лицом, не являющимся Стороной по настоящему Генеральному соглашению будут регулироваться договором, заключенным [Стороной А] *и/или* [Стороной Б] с Информирующим лицом от [●]].

6. ПРОЧИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Изменения и дополнения, вносимые в Стандартную документацию

6.1. [●]

Изменение Генерального соглашения

- 6.2. Изменение Генерального соглашения, кроме случаев заключения Сделок, действительно, если совершено в письменной форме и собственноручно подписано Сторонами.

* Здесь Стороны могут дополнить перечень Электронных средств связи, указанный в статье 12 Примерных условий договора.

** Один из вариантов удаляется в зависимости от ситуации. Выбирая второй вариант, Стороны могут установить, альтернативный набор Электронных средств связи, исключив применение определения, указанного в статье 12 Примерных условий договора.

Расторжение Генерального соглашения

- 6.3. Каждая из Сторон вправе расторгнуть Генеральное соглашение в любое время при условии отсутствия неисполненных обязательств по Генеральному соглашению.

[Безакцептное списание]

- 6.4. Если Сторона Б не произвела платеж по Генеральному соглашению в пользу Стороны А в установленный срок, на следующий Рабочий день после дня, когда денежное обязательство должно было быть исполнено, Сторона А вправе (без дополнительного распоряжения, поручения или подтверждения Стороны Б) осуществить безакцептное списание с банковского счета Стороны Б, открытого у Стороны А, (а) суммы такого платежа и (б) Процентов, начисленных в соответствии с Примерными условиями договора.
- 6.5. В целях пункта 6.3 настоящей статьи 6 в соответствии со статьями 847 и 854 Гражданского кодекса Российской Федерации Сторона Б настоящим уполномочивает Сторону А осуществлять безакцептное списание (без дополнительного распоряжения, поручения или подтверждения Стороны Б) с банковских счетов Стороны Б, открытых у Стороны А, сумм, причитающихся Стороне А от Стороны Б по Генеральному соглашению*.
- 6.6. Если у Стороны Б нет банковских счетов, открытых у Стороны А, в соответствии со статьей 847 Гражданского кодекса Российской Федерации Сторона Б в целях пункта 6.3 настоящей статьи 6 настоящим уполномочивает Сторону А осуществлять безакцептное списание (без дополнительного распоряжения, поручения или подтверждения Стороны Б) сумм, причитающихся Стороне А от Стороны Б по Генеральному соглашению, с банковских счетов Стороны Б, открытых в других кредитных организациях. Сторона Б обязуется осуществить все необходимые действия, чтобы обеспечить осуществление Стороной А этого права безакцептного списания, в том числе включить в договоры банковского счета с другими кредитными организациями условия о безакцептном списании денежных средств либо заключить дополнительное соглашение к договору банковского счета, содержащее соответствующее условие, а также предоставить в обслуживающую кредитную организацию сведения о Стороне А как о кредиторе (получателе средств), который имеет право выставлять платежные требования на списание денежных средств в безакцептном порядке, обязательствах, по которым будут производиться платежи, а также о Генеральном соглашении как об основном договоре (дата, номер и соответствующий пункт, предусматривающий право безакцептного списания).]**

[Соглашение о передаче споров на разрешение третейского суда]

- 6.7. Все споры, возникающие между Сторонами, в связи с изменением, расторжением, неисполнением либо ненадлежащим исполнением Генерального соглаше-

* Обратите внимание, что в соответствии с пунктом 11.2 Положения Банка России от 3 октября 2002 года № 2-П «О безналичных расчетах в Российской Федерации» условие о безакцептном списании также должно быть включено в договор банковского счета.

** Данное положение может быть включено в Генеральное соглашение, если одной из Сторон является кредитная организация.

ДОПОЛНИТЕЛЬНОЕ СОГЛАШЕНИЕ
К ГЕНЕРАЛЬНОМУ СОГЛАШЕНИЮ
О СРОЧНЫХ СДЕЛКАХ
НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ

ДОПОЛНИТЕЛЬНОЕ СОГЛАШЕНИЕ К ГЕНЕРАЛЬНОМУ СОГЛАШЕНИЮ О СРОЧНЫХ СДЕЛКАХ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ

НАСТОЯЩЕЕ ДОПОЛНИТЕЛЬНОЕ СОГЛАШЕНИЕ К ГЕНЕРАЛЬНОМУ СОГЛАШЕНИЮ О СРОЧНЫХ СДЕЛКАХ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ заключено «___» _____ 20__ года (далее — «*Дополнительное соглашение*»)

между

- (1) [●] (далее — «*Сторона А*»), созданным и действующим в соответствии с законодательством Российской Федерации, с местонахождением по адресу: [●], в лице [●], действующего на основании [●], с одной стороны и
- (2) [●] (далее — «*Сторона Б*»), созданным и действующим в соответствии с законодательством Российской Федерации, с местонахождением по адресу: [●], в лице [●], действующего на основании [●], с другой стороны,

далее совместно именуемыми «*Стороны*», а по отдельности — «*Сторона*».

Настоящим Дополнительным соглашением вносятся нижеследующие изменения в:

Принимая во внимание, что

- (А) Между Сторонами «___» _____ 20__ года заключено Генеральное соглашение о срочных сделках на финансовых рынках (далее — «*Генеральное соглашение*»),
- (Б) Генеральное соглашение было заключено в соответствии с Примерными условиями договора о срочных сделках на финансовых рынках в редакции 2009 г.), опубликованном в 2009 г. в сети Интернет на страницах Ассоциации российских банков, Национальной Валютной Ассоциации и Национальной ассоциации участников фондового рынка (далее — «*Примерные условия договора 2009 г.*»);
- (В) В 2011 г. Саморегулируемая (некоммерческая) организация «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальная Валютная Ассоциация и Ассоциация российских банков разработали и утвердили новую редакцию Примерных условий договора о срочных сделках на финансовых рынках и опубликовали ее в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков соответственно (далее — «*Примерные условия договора 2011 г.*»);
- (Г) Стороны желают, чтобы отдельные условия заключенного между ними Генерального соглашения, а также заключенных в соответствии с ним Сделок определялись Примерными условиями договора 2011 г.;

Стороны договорились о следующем:

1. ПРИМЕНЕНИЕ ПОЛОЖЕНИЙ ПРИМЕРНЫХ УСЛОВИЙ ДОГОВОРА 2011 г.
 - 1.1. Все ссылки на Примерные условия договора, содержащиеся в Генеральном соглашении и (или) Подтверждении по Сделке, признаются ссылками на Примерные условия договора 2011 г.
2. ИЗМЕНЕНИЯ, ВНОСИМЫЕ В ГЕНЕРАЛЬНОЕ СОГЛАШЕНИЕ
 - 2.1. С учетом изменения нумерации отдельных положений Примерных условий договора 2011 г. по сравнению с Примерными условиями договора 2009 г., ссылки в Генеральном соглашении или в Подтверждении по Сделке на нижеследующие положения Примерных условий договора 2009 г. заменяются ссылками на положения Примерных условий договора 2011 г. в следующем порядке:
 - (а) ссылку на пункт 1.5 статьи 1 Примерных условий договора считать ссылкой на пункт 1.6 статьи 1 Примерных условий договора 2011 г.;
 - (б) ссылку на пункт 1.6 статьи 1 Примерных условий договора считать ссылкой на пункт 1.7 статьи 1 Примерных условий договора 2011 г.;
 - (в) ссылку на пункт 1.7 статьи 1 Примерных условий договора считать ссылкой на пункт 1.8 статьи 1 Примерных условий договора 2011 г.;
 - (г) ссылку на пункт 1.8 статьи 1 Примерных условий договора считать ссылкой на пункт 1.9 статьи 1 Примерных условий договора 2011 г.;
 - (д) ссылку на подпункт (б) пункта 2.2 статьи 2 Примерных условий договора считать ссылкой на подпункт (в) пункта 2.2 статьи 2 Примерных условий договора 2011 г.;
 - (е) ссылку на пункт 4.8 статьи 4 Примерных условий договора считать ссылкой на пункт 4.7 статьи 4 Примерных условий договора 2011 г.;
 - (ж) ссылку на пункт 4.9 статьи 4 Примерных условий договора считать ссылкой на пункт 4.8 статьи 4 Примерных условий договора 2011 г.;
 - (з) ссылку на пункт 4.10 статьи 4 Примерных условий договора считать ссылкой на пункт 4.9 статьи 4 Примерных условий договора 2011 г.;
 - (и) ссылку на пункт 4.11 статьи 4 Примерных условий договора считать ссылкой на пункт 4.10 статьи 4 Примерных условий договора 2011 г.;
 - (к) ссылку на подпункт (в) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора считать ссылкой на подпункт (б) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора 2011 г.;
 - (л) ссылку на подпункт (д) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора считать ссылкой на подпункт (в) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора 2011 г.;
 - (м) ссылку на подпункт (е) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора считать ссылкой на подпункт (г) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора 2011 г.;

- (н) ссылку на подпункт (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора считать ссылкой на подпункт (д) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора 2011 г.;
- (о) ссылку на подпункт (з) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора считать ссылкой на подпункт (е) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора 2011 г.;
- (п) ссылку на подпункт (и) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора считать ссылкой на подпункт (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора 2011 г.;
- (р) ссылку на подпункт (к) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора считать ссылкой на подпункт (з) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора 2011 г.;
- (с) ссылку на пункт 6.6 статьи 6 Примерных условий договора считать ссылкой на подпункт (а) пункта 6.6 статьи 6 Примерных условий договора 2011 г..

2.2. С целью соблюдения требований пункта 1.5 Примерных условий 2011 г. признать утратившими силу положения Генерального соглашения (или) Подтверждения по Сделке, которые применительно к любой из Сторон (но не к ее Связанному Лицу или Лицу, предоставляющему обеспечение исполнения обязательств такой Стороны) исключают или изменяют следующие положения Примерных условий договора:

- (а) подпункт (е) и подпункт (В) подпункта (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора;
- (б) пункт 6.2 статьи 6 Примерных условий договора в части недопустимости прекращения обязательств по части Сделок;
- (в) пункт 6.3 статьи 6 Примерных условий договора;
- (г) пункт 6.9 и подпункт (а) пункта 6.10 статьи 6 Примерных условий договора в части порядка определения Ликвидационной суммы и расчета Суммы денежного обязательства при досрочном прекращении обязательств по Сделкам вследствие наступления Банкротства, указанного в подпункте (е) или подпункте (В) подпункта (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора;
- (д) пункт 6.12 статьи 6 Примерных условий договора в части срока уплаты Суммы денежного обязательства при прекращении в случае досрочного прекращения обязательств по Сделкам вследствие наступления Банкротства, указанного в подпункте (е) или подпункте (В) подпункта (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора.

2.3. Термин **«Задолженность перед третьими лицами»**, используемый в Генеральном соглашении или Подтверждении, заменить на термин **«Задолженность по долговым обязательствам»**.

2.4. Признать утратившими силу в соответствующей части положения Генерального соглашения, содержащие ссылки на:

- (а) подпункт (в) пункта 2.2 статьи 2 Примерных условий договора;

- (б) пункт 4.7 статьи 4 Примерных условий договора;¹
 - (в) подпункт (б) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора;²
 - (г) подпункт (г) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора.³
- 3. ИНЫЕ ИЗМЕНЕНИЯ, ВНОСИМЫЕ В ГЕНЕРАЛЬНОЕ СОГЛАШЕНИЕ⁴
[указать изменения]/[не применимо]⁵
 - 4. ПРИМЕНЕНИЕ ПОЛОЖЕНИЙ СТАНДАРТНЫХ УСЛОВИЙ⁶
[указать изменения]/[не применимо]⁷
 - 5. ПРОЧИЕ ПОЛОЖЕНИЯ
 - 5.1. Генеральное соглашение с внесенными настоящим Дополнительным соглашением изменениями применяется в отношении всех Сделок, заключенных в соответствии с Генеральным соглашением до момента подписания настоящего Дополнительного соглашения, обязательства по которым остаются неисполненными на дату настоящего Дополнительного соглашения.
 - 5.2. Все термины, указанные в настоящем Дополнительном соглашении с заглавной буквы, имеют значение, указанное в Генеральном соглашении, если настоящим Дополнительным соглашением не предусмотрено иное.
 - 5.3. За исключением изменений и дополнений, внесенных в Генеральное соглашение Дополнительным соглашением, все остальные положения Генерального соглашения сохраняют силу. Настоящее Дополнительное соглашение вступает в силу с момента его подписания Сторонами и является неотъемлемой частью Генерального соглашения.

¹ В случае, если стороны согласовали изменения к редакции указанного пункта, согласованная редакция пункта должна быть воспроизведена в разделе 3 настоящего Дополнительного соглашения как часть Генерального соглашения с учетом исключения пункта 4.7 из Примерных условий договора 2011 г.

² В случае, если стороны согласовали изменения к редакции указанного пункта, согласованная редакция пункта должна быть воспроизведена в разделе 3 настоящего Дополнительного соглашения как часть Генерального соглашения с учетом исключения подпункта (б) пункта 5.2 из Примерных условий договора 2011 г.

³ В случае, если стороны согласовали изменения к редакции указанного пункта, согласованная редакция пункта должна быть воспроизведена в разделе 3 настоящего Дополнительного соглашения как часть Генерального соглашения с учетом исключения подпункта (г) пункта 5.2 из Примерных условий договора 2011 г.

⁴ Стороны вправе согласовать любые иные изменения заключенного между ними Генерального соглашения. Сторонам, в частности, рекомендуется внести изменения, учитывающие изменившиеся в новой редакции Примерных условий договора формулировки отдельных пунктов.

⁵ Указать «не применимо» в случае отсутствия иных изменений с целью сохранения нумерации последующих пунктов.

⁶ Стороны могут предусмотреть изменения к Стандартным условиям.

⁷ Указать «не применимо» в случае отсутствия иных изменений с целью сохранения нумерации последующих пунктов.

- 5.4. Настоящее Дополнительное соглашение подписано в двух оригинальных экземплярах на русском языке – по одному для каждой из Сторон.
- 5.5. Настоящее Дополнительное соглашение регулируется правом Российской Федерации. Все споры, возникающие между Сторонами, в связи с настоящим Дополнительным соглашением разрешаются в [●].

В ПОДТВЕРЖДЕНИЕ ВЫШЕИЗЛОЖЕННОГО Стороны подписали настоящее Дополнительное соглашение в день, указанный в преамбуле настоящего Дополнительного соглашения.

ПОДПИСАНО

Ф. И. О.:)
Должность:)
)
за и от имени)
[Наименование Стороны А])
[Печать])

Ф. И. О.:)
Должность:)
)
за и от имени)
[Наименование Стороны Б])
)
[Печать])

СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ КОНВЕРСИОННЫХ СДЕЛОК,
СДЕЛОК ВАЛЮТНЫЙ ФОРВАРД,
ВАЛЮТНЫЙ ОПЦИОН И ВАЛЮТНЫЙ СВОП
2011 г.

This 2011 Standard Terms of FX, Currency Option and FX Swap Transactions is based, in part, on selected provisions of the 1998 FX and Currency Option Definitions, © 1998 International Swaps and Derivatives Association, Inc., («ISDA®»), Emerging Markets Traders Association, («EMTA®») and The Foreign Exchange Committee; the 1998 Annex A to the 1998 FX and Currency Option Definitions, © 1998 International Swaps and Derivatives Association, Inc., Emerging Markets Traders Association and The Foreign Exchange Committee; the 2006 ISDA Definitions, © 2006 International Swaps and Derivatives Association, Inc.; and the 2002 ISDA Equity Derivatives Definitions, 2002 International Swaps and Derivatives Association, Inc., and are used with its permission. ISDA takes no position as to this Russian-version 2011 Standard Terms of FX, Currency Option and FX Swap Transactions' suitability for use in any particular transaction. Prospective users should seek independent legal advice before using this instrument.

**СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ КОНВЕРСИОННЫХ СДЕЛОК,
СДЕЛОК ВАЛЮТНЫЙ ФОРВАРД, ВАЛЮТНЫЙ ОПЦИОН
И ВАЛЮТНЫЙ СВОП
2011 г.**

Настоящие Стандартные условия конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков, устанавливают особенности заключения, исполнения и прекращения Сделок, как они определены в пункте 1.23 Стандартных условий. Настоящие Стандартные условия применяются к Сделке, (а) если они полностью или частично включены в Подтверждение по Сделке путем указания в нем о применении Стандартных условий конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г. полностью или в соответствующей части; (б) по умолчанию при отсутствии Подтверждения применительно к Сделкам, заключенным после даты согласования Примерных условий договора (как они определены в Стандартных условиях) федеральным органом исполнительной власти по рынку ценных бумаг. Если какой-либо термин настоящих Стандартных условий употребляется в Подтверждении наряду с указанием стороны, он применяется исключительно к этой стороне.

1. ОБЩИЕ ОПРЕДЕЛЕНИЯ

- 1.1. **Базовая валюта** означает применительно к Расчетной сделке валюту, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — доллары США или иную валюту из Валютной пары, по отношению к одной единице (или иному числу, кратному десяти), которой выражается обменный курс в соответствии с практикой на рынке соответствующей Валютной пары.
- 1.2. **Валюта платежа** означает применительно к Расчетной сделке валюту, в которой проводятся расчеты по указанной Сделке в порядке, установленном пунктами 2.4(в) и 3.8(в) Стандартных условий, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — рубли.
- 1.3. **Валютная пара** означает:
 - (а) применительно к Конверсионной сделке, Сделке поставочный валютный форвард и Сделке валютный своп — валюты, определенные в Подтверждении в качестве подлежащих уплате сторонами по Сделке;

- (б) применительно к Сделке расчетный валютный форвард — Расчетную валюту и Базовую валюту;
- (в) применительно к Сделке валютный опцион — Валюту на покупку и Валюту на продажу.

- 1.4. **Генеральное соглашение** означает Генеральное соглашение в значении, определенном в Примерных условиях договора.
- 1.5. **Государственный орган** означает орган государственной власти Российской Федерации, включая Банк России.
- 1.6. **Дата оценки** означает применительно к Расчетной сделке Рабочий день, по состоянию на который определяется значение Курса спот, указанный в качестве Даты оценки в Подтверждении или определяемый в соответствии с ним либо иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке. При определении Даты оценки применяется Условие об окончании срока в нерабочий день «Предшествующий рабочий день», если иное не согласовано сторонами.

Если иное не предусмотрено Подтверждением или иным образом не согласовано сторонами, Дата оценки наступает:

- (а) по Сделке расчетный валютный форвард — за два Рабочих дня до Даты платежа;
 - (б) по Сделке расчетный валютный опцион — в Дату осуществления права на исполнение.
- 1.7. **Дата платежа** означает применительно к Сделке день, в который стороны обязаны исполнить свои обязательства по Сделке, предусмотренные пунктами 2.4, 3.8 или 5.1 Стандартных условий, указанный в качестве Даты платежа или иным образом определяемый в соответствии с Подтверждением либо иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.

Для целей настоящих Стандартных условий каждая из Дат первоначального платежа и Дат окончательного платежа является Датой платежа.

- 1.8. **Дата сделки** означает применительно к Сделке Дату сделки в значении, определенном в Генеральном соглашении.
- 1.9. **Курс спот** означает применительно к Расчетной сделке и Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, — обменный курс валюты на Дату оценки, определенный в соответствии с согласованным Способом определения курса спот или применимой Альтернативой на случай, препятствующий исполнению.
- 1.10. **Номинальная сумма в базовой валюте** означает применительно к Расчетной сделке сумму в Базовой валюте, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке в целях расчета платежей по Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон:

- (а) применительно к Сделке расчетный валютный форвард — сумму в Базовой валюте, равную результату деления Номинальной суммы в расчетной валюте на Форвардный курс;
 - (б) применительно к Сделке расчетный валютный опцион — Сумму валюты на покупку или Сумму валюты на продажу, в зависимости от того, какая из них выражена в Базовой валюте.
- 1.11. **Номинальная сумма в расчетной валюте** означает применительно к Расчетной сделке сумму в Расчетной валюте, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон:
- (а) применительно к Сделке расчетный валютный форвард — сумму в Расчетной валюте, равную произведению Номинальной суммы в базовой валюте и Форвардного курса;
 - (б) применительно к Сделке расчетный валютный опцион — Сумму валюты на покупку или Сумму валюты на продажу в зависимости от того, какая из них выражена в Расчетной валюте.
- 1.12. **Основной финансовый центр** означает применительно к Сделке или валюте финансовый центр или центры, указанные в Подтверждении или иным образом согласованные сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — финансовый центр или центры, перечисленные по каждому виду валют в приложении 7 к Стандартным условиям.
- 1.13. **Округление** означает для целей любых расчетов, производимых в соответствии с настоящими Стандартными условиями:
- (а) округление любых сумм, выраженных в процентах, до пятого знака после запятой (включительно) по математическому методу;
 - (б) округление любых сумм в валюте до четвертого знака после запятой (включительно) по математическому методу, если иной порядок округления не используется в соответствии со сложившейся рыночной практикой на рынке соответствующей валюты.
- 1.14. **Подтверждение** означает Подтверждение в значении, определенном в Генеральном соглашении, которое может быть составлено по форме, установленной в приложениях 1–6 к Стандартным условиям в зависимости от вида Сделки, или иной форме, согласованной сторонами.
- 1.15. **Покупатель расчетной валюты** означает сторону Сделки расчетный валютный форвард, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — сторону, которой в Дату платежа подлежала бы уплата Расчетная валюта, если бы расчеты по данной Сделке производились в порядке, предусмотренном для Поставочных сделок.
- 1.16. **Поставочная сделка** означает Конверсионную сделку, Сделку поставочный валютный форвард, Сделку поставочный валютный опцион или Сделку валютный своп.

Расчеты по Сделке осуществляются в порядке, установленном для Поставочной сделки, если стороны прямо не предусмотрели иное.

- 1.17. **Примерные условия договора** означает Примерные условия договора о срочных сделках на финансовых рынках 2011 г., разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков.
- 1.18. **Продавец расчетной валюты** означает сторону Сделки расчетный валютный форвард, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — сторону, которая должна была бы уплатить Расчетную валюту в Дату платежа, если бы расчеты по Сделке проводились в порядке, установленном для Поставочной сделки.
- 1.19. **Рабочий день** означает:
- (а) для целей осуществления платежей в Дату платежа/Дату уплаты премии, Даты оценки и/или Способа определения курса спот — любой день, являющийся Рабочим днем в значении, определенном в Генеральном соглашении, и:
 - (А) днем, когда кредитные организации осуществляют (или, если бы не наступление События, препятствующего исполнению, осуществляли бы) банковские операции и другие сделки (в том числе операции по переводу валют, расчеты в которых предусмотрены Сделкой, в соответствии со сложившейся на нем практикой) в месте или местах, указанных в Подтверждении или иным образом согласованных сторонами применительно к Сделке для целей определения Рабочего дня;
 - (Б) при отсутствии такого указания:
 - (аа) если евро является валютой, в которой должен быть осуществлен платеж, или одной из валют в Валютной паре для целей Даты оценки и/или Способа определения курса спот — днем, когда открыта Трансъевропейская автоматическая система валовых расчетов и экспресс-переводов в режиме реального времени (Система TARGET);
 - (бб) если другая иностранная валюта является валютой, в которой должен быть осуществлен платеж, или одной из валют в Валютной паре для целей Даты оценки и/или Способа определения курса спот — днем, когда кредитные организации осуществляют (или, если бы не наступление События, препятствующего исполнению, осуществляли бы) банковские операции и другие сделки (в том числе на валютном рынке в соответствии со сложившейся

на нем практикой) в Основном финансовом центре этой иностранной валюты;

- (вв) если несколько видов иностранных валют подлежат уплате или обе валюты Валютной пары являются иностранными валютами — Рабочим днем в соответствии с настоящим определением для каждой валюты соответственно (если практикой, сложившейся на соответствующем валютном рынке, не установлено иное);
 - (б) для целей остальных положений настоящих Стандартных условий или Подтверждения — Рабочий день в значении, определенном в Генеральном соглашении.
- 1.20. **Расчетная валюта** означает применительно к Расчетной сделке валюту, указанную в качестве Расчетной валюты в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке; при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон в отношении Расчетной сделки, по которой в состав Валютной пары входят рубли, Расчетной валютой применительно к такой Сделке являются рубли.
- 1.21. **Расчетная сделка** (или **Беспоставочная сделка**) для целей настоящих Стандартных условий означает Сделку расчетный валютный форвард или Сделку расчетный валютный опцион.
- 1.22. **Расчетный агент** означает лицо, указанное в этом качестве в Генеральном соглашении, если иное лицо не назначено в этом качестве по Сделке в Подтверждении или иным образом не согласовано сторонами применительно к Сделке. Расчетный агент определяет значения курсов, суммы и иные значения, а также выполняет другие действия в соответствии с настоящими Стандартными условиями. Расчетный агент обязан действовать разумно и добросовестно при любых обстоятельствах. Расчет (калькуляция), произведенный Расчетным агентом, является обязательным для сторон, кроме случаев очевидной ошибки.
- 1.23. **Сделка** для целей настоящих Стандартных условий означает заключаемую на основе Примерных условий договора Сделку спот, как она определена в пункте 2.1 Стандартных условий, Сделку валютный форвард, как она определена в пункте 2.2 Стандартных условий, Сделку валютный опцион, как она определена в пункте 3.1 Стандартных условий, Сделку валютный своп, как она определена в пункте 5.1 Стандартных условий, любое сочетание названных Сделок или иную сделку, в отношении которой в Подтверждении стороны указали о том, что к ней применяются настоящие Стандартные условия.
- 1.24. **Сумма платежа** означает применительно к Расчетной сделке сумму, определяемую в Дату оценки по формулам, указанным в пунктах 2.4(б) и 3.8(б) Стандартных условий, и подлежащую уплате в Дату платежа в порядке, установленном пунктами 2.4(в) и 3.8(в) Стандартных условий соответственно.
- 1.25. **Твердая котировка** означает предложение участником рынка обменного курса валюты с обязательством этого участника рынка купить или продать эту валюту по предложенному обменному курсу.

1.26. **Условие об окончании срока в нерабочий день** означает условие, в соответствии с которым определяется день окончания срока, если последний день срока приходится на нерабочий день. В Подтверждении стороны могут указать в качестве Условия об окончании срока в нерабочий день:

- (а) «**Следующий рабочий день**» — в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день;
- (б) «**Предшествующий рабочий день**» — в этом случае днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день;
- (в) «**Рабочий день в отчетном периоде**» — в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день, а если этот ближайший следующий Рабочий день является днем следующего месяца, то днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день.

Если последний день срока в соответствии с настоящими Стандартными условиями приходится на нерабочий день, день окончания срока определяется по правилу «Следующий рабочий день», указанному в подпункте (а) выше, если иное не предусмотрено другими положениями Стандартных условий, Подтверждением или иным образом не согласовано сторонами применительно к какому-либо сроку или в целом.

1.27. **Форвардный курс** означает:

- (а) применительно к Сделке поставочный валютный форвард — обменный курс валюты, выраженный в порядке, указанном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого порядка — в соответствии с практикой на рынке соответствующей Валютной пары;
- (б) применительно к Сделке расчетный валютный форвард — обменный курс валюты, выраженный как отношение количества Расчетной валюты к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Базовой валюты, указанный в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — обменный курс валюты, полученный в результате деления Номинальной суммы в расчетной валюте на Номинальную сумму в базовой валюте.

2. КОНВЕРСИОННЫЕ СДЕЛКИ И СДЕЛКИ ВАЛЮТНЫЙ ФОРВАРД

2.1. **Конверсионная сделка** (или **Сделка спот**) означает сделку, по которой одна сторона обязуется купить у другой стороны сумму в одной валюте и продать другой стороне сумму в другой валюте на условиях, согласованных сторонами, с осуществлением обеими сторонами переводов указанных сумм в Дату платежа, наступающую не позднее второго Рабочего дня после Даты сделки.

2.2. **Сделка валютный форвард** означает внебиржевой форвардный договор (контракт), по которому на условиях, согласованных сторонами:

- (а) одна сторона обязуется купить у другой стороны сумму в одной валюте и продать другой стороне сумму в другой валюте с осуществлением обеими сторонами переводов указанных сумм в Дату платежа, наступающую не ранее третьего Рабочего дня после Даты сделки (далее — «**Сделка поставочный валютный форвард**»);
- (б) одна сторона обязуется периодически и (или) одновременно уплачивать другой стороне в каждую согласованную Дату платежа, Сумму платежа в зависимости от изменения обменного курса Расчетной валюты по отношению к Форвардному курсу, согласованному сторонами в Дату сделки (далее — «**Сделка расчетный валютный форвард**»).

2.3. *Существенные условия Конверсионной сделки.*

- (а) Существенными условиями Сделки спот, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Валютная пара;
 - (Б) Сумма валюты, подлежащая уплате одной стороной;
 - (В) Сумма валюты, подлежащая уплате другой стороной, или обменный курс;
 - (Г) Дата платежа.
- (б) Существенными условиями Сделки поставочный валютный форвард, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Валютная пара;
 - (Б) Сумма валюты, подлежащая уплате одной стороной;
 - (В) Сумма валюты, подлежащая уплате другой стороной, или Форвардный курс (в этом случае валюта, указанная в подпункте (Б) выше, признается Расчетной валютой);
 - (Г) Дата платежа.
- (в) Существенными условиями Сделки расчетный валютный форвард, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Расчетная валюта;
 - (Б) Базовая валюта;
 - (В) Продавец расчетной валюты;
 - (Г) Покупатель расчетной валюты;
 - (Д) Номинальная сумма в базовой валюте и Номинальная сумма в расчетной валюте или Форвардный курс и либо Номинальная сумма в базовой валюте, либо Номинальная сумма в расчетной валюте;
 - (Е) Способ определения курса спот;
 - (Ж) Дата платежа.
- (г) Другие условия подлежат согласованию в качестве существенных условий Конверсионной сделки или Сделки валютный форвард по требованию одной из сторон.

2.4. *Порядок осуществления расчетов по Конверсионным сделкам и Сделкам валютный форвард.*

Конверсионные сделки и Сделки поставочный валютный форвард

- (а) В Дату платежа по Конверсионной сделке или Сделке поставочный валютный форвард каждая сторона обязана уплатить сумму валюты, указанную для нее в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке.

Сделки расчетный валютный форвард

- (б) Сумма платежа применительно к Сделке расчетный валютный форвард, если в отношении Сделки сторонами не согласовано иное, рассчитывается по следующей формуле:

$$\text{Сумма платежа} = \left[\frac{\text{Номинальная сумма в базовой валюте}}{\text{валюте}} \times \left(1 - \frac{\text{Форвардный курс}}{\text{Курс спот}} \right) \right]$$

При этом Курс спот выражается как отношение количества Расчетной валюты к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Базовой валюты.

- (в) В Дату платежа по Сделке расчетный валютный форвард:
- (А) если Сумма платежа имеет положительное значение, Покупатель расчетной валюты обязан уплатить Продавцу расчетной валюты:
- (АА) эту сумму в Базовой валюте (если Базовая валюта является Валютой платежа);
- (ББ) эквивалент этой суммы в Валюте платежа по Курсу спот (если Расчетная валюта является Валютой платежа) или по обменному курсу, способ определения которого указан для этих целей в Подтверждении (если Валютой платежа является валюта, не входящая в Валютную пару);
- (Б) если Сумма платежа имеет отрицательное значение, Продавец расчетной валюты обязан уплатить Покупателю расчетной валюты абсолютную величину:
- (АА) этой суммы в Базовой валюте (если Базовая валюта является Валютой платежа);
- (ББ) эквивалент этой суммы в Валюте платежа по Курсу спот (если Расчетная валюта является Валютой платежа) или по обменному курсу, способ определения которого указан для этих целей в Подтверждении (если Валютой платежа является валюта, не входящая в Валютную пару).

3. Сделки валютный ОПЦИОН

- 3.1. *Сделка валютный опцион* означает опционный договор (контракт), по которому на условиях, согласованных сторонами:

- (а) одна сторона (далее — «**Покупатель**») уплачивает другой стороне (далее — «**Продавец**») Премию (если условия Сделки валютный опцион предусматривают уплату Премии) и приобретает право (при условии его осуществления в порядке, установленном пунктом 3.7 Стандартных условий), но не обязанность купить у Продавца по Цене исполнения определенное количество Валюты на покупку и продать Продавцу по Цене исполнения определенное количество Валюты на продажу, а Продавец обязуется купить у Покупателя по Цене исполнения определенное количество Валюты на продажу и продать Покупателю по Цене исполнения определенное количество Валюты на покупку, с осуществлением обеими сторонами переводов указанных сумм в Дату платежа, в том числе путем заключения договора купли-продажи иностранной валюты (далее — «**Сделка поставочный валютный опцион**»);
- (б) Покупатель уплачивает Продавцу Премию (если условия Сделки валютный опцион предусматривают уплату Премии) и приобретает право (при условии его осуществления в порядке, установленном пунктом 3.7 Стандартных условий), но не обязанность периодически и (или) единовременно требовать от Продавца выплаты Суммы платежа (при ее положительном значении) в Дату платежа, а Продавец обязуется в этом случае выплатить Покупателю Сумму платежа (при ее положительном значении) в Дату платежа (далее — «**Сделка расчетный валютный опцион**»).

3.2. Применительно к Сделке валютный опцион следующие термины имеют следующие значения:

- (а) **Валюта на покупку** означает валюту, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — валюту, которая должна быть куплена Покупателем.
- (б) **Валюта на продажу** означает валюту, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — валюту, которая должна быть продана Покупателем.
- (в) **Дата истечения срока** означает последний день Срока осуществления права на исполнение, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.
- (г) **Дата начала срока** означает день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — Дату сделки.
- (д) **Право на исполнение** означает право Покупателя требовать от Продавца уплаты в Дату платежа:
 - (А) по Сделке поставочный валютный опцион — Суммы валюты на покупку;
 - (Б) по Сделке расчетный валютный опцион — Суммы платежа (при ее положительном значении).

Применительно к порядку осуществления Права на исполнение по Сделке валютный опцион следующие термины имеют следующие значения:

- (А) **Время закрытия** означает время в течение Рабочего дня, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, не позднее которого должно быть получено Требование об исполнении, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — 16 часов по московскому времени.
- (Б) **Дата осуществления права на исполнение** означает Рабочий день в течение Срока осуществления права на исполнение, когда Право на исполнение по Сделке валютный опцион осуществлено в порядке, установленном пунктом 3.7 Стандартных условий.
- (В) **Срок осуществления права на исполнение** означает:
 - (аа) в Американском опционе — все Рабочие дни с Даты начала срока до Даты истечения срока (обе даты включительно) в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия;
 - (бб) в Европейском опционе — Дату истечения срока в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия;
 - (вв) в Бермудском опционе — каждую Дату осуществления права на исполнение, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами, с Даты начала срока до Даты истечения срока (обе даты включительно) в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия.
- (Г) **Требование об исполнении** означает безотзывное требование, которое может быть составлено Покупателем по форме, установленной в приложении 8 к Стандартным условиям, или иной форме, согласованной Сторонами. Требование об исполнении может быть доставлено по факсу, если стороны не договорились об ином.
- (е) **Сумма валюты на покупку** означает общую сумму в Валюте на покупку, которая должна быть куплена в соответствии с Подтверждением при осуществлении Права на исполнение по Сделке валютный опцион, а при отсутствии в Подтверждении указания на эту сумму — результат умножения Суммы валюты на продажу на Цену исполнения (где Цена исполнения выражается как отношение подлежащего уплате количества Валюты на покупку к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Валюты на продажу).
- (ж) **Сумма валюты на продажу** означает общую сумму в Валюте на продажу, которая должна быть продана в соответствии с Подтверждением при осуществлении Права на исполнение по Сделке валютный опцион, а при отсутствии в Подтверждении указания на эту сумму — результат деления Суммы валюты на покупку на Цену исполнения (где Цена исполнения выражается как отношение подлежащего уплате количества Валюты на покупку к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Валюты на продажу).

- (з) **Цена исполнения** означает обменный курс валюты, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, по которому Валютная пара будет обменена при осуществлении Права на исполнение по Сделке валютный опцион.

3.3. Стили опционов.

- (а) **Американский опцион** означает вид Сделки валютный опцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено в любой Рабочий день в течение Срока осуществления права на исполнение, состоящего из двух и более дней.
- (б) **Бермудский опцион** означает вид Сделки валютный опцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено исключительно в одну из Дат осуществления права на исполнение, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами, и в Дату истечения срока.
- (в) **Европейский опцион** означает вид Сделки валютный опцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено только в Дату истечения срока.
- (г) Стороны могут договориться о заключении Сделки валютный опцион иного стиля, определив его в Подтверждении.

3.4. Типы опционов.

- (а) **Опцион на покупку (колл)** означает тип Сделки валютный опцион, по которому Покупатель вправе при осуществлении Права на исполнение:
 - (А) по Сделке поставочный валютный опцион купить у Продавца Сумму валюты на покупку по Цене исполнения;
 - (Б) по Сделке расчетный валютный опцион получить от Продавца Сумму платежа (при ее положительном значении), рассчитанную в соответствии с пунктом 3.8(б) Стандартных условий,в обоих случаях с учетом того, что предусмотрено в Подтверждении.
- (б) **Опцион на продажу (пут)** означает тип Сделки валютный опцион, по которому Покупатель вправе при осуществлении Права на исполнение:
 - (А) по Сделке поставочный валютный опцион продать Продавцу Сумму валюты на продажу по Цене исполнения;
 - (Б) по Сделке расчетный валютный опцион получить от Продавца Сумму платежа (при ее положительном значении), рассчитанную в соответствии с пунктом 3.8(б) Стандартных условий,в обоих случаях с учетом того, что предусмотрено в Подтверждении.
- (в) Стороны могут заключать Сделки, которые сочетают в себе оба типа Сделок валютный опцион. Стороны также могут договориться о заключении Сделки валютный опцион иного типа, определив его в Подтверждении.

3.5. Уплата Премии.

- (а) Если условия Сделки валютный опцион предусматривают уплату Премии, в одну или в каждую из дат, согласованных сторонами (далее — «**Дата уплаты премии**»), Покупатель обязан уплатить Продавцу премию (далее — «**Премия**»), указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами.
- (б) Стороны могут установить Премию в виде твердой суммы или процента от Суммы валюты на покупку или Суммы валюты на продажу.

3.6. Существенные условия Сделки валютный опцион.

- (а) Общими существенными условиями Сделок валютный опцион, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки в отношении каждой из этих Сделок, являются:
 - (А) Покупатель;
 - (Б) Продавец;
 - (В) Стиль опциона;
 - (Г) Тип опциона;
 - (Д) Валюта на покупку;
 - (Е) Валюта на продажу;
 - (Ж) Время закрытия;
 - (З) Дата истечения срока;
 - (И) Даты осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону (применительно к Бермудскому опциону);
 - (К) Дата платежа;
- (б) Существенными условиями Сделки поставочный валютный опцион, также подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Сумма валюты на покупку и Сумма валюты на продажу или Цена исполнения и либо Сумма валюты на покупку, либо Сумма валюты на продажу.
- (в) Существенными условиями Сделки расчетный валютный опцион, также подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Цена исполнения и Сумма валюты на покупку или Сумма валюты на продажу;
 - (Б) Способ определения курса спот.
- (г) Другие условия Сделки валютный опцион подлежат согласованию в качестве существенных условий по требованию одной из сторон.

3.7. Порядок осуществления Права на исполнение.

- (а) Право на исполнение осуществляется автоматически во Время закрытия в Дату истечения срока при условии, что Право на исполнение не было осуществлено ранее и в это Время закрытия:

- (А) по Сделке расчетный валютный опцион — Сумма платежа равна или превышает произведение одного процента от Цены исполнения и Суммы валюты на покупку или Суммы валюты на продажу в зависимости от типа Сделки валютный опцион;
- (Б) по Сделке поставочный валютный опцион — сумма, рассчитанная как Сумма платежа в соответствии с пунктом 3.8(б)(А) или 3.8(б)(Б) Стандартных условий, как если бы это была Сделка расчетный валютный опцион, равна или превышает произведение одного процента от Цены исполнения и Суммы валюты на покупку или Суммы валюты на продажу в зависимости от типа Сделки валютный опцион.

При этом если стороны направляют какие-либо уведомления или иные сообщения с напоминанием о наступлении срока исполнения обязательств по Сделке валютный опцион, по которой Право на исполнение осуществляется автоматически в соответствии с настоящим пунктом 3.7(а), в том числе, если они направляются в форме, установленной для Требования об исполнении, такие уведомления или иные сообщения носят исключительно уведомительный характер и не направлены на возникновение, изменение или прекращение прав и обязанностей сторон по Сделке валютный опцион.

Если Право на исполнение осуществляется автоматически по Сделке поставочный валютный опцион, Продавец вправе выбрать порядок расчетов по такой Сделке в соответствии с пунктом 3.8(а) или 3.8(б) Стандартных условий, уведомив об этом Покупателя незамедлительно после наступления Времени закрытия.

Право на исполнение не осуществляется автоматически, если до наступления Времени закрытия Покупатель уведомит Продавца о том, что Покупатель не будет осуществлять Право на исполнение по Сделке валютный опцион.

Правила настоящего пункта об автоматическом осуществлении Права на исполнение применяются, если в Подтверждении стороны не предусмотрели иное.

- (б) Если Право на исполнение не осуществляется автоматически в соответствии с пунктом 3.7(а) Стандартных условий, Покупатель осуществляет свое Право на исполнение по Сделке валютный опцион путем направления Продавцу Требования об исполнении в течение Срока осуществления права на исполнение.
- (в) Если Требование об исполнении не получено Продавцом до или во Время закрытия в Дату истечения срока (и Право на исполнение не осуществляется автоматически в соответствии с пунктом 3.7(а) Стандартных условий), права и обязанности сторон по Сделке валютный опцион прекращаются.
- (г) Сделка валютный опцион не подлежит частичному исполнению, если в Подтверждении не установлено иное.

(д) Если Покупатель осуществляет свое Право на исполнение по Сделке валютный опцион в порядке, установленном пунктом 3.7(б) Стандартных условий, Датой осуществления права на исполнение по этой Сделке валютный опцион будет считаться:

(А) применительно к Американскому опциону:

(аа) Рабочий день в пределах Срока осуществления права на исполнение, в который Продавец получил Требование об исполнении не позднее Времени закрытия;

(бб) следующий Рабочий день в пределах Срока осуществления права на исполнение, если Требование об исполнении получено Продавцом после Времени закрытия;

(Б) применительно к Бермудскому опциону — любая из Дат осуществления права на исполнение, указанная в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованная сторонами, в которую Продавец получил Требование об исполнении не позднее Времени закрытия;

(В) применительно к Европейскому опциону — Дата истечения срока, если Продавец получил Требование об исполнении не позднее Времени закрытия в эту Дату истечения срока.

3.8. Порядок расчетов по Сделкам валютный опцион.

Сделки поставочный валютный опцион

(а) В случае осуществления Права на исполнение по Сделке поставочный валютный опцион, в Дату платежа Покупатель обязан уплатить Продавцу Сумму валюты на продажу, а Продавец обязан уплатить Покупателю Сумму валюты на покупку.

Сделки расчетный валютный опцион

(б) Сумма платежа применительно к Сделке расчетный валютный опцион, если в отношении Сделки сторонами не согласовано иное, рассчитывается по следующим формулам:

(А) применительно к Сделке расчетный валютный опцион, где Валюта на покупку является Расчетной валютой, а Валюта на продажу — Базовой валютой:

$$\text{Сумма платежа} = \left[\text{Сумма валюты на продажу} \times \left(\frac{\text{Цена исполнения} - \text{Курс спот}}{\text{Курс спот}} \right) \right]$$

(Б) применительно к Сделке расчетный валютный опцион, где Валюта на покупку является Базовой валютой, а Валюта на продажу — Расчетной валютой:

$$\text{Сумма платежа} = \left[\text{Сумма валюты на покупку} \times \left(\frac{\text{Курс спот} - \text{Цена исполнения}}{\text{Курс спот}} \right) \right]$$

- (В) при этом применительно к пунктам 3.8(б)(А) и 3.8(б)(Б) Стандартных условий Базовой валютой признается валюта, являющаяся Базовой валютой для целей выражения обменного курса соответствующей Валютной пары, другая валюта в Валютной паре признается Расчетной валютой.
- (в) В случае осуществления Права на исполнение по Сделке расчетный валютный опцион, если Сумма платежа имеет положительное значение, Продавец обязан уплатить Покупателю в Дату платежа:
 - (А) эту сумму в Базовой валюте (если Базовая валюта является Валютой платежа);
 - (Б) эквивалент этой суммы в Валюте платежа по Курсу спот (если Расчетная валюта является Валютой платежа) или по обменному курсу, способ определения которого указан для этих целей в Подтверждении (если Валютой платежа является валюта, не входящая в Валютную пару).

4. Способы определения курса спот

- 4.1. Применительно к Расчетной сделке для целей расчета Суммы платежа и Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, стороны согласовывают способ определения Курса спот (далее «**Способ определения курса спот**»). В Подтверждении Способ определения курса спот может быть установлен путем ссылки на любое из положений настоящей статьи 4 или путем включения самостоятельного определения Способа определения курса спот.
- 4.2. Для целей определения Курса спот применительно к соответствующему Способу определения курса спот сторонами может быть использован любой из следующих обменных курсов, указанный в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке (далее — «**Применимый курс**»): (i) курс покупки Расчетной валюты, (ii) курс продажи Расчетной валюты, (iii) среднее арифметическое курсов покупки и продажи Расчетной валюты, (iv) курс покупки Базовой валюты, (v) курс продажи Базовой валюты, (vi) среднее арифметическое курсов покупки и продажи Базовой валюты, (vii) иной обменный курс валюты, указанный в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке. При отсутствии такого указания Применимым курсом считается среднее арифметическое курсов покупки и продажи Расчетной валюты.
- 4.3. Сторонами могут быть использованы следующие Способы определения курса спот:

Публикуемые рыночные обменные курсы валюты

- (а) **RUB MICEXFRX**, или **RUB01**, означает, что Курсом спот для Даты оценки является Применимый курс рубля к доллару США, выраженный как количество рублей за один доллар, для расчетов в ту же дату, объявляемый

ЗАО «Московская межбанковская валютная биржа» (далее — «**ММВБ**») на странице MICEXFRX в системе Reuters в 10 часов 30 минут по московскому времени в Дату оценки;

- (б) **RUB MMVB**, или **RUB02**, означает, что Курсом спот для Даты оценки является Применимый курс рубля к доллару США, выраженный как количество рублей за один доллар, для расчетов в ту же дату, объявляемый ММВБ на странице ММВБ в системе Reuters в 10 часов 30 минут по московскому времени в Дату оценки;
- (в) **RUB CME-EMTA**, или **RUB03**, означает, что Курсом спот для Даты оценки является Применимый курс рубля к доллару США, выраженный как количество рублей за один доллар, для расчетов на следующий Рабочий день, рассчитанный Чикагской товарной биржей (Chicago Mercantile Exchange) и объявляемый Ассоциацией трейдеров развивающихся рынков (далее — «**EMTA**») на странице EMTA в системе Reuters, а если такая страница недоступна — на другой странице системы Reuters или иной системы, на которой публикуется такая информация, примерно в 13 часов 30 минут по московскому времени в Дату оценки;
- (г) **EMTA RUB INDICATIVE SURVEY RATE**, или **RUB04**, означает, что Курсом спот для Даты оценки является Применимый курс рубля к доллару США, выраженный как количество рублей за один доллар, для расчетов на следующий рабочий день, публикуемый на странице EMTA в сети Интернет (www.emta.org) примерно в 14 часов 45 минут по московскому времени либо вскоре после указанного времени;
- (д) **ECB37** означает применительно
 - (А) к паре валют рубль/евро – обменный курс российского рубля к евро, устанавливаемый Европейским центральным банком (ЕЦБ) и публикуемый на странице ECB37 в системе Reuters примерно в 14 часов 30 минут по центральноевропейскому времени;
 - (Б) к паре валют иностранная валюта/иностранная валюта — обменный курс соответствующей пары валют (иностранной валюты к евро, если евро — одна из валют пары, или, в остальных случаях, иностранной валюты к другой иностранной валюте через кросс-курс этих иностранных валют к евро), устанавливаемый ЕЦБ и публикуемый на странице Reuters «ECB37» в 14 часов 30 минут по центральноевропейскому времени;
 - (В) к паре валют иностранная валюта (кроме долларов США и евро)/русский рубль — обменный курс, рассчитанный как кросс-курс на основе курса доллара США к российскому рублю RUB CME EMTA и курса доллара США к соответствующей иностранной валюте, определяемого в порядке, указанном в подпункте (б) выше).

Котировки банков-ориентиров

- (е) «**Котировки банков-ориентиров**» означает, что Курс спот для Даты оценки может определяться на основе котировок Применимого курса (выраженного

как отношение количества Расчетной валюты к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Базовой валюты) на Дату оценки для расчетов в Дату платежа, запрошенных у банков, указанных в Подтверждении или иным образом согласованных сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — у не менее чем четырех банков, выбранных Расчетным агентом из числа ведущих на рынке соответствующих валют (далее — «**Банки-ориентир**»). Банки-ориентир являются Дилерами-ориентирами для целей Генерального соглашения.

- (А) Если Котировки банков-ориентиров являются первичным Способом определения курса спот, Расчетный агент обязан запросить у Банков-ориентиров Твердые котировки Применимого курса в отношении суммы в Расчетной валюте, указанной в Подтверждении в качестве котировочной суммы или иным образом согласованной сторонами применительно к Сделке (далее — «**Котировочная сумма**»), а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — в отношении стандартной суммы по сделкам с Расчетной валютой (то есть суммы, которая является обычной для конверсионных сделок спот на рынке соответствующей валюты на Дату оценки). Котировки, используемые для определения Курса спот на Дату оценки, должны определяться в каждом конкретном случае во время дня (далее — «**Котировочное время**»), указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, в эту Дату оценки, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — во время дня, выбранное Расчетным агентом.
- (Б) Если Котировки банков-ориентиров являются Альтернативным способом определения курса спот, Расчетный агент обязан запросить у Банков-ориентиров котировку того, что могло бы составлять Применимый курс в соответствии с первичным Способом, определения курса спот, если бы он был опубликован в Дату оценки, исходя из опыта каждого Банка-ориентира на валютном рынке Расчетной валюты и общей ситуации на этом рынке в Дату оценки. Котировки, используемые для определения Курса спот на Дату оценки, должны определяться в каждом конкретном случае для этой Даты оценки и запрашиваться в Котировочное время или в возможно короткий срок после того, как стало известно об отсутствии или невозможности определения Применимого курса в соответствии с первичным Способом определения курса спот.
- (В) При этом Курс спот будет определяться, (А) если предоставлено не менее четырех котировок, как среднее арифметическое котировок, без учета самого высокого и самого низкого значений (если более одной котировки имеют одинаковое самое высокое или низкое значения, не учитывается только одна из этих котировок); (Б) если предоставлены две или три котировки, как среднее арифметическое предоставленных котировок. Если предоставлено менее двух котировок, считается, что определить Курс спот на эту Дату оценки в соответствии с настоящим Способом определения курса спот невозможно.

Официальные курсы валют

(ж) «**Официальный курс**» означает, что Курс спот для Даты оценки определяется на основе официального курса соответствующей иностранной валюты по отношению к рублю, установленного Банком России в Дату оценки для расчетов на следующий рабочий день (или кросс-курса с использованием официального курса Банка России).

4.4. Если применимый к Сделке публикуемый обменный курс валюты, указанный в Способе определения курса спот, или источник его опубликования официально меняется на иной публикуемый обменный курс валюты или источник его опубликования, такое событие не является Сбоем публикации. В этом случае Курс спот для Даты оценки будет определяться так, как если бы в Способе определения курса спот был указан новый публикуемый обменный курс валюты или источник его опубликования.

5. Сделки валютный своп

5.1. Сделка валютный своп означает поставочный своп договор (контракт), по которому на условиях, согласованных сторонами, в Дату первоначального платежа одна сторона уплачивает другой стороне сумму (далее — «**Сумма первоначального платежа**») в одной согласованной валюте (далее в настоящем пункте — «**Первая валюта**»), а другая сторона уплачивает первой стороне Сумму первоначального платежа в другой согласованной валюте (далее в настоящем пункте — «**Вторая валюта**»), а в Дату окончательного платежа, наступающую не ранее третьего Рабочего дня после Даты сделки, первая сторона уплачивает другой стороне сумму (далее — «**Сумма окончательного платежа**») во Второй валюте, а другая сторона уплачивает первой стороне Сумму окончательного платежа в Первой валюте.

5.2. Применительно к Сделке валютный своп следующие термины имеют следующие значения:

(а) **Дата окончательного платежа** означает применительно к Сделке валютный своп день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.

(б) **Дата первоначального платежа** означает применительно к Сделке валютный своп день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — следующий Рабочий день после Даты сделки.

5.3. Существенные условия Сделки валютный своп.

(а) Существенными условиями Сделки валютный своп, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:

(А) Сумма первоначального платежа и валюта для первой стороны;

(Б) Сумма первоначального платежа и валюта для второй стороны;

- (В) Сумма окончательного платежа для первой стороны;
 - (Г) Сумма окончательного платежа для второй стороны;
 - (Д) Дата окончательного платежа.
- (б) Другие условия подлежат согласованию в качестве существенных условий Сделки валютный своп по требованию одной из сторон.

6. БАРЬЕРЫ В СДЕЛКАХ

6.1. Сделка может быть совершена под отлагательным или отменительным условием, в соответствии с которым Право на исполнение, право на получение платежа либо обязанность совершить платеж в соответствии с условиями Сделки, если условиями Сделки не предусмотрено иное:

- (а) возникает (такое условие Сделки именуется «**Барьерное отлагательное условие**») или
- (б) прекращается (такое условие Сделки именуется «**Барьерное отменительное условие**»)

у соответствующей стороны, если Курс спот согласованной сторонами Валютной пары достиг уровня Барьерного курса или преодолел его по состоянию на Контрольное время в Контрольную дату.

Условия Сделки могут предусматривать одно или более значений Барьерного курса. Интервал между парными значениями Барьерного курса (верхним и нижним значениями Барьерного курса) именуется «**Диапазон целевых значений**». При установлении Диапазона целевых значений (одного или более), возникновение или прекращение прав и обязанностей сторон, а также размер платежа по Сделке, как указано в пункте 6.1 Стандартных условий, может зависеть от нахождения или изменения значения Курса спот внутри и (или) за пределами Диапазона целевых значений.

6.2. **Барьерный курс** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, значение обменного курса Валютной пары, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке в целях определения наступления Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

6.3. **Контрольная дата** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, каждый из Рабочих дней, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.

Если в Подтверждении не указано Контрольных дат, Контрольной датой является каждый из Рабочих дней в течение периода начиная с Даты сделки (включительно) по (включая) последнюю Дату оценки, Дату истечения срока или в случае их отсутствия Рабочий день, предшествующий Дате платежа (либо по-

следней Дате платежа, если условиями Сделки предусмотрено несколько Дат платежа) или Дате окончательного платежа по Сделке.

- 6.4. **Контрольное время** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, время дня в Контрольную дату, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания и иного соглашения сторон — фактическое время закрытия торгов в режиме основных торгов на ММВБ в отношении Валютной пары в Контрольную дату.
- 6.5. Существенными условиями Сделки, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки помимо существенных условий соответствующего вида Сделок, предусмотренных Стандартными условиями, являются:
- (а) Тип условия о барьере (отлагательное или отменительное);
 - (б) Барьерный курс (или, если применимо, Диапазон целевых значений);
 - (в) Способ определения курса спот.
- 6.6. В случае возникновения у сторон разногласий по вопросу о наступлении Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия Расчетный агент определяет, наступило ли соответствующее условие.
7. События, препятствующие исполнению, и Альтернативы на случай, препятствующий исполнению

События, препятствующие исполнению

- 7.1. Если в отношении Сделки наступает и продолжает иметь место одно из следующих событий (каждое из которых именуется в настоящих Стандартных условиях «**Событие, препятствующее исполнению**»), согласованных Сторонами в качестве применимых к такой Сделке, Сделка подлежит исполнению или прекращению в соответствии с одним из способов (каждый из которых именуется в настоящих Стандартных условиях «**Альтернатива на случай, препятствующий исполнению**»), перечисленных в пункте 7.4 Стандартных условий.
- (а) **Валютные ограничения** означает принятие Государственным органом нормативно-правового или иного акта общего характера:
 - (А) запрещающего или существенно ограничивающего конверсию рублей в иностранную валюту и/или конверсию иностранной валюты в рубли;
 - (Б) запрещающего или существенно ограничивающего ведение счетов резидентов, как они определены в валютном законодательстве Российской Федерации, в иностранной валюте и требующего проведения принудительной конверсии иностранной валюты в рубли;
 - (В) вводящего мораторий на операции с иностранной валютой, если одно или несколько вышеуказанных ограничений имеет место на Дату платежа.

- (б) **Двойной курс валюты** означает применительно к Расчетной сделке возникновение на Дату оценки двух и более различных числовых значений у обменного курса валюты, указанного в Способе определения курса спот по Сделке.
- (в) **Сбой публикации** означает применительно к Расчетной сделке невозможность получить информацию о Курсе спот из источника информации об обменных курсах, указанного в согласованном сторонами Способе определения курса спот, на Дату оценки.
- (г) Стороны могут предусмотреть в Подтверждении применительно к Сделке иные События, препятствующие исполнению.

7.3. Если какое-либо событие составляет Юридическое ограничение или действие Непреодолимой силы, как они определены в Генеральном соглашении, и одновременно представляет собой Событие, препятствующее исполнению, для целей настоящих Стандартных условий и Генерального соглашения к такому событию применяются последствия, установленные для События, препятствующего исполнению.

7.4. В Подтверждении может быть предусмотрено «Определение События, препятствующего исполнению, Расчетным агентом». В этом случае Расчетный агент после консультаций с обеими сторонами (или другой стороной, если Расчетный агент является одной из сторон) должен добросовестно определить, наступило ли в отношении Сделки Событие, препятствующее исполнению.

Альтернативы на случай, препятствующий исполнению

7.5. Если в отношении Сделки наступает Событие, препятствующее исполнению, Сделка подлежит исполнению или прекращению в соответствии с одной из следующих Альтернатив на случай, препятствующий исполнению, если это установлено в Подтверждении или следует из пункта 7.4(з) Стандартных условий.

- (а) **Альтернативный способ определения курса спот** означает применительно к Двойному курсу валюты или Сбою публикации, что Расчетный агент определяет Курс спот по Сделке на соответствующую Дату оценки в соответствии с иными Способами определения курса спот в последовательности, указанной в Подтверждении или иным образом согласованной сторонами применительно к Сделке.

При отсутствии такого указания в Подтверждении Альтернативные способы определения курса спот для соответствующей Валютной пары применяются в последовательности, указанной в пункте 4.3 Стандартных условий, начиная со Способа определения курса спот, следующего за первичным Способом определения курса спот, согласованным сторонами.

- (б) **Выплата эквивалента в рублях** означает применительно к Расчетным сделкам, что обязательство уплатить Сумму платежа в иностранной валюте заменяется обязательством уплатить эквивалент Суммы платежа в рублях по Курсу спот (если одной из валют Валютной пары является рубль) или обменному курсу, определяемому Расчетным агентом, в иных случаях.

- (в) **Замена на расчетную сделку** означает, что в Сделке поставочный валютный форвард, Сделке поставочный валютный опцион и Сделке валютный своп (в части уплаты сторонами Сумм окончательного платежа) в отношении Валютной пары, в которой одной из валют является рубль, обязательства сторон по платежам заменяются обязательством одной из сторон уплатить сумму (или ее эквивалент в рублях по Курсу спот), которая подлежала бы выплате в соответствии с настоящими Стандартными условиями, если бы расчеты по такой Сделке поставочный валютный форвард, или Сделке валютный своп (в части уплаты сторонами Сумм окончательного платежа) осуществлялись в порядке, установленном для Сделки расчетный валютный форвард, а расчеты по Сделке поставочный валютный опцион — в порядке, установленном для Сделки расчетный валютный опцион.

Для целей настоящего пункта, если иное не установлено в Подтверждении:

- (А) Датой оценки будет день, который, если бы не Событие, препятствующее исполнению, был бы Датой платежа;
- (Б) Курс спот будет определяться:
- (аа) применительно к Валютной паре, включающей рубли и доллары США — как если бы Способом определения курса спот был EMTA RUB INDICATIVE SURVEY RATE;
 - (бб) применительно к другим случаям — как если бы Способом определения курса спот были Котировки банков-ориентиров, и выражаться как отношение суммы в рублях к одной единице (или иному числу, кратному десяти) иностранной валюты;
- (В) Датой платежа будет второй Рабочий день после Даты оценки, указанной выше;
- (Г) Расчетной валютой будут рубли;
- (Д) Базовой валютой будет иностранная валюта;
- (Е) Номинальная сумма в расчетной валюте будет равна сумме, которая подлежала бы уплате по Сделке поставочный валютный форвард и Сделке поставочный валютный опцион (если бы не Событие, препятствующее исполнению), или Сумме окончательного платежа в рублях по Сделке валютный своп;
- (Ж) Номинальная сумма в базовой валюте будет равна сумме в иностранной валюте, которая подлежала бы уплате по Сделке поставочный валютный форвард и Сделке поставочный валютный опцион (если бы не Событие, препятствующее исполнению), или Сумме окончательного платежа в иностранной валюте по Сделке валютный своп;
- (З) в Сделке поставочный валютный форвард и Сделке валютный своп (в части уплаты сторонами Сумм окончательного платежа) Форвардным курсом будет обменный курс валюты, выраженный как отношение суммы в рублях к одной единице (или иному числу, кратному десяти)

иностранной валюты, полученный путем деления суммы в рублях, которая подлежала бы платежу по Сделке поставочный валютный форвард или Сделке валютный своп (если бы не Событие, препятствующее исполнению), на сумму в иностранной валюте, которая подлежала бы платежу по Сделке поставочный валютный форвард или Сделке валютный своп (если бы не Событие, препятствующее исполнению);

- (И) Сумма платежа по Сделке расчетный валютный форвард будет определяться по следующей формуле:

$$\text{Сумма платежа} = \left[\frac{\text{Номинальная сумма в базовой валюте}}{\text{Курс спот}} \times \left(1 - \frac{\text{Форвардный курс}}{\text{Курс спот}} \right) \right] \times \text{Курс спот}$$

- (К) Сумма платежа по Сделке расчетный валютный опцион будет определяться по следующим формулам, если в отношении Сделки сторонами не согласовано иное:

- (аа) Если Валютой на продажу являются рубли, а Валютой на покупку — иностранная валюта:

$$\text{Сумма платежа} = \left[\frac{\text{Сумма валюты на покупку}}{\text{Курс спот}} \times \left(\frac{\text{Курс спот} - \text{Цена исполнения}}{\text{Курс спот}} \right) \right] \times \text{Курс спот}$$

- (бб) Если Валютой на покупку являются рубли, а Валютой на продажу — иностранная валюта:

$$\text{Сумма платежа} = \left[\frac{\text{Сумма валюты на продажу}}{\text{Курс спот}} \times \left(\frac{\text{Цена исполнения} - \text{Курс спот}}{\text{Курс спот}} \right) \right] \times \text{Курс спот}$$

- (г) **Определение курса спот расчетным агентом** означает, что Расчетный агент должен определить Курс спот (или метод определения Курса спот), принимая во внимание всю доступную информацию, которую он разумно и добросовестно посчитает уместной.
- (д) **Отсрочка исполнения** означает, что Датой платежа по Сделке будет считаться первый Рабочий день после дня, когда Событие, препятствующее исполнению, прекратило действие, если только Событие, препятствующее исполнению, не продолжает иметь место (начиная со дня, который, если бы не Событие, препятствующее исполнению, был бы Датой платежа) в течение максимального количества Рабочих дней подряд, установленного в Подтверждении (далее — «**Максимальный срок события, препятствующего исполнению**»). В этом случае последний из таких Рабочих дней будет Датой платежа, и соответствующие Альтернативы на случай, препятствующий исполнению, подлежат применению к этой Сделке.
- (е) **Прекращение** означает, что обязательства по Сделке прекращаются в соответствии с применимыми положениями статьи 6 Примерных условий договора, как если бы:

- (А) Событие, препятствующее исполнению, было определено как Дополнительное основание прекращения;
- (Б) все применимые Льготные периоды истекли;
- (В) все уведомления, необходимые для возникновения права на прекращение обязательств по Сделке, были получены в день, когда Прекращение стало применимой Альтернативой на случай, препятствующий исполнению;
- (Г) были две Затронутые стороны;
- (Д) Сделка являлась единственной Затронутой сделкой.

Термины «Дополнительное основание прекращения», «Льготный период», «Затронутые стороны» и «Затронутая сделка» имеют значение, указанное в Примерных условиях договора, если Генеральным соглашением не предусмотрено иное.

- (ж) Стороны могут установить в Подтверждении иные Альтернативы на случай, препятствующий исполнению, которые будут применяться к Сделке.
- (з) Если стороны не указали в Подтверждении Альтернатив на случай, препятствующий исполнению, Альтернативы на случай, препятствующий исполнению, применяются в следующей последовательности:
 - (и) при Валютных ограничениях:
 - (А) в Поставочной сделке, где Валютная пара включает рубли, — Замена на расчетную сделку, а в других случаях Поставочных сделок — Отсрочка исполнения;
 - (Б) в Расчетной сделке — Выплата эквивалента в рублях;
 - (к) при Двойном курсе валюты — применимый Альтернативный способ определения курса спот, а при его отсутствии — Определение курса спот расчетным агентом;
 - (л) при Сбое публикации:
 - (А) применимый Альтернативный способ определения курса спот из публикуемых рыночных обменных курсов валют, а при его отсутствии — Котировки банков-ориентиров;
 - (Б) Определение курса спот расчетным агентом.

7.5. Кроме случаев, указанных в подпункте 7.6 Стандартных условий, если в Подтверждении предусмотрена одна или более Альтернатив на случай, препятствующий исполнению, к Сделке применяются только эти Альтернативы на случай, препятствующий исполнению, в последовательности, установленной Подтверждением.

7.6. Если иное не установлено в Подтверждении, в случае когда ни одна из применимых Альтернатив на случай, препятствующий исполнению, не позволяет сторонам определить Курс спот или порядок исполнения Сделки, обязательства по Сделке подлежат прекращению в соответствии с положениями о Прекращении.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1
к Стандартным условиям конверсионных сделок,
сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г.

Форма Подтверждения для Конверсионной сделки

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — «*Подтверждение*») является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — «*Сторона А*») и [●] (далее — «*Сторона Б*») от [●] (далее — «*Генеральное соглашение*»).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

[Сумма и валюта,
подлежащая уплате Стороной А:]

[Сумма и]¹ валюта,
подлежащая уплате
Стороной Б:

[Обменный курс:]²

Дата платежа:

[Сегодня/Завтра/Послезавтра]

[(б) Иные условия:]

[4][5]. Банковские реквизиты:

Счет для платежей
в пользу Стороны А:

Счет для платежей
в пользу Стороны Б:

[[5][6]. Рабочий день:]

[[6][7]. [Условие окончания срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

¹ Для Сделок спот стороны обязаны указать (а) сумму и валюту, подлежащую уплате Стороной Б, или (б) Курс спот и валюту, подлежащую уплате Стороной Б.

² Для Сделок спот стороны обязаны указать (а) сумму и валюту, подлежащую уплате Стороной Б, или (б) Курс спот и валюту, подлежащую уплате Стороной Б.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

[Сумма и валюта,
подлежащая уплате Стороной А:]

[Сумма и]³ валюта,
подлежащая уплате Стороной Б:

[Форвардный курс]⁴

Дата платежа:

Расчеты в порядке,
установленном
для Поставочной сделки

Применимо

[(б) Иные условия:]

[4. Правила о Событиях, препятствующих исполнению, и Альтернативах на случай, препятствующий исполнению:

[Иные События,
препятствующие исполнению:]

[Определение События,
препятствующего исполнению,
Расчетным агентом:

Применимо]

[Альтернативы на случай,
препятствующий исполнению:]

[Альтернативный способ
определения курса спот:⁵

Двойной курс валюты:

[Способ определения курса спот:]

Сбой публикации:

[Способ определения курса спот:]

³ Для Поставочных конверсионных сделок стороны обязаны указать (а) сумму и валюту, подлежащую уплате Стороной Б, или (б) Форвардный курс и валюту, подлежащую уплате Стороной Б.

⁴ Для Поставочных конверсионных сделок стороны обязаны указать (а) сумму и валюту, подлежащую уплате Стороной Б, или (б) Форвардный курс и валюту, подлежащие уплате Стороной Б

⁵ Применяется, если Стороны при Замене на расчетную сделку намерены изменить порядок определения Курса спот, установленный пунктом 7.4(в)(Б) Стандартных условий. Если стороны выбирают в качестве Способа определения курса спот «Котировки банков-ориентиров» и намерены изменить правила пункта 4.3(ж) Стандартных условий, установленные для такого Способа определения курса спот, они должны указать следующую информацию: (i) Банки-ориентиры (по умолчанию используются четыре ведущих банка, выбранных Расчетным агентом), (ii) Применимый курс (по умолчанию используется среднее арифметическое курса покупки и продажи Расчетной валюты), (iii) Котировочную сумму (по умолчанию используется сумма, равная Номинальной сумме в расчетной валюте) и (iv) Котировочное время.

[Отсрочка исполнения:

Максимальный срок события,
препятствующего исполнению:]

[Иные Альтернативы на случай,
препятствующий исполнению:]

[4][5]. Расчетный агент: [Сторона А].

[5][6]. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[[6][7]. Рабочий день:]

[[7][8]. [Условие окончания срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ПРИЛОЖЕНИЕ 3
к Стандартным условиям конверсионных сделок,
сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г.

Форма Подтверждения для Сделки расчетный валютный форвард

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Расчетная валюта:

[Номинальная сумма
в расчетной валюте:]⁶

[Номинальная сумма
в базовой валюте:]⁶

[Форвардный курс:]⁶

Покупатель расчетной валюты: [Сторона А]/[Сторона Б]

Продавец расчетной валюты: [Сторона Б]/[Сторона А]

[Валюта платежа]⁷

[и способ определения
обменного курса
для целей расчета суммы
в Валюте платежа]⁸:

Дата платежа:

Расчеты в порядке, установленном для Расчетной сделки: Применимо⁹

Способ определения курса спот:

[Дата оценки:]¹⁰

[(б) Иные условия:]

4. Правила о Событиях, препятствующих исполнению, и Альтернативах на случай, препятствующий исполнению:

[Иные События,
препятствующие исполнению:]

[Определение События,
препятствующего исполнению,
Расчетным агентом: Применимо]

⁶ Для Расчетных конверсионных сделок стороны обязаны указать (а) Номинальную сумму в расчетной валюте и Номинальную сумму в базовой валюте; или (б) Форвардный курс и либо Номинальную сумму в расчетной валюте, либо Номинальную сумму в базовой валюте.

⁷ Стороны обязаны указать данную информацию, если они хотят, чтобы расчеты по Сделке осуществлялись в валюте, отличной от Базовой валюты.

⁸ Стороны обязаны указать способ определения обменного курса для пересчета Суммы платежа в Валюту платежа, если Валюта платежа отличается как от Базовой валюты, так и от Расчетной валюты.

⁹ Стороны должны специально указать, что расчеты по соответствующей Сделке осуществляются в порядке, установленном для Расчетной сделки, поскольку по умолчанию расчеты по Сделке осуществляются в порядке, установленном для Поставочной сделки.

¹⁰ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.6 Стандартных условий о том, что Дата оценки наступает за два Рабочих дня до Даты платежа

[Альтернативы на случай,
препятствующий исполнению:]

[Альтернативный способ
определения курса спот:¹¹

Двойной курс валюты:

[Способ определения курса спот:]

Сбой публикации:

[Способ определения курса спот:]

[Отсрочка исполнения:

Максимальный срок события,
препятствующего исполнению:]

[Иные Альтернативы на случай,
препятствующий исполнению:]

[4][5]. Расчетный агент: [Сторона А].

[5][6]. Банковские реквизиты:

Счет для платежей
в пользу Стороны А:

Счет для платежей
в пользу Стороны Б:

[[6][7]. Рабочий день:]

[[7][8]. [Условие окончания срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

[Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

¹¹ Если стороны выбирают в качестве Способа определения курса спот «Котировки банков-ориентиров» и намерены изменить правила пункта 4.3(ж) Стандартных условий, установленные для такого Способа определения курса спот, они должны указать следующую информацию: (i) Банки-ориентеры (по умолчанию используются четыре ведущих банка, выбранных Расчетным агентом), (ii) Применимый курс (по умолчанию используется среднее арифметическое курса покупки и продажи Расчетной валюты), (iii) Котировочную сумму (по умолчанию используется сумма, равная Номинальной сумме в расчетной валюте) и (iv) Котировочное время.

ПРИЛОЖЕНИЕ 4
к Стандартным условиям конверсионных сделок,
сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г.

Форма Подтверждения для Сделки поставочный валютный опцион

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — «*Подтверждение*») является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — «*Сторона А*») и [●] (далее — «*Сторона Б*») от [●] (далее — «*Генеральное соглашение*»).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Покупатель:

[Сторона А]/[Сторона Б]

Продавец:

[Сторона Б]/[Сторона А]

Стиль валютного опциона:

[Американский/Бермудский/
Европейский]

Тип валютного опциона:¹²

[Опцион на продажу (пут) [●]¹³/
Опцион на покупку (колл) [●]¹⁴]

Валюта на покупку

[и Сумма валюты на покупку]:¹⁵

Валюта на продажу

[и Сумма валюты на продажу]:¹⁵

[Цена исполнения]:¹⁵

[Дата начала срока]:¹⁶

[Срок осуществления права
на исполнение]:¹⁷

[Даты осуществления права
на исполнение
по Бермудскому опциону]:¹⁸

Дата истечения срока:

Время закрытия:

[●] ч. [●] мин.
по московскому времени

Расчеты в порядке,
установленном
для Поставочной сделки

Применимо

¹² Стороны должны определить свою сделку как Опцион на продажу (пут) и/или Опцион на покупку (колл) в отношении соответствующей валюты.

¹³ Стороны должны указать соответствующую валюту, идентичную Валюте на продажу.

¹⁴ Стороны должны указать соответствующую валюту, идентичную Валюте на покупку.

¹⁵ Для Сделок поставочный валютный опцион стороны обязаны определить (а) Сумму валюты на покупку и Сумму валюты на продажу; или (б) Цену исполнения и либо Сумму валюты на покупку, либо Сумму валюты на продажу.

¹⁶ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 3.2(г) Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

¹⁷ При желании стороны могут изменить Срок осуществления прав, предусмотренный для Американского опциона. Например, при наличии нескольких Сроков осуществления прав необходимы дополнительные ссылки.

¹⁸ Стороны обязаны указать данную информацию для Бермудского опциона.

Дата платежа:¹⁹

[[●] Рабочий день, следующий за Датой осуществления права на исполнение.]/[указать дату]

[Премия:]²⁰

[Дата уплаты премии:]²¹

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]²²

Барьерный курс:

Способ определения курса спот для Барьерного отлагательного условия:²³

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]²⁴

[Барьерное отменительное условие:

[Применимо]²⁵

Барьерный курс:

Способ определения курса спот для Барьерного отменительного условия:²⁶

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]²⁷

[(б) Иные условия:]²⁸

¹⁹ При желании стороны могут указать Дату платежа в отношении Даты истечения срока.

²⁰ Данное условие может быть включено в Подтверждение если Стороны договорятся об уплате Премии. Стороны могут указать размер Премии в виде твердой суммы или процента от Суммы валюты на покупку или Суммы валюты на продажу.

²¹ Данное условие может быть включено в Подтверждение если Стороны договорятся об уплате Премии.

²² Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

²³ Стороны должны указать Способ определения курса спот, если в строке выше они указали на применимость Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

²⁴ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

²⁵ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

²⁶ Стороны должны указать Способ определения курса спот, если в строке выше они указали на применимость Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

²⁷ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

²⁸ Например, такие условия могут включать возможность частичного исполнения Сделки валютный опцион.

- [4. Правила о Событиях, препятствующих исполнению, и Альтернативах на случай, препятствующий исполнению:
 [Иные События, препятствующие исполнению:]
 [Определение События, препятствующего исполнению, Расчетным агентом: Применимо]
 [Альтернативы на случай, препятствующий исполнению:]
 [Альтернативный способ определения курса спот:²⁹
 Двойной курс валюты: [Способ определения курса спот:]
 Сбой публикации: [Способ определения курса спот:]
 [Отложение исполнения:
 Максимальный срок события, препятствующего исполнению:]
 [Иные Альтернативы на случай, препятствующий исполнению:]
- [4][5]. Расчетный агент: [Сторона А]
 [5][6]. Банковские реквизиты:
 Счет для платежей в пользу Стороны А:
 Счет для платежей в пользу Стороны Б:
 [[6][7]. Рабочий день:]
 [[7][8]. [Условие окончания срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату, указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

 Ф. И. О.:

 Ф. И. О.:

 Должность:

 Должность:

²⁹ Если стороны выбирают в качестве Способа определения курса спот «Котировки банков-ориентиров» и намерены изменить правила пункта 4.3(ж) Стандартных условий, установленные для такого Способа определения курса спот, они должны указать следующую информацию: (i) Банки-ориентиров (по умолчанию используются четыре ведущих банка, выбранных Расчетным агентом), (ii) Применимый курс (по умолчанию используется среднее арифметическое курса покупки и продажи Расчетной валюты), (iii) Котировочную сумму (по умолчанию используется сумма, равная Номинальной сумме в расчетной валюте) и (iv) Котировочное время.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Покупатель:

[Сторона А]/[Сторона Б]

Продавец:

[Сторона Б]/[Сторона А]

Стиль валютного опциона:

[Американский/Бермудский/
Европейский]

Тип валютного опциона:³⁰

[Опцион на продажу (пут) [●]³¹/
Опцион на покупку (колл) [●]³²]

Валюта на покупку

[и Сумма валюты на покупку:]³³

Валюта на продажу

[и Сумма валюты на продажу:]³⁴

Цена исполнения:

[Валюта платежа]³⁵

[и способ определения обменного курса
для целей расчета суммы в Валюте платежа]³⁶:

Способ определения курса спот:

[Дата начала срока:]³⁷

[Срок осуществления права на исполнение:]³⁸

[Даты осуществления права на исполнение
по Бермудскому опциону:]³⁹

³⁰ Стороны должны определить свою сделку как Опцион на продажу (пут) и/или Опцион на покупку (колл) в отношении соответствующей валюты.

³¹ Стороны должны указать соответствующую валюту, идентичную Валюте на продажу.

³² Стороны должны указать соответствующую валюту, идентичную Валюте на покупку.

³³ Для Сделок расчетный валютный опцион стороны обязаны определить Цену исполнения и либо Сумму валюты на покупку, либо Сумму валюты на продажу.

³⁴ Для Сделок расчетный валютный опцион стороны обязаны определить Цену исполнения и либо Сумму валюты на покупку, либо Сумму валюты на продажу.

³⁵ Стороны обязаны указать данную информацию, если они хотят, чтобы расчеты по Сделке осуществлялись в валюте, отличной от Базовой валюты.

³⁶ Стороны обязаны указать способ определения обменного курса для пересчета Суммы платежа в Валюту платежа, если Валюта платежа отличается как от Базовой валюты, так и от Расчетной валюты.

³⁷ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 3.2(г) Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки

³⁸ Стороны могут изменить Срок осуществления прав, предусмотренный для Американского опциона. Например, при наличии нескольких Сроков осуществления прав необходимы дополнительные ссылки.

³⁹ Стороны обязаны указать данную информацию для Бермудского опциона.

Дата истечения срока:

Время закрытия:

[●] ч. [●] мин.
по московскому времени

[Дата оценки:]⁴⁰

Расчеты в порядке,
установленном
для Расчетной сделки:

Применимо⁴¹

Дата платежа:⁴²

[[●] Рабочий день, следующий
за Датой осуществления права
на исполнение.]/[указать дату]

[Премия:]⁴³

[Дата уплаты премии:]⁴⁴

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]⁴⁵

Барьерный курс:

Способ определения курса спот
для Барьерного отлагательного условия:⁴⁶

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:⁴⁷

[Барьерное отменительное условие:

[Применимо]⁴⁸

Барьерный курс:

⁴⁰ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.6 Стандартных условий о том, что Датой оценки будет Дата осуществления прав.

⁴¹ Стороны должны специально указать, что расчеты по соответствующей Сделке осуществляются в порядке, установленном для Расчетной сделки, поскольку по умолчанию расчеты по Сделке осуществляются в порядке, установленном для Поставочной сделки.

⁴² Стороны могут указать Дату платежа в отношении Даты истечения срока.

⁴³ Данное условие может быть включено в Подтверждение если Стороны договариваются об уплате Премии. Стороны могут указать размер Премии в виде твердой суммы или процента от Суммы валюты на покупку или Суммы валюты на продажу.

⁴⁴ Данное условие может быть включено в Подтверждение если Стороны договариваются об уплате Премии.

⁴⁵ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

⁴⁶ Стороны должны указать Способ определения курса спот, если в строке выше они указали на применимость Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

⁴⁷ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

⁴⁸ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

Способ определения курса спот
для Барьерного отменительного условия:⁴⁹

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]⁵⁰

[(б) Иные условия:]⁵¹

[4. Правила о Событиях, препятствующих исполнению, и Альтернативах на случай, препятствующий исполнению:

[Иные События,
препятствующие исполнению:]

[Определение События,
препятствующего исполнению,
Расчетным агентом:

Применимо]

[Альтернативы на случай,
препятствующий исполнению:]

[Альтернативный способ
определения курса спот:⁵²

Двойной курс валюты:

[Способ определения
курса спот:]

Сбой публикации:

[Способ определения
курса спот:]

[Отложение исполнения:

Максимальный срок события,
препятствующего исполнению:]

[Иные Альтернативы на случай,
препятствующий исполнению:]

[4][5]. Расчетный агент: [Сторона А].

[5][6]. Банковские реквизиты:

⁴⁹ Стороны должны указать Способ определения курса спот, если в строке выше они указали на применимость Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

⁵⁰ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

⁵¹ Такие условия могут включать, в частности, возможность частичного исполнения Сделки валютный опцион.

⁵² Если стороны выбирают в качестве Способа определения курса спот «Котировки банков-ориентиров» и намерены изменить правила пункта 4.3(ж) Стандартных условий, установленные для такого Способа определения курса спот, они должны указать следующую информацию: (i) Банки-ориентеры (по умолчанию используются четыре ведущих банка, выбранных Расчетным агентом), (ii) Применимый курс (по умолчанию используется среднее арифметическое курса покупки и продажи Расчетной валюты), (iii) Котировочную сумму (по умолчанию используется сумма, равная Номинальной сумме в расчетной валюте) и (iv) Котировочное время.

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[[6][7]. Рабочий день:]

[[7][8]. [Условие окончания срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ПРИЛОЖЕНИЕ 6
к Стандартным условиям конверсионных сделок,
сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г.

Форма Подтверждения для Сделки валютный своп

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — «*Подтверждение*») является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — «*Сторона А*») и [●] (далее — «*Сторона Б*») от [●] (далее — «*Генеральное соглашение*»).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условия Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, составляют:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

[Дата первоначального платежа:]⁵³ [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]⁵⁴

Сумма первоначального платежа и валюта для Стороны А:

Сумма первоначального платежа и валюта для Стороны Б:

Дата окончательного платежа: [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]⁵⁵

Сумма окончательного платежа для Стороны А:

Сумма окончательного платежа для Стороны Б:

[(б) Иные условия:]

[4. Правила о Событиях, препятствующих исполнению, и Альтернативах на случай, препятствующий исполнению:

[Иные События, препятствующие исполнению:]

[Определение События, препятствующего исполнению, Расчетным агентом: Применимо]

[Альтернативы на случай, препятствующий исполнению:]

[Отсрочка исполнения:

Максимальный срок события, препятствующего исполнению:]

[Иные Альтернативы на случай, препятствующий исполнению:]

⁵³ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 5.2(б) Стандартных условий о том, что Датой первоначального платежа является следующий Рабочий день после Даты сделки.

⁵⁴ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.17 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день»

⁵⁵ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.17 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день»

5. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[6. Рабочий день:

для [первой валюты]⁵⁶:

для [второй валюты]⁵⁷:]

[7. Условие окончания срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

⁵⁶ Укажите наименование первой из двух валют, в которых заключается Сделка валютный своп.

⁵⁷ Укажите наименование второй из двух валют, в которых заключается Сделка валютный своп.

ПРИЛОЖЕНИЕ 7
к Стандартным условиям конверсионных сделок,
валютных опционов и сделок валютный своп 2011 г.

Основные финансовые центры

Валюта	Основной финансовый центр
Австралийский доллар	Сидней и Мельбурн
Датская крона	Копенгаген
Доллар США	Нью-Йорк
Исландская крона	Рейкьявик
Иена	Токио
Канадский доллар	Торонто
Норвежская крона	Осло
Российский рубль	Москва
Сингапурский доллар	Сингапур
Турецкая лира	Анкара
Фунт стерлингов	Лондон
Шведская крона	Стокгольм
Швейцарский франк	Цюрих

ПРИЛОЖЕНИЕ 8
к Стандартным условиям конверсионных сделок,
сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г.

Форма Требования об исполнении по Сделке валютный опцион

[На бланке Покупателя]

[Дата]

[Наименование и адрес Продавца]

Кас.: Требование об исполнении [наименование Сделки валютный опцион]

Уважаемые господа!

Мы ссылаемся на Сделку валютный опцион, заключенную между нами [дата], [регистрационный номер Сделки] (далее — «Сделка»), на основании Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] и [●] от [●].

Настоящее Требование об исполнении направляется вам в порядке и в целях осуществления нами Права на исполнение по Сделке в соответствии с пунктом 3.7 Стандартных условий конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков, применяемых в соответствии с Подтверждением по Сделке.

Все термины, использованные в настоящем Требовании об исполнении с заглавной буквы, имеют значение, определенное в Стандартных условиях.

С уважением,

[Покупатель]

Ф. И. О.:

Должность:

АЛФАВИТНО-ПРЕДМЕТНЫЙ УКАЗАТЕЛЬ

Термин	Пункт
ECB37	4.3(д)
EMTA	4.3(в)
EMTA RUB INDICATIVE SURVEY RATE	4.3(г)
RUB01	4.3(а)
RUB02	4.3(б)
RUB03	4.3(в)
RUB04	4.3(г)
RUB CME-EMTA	4.3(в)
RUB MICEXFRX,	4.3(а)
RUB MMVB	4.3(б)
Альтернатива на случай, препятствующий исполнению	7.1
Альтернативный способ определения курса спот	7.4(а)
Американский опцион	3.3(а)
Базовая валюта	1.1
Банки-ориентиры	4.3(ж)
Барьерный курс	6.2
Барьерное отлагательное условие	6.1(а)
Барьерное отменительное условие	6.1(б)
Бермудский опцион	3.3(б)
Беспоставочная сделка	1.21
Валюта на покупку	3.2(а)
Валюта на продажу	3.2(б)
Валюта платежа	1.2
Валютная пара	1.3
Валютные ограничения	7.1(а)
Время закрытия	3.2(д)(А)
Выплата эквивалента в рублях	7.4(б)
Генеральное соглашение	1.4
Государственный орган	1.5
Дата истечения срока	3.2(в)
Дата начала срока	3.2(г)
Дата окончательного платежа	5.2(а)
Дата осуществления права на исполнение	3.2(д)(Б)

Дата оценки	1.6
Дата первоначального платежа	5.2(б)
Дата платежа	1.7
Дата сделки	1.8
Дата уплаты премии	3.5(а)
Двойной курс валюты	7.1(б)
Европейский опцион	3.3(в)
Замена на расчетную сделку	7.4(в)
Конверсионная сделка	2.1
Контрольная дата	6.3
Контрольное время	6.4
Котировки банков-ориентиров	4.3(ж)
Котировочная сумма	4.3(ж)(А)
Котировочное время	4.3(ж)(А)
Курс спот	1.9
Максимальный срок события, препятствующего исполнению	7.4(д)
ММВБ	4.3(а)
Номинальная сумма в базовой валюте	1.10
Номинальная сумма в расчетной валюте	1.11
Округление	1.13
Определение курса спот расчетным агентом	7.4(г)
Опцион на покупку (колл)	3.4(а)
Опцион на продажу (пут)	3.4(б)
Основной финансовый центр	1.12
Отсрочка исполнения	7.4(д)
Официальный курс	4.3(з)
Подтверждение	1.14
Покупатель	3.1(а)
Покупатель расчетной валюты	1.15
Поставочная сделка	1.16
Право на исполнение	3.2(д)
Предшествующий рабочий день	1.26(б)
Прекращение	7.4(е)
Премия	3.5(а)
Применимый курс	4.2
Примерные условия договора	1.17
Продавец	3.1(а)
Продавец расчетной валюты	1.18
Рабочий день	1.19
Рабочий день в отчетном периоде	1.26(в)

Расчетная валюта	1.20
Расчетная сделка (или Беспоставочная сделка) для целей настоящих Стандартных условий означает Сделку расчетный валютный форвард или Сделку расчетный валютный опцион.	1.21
Расчетный агент	1.22
Сбой публикации	7.1(в)
Сделка для целей настоящих Стандартных условий	1.23
Сделка валютный форвард	2.2
Сделка валютный опцион	3.1
Сделка валютный своп	5.1
Сделка поставочный валютный опцион	3.1(а)
Сделка поставочный валютный форвард	2.2(а)
Сделка расчетный валютный опцион	3.1(б)
Сделка расчетный валютный форвард	2.2(б)
Конверсионная сделка (или Сделка спот)	2.1
Следующий рабочий день	1.26(а)
Событие, препятствующее исполнению	7.1
Способ определения курса спот	4.1
Срок осуществления права на исполнение	3.2(д)(В)
Сумма валюты на покупку	3.2(е)
Сумма валюты на продажу	3.2(ж)
Сумма окончательного платежа	5.1
Сумма первоначального платежа	5.1
Сумма платежа	1.24
Твердая котировка	1.25
Требование об исполнении	3.2(д)(Г)
Условие об окончании срока в нерабочий день	1.26
Форвардный курс	1.27
Цена исполнения	3.2(з)

СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ
СРОЧНЫХ СДЕЛОК НА ПРОЦЕНТНЫЕ СТАВКИ,
СДЕЛОК ВАЛЮТНО-ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП
И СДЕЛОК СВОПЦИОН

2011 г.

This 2011 Standard Terms of Interest Rate and Swaption Transactions is based, in part, on selected provisions of the 2006 ISDA Definitions, © 2006 International Swaps and Derivatives Association, Inc., («ISDA®»); 1998 FX and Currency Option Definitions, © 1998 International Swaps and Derivatives Association, Inc., Emerging Markets Traders Association, («EMTA®») and The Foreign Exchange Committee; and the 2002 ISDA Equity Derivatives Definitions, © 2002 International Swaps and Derivatives Association, Inc., and are used with its permission. ISDA takes no position as to this Russian-version 2011 Standard Terms of Interest Rate and Swaption Transactions' suitability for use in any particular transaction. Prospective users should seek independent legal advice before using this instrument.

СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ СРОЧНЫХ СДЕЛОК НА ПРОЦЕНТНЫЕ СТАВКИ И СДЕЛОК СВОПЦИОН 2011 г.

Настоящие Стандартные условия срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков, устанавливают особенности заключения, исполнения и прекращения Сделок, как они определены в пункте 6 Стандартных условий. Настоящие Стандартные условия применяются к Сделке, (а) если они полностью или частично включены в Подтверждение по Сделке путем указания в нем о применении Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок опцион 2011 г. полностью или в соответствующей части; (б) по умолчанию при отсутствии Подтверждения применительно к Сделкам, заключенным после даты согласования Примерных условий договора (как они определены в Стандартных условиях) федеральным органом исполнительной власти по рынку ценных бумаг. Если какой-либо термин настоящих Стандартных условий употребляется в Подтверждении наряду с указанием стороны, он применяется исключительно к этой стороне.

1. ОБЩИЕ ОПРЕДЕЛЕНИЯ

- 1.1. *Генеральное соглашение* означает Генеральное соглашение в значении, определенном в Примерных условиях договора.
- 1.2. *Дата изменения плавающей ставки* означает применительно к Сделке каждый день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, в который Расчетный агент определяет Плавающую ставку применительно к соответствующему Процентному периоду, с учетом применимого Условия об окончании срока в нерабочий день. При этом, если Условие об окончании срока в нерабочий день не определено применительно к Дате изменения плавающей ставки, применяется Условие об окончании срока в нерабочий день, установленное для Дат платежа Плавающих сумм по этой Сделке, за исключением случаев, когда применение такого Условия об окончании срока в нерабочий день приведет к совпадению Даты изменения плавающей ставки и Даты платежа применительно к Процентному периоду, к которому относится Дата изменения плавающей ставки. В последнем случае применяется Условие об окончании срока в нерабочий день «Предшествующий рабочий день».
- 1.3. *Дата истечения срока* означает применительно к Сделке последний день срока Сделки, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согла-

сованный сторонами применительно к Сделке. Дата истечения срока не подлежит переносу в соответствии с применимым к Сделке Условием об окончании срока в нерабочий день, если иное не согласовано сторонами.

- 1.4. **Дата калькуляции** означает применительно к Дате платежа или Процентному периоду наиболее ранний день, когда Расчетный агент с учетом сложившихся обстоятельств может направить требуемое уведомление применительно к этой Дате платежа или Процентному периоду. Дата калькуляции должна наступить не позднее окончания Рабочего дня, непосредственно предшествующего Дате платежа, кроме случаев, когда этот предшествующий Рабочий день является Датой изменения плавающей ставки. В этом случае Датой калькуляции является день, который позволит осуществить платеж в Дату платежа.
- 1.5. **Дата начала срока** означает применительно к Сделке день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — Дату сделки. Дата начала срока не подлежит переносу в соответствии с применимым к Сделке Условием об окончании срока в нерабочий день, если иное не согласовано сторонами.
- 1.6. **Дата платежа** означает применительно к Сделке день, в который стороны обязаны исполнить свои обязательства по Сделке, указанные в пункте 3.3, 4.3, 5.5 или 6.4 Стандартных условий, указанный в качестве Даты платежа в Подтверждении или определяемый в соответствии с ним либо иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.
- 1.7. **Дата сделки** означает применительно к Сделке Дату сделки в значении, определенном в Генеральном соглашении.
- 1.8. **Номинальная сумма** означает:
 - (а) применительно к Срочной сделке на процентные ставки:
 - (А) не являющейся Сделкой валютно-процентный своп — сумму в валюте, и
 - (Б) являющейся Сделкой валютно-процентный своп — сумму в каждой из валют,
указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке в целях расчета сумм платежей по Сделке;
 - (б) применительно к Сделке свопцион — Номинальную сумму по Основной сделке, или, применительно к Сделке свопцион, Основной сделкой по которой является Сделка валютно-процентный своп — Номинальную сумму, установленную в отношении Продавца.
- 1.9. **Основной финансовый центр** означает применительно к Сделке или валюте финансовый центр или центры, указанные в Подтверждении или иным образом согласованные сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — финансовый центр или центры, перечис-

ленные по каждому виду валют в приложении 7 к Стандартным условиям конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г., разработанным и утвержденным Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованным в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков.

- 1.10. **Округление** означает для целей любых расчетов, производимых в соответствии с настоящими Стандартными условиями:
- (а) округление любых сумм, выраженных в процентах, до пятого знака после запятой (включительно) по математическому методу;
 - (б) округление любых сумм в валюте до четвертого знака после запятой (включительно) по математическому методу, если иной порядок округления не используется в соответствии со сложившейся рыночной практикой на рынке соответствующей валюты.
- 1.11. **Плавающая ставка** означает процентную ставку, определяемую Расчетным агентом в Дату изменения плавающей ставки применительно к соответствующему Процентному периоду в соответствии с согласованным Способом определения плавающей ставки.
- 1.12. **Подтверждение** означает Подтверждение в значении, определенном в Генеральном соглашении, которое может быть составлено по форме, установленной в приложениях 1–7 к Стандартным условиям в зависимости от вида Сделки, или иной форме, согласованной сторонами.
- 1.13. **Примерные условия договора** означает Примерные условия договора о срочных сделках на финансовых рынках 2011 г., разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков.
- 1.14. **Рабочий день** означает:
- (а) для целей осуществления платежей в Дату платежа/Дату уплаты премии и/или применительно к Дате изменения плавающей ставки и Способу определения плавающей ставки — любой день, являющийся Рабочим днем в значении, определенном в Генеральном соглашении, и:
 - (А) днем, когда кредитные организации осуществляют банковские операции и другие сделки (в том числе на валютном рынке в соответствии со сложившейся на нем практикой) в месте или местах, указанных в

Подтверждении или иным образом согласованных сторонами применительно к Сделке для целей определения Рабочего дня;

(Б) при отсутствии такого указания:

(аа) если евро является валютой, в которой должен быть осуществлен платеж, и/или применительно к Дате изменения плавающей ставки и Способу определения плавающей ставки сумма выражена в евро — днем, когда открыта Трансъевропейская автоматическая система валовых расчетов и экспресс-переводов в режиме реального времени (Система TARGET);

(бб) если другая иностранная валюта является валютой, в которой должен быть осуществлен платеж, и/или применительно к Дате изменения плавающей ставки и Способу определения плавающей ставки сумма выражена в такой другой иностранной валюте, — днем, когда кредитные организации осуществляют банковские операции и другие сделки (в том числе на валютном рынке в соответствии со сложившейся на нем практикой) в Основном финансовом центре этой иностранной валюты;

(вв) если несколько видов иностранных валют подлежат уплате, и/или применительно к Дате изменения плавающей ставки и Способу определения плавающей ставки суммы выражены в нескольких видах иностранных валют, — Рабочим днем в соответствии с настоящим определением для каждой валюты соответственно (если практикой, сложившейся на соответствующем валютном рынке, не установлено иное);

(б) для целей остальных положений настоящих Стандартных условий или Подтверждения — Рабочий день в значении, определенном в Генеральном соглашении.

1.15. **Расчетный агент** означает лицо, указанное в этом качестве в Генеральном соглашении, если иное лицо не назначено в этом качестве по Сделке в Подтверждении или иным образом не согласовано сторонами применительно к Сделке. Расчетный агент определяет значения ставок, курсов, суммы и иные значения, а также выполняет другие действия в соответствии с настоящими Стандартными условиями. Расчетный агент обязан действовать разумно и добросовестно при любых обстоятельствах. Расчет (калькуляция), произведенный Расчетным агентом, является обязательным для сторон, кроме случаев очевидной ошибки.

Расчетный агент, в частности, направляет необходимое уведомление другой стороне или сторонам (если Расчетный агент является третьим лицом) в Дату калькуляции применительно к каждой Дате платежа, в котором указывает:

(а) Дату платежа;

(б) сторону или стороны, с которых причитается платеж в указанную Дату платежа;

- (в) сумму или суммы соответствующих платежей;
- (г) информацию в разумном объеме о том, каким образом указанная сумма или суммы платежей были определены.

1.16. **Сделка** для целей настоящих Стандартных условий означает заключаемую на основе Примерных условий договора Срочную сделку на процентные ставки, как она определена в пункте 2.1 Стандартных условий, и Сделку свопцион, как она определена в пункте 9.1 Стандартных условий, любое сочетание названных Сделок или иную сделку, в отношении которой в Подтверждении стороны указали о том, что к ней применяются настоящие Стандартные условия.

1.17. **Условие об окончании срока в нерабочий день** означает условие, в соответствии с которым определяется день окончания срока, если последний день срока приходится на нерабочий день. В Подтверждении стороны могут указать в качестве Условия об окончании срока в нерабочий день:

- (а) «**Следующий рабочий день**» — в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день;
- (б) «**Предшествующий рабочий день**» — в этом случае днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день;
- (в) «**Рабочий день в отчетном периоде**» — в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день, а если этот ближайший следующий Рабочий день является днем следующего месяца, то днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день.

Если последний день срока в соответствии с настоящими Стандартными условиями приходится на нерабочий день, день окончания срока определяется по правилу «Следующий рабочий день», указанному в подпункте (а) настоящего пункта 1.17, если иное не предусмотрено другими положениями Стандартных условий, Подтверждением или иным образом не согласовано сторонами применительно к какому-либо сроку или в целом.

1.18. **Фиксированная ставка** означает процентную ставку, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к соответствующему Процентному периоду.

2. Срочные сделки на процентные ставки. Общие положения

2.1. **Срочная сделка на процентные ставки** означает Сделку процентный своп, как она определена в пункте 3.1 Стандартных условий, Сделку процентный форвард, как она определена в пункте 4.1 Стандартных условий, Сделку фиксации максимума процентной ставки, как она определена в пункте 5.1 Стандартных условий, Сделку фиксации минимума процентной ставки, как она определена в пункте 5.2 Стандартных условий, Сделку фиксации максимума и минимума процентной ставки, как она определена в пункте 5.3 Стандартных условий, а также Сделку валютно-процентный своп, как она определена в пункте 6.1. Стандартных условий.

- 2.2. Срок Срочной сделки на процентные ставки может состоять из одного или нескольких периодов начисления процентов (далее — «**Процентный период**»).
- (а) Первый Процентный период начинается в Дату начала срока (включительно) и оканчивается в день (исключая его), согласованный сторонами (день, в который оканчивается Процентный период, именуется в настоящих Стандартных условиях «**Дата окончания периода**»).
 - (б) Каждый последующий Процентный период начинается в Дату окончания периода предшествующего Процентного периода (включительно) и оканчивается в Дату окончания периода (исключая ее) или применительно к последнему Процентному периоду — в Дату истечения срока (исключая ее).
 - (в) Если в Подтверждении не установлены Даты окончания периода, Датами окончания периода являются каждая из установленных сторонами Дат платежа.
- 2.3. Применительно к Срочным сделкам на процентные ставки все процентные ставки выражаются целым числом или десятичной дробью в виде ставки процентов годовых.
- 2.4. Расчеты по Срочным сделкам на процентные ставки могут осуществляться в следующем порядке.
- (а) Если по Срочной сделке на процентные ставки в какую-либо Дату платежа сторона обязана уплатить сумму в иностранной валюте, такая сумма может быть уплачена в рублях в случае, если это предусмотрено условиями Сделки. При этом пересчет суммы в иностранной валюте в рубли осуществляется по обменному курсу, согласованному сторонами применительно к этой Дате платежа.
 - (б) Если в результате пересчета в рубли суммы в иностранной валюте, причитающейся от одной стороны или обеих сторон, в соответствии с подпунктом (а) настоящего пункта 2.4, обе стороны обязаны уплатить в соответствующую Дату платежа суммы в рублях, к этим обязательствам сторон применяются положения о платежном неттинге пунктов 3.5 и 3.6 статьи 3 Примерных условий договора, если иное не предусмотрено Генеральным соглашением или иным образом не согласовано сторонами.
3. СДЕЛКИ ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП
- 3.1. **Сделка процентный своп** означает своп договор, (контракт) по которому на условиях, согласованных сторонами, одна сторона одновременно или периодически уплачивает другой стороне сумму в согласованной валюте, рассчитанную на основе Номинальной суммы в этой валюте и Плавающей ставки (далее — «**Плавающая сумма**»), а другая сторона одновременно или периодически уплачивает первой стороне либо (i) сумму в той же валюте, рассчитанную на основе той же Номинальной суммы и Фиксированной ставки (далее — «**Фиксированная сумма**»), либо (ii) Плавающую сумму в той же валюте, рассчитанную на основе

той же Номинальной суммы и другой Плавающей ставки (такая Сделка процентный своп также именуется «сделка базисный своп»).

3.2. Существенные условия Сделки процентный своп.

- (а) Существенными условиями Сделки процентный своп, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Номинальная сумма;
 - (Б) Дата истечения срока;
 - (В) Плательщик плавающей суммы;
 - (Г) Даты платежа Плавающих сумм;
 - (Д) Способ определения плавающей ставки;
 - (Е) срок кредитования или иной аналогичный период, в отношении которого публикуется Плавающая ставка (далее — «*Период плавающей ставки*»);
 - (Ж) Даты изменения плавающей ставки.
- (б) Если по условиям Сделки одна из сторон уплачивает Фиксированные суммы, существенными условиями также являются:
 - (А) Плательщик фиксированной суммы;
 - (Б) Даты платежа Фиксированных сумм;
 - (В) Фиксированная ставка.
- (в) Если по условиям Сделки обе стороны уплачивают Плавающие суммы, в отношении второй стороны согласуются существенные условия, указанные в пунктах 3.2(а)(В)–3.2(а)(Ж) Стандартных условий.
- (г) Другие условия подлежат согласованию в качестве существенных условий Сделки процентный своп по требованию одной из сторон.

3.3. Порядок осуществления расчетов по Сделке процентный своп.

- (а) В каждую Дату платежа, согласованную в отношении Плавающей суммы, сторона, обязанная уплатить такую сумму (далее — «*Плательщик плавающей суммы*»), уплачивает Плавающую сумму другой стороне.
- (б) В каждую Дату платежа, согласованную в отношении Фиксированной суммы, сторона, обязанная уплатить такую сумму (далее — «*Плательщик фиксированной суммы*»), уплачивает Фиксированную сумму другой стороне.

4. Сделки процентный форвард

- 4.1. **Сделка процентный форвард** означает расчетный внебиржевой форвардный договор (контракт), по которому на условиях, согласованных сторонами, одна сторона (далее — «*Плательщик положительной разницы*») одновременно уплачивает другой стороне Плавающую сумму в согласованной валюте, расчи-

танную на основе Номинальной суммы в этой валюте и разницы между Плавающей ставкой и Фиксированной ставкой, если эта разница имеет положительное значение, либо другая сторона (далее — «*Плательщик отрицательной разницы*») одновременно уплачивает первой стороне Плавающую сумму в согласованной валюте, рассчитанную на основе Номинальной суммы в этой валюте и разницы между Плавающей ставкой и Фиксированной ставкой, если эта разница имеет отрицательное значение.

4.2. Существенные условия Сделки процентный форвард.

- (а) Существенными условиями Сделки процентный форвард, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Номинальная сумма;
 - (Б) Дата истечения срока;
 - (В) Плательщик положительной разницы;
 - (Г) Плательщик отрицательной разницы;
 - (Д) Дата платежа;
 - (Е) Фиксированная ставка;
 - (Ж) Способ определения плавающей ставки;
 - (З) Период плавающей ставки;
 - (И) Дата изменения плавающей ставки.
- (б) Другие условия подлежат согласованию в качестве существенных условий Сделки процентный форвард по требованию одной из сторон.

4.3. Порядок осуществления расчетов по Сделке процентный форвард. В Дату платежа, согласованную в отношении Плавающей суммы:

- (а) если она имеет положительное значение — Плательщик положительной разницы обязан уплатить Плавающую сумму;
- (б) если она имеет отрицательное значение — Плательщик отрицательной разницы обязан уплатить абсолютную величину Плавающей суммы.

5. Сделки фиксации максимума процентной ставки. Сделки фиксации минимума процентной ставки. Сделки фиксации максимума и минимума процентной ставки

- 5.1. *Сделка фиксации максимума процентной ставки* или *Сделка кэп* означает расчетный внебиржевой форвардный договор (контракт), по которому, на условиях, согласованных сторонами, одна сторона одновременно или периодически уплачивает другой стороне Фиксированные суммы в согласованной валюте, а другая сторона одновременно или периодически уплачивает первой стороне Плавающие суммы в той же валюте, рассчитанные на основе Номинальной суммы в этой валюте и разницы между Плавающей ставкой и максимальным значе-

нием процентной ставки, согласованным сторонами (далее — «**Максимальная ставка**»), если эта разница имеет положительное значение.

- 5.2. **Сделка фиксации минимума процентной ставки** или **Сделка флор** означает расчетный внебиржевой форвардный договор (контракт), по которому, на условиях, согласованных сторонами, одна сторона одновременно или периодически уплачивает другой стороне Фиксированные суммы в согласованной валюте, а другая сторона одновременно или периодически уплачивает первой стороне Плавающие суммы в той же валюте, рассчитанные на основе Номинальной суммы в этой валюте и разницы между Плавающей ставкой и минимальным значением процентной ставки, согласованным сторонами (далее — «**Минимальная ставка**»), если эта разница имеет отрицательное значение.
- 5.3. **Сделка фиксации максимума и минимума процентной ставки** или **Сделка кóллар** означает расчетный внебиржевой форвардный договор (контракт), по которому, на условиях, согласованных сторонами, одна сторона одновременно или периодически уплачивает другой стороне Плавающую сумму при превышении Плавающей ставкой Максимальной ставки, а другая сторона одновременно или периодически уплачивает первой стороне Плавающую сумму, если Плавающая ставка становится ниже Минимальной ставки.
- 5.4. **Существенные условия Сделки фиксации максимума процентной ставки, Сделки фиксации минимума процентной ставки и Сделки фиксации максимума и минимума процентной ставки.**
- (а) Общими существенными условиями Сделки фиксации максимума процентной ставки, Сделки фиксации минимума процентной ставки и Сделки фиксации максимума и минимума процентной ставки, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки в отношении каждой из этих Сделок, являются:
- (А) Номинальная сумма;
 - (Б) Дата истечения срока;
 - (В) Способ определения плавающей ставки;
 - (Г) Период плавающей ставки;
 - (Д) Даты изменения плавающей ставки.
- (б) Существенными условиями Сделки фиксации максимума процентной ставки, также подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
- (А) Плательщик фиксированной суммы;
 - (Б) Дата или Даты платежа Фиксированных сумм;
 - (В) Фиксированная сумма;
 - (Г) Плательщик плавающей суммы;
 - (Д) Максимальная ставка;
 - (Е) Дата или Даты платежа Плавающих сумм.

- (в) Существенными условиями Сделки фиксации минимума процентной ставки, также подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Плательщик фиксированной суммы;
 - (Б) Дата или Даты платежа Фиксированных сумм;
 - (В) Фиксированная сумма;
 - (Г) Плательщик плавающей суммы;
 - (Д) Минимальная ставка;
 - (Е) Дата или Даты платежа Плавающих сумм.
- (г) Существенными условиями Сделки фиксации максимума и минимума процентной ставки, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Плательщик плавающей суммы при превышении Плавающей ставкой Максимальной ставки;
 - (Б) Максимальная ставка;
 - (В) Плательщик плавающей суммы при превышении Минимальной ставкой Плавающей ставки;
 - (Г) Минимальная ставка;
 - (Д) Дата или Даты платежа.
- (д) Другие условия подлежат согласованию в качестве существенных условий Сделки фиксации максимума процентной ставки, Сделки фиксации минимума процентной ставки и Сделки фиксации максимума и минимума процентной ставки по требованию одной из сторон.

5.5. Порядок осуществления расчетов по Сделке фиксации максимума процентной ставки, Сделке фиксации минимума процентной ставки и Сделке фиксации максимума и минимума процентной ставки.

- (а) По Сделке фиксации максимума процентной ставки и Сделке фиксации минимума процентной ставки в каждую Дату платежа, согласованную в отношении Фиксированных сумм, Плательщик фиксированной суммы обязан уплатить Плательщику плавающей суммы Фиксированную сумму. В каждую Дату платежа, согласованную в отношении Плавающей суммы, Плательщик плавающей суммы обязан уплатить Плательщику фиксированной суммы:
 - (А) Плавающую сумму, если по Сделке фиксации максимума процентной ставки такая сумма имеет положительное значение (если она равна нулю или имеет отрицательное значение, платежа не производится);
 - (Б) абсолютное значение Плавающей суммы, если по Сделке фиксации минимума процентной ставки такая сумма имеет отрицательное значение (если она равна нулю или имеет положительное значение, платежа не производится).

- (б) По Сделке фиксации максимума и минимума процентной ставки в каждую Дату платежа Плавающая сумма уплачивается одной из сторон, если Плавающая ставка превышает Максимальную ставку или становится ниже Минимальной ставки. Если в какую-либо Дату платежа Плавающая ставка как не превышает Максимальную ставку, так и не становится ниже Минимальной ставки, Плавающая сумма не уплачивается.

6. Сделки валютно-процентный своп

- 6.1. **Сделка валютно-процентный своп** означает своп-договор (контракт), предусматривающий (если иного не предусмотрено условиями Сделки) (i) обязанность одной стороны передать валюту в собственность второй стороне в размере Номинальной суммы, установленной для второй стороны, и обязанность второй стороны уплатить первой стороне Номинальную сумму, установленную для первой стороны, (ii) обязанность второй стороны не ранее третьего Рабочего дня после Даты сделки передать валюту в собственность первой стороне в размере Номинальной суммы, установленной для второй стороны, и обязанность первой стороны уплатить второй стороне Номинальную сумму, установленную для первой стороны, и (iii) обязанность стороны или сторон уплачивать друг другу одновременно или периодически Фиксированные суммы и/или Плавающие суммы, рассчитанные на основе Номинальных сумм, установленных для соответствующей стороны. Сделка валютно-процентный своп является производным финансовым инструментом.

6.2. Отдельные определения для Сделок валютно-процентный своп.

- (а) *Дата окончательного платежа* означает Дату истечения срока или иной день, указанный в этом качестве в Подтверждении.
- (б) *Дата первоначального платежа* означает Дату начала срока или иной день, указанный в этом качестве в Подтверждении.
- (в) *Дата промежуточного платежа* означает каждую из Дат платежа между Датой начала срока и Датой окончательного платежа, если срок Сделки валютно-процентный своп состоит из двух или более Процентных периодов.
- (г) Для целей Стандартных условий Дата первоначального платежа, каждая из Дат промежуточного платежа и Дата окончательного платежа являются Датами платежа.

6.3. Существенные условия Сделки валютно-процентный своп.

- (а) Существенными условиями Сделки валютно-процентный своп являются:
 - (А) Номинальная сумма и валюта для одной стороны;
 - (Б) Номинальная сумма и валюта для другой стороны;
 - (Г) Дата истечения срока;

- (б) Если по условиям Сделки валютно-процентный своп одна из сторон уплачивает Плавающие суммы, существенными условиями также являются:
- (А) указание стороны, являющейся Плательщиком плавающей суммы;
 - (Б) Дата или Даты платежа Плавающих сумм;
 - (В) Способ определения плавающей ставки;
 - (Г) Период плавающей ставки;
 - (Д) Дата или Даты изменения плавающей ставки.

Если по условиям Сделки валютно-процентный своп обе Стороны уплачивают Плавающие суммы, условия, указанные в настоящем подпункте (б), согласовываются в отношении каждой из Сторон.

- (в) Если по условиям Сделки валютно-процентный своп одна из сторон уплачивает Фиксированные суммы, существенными условиями также являются:
- (А) указание стороны, являющейся Плательщиком фиксированной суммы;
 - (Б) Дата или Даты платежа Фиксированных сумм;
 - (В) Фиксированная ставка.

Если по условиям Сделки валютно-процентный своп обе стороны уплачивают Фиксированные суммы, условия, указанные в настоящем подпункте (в), согласовываются в отношении каждой из сторон.

- (г) Другие условия подлежат согласованию в качестве существенных условий Сделок валютно-процентный своп по требованию одной из сторон.

6.4. Порядок осуществления расчетов по Сделкам валютно-процентный своп.

- (а) Стороны уплачивают друг другу Фиксированные суммы или Плавающие суммы, указанные в этом качестве в Подтверждении или определяемые в соответствии с ним, в Дату окончательного платежа и в каждую из Дат промежуточного платежа, если срок Сделки состоит из двух или более Процентных периодов.
- (б) Фиксированные суммы по Сделкам валютно-процентный своп рассчитываются в порядке, установленном пунктом 7.2 Стандартных условий. Плавающие суммы по Сделкам валютно-процентный своп рассчитываются в порядке, установленном пунктами 7.3(а) и 7.3(д) Стандартных условий, в зависимости от условий Сделки валютно-процентный своп.
- (в) Если предусмотрено условиями Сделки, в Дату первоначального платежа каждая из сторон уплачивает другой стороне Номинальную сумму, определенную для этой стороны в Подтверждении (далее — **«Сумма первоначального платежа»**).
- (г) Если предусмотрено условиями Сделки, в Дату окончательного платежа каждая из сторон уплачивает другой стороне сумму в размере Суммы первоначального платежа, полученной от другой стороны в Дату первоначального

платежа, или в ином размере, предусмотренном в Подтверждении (далее — «**Сумма окончательного платежа**»).

- (д) Стороны вправе предусмотреть, что Суммы окончательного платежа уплачиваются в рассрочку, то есть по частям (далее каждая такая часть — «**Сумма промежуточного платежа**») в каждую Дату промежуточного платежа с выплатой остатка Суммы окончательного платежа в Дату окончательного платежа. При этом Фиксированные суммы или Плавающие суммы для каждого последующего Процентного периода рассчитываются на основе Номинальных сумм за вычетом уплаченных соответствующей стороной Сумм промежуточного платежа.

7. РАСЧЕТ ФИКСИРОВАННЫХ СУММ И ПЛАВАЮЩИХ СУММ

- 7.1. Фиксированная сумма или Плавающая сумма применительно к какой-либо Дате платежа рассчитывается по Фиксированной ставке или Плавающей ставке, применимой к Процентному периоду, оканчивающемуся в такую Дату платежа или, если Дата платежа не является Датой окончания периода, ближайшую к этой Дате платежа Дату окончания периода.

Фиксированные суммы

- 7.2. Фиксированная сумма, подлежащая уплате в Дату платежа Фиксированной суммы, составляет:
- (а) сумму, указанную в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к этой Дате платежа;
- (б) при отсутствии такого указания сумму, равную произведению Номинальной суммы, Фиксированной ставки и Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбранного сторонами для расчета Фиксированных сумм:

$$\text{Фиксированная сумма} = \text{Номинальная сумма} \times \text{Фиксированная ставка} \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}$$

Плавающие суммы

- 7.3. Плавающая сумма, подлежащая уплате в Дату платежа Плавающей суммы, равна:
- (а) применительно к *Сделке процентный своп* и *Сделке валютно-процентный своп*, если в отношении Сделки не установлено условия о капитализации, — произведению Номинальной суммы, Плавающей ставки (с добавлением спреда) и Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбранного сторонами для расчета Плавающих сумм:

$$\text{Плавающая сумма} = \text{Номинальная сумма} \times (\text{Плавающая ставка} + \text{спред}) \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}$$

при этом (здесь и далее) под спредом понимается процентная надбавка в виде ставки процентов годовых (которая может быть выражена отрицательным числом), указанная в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованная сторонами применительно к Срочной сделке на процентные ставки или стороне;

(б) применительно к *Сделке процентный форвард*:

(А) если в отношении Сделки процентный форвард не установлено условия о капитализации и не применяется дисконтирование (далее — «*Дисконтирование*»), — произведению Номинальной суммы, Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбранного сторонами для расчета Плавающих сумм, и разности Плавающей ставки (с добавлением спреда) и Фиксированной ставки:

$$\text{Плавающая сумма} = \text{Номинальная сумма} \times (\text{Плавающая ставка} + \text{спред} - \text{Фиксированная ставка}) \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}$$

(Б) если к Сделке процентный форвард применяется Дисконтирование, — сумме, рассчитываемой по формуле, указанной в пункте 7.6. Стандартных условий;

(в) применительно к *Сделке фиксации максимума процентной ставки* и *Сделке фиксации максимума и минимума процентной ставки*, если в отношении Сделки не установлено условия о капитализации, — произведению Номинальной суммы, Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбранного сторонами для расчета Плавающих сумм, и разности Плавающей ставки (с добавлением спреда) и Максимальной ставки:

$$\text{Плавающая сумма} = \text{Номинальная сумма} \times (\text{Плавающая ставка} + \text{спред} - \text{Максимальная ставка}) \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}$$

(г) применительно к *Сделке фиксации минимума процентной ставки* и *Сделке фиксации максимума и минимума процентной ставки*, если в отношении Сделки не установлено условия о капитализации, — произведению Номинальной суммы, Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбранного сторонами для расчета Плавающих сумм, и разности Плавающей ставки (с добавлением спреда) и Минимальной ставки:

$$\text{Плавающая сумма} = \text{Номинальная сумма} \times (\text{Плавающая ставка} + \text{спред} - \text{Минимальная ставка}) \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}$$

(д) если в отношении Сделки установлено условие о капитализации, — сумме Сумм периодов капитализации, рассчитанных в порядке, установленном пунктом 7.8 Стандартных условий, за каждый Период капитализации в Процентном периоде применительно к Дате платежа.

Коэффициент для расчета дней в процентном периоде

- 7.4. В целях расчета Фиксированных сумм, Плавающих сумм или Сумм периода капитализации стороны вправе выбрать один из следующих коэффициентов для расчета количества дней в Процентном периоде или Периоде капитализации, исходя из которого начисляются Фиксированные суммы, Плавающие суммы или Суммы периода капитализации (далее — «*Коэффициент для расчета дней в процентном периоде*»):
- (а) $1/1$ означает 1;
 - (б) $30E/360$ означает количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, которое условно рассчитывается на основе года, состоящего из 12 месяцев продолжительностью 30 дней каждый, разделенное на 360. В случае если последний день Процентного периода или Периода капитализации приходится на последний день февраля, за количество дней, истекшее в этом месяце, принимается фактическое количество дней);
 - (в) $30/360$ определяется как количество дней, истекшее в процентном периоде, которое условно рассчитывается на основе года, состоящего из 12 месяцев, каждый такой месяц - продолжительностью 30 дней, разделенное на 360.
 - (г) *Фактическое/360* означает фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на 360;
 - (д) *Фактическое/365* означает фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на 365;
 - (е) *Фактическое/Фактическое* означает:
 - (А) фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на действительное число календарных дней в году (365 или 366 дней соответственно);
 - (Б) если части Процентного периода или Периода капитализации приходится на календарные годы с различным количеством дней (365 и 366 дней соответственно), то начисление процентов за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 365, производится из расчета 365 календарных дней в году, а за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 366, производится из расчета 366 календарных дней в году.
- 7.5. Стороны вправе применительно к Сделке согласовать иной Коэффициент для расчета дней в процентном периоде. Если стороны не определили Коэффициент для расчета дней в процентном периоде, применяется Коэффициент для расчета дней в процентном периоде «Фактическое/Фактическое».

Дисконтирование

- 7.6. К Сделке процентный форвард может быть применено Дисконтирование в отношении Процентного периода, не превышающего одного года. В этом случае Плавающая сумма рассчитывается по следующей формуле:

$$\text{Плавающая сумма} = \frac{\text{Номинальная сумма} \times (\text{Плавающая ставка} + \text{спред} - \text{Фиксированная ставка}) \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}}{1 + \text{Ставка дисконтирования} \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для дисконтирования}}$$

7.7. Для целей расчета Плавающей суммы в случае применения к Сделке процентный форвард Дисконтирования:

- (а) **Ставка дисконтирования** означает процентную ставку, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — Плавающую ставку (с добавлением спреда), примененную к соответствующему Процентному периоду;
- (б) **Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для дисконтирования** означает Коэффициент для расчета дней в процентном периоде, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — Коэффициент для расчета дней в процентном периоде, выбранный сторонами для расчета Плавающих сумм.

Капитализация

7.8. Для целей расчета Плавающей суммы в случае, когда в отношении Сделки установлено условие о капитализации:

- (а) **Период капитализации** означает применительно к Процентному периоду каждый период времени начиная с (включительно) Даты начала или Даты капитализации по (исключая) следующую Дату капитализации или Дату истечения срока;
- (б) **Дата капитализации** означает каждый день в течение срока соответствующей Сделки, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке;
- (в) **Сумма периода капитализации** означает применительно к каждому Периоду капитализации сумму, равную произведению Уточненной номинальной суммы, Плавающей ставки (с добавлением спреда) и Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбранного сторонами для расчета Плавающих сумм:

$$\text{Сумма периода капитализации} = \text{Уточненная номинальная сумма} \times (\text{Плавающая ставка} + \text{спред})^* \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}$$

* Применительно к Сделке процентный форвард, Сделке фиксации максимума процентной ставки, Сделке фиксации минимума процентной ставки и

Сделке фиксации максимума и минимума процентной ставки из Плавающей ставки (с добавлением спреда) также вычитается Фиксированная ставка, Максимальная ставка или Минимальная ставка, соответственно.

- (г) **Уточненная номинальная сумма** означает:
- (А) применительно к первому Периоду капитализации в Процентном периоде — Номинальную сумму для этого Процентного периода;
 - (Б) применительно к каждому последующему Периоду капитализации в этом Процентном периоде — сумму Номинальной суммы для этого Процентного периода и Сумм периодов капитализации за каждый предшествующий Период капитализации в этом Процентном периоде.

Амортизация и иное изменение Номинальной суммы

- 7.9. При заключении Сделки Стороны могут договориться о возможности:
- (а) амортизации (последовательного уменьшения) Номинальной суммы (или Номинальных сумм) по Сделке;
 - (б) изменения Номинальной суммы (или Номинальных сумм) по Сделке в сторону как уменьшения, так и увеличения, —
- в каждом очередном Процентном периоде, в одном из Процентных периодов или в нескольких Процентных периодах.
- 7.10. При включении в Сделку условия об амортизации и (или) ином изменении Номинальной суммы, в Подтверждение включаются положения о порядке такой амортизации и (или) иного изменения.
- 7.11. Фиксированные суммы или Плавающие суммы для каждого последующего Процентного периода рассчитываются на основе Номинальной суммы с учетом амортизации и (или) иного изменения за все предшествующие Процентные периоды.

8. Способы определения плавающей ставки

- 8.1. Для целей расчета Плавающих сумм по Сделке стороны согласовывают способ определения Плавающей ставки (далее — «**Способ определения плавающей ставки**»). В Подтверждении Способ определения плавающей ставки может быть установлен путем ссылки на наименование любого из способов, указанных в настоящей статье 7, или путем включения самостоятельного определения Способа определения плавающей ставки.
- 8.2. Сторонами могут быть использованы следующие Способы определения плавающей ставки:

По суммам, выраженным в рублях

- (а) **MosIBOR**, или **Moscow InterBank Offered Rate** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является индикативная ставка предоставления кредитов (депозитов) в рублях на московском меж-

банковском рынке на срок, равный Периоду плавающей ставки, формируемая Национальной валютной ассоциацией (далее — «НВА») и публикуемая в Дату изменения плавающей ставки примерно в 12 часов 30 минут по московскому времени на странице MOSIBOR= в системе Reuters и/или на сайте НВА. Если указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters и/или на сайте НВА, Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется, как если бы стороны установили в качестве Способа определения плавающей ставки «RUB-MOSPRIME-банки-ориентеры».

- (б) **RUB-MOSPRIME-NFEA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является предлагаемая ставка по депозитам в рублях на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая на странице MOSPRIME1 в системе Reuters в 12 часов 30 минут по московскому времени в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки. Если указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters, Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется, как если бы стороны установили в качестве Способа определения плавающей ставки «RUB-MOSPRIME-банки-ориентеры».
- (в) **RUB-MOSPRIME-банки-ориентеры** означает, что Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется на основе ставок по депозитам в рублях на срок, равный Периоду плавающей ставки, начинающийся в эту Дату изменения плавающей ставки, предлагаемых на московском межбанковском рынке первоклассным банкам пятью ведущими банками московского межбанковского рынка, примерно в 12 часов 30 минут по московскому времени в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки, в отношении суммы, которая является показательной для единичной сделки на этом рынке в соответствующее время.

Расчетный агент запрашивает у головного офиса каждого банка, указанного в первом абзаце настоящего подпункта (в), в г. Москве котировку его ставки.

Если предоставлено пять котировок, то Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки будет среднее арифметическое котировок, без учета самого высокого и самого низкого значений (если более одной котировки имеют одинаковое самое высокое или низкое значения, не учитывается только одна из этих котировок). Если предоставлено менее пяти, но не менее двух котировок, Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки будет среднее арифметическое предоставленных котировок. Если предоставлено менее двух котировок, Плавающую ставку для Даты изменения плавающей ставки определяет Расчетный агент.

- (г) **RUONIA** или **Ruble OverNight Index Average** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является индикативная взвешенная ставка однодневных рублевых кредитов (депозитов) в рублях на московском межбанковском рынке, рассчитываемая Банком России по методике, разработанной Национальной валютной ассоциацией (далее — «НВА») совместно с Банком России, и публикуемая в Дату измене-

ния плавающей ставки около 17:00 по московскому времени на странице RUONIA= в системе Reuters и/или в Интернет на официальном сайте Банка России и/или на странице <http://www.ruonia.ru>. Если указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters и/или в Интернет на официальном сайте Банка России и/или на странице <http://www.ruonia.ru>, Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется, как если бы стороны установили в качестве Способа определения плавающей ставки «RUB-MOSPRIME-банки-ориентир».

По суммам, выраженным в долларах США

- (д) **USD-LIBOR BBA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам в долларах США на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая в 11 часов по лондонскому времени на странице LIBOR01 в системе Reuters в день, наступающий за два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, до Даты изменения плавающей ставки. Если указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters, Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется, как если бы стороны установили в качестве Способа определения плавающей ставки «USD-LIBOR-банки-ориентир».
- (е) **USD-Federal Funds-H.15** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, установленная в еженедельном выпуске H.15(519) Федеральной резервной системы США на соответствующую дату под заголовком «EFFECT», публикуемая на странице FEDFUNDS1 в системе Reuters. Если к 17 часам по нью-йоркскому времени на следующий Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты изменения плавающей ставки указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters и не опубликована в выпуске H.15(519), Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, установленная в Ежедневном обновлении выпуска H.15 или ином признанном электронном источнике, используемом для публикации такой ставки, по состоянию на указанный день напротив заголовка «Federal funds (effective)». Если к 17 часам по нью-йоркскому времени указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters и не опубликована в выпуске H.15(519), Ежедневном обновлении выпуска H.15 или ином признанном электронном источнике, Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, установленная в ближайший предшествующий день в выпуске H.15(519) напротив заголовка «Federal funds (effective)» на странице FEDFUNDS1 в системе Reuters.
- (ж) **USD-LIBOR-банки-ориентир** означает, что Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется на основе ставок по депозитам в долларах США на срок, равный Периоду плавающей ставки, начинающийся в эту Дату изменения плавающей ставки, предлагаемых на лондонском межбанковском рынке первоклассным банкам четырьмя ведущими

банками на лондонском межбанковском рынке, примерно в 11 часов по лондонскому времени в день, наступающий за два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, до Даты изменения плавающей ставки, в отношении суммы, которая является показательной для единичной сделки на этом рынке в соответствующее время. Расчетный агент обязан запросить котировки у подразделения в г. Лондоне (Великобритания) каждого из банков-ориентиров. Если предоставлено не менее двух котировок, Плавающая ставка определяется как среднее арифметическое этих котировок. Если предоставлено менее двух котировок, Плавающая ставка определяется как среднее арифметическое ставок по кредитам в долларах США ведущим европейским банкам на срок, равный Периоду плавающей ставки, начинающийся в Дату изменения плавающей ставки, прокотированных примерно в 11 часов по нью-йоркскому времени в эту Дату изменения плавающей ставки крупнейшими банками в г. Нью-Йорк (США), выбранными Расчетным агентом, в отношении суммы, которая является показательной для единичной сделки на этом рынке в соответствующее время.

По суммам, выраженным в евро

- (з) ***EUR-EURIBOR-Reuters*** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам в евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая в 11 часов по брюссельскому времени на странице EURIBOR01 в системе Reuters в день, наступающий за два дня, являющихся рабочими днями для системы TARGET до Даты изменения плавающей ставки. Если указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters, Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется, как если бы стороны установили в качестве Способа определения плавающей ставки «EUR-EURIBOR-банки-ориентирь».
- (и) ***EUR-EURIBOR-банки-ориентирь*** означает, что Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется на основе ставок по депозитам в евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, начинающийся в эту Дату изменения плавающей ставки, предлагаемых на межбанковском рынке стран еврозоны первоклассным банкам четырьмя ведущими банками на межбанковском рынке стран еврозоны, примерно в 11 часов по брюссельскому времени в день, наступающий за два дня, являющихся рабочими днями для системы TARGET до Даты изменения плавающей ставки, в отношении суммы, которая является показательной для единичной сделки на этом рынке в соответствующее время, с учетом Коэффициента для расчета дней в процентном периоде «Фактическое/360». Расчетный агент обязан запросить котировки у основного подразделения в еврозоне каждого из банков-ориентиров. Если предоставлено не менее двух котировок, Плавающая ставка определяется как среднее арифметическое этих котировок. Если предоставлено менее двух котировок, Плавающая ставка определяется как среднее арифметическое ставок по кредитам в евро ведущим европейским банкам на срок, равный Периоду плавающей ставки, начинающийся в Дату

изменения плавающей ставки, прокотируемых примерно в 11 часов по брюссельскому времени в эту Дату изменения плавающей ставки, крупнейшими банками стран еврозоны, выбранными Расчетным агентом, в отношении суммы, которая является показательной для единичной сделки на этом рынке в соответствующее время.

8.3. Если применимая к Срочной сделке на процентные ставки публикуемая процентная ставка, указанная в Способе определения плавающей ставки, или источник ее опубликования официально меняется на иную публикуемую процентную ставку или источник ее опубликования, такое событие не является Сбоем публикации. В этом случае Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки будет определяться так, как если бы в Способе определения плавающей ставки была указана новая публикуемая процентная ставка или источник ее опубликования.

9. Сделки свопцион

9.1. **Сделка свопцион** означает опционный договор (контракт), по которому на условиях, согласованных сторонами, одна сторона (далее — «**Покупатель**») уплачивает другой стороне (далее — «**Продавец**») Премию (если условия Сделки свопцион предусматривают уплату Премии) и приобретает право (при условии его осуществления в порядке, установленном пунктом 9.4 Стандартных условий), но не обязанность, предъявить требование об исполнении (далее — «**Право на исполнение**») лежащей в ее основе Срочной сделки на процентные ставки (далее — «**Основная сделка**»). Основная сделка считается заключенной в дату предъявления требования об исполнении, если иное не согласовано Сторонами.

9.2. Стили свопционов.

(а) **Американский свопцион** означает вид Сделки свопцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено в любой Рабочий день в течение Срока осуществления права на исполнение, состоящего из двух и более дней.

(б) **Бермудский свопцион** означает вид Сделки свопцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено исключительно в одну из Дат осуществления права на исполнение, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами, и в Дату истечения срока.

(в) **Европейский свопцион** означает вид Сделки свопцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено только в Дату истечения срока.

9.3. Существенные условия Сделки свопцион.

(а) Существенными условиями Сделки свопцион, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:

(А) Покупатель;

(Б) Продавец;

- (В) Стиль свопциона;
 - (Г) Время закрытия;
 - (Д) Дата истечения срока;
 - (Е) Даты осуществления права на исполнение по Бермудскому свопциону (применительно к Бермудскому свопциону);
 - (Ж) Существенные условия Основной сделки, указанные в пункте 3.2, 4.2 или 5.4 Стандартных условий в зависимости от вида Основной сделки.
- (б) Другие условия Сделки свопцион подлежат согласованию в качестве существенных условий по требованию одной из сторон.

9.4. Порядок осуществления Права на исполнение.

- (а) Применительно к порядку осуществления Права на исполнение по Сделке свопцион следующие термины имеют следующие значения:
- (А) **Время закрытия** означает время в течение Рабочего дня, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, не позднее которого должно быть получено Требование об исполнении, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — 16 часов по московскому времени.
 - (Б) **Дата осуществления права на исполнение** означает Рабочий день в течение Срока осуществления права на исполнение, когда Право на исполнение по Сделке свопцион осуществлено в порядке, установленном настоящим пунктом 9.4.
 - (В) **Срок осуществления права на исполнение** означает:
 - (аа) в Американском свопционе — все Рабочие дни с Даты начала срока до Даты истечения срока (обе даты включительно) в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия;
 - (бб) в Европейском свопционе — Дату истечения срока в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия;
 - (вв) в Бермудском свопционе — каждую Дату осуществления права на исполнение, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами, с Даты начала срока до Даты истечения срока (обе даты включительно) в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия.
 - (Г) **Требование об исполнении** означает безотзывное требование, которое может быть составлено Покупателем по форме, установленной в приложении 8 к Стандартным условиям, или иной форме, согласованной Сторонами. Требование об исполнении может быть доставлено по факсу, если стороны не договорились об ином.

- (б) Покупатель осуществляет свое Право на исполнение по Сделке свопцион путем направления Продавцу Требования об исполнении в течение Срока осуществления права на исполнение. Если Требование об исполнении не получено Продавцом до или во Время закрытия в Дату истечения срока, права и обязанности сторон по Сделке свопцион прекращаются. Сделка свопцион не подлежит частичному исполнению, если в Подтверждении не установлено иное.
- (в) Если Покупатель осуществляет свое Право на исполнение по Сделке свопцион, Датой осуществления права на исполнение по этой Сделке свопцион будет считаться:
 - (А) применительно к Американскому свопциону:
 - (аа) Рабочий день в пределах Срока осуществления права на исполнение, в который Продавец получил Требование об исполнении не позднее Времени закрытия;
 - (бб) следующий Рабочий день в пределах Срока осуществления права на исполнение, если Требование об исполнении получено Продавцом после Времени закрытия;
 - (Б) применительно к Бермудскому свопциону — любая из Дат осуществления права на исполнение, указанная в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованная сторонами, в которую Продавец получил Требование об исполнении не позднее Времени закрытия;
 - (В) применительно к Европейскому свопциону — Дата истечения срока, если Продавец получил Требование об исполнении не позднее Времени закрытия в эту Дату истечения срока.

9.5. Порядок расчетов по Сделке свопцион.

Уплата Премии

- (а) Если условия Сделки свопцион предусматривают уплату Премии, в одну или в каждую из дат, согласованных сторонами (далее — «*Дата уплаты премии*»), Покупатель обязан уплатить Продавцу премию (далее — «*Премия*»), указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами.
- (б) Стороны могут установить Премию в виде твердой суммы или процента от Номинальной суммы.

Расчеты по Основной сделке

- (в) В случае осуществления Покупателем Права на исполнение по Сделке свопцион стороны осуществляют расчеты по Основной сделке в соответствии с условиями Основной сделки, установленными в Подтверждении по Сделке свопцион.

10 БАРЬЕРЫ В СДЕЛКАХ

10.1. Сделка может быть совершена под отлагательным или отменительным условием, в соответствии с которым Право на исполнение, право на получение платежа либо обязанность совершить платеж в соответствии с условиями Сделки, если условиями Сделки не предусмотрено иное:

- (а) возникает (такое условие Сделки именуется «**Барьерное отлагательное условие**») или
- (б) прекращается (такое условие Сделки именуется «**Барьерное отменительное условие**»)

у соответствующей стороны, если согласованная сторонами Плавающая ставка достигла уровня Барьерной ставки или преодолела его по состоянию на Контрольное время в Контрольную дату.

10.2. **Барьерная ставка** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, значение Плавающей ставки, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке в целях определения наступления Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

10.3. **Контрольная дата** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, каждый из Рабочих дней, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.

Если в Подтверждении не указано Контрольных дат, Контрольной датой является каждый из Рабочих дней в течение периода начиная с Даты сделки (включительно) по (включая) последнюю Дату оценки, Дату истечения срока или в случае их отсутствия Рабочий день, предшествующий Дате платежа (либо последней Дате платежа, если условиями Сделки предусмотрено несколько Дат платежа) или Дате окончательного платежа по Сделке.

10.4. **Контрольное время** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, время дня в Контрольную дату, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания и иного соглашения сторон — время публикации соответствующей Плавающей ставки (как указано в пункте 8.2 Стандартных условий) в Контрольную дату.

10.5. Существенными условиями Сделки, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки помимо существенных условий соответствующего вида Сделок, предусмотренных Стандартными условиями, являются:

- (а) Тип условия о барьере (отлагательное или отменительное);

- (б) Барьерная ставка (или Диапазон целевых значений);
- (в) Способ определения плавающей ставки.

10.6. В случае возникновения у сторон разногласий по вопросу о наступлении Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия Расчетный агент определяет, наступило ли соответствующее условие.

11. Сбой публикации

11.1. **Сбой публикации** означает невозможность получить информацию о процентной ставке из источника информации о процентных ставках, указанного в согласованном сторонами Способе определения плавающей ставки, или любую иную информацию, необходимую для определения Плавающей ставки на Дату изменения плавающей ставки.

11.2. Если в отношении Сделки наступает Сбой публикации:

- (а) и если Сбой публикации происходит в Дату изменения плавающей ставки Дата изменения плавающей ставки переносится на ближайший Рабочий день после того, как Сбой публикации перестанет иметь место. Если Сбой публикации, затронувший соответствующий Способ определения плавающей ставки, продолжается в течение пяти Рабочих дней, следующих за Датой изменения плавающей ставки, и в течение этого времени стороны не согласовали новый Способ определения плавающей ставки, у каждой из сторон возникает право прекратить обязательства по Сделке в порядке, установленном подпунктом (б) настоящего пункта 11.2;
- (б) в иных случаях стороны должны согласовать новый Способ определения плавающей ставки. Если стороны не согласуют новый Способ определения плавающей ставки в течение пяти Рабочих дней (и Сбой публикации при этом продолжает иметь место), любая из сторон вправе, уведомив другую сторону, прекратить обязательства по Сделке в соответствии с применимыми положениями статьи 7 Примерных условий договора, как если бы:
 - (А) Сбой публикации был определен как Дополнительное основание прекращения;
 - (Б) все применимые Льготные периоды истекли;
 - (В) все уведомления, необходимые для возникновения права на прекращение обязательств по Сделке, были получены в день, когда истек срок, установленный в абзаце первом настоящего пункта 11.2(б) для согласования нового Способа определения плавающей ставки;
 - (Г) обе стороны были бы Затронутыми сторонами;
 - (Д) Сделка являлась единственной Затронутой сделкой.

Термины «Дополнительное основание прекращения», «Льготный период», «Затронутые стороны» и «Затронутая сделка» имеют значение, указанное в Примерных условиях договора, если Генеральным соглашением не предусмотрено иное.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1
к Стандартным условиям срочных сделок
на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г.

Форма Подтверждения для Сделки процентный своп

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — «*Подтверждение*») является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — «*Сторона А*») и [●] (далее — «*Сторона Б*») от [●] (далее — «*Генеральное соглашение*»).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:
- (а) Общие условия:
- Номинальная сумма:
- Дата сделки:
- [Дата начала срока:]¹
- Дата истечения срока: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]²
- (б) [Фиксированные суммы:]
- [Плательщик [Сторона А] [Сторона Б]
фиксированной суммы:]
- [Даты платежа [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]³
Фиксированных сумм:]
- [Фиксированная сумма
[или Фиксированная ставка
и Коэффициент для расчета дней
в процентном периоде
для Фиксированной ставки]:]
- (в) Плавающие суммы:
- Плательщик плавающей суммы: [Сторона Б] [Сторона А]
- Даты платежа Плавающих сумм: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]⁴
- [Плавающая ставка для
первого Процентного периода:]
- Способ определения
плавающей ставки:
- Период плавающей ставки:
- Спред: [плюс/минус [●] %] [Отсутствует]
- Коэффициент для расчета дней
в процентном периоде
для Плавающей ставки:

¹ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.5 Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

² Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

³ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

⁴ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

Даты изменения
плавающей ставки:

[●], [с учетом Условия об окончании
срока в нерабочий день: [●]]⁵

(г) Капитализация:

Условие о капитализации:

[Применимо] [Не применимо]

Даты капитализации:

[(д) Иные условия:]

4. Расчетный агент: [Сторона А]

5. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[6. Рабочий день:]

[7. Условие об окончании срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

⁵ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

ПРИЛОЖЕНИЕ 2
к Стандартным условиям срочных сделок
на процентные ставки и сделок свопцион 2011

Форма Подтверждения для Сделки процентный форвард

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условия Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, составляют:

(а) Общие условия:

Номинальная сумма:

Дата сделки:

[Дата начала срока:]⁶

Дата истечения срока:

[●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]⁷

Плательщик
положительной разницы:

[Сторона А] [Сторона Б]

Плательщик
отрицательной разницы:

[Сторона Б] [Сторона А]

Дата платежа:

[● -ый/-ой/-ий] Рабочий день после
Даты изменения плавающей ставки,
[с учетом Условия об окончании
срока в нерабочий день: [●]]⁸

Фиксированная ставка:

Способ определения
плавающей ставки:

Период плавающей ставки:

Сред:

[плюс/минус [●] %] [Отсутствует]

Коэффициент для расчета дней
в процентном периоде
для Плавающей ставки:

Дата изменения
плавающей ставки:

[●], [с учетом Условия об окончании
срока в нерабочий день: [●]]⁹

[Дисконтирование:]

[Применимо] [Не применимо]

[Ставка дисконтирования:]¹⁰

⁶ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.5 Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

⁷ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

⁸ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

⁹ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

¹⁰ Стороны должны указать эту информацию, если они хотят изменить правило о применении по умолчанию Плавающей ставки.

[Коэффициент для расчета дней
в процентном периоде
для дисконтирования:]¹¹

[(б) Иные условия:]

4. Расчетный агент: [Сторона А]

5. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[6. Рабочий день:]

[7. Условие об окончании срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

¹¹ Стороны должны указать эту информацию, если они хотят изменить правило о применении по умолчанию Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбранного сторонами для Плавающей ставки.

ПРИЛОЖЕНИЕ 3
к Стандартным условиям срочных сделок
на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г.

Форма Подтверждения для Сделок
фиксации максимума процентной ставки

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:
- (а) Общие условия:
- Номинальная сумма:
- Дата сделки:
- [Дата начала срока:]¹²
- Дата истечения срока: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]¹³
- (б) Фиксированные суммы:
- Плательщик [Сторона А] [Сторона Б]
- фиксированной суммы:
- Дата или Даты платежа [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]¹⁴
- Фиксированных сумм:
- Фиксированная сумма:
- (в) Плавающие суммы:
- Плательщик плавающей суммы: [Сторона Б] [Сторона А]
- Максимальная ставка: [●] %
- Дата или Даты платежа [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]¹⁵
- Плавающих сумм:
- [Плавающая ставка для первого
Процентного периода:]
- Способ определения
плавающей ставки:
- Период плавающей ставки:
- Сред: [плюс/минус [●] %] [Отсутствует]
- Коэффициент для расчета дней
в процентном периоде
для Плавающей ставки:

¹² Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.5 Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

¹³ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

¹⁴ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

¹⁵ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

Даты изменения плавающей ставки: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]¹⁶

[(г) Капитализация:

Условие о капитализации: [Применимо] [Не применимо]

Даты капитализации:]

[(д) Иные условия:]

4. Расчетный агент: [Сторона А]

5. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[6. Рабочий день:

[7. Условие об окончании срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

¹⁶ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

ПРИЛОЖЕНИЕ 4
к Стандартным условиям срочных сделок
на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г.

Форма Подтверждения для Сделок фиксации минимума
процентной ставки

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Номинальная сумма:

Дата сделки:

[Дата начала срока:]¹⁷

Дата истечения срока: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]¹⁸

(б) Фиксированные суммы:

Плательщик [Сторона А] [Сторона Б]
фиксированной суммы:

Дата или Даты платежа [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]¹⁹

Фиксированная сумма:

(в) Плавающие суммы:

Плательщик плавающей суммы: [Сторона Б] [Сторона А]

Минимальная ставка: [●] %

Дата или Даты платежа [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]²⁰

[Плавающая ставка
для первого Процентного периода:]

Способ определения
плавающей ставки:

Период плавающей ставки:

Сред: [плюс/минус [●] %] [Отсутствует]

Коэффициент для расчета дней
в процентном периоде
для Плавающей ставки:

¹⁷ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.5 Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

¹⁸ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

¹⁹ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

²⁰ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

Даты изменения плавающей ставки: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]²¹

(г) Капитализация:

Условие о капитализации: [Применимо] [Не применимо]

Даты капитализации:

[(д) Иные условия:]

4. Расчетный агент: [Сторона А]

5. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[6. Рабочий день:

[7. Условие об окончании срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

²¹ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

ПРИЛОЖЕНИЕ 5
к Стандартным условиям срочных сделок
на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г.

**Форма Подтверждения для Сделок фиксации максимума и минимума
процентной ставки**

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Номинальная сумма:

Дата сделки:

[Дата начала срока:]²²

Дата истечения срока:

[●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]²³

Плательщик плавающей суммы при превышении Плавающей ставкой Максимальной ставки:

[Сторона А] [Сторона Б]

Максимальная ставка:

[●] %

Плательщик плавающей суммы при превышении Минимальной ставкой Плавающей ставки:

[Сторона А] [Сторона Б]

Минимальная ставка:

[●] %

Дата или Даты платежа:

[●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]²⁴

[Плавающая ставка для первого Процентного периода:]

Способ определения плавающей ставки:

Период плавающей ставки:

Спред:

[плюс/минус [●] %] [Отсутствует]

Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки:

Даты изменения плавающей ставки:

[●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]²⁵

²² Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.5 Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

²³ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

²⁴ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

²⁵ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

(г) Капитализация:

Условие о капитализации: [Применимо] [Не применимо]

Даты капитализации:

[(д) Иные условия:]

4. Расчетный агент: [Сторона А]

5. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[6. Рабочий день:

[7. Условие об окончании срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ПРИЛОЖЕНИЕ 6
к Стандартным условиям срочных сделок на процентные ставки
и сделок свопцион

Форма Подтверждения для Сделки валютно-процентный своп

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является Подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой *«Подтверждение»* в смысле Генерального соглашения о срочных Сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет, является частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Номинальная сумма
и валюта для Стороны А:²⁶

Номинальная сумма
и валюта для Стороны Б:²⁷

Дата сделки:

[Дата начала срока:]²⁸

Дата истечения срока:

[●], [с учетом Условия об окончании
срока в нерабочий день: [●]]²⁹

(б) [Фиксированные суммы:]

[Плательщик
фиксированной суммы:]

[Сторона А] [Сторона Б]

[Даты платежа
Фиксированных сумм:]

[●], [с учетом Условия об окончании
срока в нерабочий день: [●]]³⁰

[Фиксированная сумма
[или Фиксированная ставка
и Коэффициент для расчета дней
в процентном периоде
для Фиксированной ставки]:]

(в) Плавающие суммы:

Плательщик плавающей суммы:

[Сторона Б] [Сторона А]

Даты платежа Плавающих сумм:

[●], [с учетом Условия об окончании
срока в нерабочий день: [●]]³¹

²⁶ Номинальной суммой для Стороны А является сумма, используемая для расчета Фиксированных/Плавающих сумм Стороны А, то есть Сумма первоначального платежа, установленная для Стороны Б, если к Сделке применяется условие о совершении первоначального платежа.

²⁷ Номинальной суммой для Стороны Б является сумма, используемая для расчета Фиксированных/Плавающих сумм Стороны Б, то есть Сумма первоначального платежа, установленная для Стороны А, если к Сделке применяется условие о совершении первоначального платежа.

²⁸ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.2 Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

²⁹ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

³⁰ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

³¹ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

[Плавающая ставка для
первого Процентного периода:]

Способ определения
плавающей ставки:

Период плавающей ставки:

Спред: [плюс/минус [●] %] [Отсутствует]

Коэффициент для расчета дней
в процентном периоде
для Плавающей ставки:

Даты изменения
плавающей ставки: [●], [с учетом Условия об окончании
срока в нерабочий день: [●]]³²

[(г) Капитализация:

Условие о капитализации: [Применимо] [Не применимо]

Даты капитализации:]

[(д) Первоначальный платеж: [Применимо] [Не применимо]

[Дата первоначального платежа:] [●], [с учетом Условия об окончании
срока в нерабочий день: [●]]³³

[Сумма первоначального платежа для Стороны А:]

[Сумма первоначального платежа для Стороны Б:]

[(е) Промежуточные платежи:

Дата или Даты
промежуточного платежа: [●], [с учетом Условия об окончании
срока в нерабочий день: [●]]³⁴

Сумма промежуточного платежа для Стороны А:

Сумма промежуточного платежа для Стороны Б:]³⁵

[(ж) Окончательный платеж:

³² Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день»

³³ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

³⁴ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

³⁵ Стороны должны включить положения о промежуточных платежах, если они хотят предусмотреть амортизацию Номинальных сумм в соответствии с пунктом 3.3 (г) Стандартных условий.

[Дата окончательного платежа:] [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]³⁶

[Сумма окончательного платежа для Стороны А:]

[Сумма окончательного платежа для Стороны Б:]

[(з) Амортизация или иное изменение Номинальной суммы:]

[(и) Иные условия:] [Согласно прилагаемому графику]

4. Расчетный агент: [Сторона А]

5. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[6. Рабочий день:

для [первой валюты]³⁷:

для [второй валюты]³⁸:]

[7. Условие об окончании срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

³⁶ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

³⁷ Укажите наименование первой из двух валют, в которых заключается Сделка валютно-процентный своп.

³⁸ Укажите наименование второй из двух валют, в которых заключается Сделка валютно-процентный своп.

ПРИЛОЖЕНИЕ 7
к Стандартным условиям срочных сделок
на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г.

Форма Подтверждения для Сделки свопцион

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Стиль Сделки свопцион: [Американский/Бермудский/
Европейский]

Покупатель: [Сторона А] [Сторона Б]

Продавец: [Сторона Б] [Сторона А]

[Дата начала срока:]³⁹

[Срок осуществления
права на исполнение:]⁴⁰

[Даты осуществления права
на исполнение
по Бермудскому свопциону:]⁴¹

Дата истечения срока:

Время закрытия: [●] ч. [●]мин.
по московскому времени

[Премия:]⁴²

[Дата уплаты премии:]⁴³ [●], [с учетом Условия об окончании
срока в нерабочий день: [●]]⁴⁴

[(б) Иные условия:]

4. Условия Основной сделки:

[Включаются условия, указанные в пункте 3 приложений 1–6 к Стандартным условиям в зависимости от вида Основной сделки.]

5. Расчетный агент: [Сторона А]

³⁹ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.5 Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки

⁴⁰ При желании стороны могут изменить Срок осуществления прав, предусмотренный для Американского свопциона. Например, при наличии нескольких Сроков осуществления прав необходимы дополнительные ссылки.

⁴¹ Стороны обязаны указать данную информацию для Бермудского свопциона.

⁴² Данное условие может быть включено в Подтверждение если Стороны договорятся об уплате Премии. Стороны могут указать размер Премии в виде твердой суммы или процента от Номинальной суммы.

⁴³ Данное условие может быть включено в Подтверждение если Стороны договорятся об уплате Премии.

⁴⁴ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день»

6. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[7. Рабочий день:]

[8. Условие об окончании срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ПРИЛОЖЕНИЕ 8
к Стандартным условиям срочных сделок
на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г.

Форма Требования об исполнении по Сделке свопцион

[На бланке Покупателя]

[Дата]

[Наименование и адрес Продавца]

Кас.: Требование об исполнении [наименование Сделки свопцион]

Уважаемые господа!

Мы ссылаемся на Сделку свопцион, заключенную между нами [дата], [регистрационный номер Сделки] (далее — «Сделка»), на основании Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] и [●] от [●].

Настоящее Требование об исполнении направляется вам в порядке и в целях осуществления нами Права на исполнение по Сделке в соответствии с пунктом 9.4 Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г. (далее — «Стандартные условия»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков, применяемых в соответствии с Подтверждением по Сделке.

Все термины, использованные в настоящем Требовании об исполнении с заглавной буквы, имеют значение, определенное в Стандартных условиях.

С уважением,

[Покупатель]

Ф. И. О.:

Должность:

АЛФАВИТНО-ПРЕДМЕТНЫЙ УКАЗАТЕЛЬ

Термин	Пункт
1/1	7.4(а)
30E/360	7.4(б)
EUR-EURIBOR-Reuters	8.2(з)
EUR-EURIBOR-банки-ориентеры	8.2(и)
Moscow InterBank Offered Rate	8.2(а)
MosIBOR	8.2(а)
RUB-MOSPRIME-банки-ориентеры	8.2(в)
RUB-MOSPRIME-NFEA	8.2(б)
USD-Federal Funds-H.15	8.2(е)
USD-LIBOR BBA	8.2(д)
USD-LIBOR-банки-ориентеры	8.2(ж)
Американский свопцион	9.2(а)
Бермудский свопцион	9.2(б)
Время закрытия	9.4(а)(А)
Генеральное соглашение	1.1
Дата истечения срока	1.3
Дата калькуляции	1.4
Дата капитализации	7.8(б)
Дата начала срока	1.5
Дата окончания периода	2.2(а)
Дата осуществления права на исполнение	9.4(а)(Б)
Дата платежа	1.66
Дата сделки	1.77
Дата уплаты премии	9.5(а)
Дата изменения плавающей ставки	1.2
Дисконтирование	7.3(б)(А)
Европейский свопцион	9.2(в)
Коэффициент для расчета дней в процентном периоде	7.4
Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для дисконтирования	7.7(б)
Максимальная ставка	5.1
Минимальная ставка	5.2
НВА	8.2(а)

Номинальная сумма	1.88
Округление	1.1010
Основная сделка	9.1
Основной финансовый центр	1.99
Период капитализации	7.8(a)
Период плавающей ставки	3.2(a)(E)
Плавающая ставка	1.11
Плавающая сумма	3.1
Плательщик отрицательной разницы	4.1
Плательщик плавающей суммы	3.3(a)
Плательщик положительной разницы	4.1
Плательщик фиксированной суммы	3.3(б)
Подтверждение	1.12
Покупатель	9.1
Право на исполнение	9.1
Предшествующий рабочий день	1.17(б)
Премия	9.5(a)
Продавец	9.1
Процентный период	2.2
Рабочий день	1.14
Рабочий день в отчетном периоде	1.17(в)
Расчетный агент	1.15
Сбой публикации	11.1
<p>Расчетный агент, в частности, направляет необходимое уведомление другой стороне или сторонам (если Расчетный агент является третьим лицом) в Дату калькуляции применительно к каждой Дате платежа, в котором указывает:</p> <ul style="list-style-type: none"> (a) Дату платежа; (б) сторону или стороны, с которых причитается платеж в указанную Дату платежа; (в) сумму или суммы соответствующих платежей; (г) информацию в разумном объеме о том, каким образом указанная сумма или суммы платежей были определены. 	
Сделка для целей настоящих Стандартных условий	0
Сделка процентный форвард	4.1
Сделка кóллар	5.3
Сделка кэп	5.1

Сделка процентный своп	3.1
Сделка процентный форвард	4.1
Сделка свопцион	9.1
Сделка фиксации максимума и минимума процентной ставки	5.3
Сделка фиксации максимума процентной ставки	5.1
Сделка фиксации минимума процентной ставки	5.2
Сделка флор	5.2
Следующий рабочий день	1.17(а)
Способ определения плавающей ставки	8.1
Срок осуществления права на исполнение	9.4(а)(В)
Срочная сделка на процентные ставки	2.1
Ставка дисконтирования	7.7(а)
Стандартные условия	Преамбула
Сумма периода капитализации	7.8(в)
Требование об исполнении	9.4(а)(Г)
Уточненная номинальная сумма	7.8(г)
Условие об окончании срока в нерабочий день	1.17
Фактическое/360	7.4(г)
Фактическое/365	7.4(д)
Фактическое/Фактическое	7.4(е)
Фиксированная ставка	1.18
Фиксированная сумма	3.1

СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ
СРОЧНЫХ СДЕЛОК С АКЦИЯМИ
И ФОНДОВЫМИ ИНДЕКСАМИ
2011 г.

This 2011 Standard Terms of Share and Index Derivatives Transactions is based, in part, on selected provisions of the 2002 ISDA Equity Derivatives Definitions, © 2002 International Swaps and Derivatives Association, Inc., («ISDA®»), and is used with its permission. ISDA takes no position as to this Russian-version 2011 Standard Terms of Share and Index Derivatives Transactions' suitability for use in any particular transaction. Prospective users should seek independent legal advice before using this instrument.

СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ СРОЧНЫХ СДЕЛОК С АКЦИЯМИ И ФОНДОВЫМИ ИНДЕКСАМИ 2011 Г.

Настоящие Стандартные условия срочных сделок с акциями и фондовыми индексами (далее — «**Стандартные условия**»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков, устанавливают особенности заключения, исполнения и прекращения Сделок, как они определены в пункте 1.30 Стандартных условий. Настоящие Стандартные условия применяются к Сделке, (а) если они полностью или частично включены в Подтверждение по Сделке путем указания в нем о применении Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. полностью или в соответствующей части; (б) по умолчанию при отсутствии Подтверждения. Если какой-либо термин настоящих Стандартных условий употребляется в Подтверждении наряду с указанием стороны, он применяется исключительно к этой стороне.

1. ОБЩИЕ ОПРЕДЕЛЕНИЯ

- 1.1. **Акции** означает применительно к Срочной сделке на акции и Срочной сделке на корзину акций акции в значении, определенном законодательством Российской Федерации о рынке ценных бумаг, указанные в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованные сторонами применительно к Сделке. По условиям Сделки настоящие Стандартные условия могут применяться к опциону эмитента в значении, определенном законодательством Российской Федерации о рынке ценных бумаг. В этом случае опцион эмитента включается в понятие «Акции» для целей настоящих Стандартных условий.
- 1.2. **Базовый актив** означает Акции, как они определены в пункте 1.1, Индексы, как они определены в пункте 1.13, и Корзину Акции или Индексов, как она определена в пункте 1.18, которые являются предметом поставки по Сделке или в зависимости от изменения цен на которые (значений которых) осуществляется исполнение обязательств по Сделкам.
- 1.3. **Банковский день** означает любой день, являющийся Рабочим днем в значении, определенном в Генеральном соглашении, и:
 - (а) если евро является Валютой платежа, днем, когда открыта Трансъевропейская автоматическая система валовых расчетов и экспресс-переводов в режиме реального времени (Система TARGET);
 - (б) если другая иностранная валюта является Валютой платежа, днем, когда кредитные организации осуществляют банковские операции и другие сделки

(в том числе на валютном рынке) в основном финансовом центре этой иностранной валюты, определенном для соответствующей валюты в приложении 7 к Стандартным условиям конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп, разработанным и утвержденным Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованным в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков.

- 1.4. **Беспоставочная сделка** означает Сделку беспоставочный опцион, Сделку беспоставочный форвард или Сделку беспоставочный своп.
- 1.5. **Биржа** означает:
 - (а) применительно к Индексу и Срочной сделке на индекс или Срочной сделке на корзину индексов — каждую биржу или иного организатора торговли, указанного применительно к этому Индексу в Подтверждении или иным образом согласованного сторонами применительно к Индексу;
 - (б) применительно к Акции и Срочной сделке на акции или Срочной сделке на корзину акций — каждую биржу или иного организатора торговли, указанного применительно к этой Акции в Подтверждении или иным образом согласованного сторонами применительно к Акции.
- 1.6. **Биржа срочных контрактов** означает каждую биржу, указанную применительно к Индексу или Акции в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Индексу или Акции, на которой торгуются фьючерсные, опционные или иные срочные договоры (контракты), базовым активом которых является Индекс или Акция. При этом если в Подтверждении условие о Бирже срочных контрактов определено как «Все Биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Индекс или Акция.
- 1.7. **Биржевая цена** означает:
 - (а) применительно к Индексу — значение этого Индекса, определенное Расчетным агентом в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, по состоянию на Время оценки в Дату оценки, а при отсутствии такого порядка — значение Индекса по состоянию на Время оценки в Дату оценки;
 - (б) применительно к Акции — цену одной Акции, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, а при отсутствии такого порядка — среднее арифметическое значение между

максимальной ценой в заявках на покупку и минимальной ценой в заявках на продажу по данной Акции, зарегистрированных на Бирже по состоянию на Время оценки в Дату оценки (или при их отсутствии на Время оценки между последней максимальной ценой в заявках на покупку и последней минимальной ценой в заявках на продажу по данной Акции, зарегистрированных непосредственно перед наступлением Времени оценки), без учета адресных (внесистемных) заявок и совершенных на их основе сделок (переговорных сделок), а также сделок на основании заявок, поданных за счет одного участника торгов или одного клиента участника торгов (кросс-сделок), и сделок РЕПО.

- 1.8. **Биржевой день** означает любой Плановый торговый день, в который каждая Биржа и каждая Биржа срочных контрактов открыты для проведения торгов в режиме основных торгов, в том числе день, в который Биржа или Биржа срочных контрактов по какой-либо причине закрылась до наступления Времени закрытия торгов.
- 1.9. **Валюта платежа** означает валюту, в которой проводятся расчеты по Сделке, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке.
- 1.10. **Время закрытия торгов** означает применительно к Бирже или Бирже срочных контрактов, а также Плановому торговому дню время закрытия торгов на Бирже или Бирже срочных контрактов по расписанию в этот Плановый торговый день без учета послеторгового и других периодов за рамками периода проведения торгов в режиме основных торгов.
- 1.11. **Генеральное соглашение** означает Генеральное соглашение в значении, определенном в Примерных условиях договора.
- 1.12. **Дата сделки** означает применительно к Сделке Дату сделки в значении, определенном в Генеральном соглашении.
- 1.13. **Индекс** означает применительно к Срочной сделке на индекс и Срочной сделке на корзину индексов индекс, рассчитываемый на основании совокупности цен на акции (фондовый индекс), указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.
- 1.14. **Клиринговая организация** означает применительно к Поставочным сделкам клиринговую организацию, указанную в этом качестве применительно к Акции в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к этой Акции либо любую заменяющую ее клиринговую организацию, определяемую Расчетным агентом, а при отсутствии такого указания и иного соглашения сторон — основную клиринговую организацию для расчетов по операциям с Акциями на Бирже в Дату расчетов. Если Клиринговая организация прекращает осуществлять расчеты по Акции, стороны добросовестно договариваются о другом способе поставки.
- 1.15. **Клиринговый день** означает применительно к Клиринговой организации любой день, в который такая Клиринговая организация открыта (или, если бы не

наступление События, препятствующего проведению расчетов, была бы открыта) для принятия и исполнения поручений на осуществление расчетов.

1.16. **Количество акций** означает:

- (а) применительно к Сделке опцион на акции — количество Акции, полученное путем умножения Количества опционов на Предмет опциона;
- (б) применительно к Сделке форвард на акции или Сделке своп на акции — количество Акции, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке;
- (в) применительно к Срочной сделке на корзину акций в отношении Акции каждого Эмитента, включенных в Корзину, — количество Акции в одной Корзине, указанное в Подтверждении, иным образом определяемое в соответствии с ним или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке.

1.17. **Количество корзин** означает применительно к Срочной сделке на корзину индексов или Срочной сделке на корзину акций количество Корзин, указанное в Подтверждении, иным образом определяемое в соответствии с ним или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке.

1.18. **Корзина** означает:

- (а) применительно к Срочной сделке на корзину индексов — набор Индексов, перечисленных в Подтверждении в пропорции, указанной в Подтверждении или иным образом согласованной сторонами применительно к Сделке;
- (б) применительно к Срочной сделке на корзину акций — набор Акции каждого из Эмитентов, перечисленных в Подтверждении в пропорции или количестве, указанном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами применительно к Сделке.

1.19. **Множитель** означает процент или число, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания и иного соглашения сторон — единицу.

1.20. **Номинальная сумма сделки** означает применительно к Сделке своп сумму, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке и, если применимо, скорректированную в соответствии с пунктами 5.1(к) и 11.4 и статьей 0 Стандартных условий.

1.21. **Плановый торговый день** означает любой день, в который каждая Биржа и каждая Биржа срочных контрактов должны быть открыты в соответствии с графиком работы для проведения торгов в режиме основных торгов.

1.22. **Подтверждение** означает Подтверждение в значении, определенном в Генеральном соглашении, которое может быть составлено по форме, установленной в приложениях 1–18 к Стандартным условиям в зависимости от вида Сделки, или иной форме, согласованной сторонами.

- 1.23. **Покупатель** означает сторону Сделки, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке.
- 1.24. **Поставочная сделка** означает Сделку поставочный опцион, Сделку поставочный форвард или Сделку поставочный своп.
- 1.25. **Примерные условия договора** означает Примерные условия договора о срочных сделках на финансовых рынках, опубликованные в сети Интернет на страницах Ассоциации российских банков, Национальной Валютной Ассоциации и Национальной ассоциации участников фондового рынка.
- 1.26. **Продавец** означает сторону Сделки, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке.
- 1.27. **Разработчик индекса** означает юридическое лицо, которое:
- (а) устанавливает правила и методику расчета и корректировки (если применимо) соответствующего Индекса; и
 - (б) публикует информацию о значении Индекса на регулярной основе в течение Планового торгового дня.
- 1.28. **Расчетный агент** означает лицо, указанное в этом качестве в Генеральном соглашении, если иное лицо не назначено в этом качестве по Сделке в Подтверждении или иным образом не согласовано сторонами применительно к Сделке. Расчетный агент определяет значения курсов, стоимость, цены, суммы и иные значения, а также выполняет другие действия в соответствии с настоящими Стандартными условиями. Расчетный агент обязан действовать разумно и добросовестно при любых обстоятельствах. Расчет (калькуляция), произведенный Расчетным агентом, является обязательным для сторон, кроме случаев очевидной ошибки.
- 1.29. **Расчетный цикл** означает:
- (а) применительно к Индексу или Акции количество Клиринговых дней, в течение которого в соответствии с правилами Биржи обычно осуществляются расчеты по результатам торгов акциями, на основе сделок с которыми рассчитывается Индекс, или такими Акциями (а при наличии нескольких Бирж применительно к Индексу наибольшее из установленных правилами этих Бирж количество Клиринговых дней);
 - (б) применительно к Биржевому контракту количество Биржевых дней, в течение которого в соответствии с правилами Биржи обычно осуществляются расчеты по результатам торгов такими Биржевыми контрактами.
- 1.30. **Сделка** означает Сделку опцион, как она определена в пункте 1.31 Стандартных условий, Сделку своп, как она определена в пункте 1.35 Стандартных условий, Сделку форвард, как она определена в пункте 1.39 Стандартных условий, любое сочетание названных Сделок или иную сделку, в отношении которой в Подтверждении стороны указали о том, что к ней применяются настоящие Стандартные условия.

- 1.31. **Сделка опцион** означает сделку, по которой на условиях, согласованных сторонами, и с учетом других положений настоящих Стандартных условий Покупатель уплачивает Продавцу Премию и приобретает право (далее — **«Право на исполнение»**), но не обязанность:
- (а) потребовать от Продавца выплаты Суммы платежа в Дату расчетов, а Продавец обязуется выплатить Покупателю такую Сумму платежа (далее — **«Сделка беспоставочный опцион»**). Сумма платежа по Сделке беспоставочный опцион может рассчитываться применительно к:
 - (А) одному Индексу (такая Сделка далее именуется **«Сделка индексный опцион»**);
 - (Б) одной категории (типу) Акций одного Эмитента (такая Сделка далее именуется **«Сделка беспоставочный опцион на акции»**);
 - (В) Корзине Индексов (такая Сделка далее именуется **«Сделка опцион на корзину индексов»**);
 - (Г) Корзине Акций (такая Сделка далее именуется **«Сделка беспоставочный опцион на корзину акций»**);
 - (б) в Дату расчетов по Опциону колл получить от Продавца в собственность Акции одной категории (типа) одного Эмитента или по Опциону пут передать Продавцу в собственность такие Акции по Цене исполнения, а Продавец обязуется соответственно передать Покупателю в собственность такие Акции или получить от Покупателя в собственность такие Акции по Цене исполнения (далее — **«Сделка поставочный опцион на акции»**);
 - (в) в Дату расчетов по Опциону колл получить от Продавца в собственность Корзину или Корзины Акций или по Опциону пут передать Продавцу в собственность Корзину или Корзины Акций по Цене исполнения, а Продавец обязуется соответственно передать Покупателю в собственность Корзину или Корзины Акций или получить от Покупателя в собственность Корзину или Корзины Акций по Цене исполнения (далее — **«Сделка поставочный опцион на корзину акций»**), а вместе со Сделкой поставочный опцион на акции — **«Сделка поставочный опцион»**);
- 1.32. **Сделка опцион на акции** означает Сделку поставочный опцион на акции или Сделку беспоставочный опцион на акции.
- 1.33. **Сделка опцион на корзину** означает Сделку опцион на корзину индексов или Сделку опцион на корзину акций.
- 1.34. **Сделка опцион на корзину акций** означает Сделку поставочный опцион на корзину акций или Сделку беспоставочный опцион на корзину акций.
- 1.35. **Сделка своп** означает сделку, по которой на условиях, согласованных сторонами, и с учетом других положений настоящих Стандартных условий:
- (а) единовременно или периодически сумма, рассчитываемая на основе плавающей или фиксированной процентной ставки, если условиями Сделки

не предусмотрено иное, уплачивается одной стороной, а Индексированная сумма при ее положительном значении уплачивается другой стороной, а при ее отрицательном значении — первой стороной (далее — «**Сделка беспоставочный своп**»). Индексированная сумма по Сделке беспоставочный своп может рассчитываться применительно к:

- (А) одному Индексу (такая Сделка далее именуется «**Сделка индексный своп**»);
 - (Б) одной категории (типу) Акций одного Эмитента (такая Сделка далее именуется «**Сделка беспоставочный своп на акции**»);
 - (В) Корзине Индексов (такая Сделка далее именуется «**Сделка своп на корзину индексов**»);
 - (Г) Корзине Акций (такая Сделка далее именуется «**Сделка беспоставочный своп на корзину акций**»);
- (б) одна сторона одновременно или периодически уплачивает сумму, рассчитываемую на основе плавающей или фиксированной процентной ставки, если условиями Сделки не предусмотрено иное, и в Дату расчетов обязуется уплатить другой стороне Номинальную сумму сделки, а другая сторона одновременно или периодически уплачивает Сумму дивидендов и в Дату расчетов обязуется передать первой стороне в собственность:
- (А) Акции одной категории (типа) одного Эмитента (далее — «**Сделка поставочный своп на акции**»);
 - (Б) Корзину или Корзины Акций (далее — «**Сделка поставочный своп на корзину акций**»), а вместе со Сделкой поставочный своп на акции — «**Сделка поставочный своп**»).
- 1.36. **Сделка своп на акции** означает Сделку беспоставочный своп на акции или Сделку поставочный своп на акции.
- 1.37. **Сделка своп на корзину** означает Сделку своп на корзину индексов или Сделку своп на корзину акций.
- 1.38. **Сделка своп на корзину акций** означает Сделку беспоставочный своп на корзину акций или Сделку поставочный своп на корзину акций.
- 1.39. **Сделка форвард** означает сделку, по которой на условиях, согласованных сторонами, и с учетом других положений настоящих Стандартных условий:
- (а) в Дату расчетов Продавец обязуется уплатить Покупателю Сумму платежа при ее положительном значении, а Покупатель обязуется уплатить Продавцу абсолютное значение Суммы платежа при ее отрицательном значении (далее — «**Сделка беспоставочный форвард**»). Сумма платежа по Сделке беспоставочный форвард может рассчитываться применительно к:
 - (А) одному Индексу (такая Сделка далее именуется «**Сделка индексный форвард**»);

- (Б) одной категории (типу) Акций одного Эмитента (такая Сделка далее именуется «*Сделка беспоставочный форвард на акции*»);
 - (В) Корзине Индексов (такая Сделка далее именуется «*Сделка форвард на корзину индексов*»);
 - (Г) Корзине Акций (такая Сделка далее именуется «*Сделка беспоставочный форвард на корзину акций*»);
- (б) в Дату расчетов Продавец обязуется передать Покупателю в собственность согласованное количество Акций одной категории (типа) одного Эмитента, а Покупатель обязуется оплатить их в сумме, рассчитанной на основе Форвардной цены (далее — «*Сделка поставочный форвард на акции*»);
 - (в) в Дату расчетов Продавец обязуется передать Покупателю в собственность согласованное количество Акций в одной или более Корзин, а Покупатель обязуется оплатить их в сумме, рассчитанной на основе Форвардной цены (далее — «*Сделка поставочный форвард на корзину акций*»), а вместе со Сделкой поставочный форвард на акции — «*Сделка поставочный форвард*»).
- 1.40. *Сделка форвард на акции* означает Сделку беспоставочный форвард на акции или Сделку поставочный форвард на акции.
 - 1.41. *Сделка форвард на корзину* означает Сделку форвард на корзину индексов или Сделку форвард на корзину акций.
 - 1.42. *Сделка форвард на корзину акций* означает Сделку беспоставочный форвард на корзину акций или Сделку поставочный форвард на корзину акций.
 - 1.43. *Срочная сделка на акции* означает Сделку опцион на акции, Сделку форвард на акции или Сделку своп на акции.
 - 1.44. *Срочная сделка на индекс* означает Сделку индексный опцион, Сделку индексный форвард или Сделку индексный своп.
 - 1.45. *Срочная сделка на корзину акций* означает Сделку опцион на корзину акций, Сделку форвард на корзину акций или Сделку своп на корзину акций.
 - 1.46. *Срочная сделка на корзину индексов* означает Сделку опцион на корзину индексов, Сделку форвард на корзину индексов или Сделку своп на корзину индексов.
 - 1.47. *Эмитент* означает применительно к Акциям эмитента этих Акций.
- 2. Сделки опцион
 - 2.1. Применительно к Сделкам опцион следующие термины имеют следующие значения:
 - (а) *Дата начала срока* означает применительно к Американскому опциону день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а если этот день не является

Плановым торговым днем — ближайший следующий Плановый торговый день; а при отсутствии такого указания и иного соглашения сторон — Дату сделки.

- (б) **Количество опционов** означает количество Предметов опциона, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, в отношении которых по Сделке опцион может быть осуществлено Право на исполнение.
- (в) **Предмет опциона** означает:
 - (А) применительно к Сделке опцион на акции количество Акций, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания и иного соглашения сторон — одну Аксию;
 - (Б) применительно к Сделке опцион на корзину акций количество Корзин, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания и иного соглашения сторон — одну Корзину.
- (г) **Опцион** означает применительно к Сделке опцион Право на исполнение в отношении одного Предмета опциона.
- (д) **Цена исполнения** означает:
 - (А) применительно к Сделке индексный опцион значение соответствующего Индекса, указанное в Подтверждении, иным образом определяемое в соответствии с ним или иным образом согласованное сторонами;
 - (Б) применительно к Сделке опцион на акции цену за одну Аксию, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами;
 - (В) применительно к Сделке опцион на корзину индексов стоимость одной Корзины, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами;
 - (Г) применительно к Сделке опцион на корзину акций стоимость одной Корзины, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами.

2.2. Стили опционов.

- (а) **Американский опцион** означает вид Сделки опцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено в любой Плановый торговый день в течение Срока осуществления права на исполнение, состоящего из двух и более Плановых торговых дней.
- (б) **Бермудский опцион** означает вид Сделки опцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено исключительно в одну из Дат осуществления права на исполнение, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами, и в Дату истечения срока.

- (в) **Европейский опцион** означает вид Сделки опцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено только в Дату истечения срока.

2.3. Типы опционов.

- (а) **Опцион на покупку (колл)** означает тип Сделки опцион, по которому Покупатель вправе при осуществлении Права на исполнение:

- (А) по Сделке поставочный опцион получить от Продавца в собственность Акции или Корзины Акции в обмен на уплату суммы, рассчитанной исходя из Цены исполнения за Аксию или Корзину;

- (Б) по Сделке беспоставочный опцион получить от Продавца Сумму платежа, если Расчетная цена превышает Цену исполнения,

в обоих случаях с учетом того, что предусмотрено другими положениями настоящих Стандартных условий и Подтверждением.

- (б) **Опцион на продажу (пут)** означает тип Сделки опцион, по которому Покупатель вправе при осуществлении Права на исполнение:

- (А) по Сделке поставочный опцион передать Продавцу в собственность Акции или Корзины Акции в обмен на уплату суммы, рассчитанной исходя из Цены исполнения за Аксию или Корзину;

- (Б) по Сделке беспоставочный опцион получить от Продавца Сумму платежа, если Цена исполнения превышает Расчетную цену,

в обоих случаях с учетом того, что предусмотрено другими положениями настоящих Стандартных условий и Подтверждением.

2.4. Уплата Премии.

- (а) В одну или в каждую из дат, согласованных сторонами (далее — «**Дата уплаты премии**») Покупатель обязан уплатить Продавцу премию (далее — «**Премия**»), указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке. Если день, определенный в соответствии с настоящим пунктом в качестве Даты уплаты премии, не является Банковским днем для расчетов в валюте, в которой должна быть уплачена Премия, Датой уплаты премии считается ближайший следующий Банковский день для расчетов в этой валюте.

- (б) Если в Подтверждении указана Премия за Опцион, то общая сумма Премии составляет произведение Премии за Опцион и Количества опционов.

2.5. Существенные условия Сделки опцион.

- (а) Существенными условиями Сделок опцион, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки в отношении каждой из этих Сделок, являются:

- (А) Покупатель;

- (Б) Продавец;

- (В) Стиль опциона;
 - (Г) Тип опциона;
 - (Д) Базовый актив;
 - (Е) Количество опционов;
 - (Ж) Цена исполнения;
 - (З) Дата истечения срока;
 - (И) Даты осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону (применительно к Бермудскому опциону);
 - (К) размер Премии;
 - (Л) Биржа (применительно к Сделке беспоставочный опцион).
- (б) Другие условия Сделок опцион подлежат согласованию в качестве существенных условий по требованию одной из сторон.

3. Порядок осуществления Права на исполнение по Сделке опцион

3.1. Применительно к порядку осуществления Права на исполнение по Сделке опцион следующие термины имеют следующие значения:

- (а) **Время закрытия** означает время в течение Планового торгового дня, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, не позднее которого должно быть получено Требование об исполнении, а при отсутствии такого указания — Время оценки.
- (б) **Дата осуществления права на исполнение** означает Плановый торговый день в течение Срока осуществления права на исполнение, когда Право на исполнение по Сделке опцион может быть осуществлено в порядке, установленном пунктом 3.2 Стандартных условий.

Применительно к Бермудскому опциону, если Дата осуществления права на исполнение, указанная в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованная сторонами, не является Плановым торговым днем, Датой осуществления права на исполнение считается ближайший следующий Плановый торговый день. Если в день, определенный в качестве Даты осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону, до наступления Времени закрытия возникла Чрезвычайная ситуация, Датой осуществления права на исполнение считается:

- (А) ближайший следующий Плановый торговый день после окончания Чрезвычайной ситуации;
- (Б) если Чрезвычайная ситуация продолжается в течение восьми Плановых торговых дней подряд после дня, первоначально указанного в качестве Даты осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону, — восьмой Плановый торговый день, независимо от того, что Чрезвычайная ситуация продолжает иметь место.

Если, несмотря на вышеизложенное, Право на исполнение по Бермудскому опциону было осуществлено в Плановый торговый день, который был бы Датой осуществления права на исполнение, если бы не возникло Чрезвычайной ситуации, указанный день считается Датой осуществления права на исполнение для целей определения того, было ли осуществлено Право на исполнение в пределах Срока осуществления права на исполнение.

- (в) ***Срок осуществления права на исполнение*** означает:
- (А) в Американском опционе — все Плановые торговые дни с Даты начала срока до Даты истечения срока (обе даты включительно) в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия;
 - (Б) в Европейском опционе — Дату истечения срока в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия;
 - (В) в Бермудском опционе — каждую Дату осуществления права на исполнение, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами, с Даты начала срока до Даты истечения срока (обе даты включительно) в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия.
- (г) ***Требование об исполнении*** означает безотзывное требование, которое может быть составлено Покупателем по форме, установленной в приложении 19 к Стандартным условиям, или иной форме, согласованной сторонами. Требование об исполнении может быть доставлено по факсу, если стороны не договорились об ином.
- (д) ***Дата истечения срока*** означает день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, в который прекращается Право на исполнение по Сделке опцион в случае его неосуществления до Времени закрытия (а если этот день не является Плановым торговым днем, то ближайший следующий за ним Плановый торговый день) при условии, что в этот день не возникло Чрезвычайной ситуации до наступления Времени закрытия. Если в день, определенный в качестве Даты истечения срока, возникла Чрезвычайная ситуация, Датой истечения срока считается:
- (А) ближайший следующий Плановый торговый день после окончания Чрезвычайной ситуации;
 - (Б) если Чрезвычайная ситуация продолжается в течение восьми Плановых торговых дней подряд после дня, первоначально указанного в качестве Даты истечения срока, — восьмой Плановый торговый день, независимо от того, что Чрезвычайная ситуация продолжает иметь место.

3.2. Порядок осуществления Права на исполнение.

Предъявление Требования об исполнении

- (а) Если Право на исполнение не осуществляется автоматически в соответствии с пунктом 3.2(е) Стандартных условий, Покупатель осуществляет

свое Право на исполнение по Сделке опцион путем направления Продавцу Требования об исполнении в течение Срока осуществления права на исполнение.

- (б) Применительно к Американскому опциону и Бермудскому опциону, в отношении которых в соответствии с пунктом 3.2(в) Стандартных условий установлена возможность Многократного исполнения, в Требовании об исполнении Покупатель обязан указать количество Опционов, осуществляемых в соответствующую Дату осуществления права на исполнение по Сделке опцион.

Многократное исполнение

- (в) Условиями Американского опциона или Бермудского опциона может быть предусмотрена возможность многократного исполнения Сделки опцион (далее — «**Многократное исполнение**»). В этом случае Покупатель вправе осуществить все или часть неисполненных Опционов в один или более Плановых торговых дней в течение Срока осуществления права на исполнение. При этом Опционы не могут быть осуществлены в количестве ниже минимального предела (далее — «**Минимальное число**») и/или выше максимального предела (далее — «**Максимальное число**»), установленного условиями Сделки опцион. Если условиями Сделки опцион также установлен целый множитель (далее — «**Целый множитель**»), количество осуществляемых Опционов должно быть равным или кратным Целому множителю.
- (г) За исключением случаев, предусмотренных пунктом 3.2(д) Стандартных условий, при установлении ограничений, указанных в пункте 3.2(в) Стандартных условий, если в какой-либо из указанных Плановых торговых дней Покупатель предпринимает действия по осуществлению Опционов в количестве:
 - (А) превышающем Максимальное число, осуществляется Максимальное число Опционов (Опционы в количестве, превышающем Максимальное число, остаются неисполненными);
 - (Б) менее Минимального числа, Опционы не осуществляются;
 - (В) не равном или не кратном Целому множителю, Опционы осуществляются в количестве, уменьшенном до ближайшего кратного Целому множителю значения (Опционы в количестве, превышающем это значение, остаются неисполненными).
- (д) В любой из указанных Плановых торговых дней Покупатель вправе осуществить любое количество Опционов (без учета требований пунктов 3.2(г)(Б) и 3.2(г)(В) Стандартных условий), не превышающее Максимальное число, если при этом осуществляются все неисполненные Опционы. При этом в Дату истечения срока Покупатель вправе осуществить любое количество неисполненных Опционов без ограничений.

Автоматическое исполнение

- (е) Если условиями Сделки опцион предусмотрено, что Право на исполнение осуществляется автоматически, каждый неисполненный Опцион считается осуществленным автоматически:
- (А) применительно к Сделке беспоставочный опцион — во Время закрытия в Дату истечения срока, если до наступления Времени закрытия Покупатель не уведомит Продавца о том, что Опцион не подлежит автоматическому исполнению;
 - (Б) применительно к Сделке поставочный опцион — во Время закрытия в Дату истечения срока, если до наступления Времени закрытия Покупатель не уведомит Продавца о том, что Опцион не подлежит автоматическому исполнению, и по заключению Расчетного агента в указанное Время закрытия;
 - (В) по Опциону на покупку (колл):
 - (аа) Пороговая цена равна или превышает цену за Акцию, по которой любая Биржа срочных контрактов автоматически исполнила бы поставочный опцион, базовым активом которого является Акция, с ценой исполнения, эквивалентной Цене исполнения;
 - (бб) Пороговая цена превышает Цену исполнения, если опционы на Акцию не допущены к торгам ни на одной из Бирж срочных контрактов, или в Подтверждении не указано ни одной Биржи срочных контрактов;
 - (Г) по Опциону на продажу (пут):
 - (аа) Пороговая цена равна или меньше цены за Акцию, по которой любая Биржа срочных контрактов автоматически исполнила бы поставочный опцион, базовым активом которого является Акция, с ценой исполнения, эквивалентной Цене исполнения;
 - (бб) Пороговая цена меньше Цены исполнения, если опционы на Акцию не допущены к торгам ни на одной из Бирж срочных контрактов, или в Подтверждении не указано ни одной Биржи срочных контрактов.
- При этом если стороны направляют какие-либо уведомления или иные сообщения с напоминанием о наступлении срока исполнения обязательств по Сделке опцион, по которой Право на исполнение осуществляется автоматически в соответствии с настоящим пунктом, в том числе, если они направляются в форме, установленной для Требования об исполнении, такие уведомления или иные сообщения носят исключительно уведомительный характер и не направлены на возникновение, изменение или прекращение прав и обязанностей сторон по Сделке опцион.
- (ж) **Пороговая цена** означает цену за Акцию или стоимость одной Корзины, определяемую в порядке, установленном в Подтверждении или иным обра-

зом согласованном сторонами, по состоянию на Время закрытия в Дату истечения срока, а при отсутствии такого порядка:

- (А) применительно к Сделке опцион на акции — Биржевую цену Акции (в этих целях Временем оценки и Датой оценки будут Время закрытия и Дата истечения срока соответственно);
- (Б) применительно к Сделке опцион на корзину акций — сумму стоимостей, рассчитанных по состоянию на Время закрытия в Дату истечения срока в отношении Акции каждого из Эмитентов как произведение Биржевой цены Акции (в этих целях Временем оценки и Датой оценки будут Время закрытия и Дата истечения срока соответственно) и соответствующего Количества акций, включенного в Корзину.

4. СДЕЛКИ ФОРВАРД

4.1. Применительно к Сделкам форвард следующие термины имеют следующие значения:

(а) **Форвардная цена** означает:

- (А) применительно к Сделке индексный форвард значение соответствующего Индекса, указанное в Подтверждении, иным образом определяемое в соответствии с ним или иным образом согласованное сторонами;
- (Б) применительно к Сделке форвард на акции цену за Аксию, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами;
- (В) применительно к Сделке форвард на корзину индексов стоимость одной Корзины, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами;
- (Г) применительно к Сделке форвард на корзину акций стоимость одной Корзины, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами.

(б) **Минимальная форвардная цена** означает значение Индекса, цену за Аксию или стоимость одной Корзины, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке.

(в) **Максимальная форвардная цена** означает значение Индекса, цену за Аксию или стоимость одной Корзины, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке.

4.2. **Предварительная оплата по Сделке форвард.**

(а) Условиями Сделки форвард может быть предусмотрено осуществление Покупателем предварительной оплаты Базового актива (далее — «**Предварительная оплата**»). В этом случае в день, указанный в Подтвержде-

нии, иным образом определяемый в соответствии с ним или иным образом согласованный сторонами (далее — «*Дата предварительной оплаты*»), Покупатель обязан произвести в пользу Продавца Предварительную оплату в сумме, указанной в Подтверждении, иным образом определяемой в соответствии с ним или иным образом согласованной сторонами. Если в Подтверждении и ином соглашении сторон не установлены Дата предварительной оплаты и порядок ее определения, Датой предварительной оплаты будет следующий Банковский день после Даты сделки. Если день, определенный в соответствии с настоящим пунктом в качестве Даты предварительной оплаты, не является Банковским днем для расчетов в валюте, в которой должна быть произведена Предварительная оплата, Датой предварительной оплаты считается ближайший следующий Банковский день для расчетов в этой валюте.

4.3. Существенные условия Сделки форвард.

- (а) Существенными условиями Сделок форвард, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки в отношении каждой из этих Сделок, являются:
 - (А) Покупатель;
 - (Б) Продавец;
 - (В) Базовый актив;
 - (Г) применительно к Сделке форвард на акции Количество акций;
 - (Д) применительно к Сделке форвард на корзину акций Количество корзин;
 - (Е) Форвардная цена;
 - (Ж) Дата оценки;
 - (З) Биржа (применительно к Сделке беспоставочный форвард).
- (б) Другие условия Сделок форвард подлежат согласованию в качестве существенных условий по требованию одной из сторон.

5. Сделки своп

5.1. Применительно к Сделкам своп следующие термины имеют следующие значения:

- (а) **Плательщик индексируемой суммы** означает сторону или стороны, указанные в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованные сторонами применительно к Сделке.
- (б) **Получатель индексируемой суммы** означает сторону или стороны, указанные в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованные сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания и иного соглашения сторон — Получателем индексируемой суммы будет контрагент Плательщика индексируемой суммы по Сделке своп.

- (в) **Сумма первоначального платежа** означает сумму, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, подлежащую уплате стороной, применительно к которой эта сумма определена, в Дату первоначального платежа, если обмен Суммами первоначального платежа предусмотрен условиями Сделки.
- (г) **Дата первоначального платежа** означает день, указанный в этом качестве в Подтверждении, иным образом определяемый в соответствии с ним или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а если этот день не является Биржевым днем и Банковским днем, ближайший следующий Биржевой день, который одновременно является Банковским днем.
- (д) **Сумма окончательного платежа** означает сумму, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, подлежащую уплате стороной, применительно к которой эта сумма определена, в Дату окончательного платежа, если обмен Суммами окончательного платежа предусмотрен условиями Сделки.
- (е) **Дата окончательного платежа** означает день, указанный в этом качестве в Подтверждении, иным образом определяемый в соответствии с ним или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а если этот день не является Биржевым днем и Банковским днем, ближайший следующий Биржевой день, который одновременно является Банковским днем.
- (ж) **Сумма дохода** означает применительно к каждой Дате расчетов сумму, определяемую Расчетным агентом по состоянию на соответствующую ей Дату оценки по следующей формуле:

$$\text{Сумма дохода} = \frac{\text{Окончательная цена} - \text{Первоначальная цена}}{\text{Первоначальная цена}} \times \text{Множитель}$$

- (з) **Первоначальная цена** означает:
- (А) применительно к первой Дате оценки цену, указанную в этом качестве в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке;
- (Б) применительно к каждой из последующих Дат оценки Окончательную цену по состоянию на предшествующую Дату оценки.
- (и) **Окончательная цена** означает применительно к каждой Дате оценки:
- (А) по Сделке индексный своп значение Индекса, определяемое Расчетным агентом в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, по состоянию на Время оценки в Дату оценки, а при отсутствии такого порядка — значение Индекса по состоянию на Время оценки в Дату оценки;

- (Б) по Сделке своп на акции цену одной Акции, определяемую Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, а при отсутствии такого порядка — среднее арифметическое значение между максимальной ценой в заявках на покупку и минимальной ценой в заявках на продажу по данной Акции, зарегистрированных на Бирже по состоянию на Время оценки в Дату оценки (или при их отсутствии на Время оценки между последней максимальной ценой в заявках на покупку и последней минимальной ценой в заявках на продажу по данной Акции, зарегистрированных непосредственно перед наступлением Времени оценки), без учета адресных (внесистемных) заявок и совершенных на их основе сделок (переговорных сделок), а также сделок на основании заявок, поданных за счет одного участника торгов или одного клиента участника торгов (кросс-сделок), и сделок РЕПО.
- (В) применительно к Сделке своп на корзину индексов стоимость одной Корзины, определяемую Расчетным агентом в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, по состоянию на Время оценки (или каждое Время оценки) в Дату оценки, а при отсутствии такого порядка — стоимость одной Корзины, равную сумме Биржевых цен (взвешенных или скорректированных применительно к каждому Индексу в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами) Индексов, включенных в Корзину;
- (Г) применительно к Сделке своп на корзину акций стоимость одной Корзины, определяемую Расчетным агентом в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, по состоянию на Время оценки (или каждое Время оценки) в Дату оценки, а при отсутствии такого порядка — стоимость одной Корзины, равную совокупной стоимости Акции каждого из Эмитентов, рассчитанных как произведение (А) Биржевой цены такой Акции и (Б) соответствующего Количества акций, включенного в Корзину.
- (к) **Пересчет Номинальной суммы сделки.** Условия Сделки могут предусматривать пересчет Номинальной суммы сделки для каждой Даты расчетов (далее — *«Пересчет номинальной суммы сделки»*). В этом случае:
- (А) Номинальной суммой сделки для первой Даты расчетов будет сумма, указанная в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованная сторонами применительно к Сделке;
- (Б) Номинальной суммой сделки для каждой последующей Даты расчетов будет сумма (А) Номинальной суммы сделки и (Б) Индексированной суммы (в положительном или отрицательном значении), установленных применительно к предшествующей Дате расчетов.

Пересчет номинальной суммы осуществляется применительно к обязательству Плательщика индексированной суммы, при этом обязательство Получателя индексированной суммы в соответствующей части остается неизменным.

5.2. Существенные условия Сделки своп.

- (а) Существенными условиями Сделок своп, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки в отношении каждой из этих Сделок, являются:
 - (А) Плательщик индексируемой суммы;
 - (Б) Базовый актив;
 - (В) Номинальная сумма сделки;
 - (Г) Первоначальная цена;
 - (Д) применительно к Сделке своп на акции Количество акций;
 - (Е) применительно к Сделке своп на корзину акций Количество акций и Количество корзин;
 - (Ж) Дата (-ы) оценки;
 - (З) Биржа (применительно к Сделке беспоставочный своп).
- (б) Другие условия Сделок своп подлежат согласованию в качестве существенных условий по требованию одной из сторон.

6. БАРЬЕРЫ В СДЕЛКАХ

6.1. Сделка может быть совершена под отлагательным или отменительным условием, в соответствии с которым Право на исполнение, право на получение платежа или поставки либо обязанность совершить платеж или поставку в соответствии с условиями Сделки опцион, Сделки форвард или Сделки своп, если условиями Сделки не предусмотрено иное:

- (а) возникает (такое условие Сделки именуется — **«Барьерное отлагательное условие»**) или
- (б) прекращается (такое условие Сделки именуется — **«Барьерное отменительное условие»**)

у соответствующей стороны, если значение, цена или стоимость согласованного сторонами Барьерного ориентира достигла уровня Барьерной цены или преодолела его по состоянию на Контрольное время в Контрольную дату.

6.2. **Барьерная цена** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, значение, цену или стоимость, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке в целях определения наступления Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

6.3. **Барьерный ориентир** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, индекс, акцию, иную ценную бумагу или корзину, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания и иного соглашения сторон — Индекс, Акцию или Корзину по этой Сделке.

6.4. **Контрольная дата** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, каждый Плановый торговый день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, если в этот день не возникло Чрезвычайной ситуации до наступления Контрольного времени. Если в день, указанный в качестве Контрольной даты, возникла Чрезвычайная ситуация, Контрольной датой считается:

- (а) ближайший следующий Плановый торговый день после окончания Чрезвычайной ситуации;
- (б) если Чрезвычайная ситуация продолжается в течение восьми Плановых торговых дней подряд после дня, первоначально указанного в качестве Контрольной даты, — восьмой Плановый торговый день независимо от того, что Чрезвычайная ситуация продолжает иметь место. При этом Расчетный агент определяет значение Барьерного ориентира в порядке, установленном пунктом 7.5(а)(Б), 7.5(б) или 7.5(в) Стандартных условий.

Если в Подтверждении не указано Контрольных дат, Контрольной датой является каждый из Плановых торговых дней в течение периода начиная с Даты сделки (включительно) по (включая) последнюю Дату оценки, Дату истечения срока или в случае их отсутствия день, предшествующий последней Дате расчетов по Сделке на один Расчетный цикл (с учетом положений пунктов 3.1(д) и 7.5 Стандартных условий о переносе срока, если применимо).

6.5. **Контрольное время** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием:

- (а) время дня в Контрольную дату, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке;
- (б) при отсутствии такого указания и иного соглашения сторон — Время оценки, указанное в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке;
- (в) при отсутствии в Подтверждении и ином соглашении сторон Времени оценки — Время закрытия торгов на соответствующей бирже в отношении Барьерного ориентира в Контрольную дату;
- (г) если такая биржа закрывается до наступления Времени закрытия торгов — фактическое время закрытия торгов в режиме основных торгов.

6.6. Если условиями Сделки предусмотрены Барьерный ориентир, который также является Индексом, Акцией или Корзиной по этой Сделке, и Барьерная цена, то Барьерное отлагательное условие или Барьерное отменительное условие считается наступившим, если на Контрольное время в Контрольную дату:

- (а) значение, цена или стоимость Барьерного ориентира равна или превышает Барьерную цену, если на Дату сделки Барьерная цена превышала Первоначальную цену, Цену исполнения, Форвардную цену или иной установленный условиями Сделки первоначальный ориентир;

(б) значение, цена или стоимость Барьерного ориентира равна или меньше Барьерной цены, если на Дату сделки Барьерная цена была меньше Первоначальной цены, Цены исполнения, Форвардной цены или иного установленного условиями Сделки первоначального ориентира.

6.7. Существенными условиями Сделки, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки помимо существенных условий соответствующего вида Сделок, предусмотренных Стандартными условиями, являются:

(а) Тип условия о барьере (отлагательное или отменительное);

(б) Барьерный ориентир (если отличается от Базового актива);

(в) Барьерная цена.

6.8. В случае возникновения у сторон разногласий по вопросу о наступлении Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия Расчетный агент определяет, наступило ли соответствующее условие.

7. ОЦЕНКА

7.1. **Время оценки** означает время в течение Даты оценки, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания и иного соглашения сторон — Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки применительно к каждому Индексу или Акции, значение или стоимость которых подлежит определению или оценке. Если Биржа закрывается раньше Времени закрытия торгов, и указанное в Подтверждении либо иным образом согласованное сторонами Время оценки наступает по окончании проведения торгов в режиме основных торгов, Временем закрытия будет фактическое время закрытия Биржи.

7.2. **Дата оценки** означает:

(а) применительно к Сделке опцион каждую Дату осуществления права на исполнение;

(б) применительно к Сделке форвард или Сделке своп каждый день, указанный в этом качестве в Подтверждении, иным образом определяемый в соответствии с ним или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а если этот день не является Плановым торговым днем, — ближайший следующий Плановый торговый день,

в каждом случае с учетом пункта 7.5 Стандартных условий.

7.3. **Общие положения о Чрезвычайных ситуациях.** Если применительно к Акции или Индексу наступает или имеет место одно из событий, указанных в подпунктах (а)–(в) настоящего пункта 7.3, с учетом подпунктов (г) и (д) настоящего пункта 7.3 (далее каждое из таких событий — «*Чрезвычайная ситуация*»), к Сделке применяются последствия, установленные пунктом 7.5 Стандартных условий:

- (а) **Сбой в проведении торгов** означает любое приостановление или ограничение торгов:
- (А) Акцией на Бирже или применительно к Срочной сделке на индекс либо Срочной сделке на корзину индексов акциями, доля которых при расчете Индекса составляет двадцать и более процентов, на соответствующей Бирже или Биржах;
 - (Б) фьючерсными, опционными или иными срочными договорами (контрактами), базовым активом которых является Акция или Индекс, на соответствующей Бирже срочных контрактов —
вводимое Биржей, Биржей срочных контрактов или иным образом по причине изменения цен, превышающего лимиты, установленные Биржей или Биржей срочных контрактов, либо по другой причине.
- (б) **Сбой в работе биржи** означает:
- (А) любое событие, не являющееся Внеплановым закрытием, которое по заключению Расчетного агента нарушает или затрудняет возможность участников рынка в целом:
 - (аа) заключать сделки (или получать данные о котировках) с Акциями на Бирже или применительно к Срочной сделке на индекс либо Срочной сделке на корзину индексов акциями, доля которых при расчете Индекса составляет двадцать и более процентов, на соответствующей Бирже или Биржах;
 - (бб) заключать сделки (или получать данные о котировках) с фьючерсными, опционными или иными срочными договорами (контрактами), базовым активом которых является Акция или Индекс, на соответствующей Бирже срочных контрактов;
 - (Б) случаи, когда Биржа или Биржа срочных контрактов не открывается для проведения торгов в режиме основных торгов в Плановый торговый день.
- (в) **Внеплановое закрытие** означает закрытие Биржи (или применительно к Срочной сделке на индекс или Срочной сделке на корзину индексов любой Биржи или Бирж, на которых проводятся торги акциями, доля которых при расчете Индекса, составляет двадцать и более процентов) или Биржи срочных контрактов (Бирж срочных контрактов) в какой-либо Биржевой день до наступления Времени закрытия торгов, кроме случаев, когда Биржа (Биржи) или Биржа срочных контрактов (Биржи срочных контрактов) объявляет о таком досрочном закрытии не менее чем за один час до (в зависимости от того, что наступит раньше):
- (А) фактического закрытия торгов в режиме основных торгов на этой Бирже (Биржах) или Бирже срочных контрактов (Биржах срочных контрактов) в этот Биржевой день;
 - (Б) срока завершения подачи заявок для их регистрации в системе Биржи или Биржи срочных контрактов в целях их исполнения во Время оценки в этот Биржевой день.

- (г) Сбой в проведении торгов или Сбой в работе биржи (кроме указанного в подпункте (Б) настоящего пункта 7.3(б)) является Чрезвычайной ситуацией, если он происходит не ранее одного часа до наступления Времени оценки, Времени закрытия, Контрольного времени и является по заключению Расчетного агента существенным.
- (д) В целях определения того, имеет ли место Чрезвычайная ситуация применительно к Индексу, если Чрезвычайная ситуация возникает в отношении любой из акций, на основе сделок с которыми рассчитывается Индекс, соответствующая, выраженная в процентах, доля этой акции в значении Индекса определяется путем сопоставления (i) размера той части значения Индекса, которая относится к этой акции, и (ii) общего значения Индекса, в каждом случае на момент времени, непосредственно предшествующий возникновению Чрезвычайной ситуации.

7.4. **Первоначальная дата оценки** означает любой день, который, если бы не возникла Чрезвычайная ситуация, был бы Датой оценки (не принимая во внимание для целей настоящего пункта перенос Даты осуществления права на исполнение или Даты истечения срока по причине возникновения Чрезвычайной ситуации, при условии, что первоначальная Дата осуществления права на исполнение или Дата истечения срока была бы Датой оценки).

7.5. **Последствия возникновения Чрезвычайной ситуации.** Если Чрезвычайная ситуация возникает или имеет место в Дату оценки:

- (а) применительно к Срочной сделке на индекс или Срочной сделке на акции Датой оценки считается:
 - (А) ближайший следующий Плановый торговый день после окончания Чрезвычайной ситуации;
 - (Б) если Чрезвычайная ситуация продолжается в течение восьми Плановых торговых дней подряд после Первоначальной даты оценки — восьмой Плановый торговый день, независимо от того, что Чрезвычайная ситуация продолжает иметь место;
при этом Расчетный агент определяет:
 - (аа) применительно к Срочной сделке на индекс значение Индекса по состоянию на Время оценки в этот восьмой Плановый торговый день, используя формулу и метод расчета Индекса, применявшиеся непосредственно перед возникновением Чрезвычайной ситуации, на основании котировок или цен каждой из акций, на основе сделок с которыми рассчитывается Индекс, на торгах Биржи во Время оценки в этот восьмой Плановый торговый день (если Чрезвычайная ситуация затронула одну или более таких акций, Расчетный агент определяет стоимость такой акции или акций по состоянию на Время оценки в этот восьмой Плановый торговый день, исходя из своей добросовестной оценки);
 - (бб) применительно к Срочной сделке на акции стоимость Акции по состоянию на Время оценки в этот восьмой Плановый торговый день, исходя из своей добросовестной оценки;

(б) применительно к Срочной сделке на корзину индексов Датой оценки считается:

(А) для Индекса, не затронутого Чрезвычайной ситуацией, Первоначальная дата оценки;

(Б) для Индекса, затронутого Чрезвычайной ситуацией:

(аа) ближайший следующий Плановый торговый день после окончания Чрезвычайной ситуации;

(бб) если Чрезвычайная ситуация продолжается в течение восьми Плановых торговых дней подряд после Первоначальной даты оценки — восьмой Плановый торговый день, независимо от того, что Чрезвычайная ситуация продолжает иметь место;

при этом Расчетный агент определяет значение этого Индекса по состоянию на Время оценки в этот восьмой Плановый торговый день, используя формулу и метод расчета Индекса, применявшиеся непосредственно перед возникновением Чрезвычайной ситуации, на основании котировок или цен каждой из акций, на основе сделок с которыми рассчитывается Индекс, на торгах Биржи во Время оценки в этот восьмой Плановый торговый день (если Чрезвычайная ситуация затронула одну или более таких акций, Расчетный агент определяет стоимость такой акции или акций по состоянию на Время оценки в этот восьмой Плановый торговый день, исходя из своей добросовестной оценки);

(в) применительно к Срочной сделке на корзину акций Датой оценки считается:

(А) для Акции, не затронутой Чрезвычайной ситуацией, Первоначальная дата оценки;

(Б) для Акции, затронутой Чрезвычайной ситуацией:

(аа) ближайший следующий Плановый торговый день после окончания Чрезвычайной ситуации;

(бб) если Чрезвычайная ситуация продолжается в течение восьми Плановых торговых дней после Первоначальной даты оценки — восьмой Плановый торговый день, независимо от того, что Чрезвычайная ситуация продолжает иметь место. При этом Расчетный агент определяет стоимость Акции по состоянию на Время оценки в этот восьмой Плановый торговый день, исходя из своей добросовестной оценки.

7.6. **Оценка стоимости фьючерса.** Условия Срочной сделки на индекс могут предусматривать оценку стоимости фьючерса (далее — «*Оценка стоимости фьючерса*») применительно к Индексу. В этом случае применяются следующие правила оценки Индекса в Дату оценки независимо от того, что предусмотрено другими положениями настоящих Стандартных условий.

(а) Применительно только к настоящему пункту Датой оценки будет считаться день, в который публикуется Официальная цена, независимо от того, имеет

ли место в этот день Чрезвычайная ситуация (кроме случаев, указанных в пункте 7.6(д) Стандартных условий).

- (б) **Дополнительные определения для Оценки стоимости фьючерса.**
- (А) **Биржевой контракт** означает применительно к Индексу срочный договор (контракт), заключаемый на торгах, организуемых биржей, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Индексу. В этих целях стороны указывают фьючерсный, опционный или иной срочный договор (контракт) со ссылкой на:
- (аа) Индекс, к которому он относится;
 - (бб) месяц поставки по этому срочному договору (контракту);
 - (вв) биржу, к торгам на которой допущен этот срочный договор (контракт).
- (Б) **Официальная цена** означает официальную цену (независимо от наименования этой цены во внутренних документах Биржи или ее клиринговой организации) соответствующего Биржевого контракта, опубликованную Биржей или ее клиринговой организацией.
- (в) **Расчетная цена и Окончательная цена.** В целях определения в Дату оценки Расчетной цены или Окончательной цены:
- (А) применительно к Срочной сделке на индекс Расчетной ценой или Окончательной ценой будет Официальная цена в эту Дату оценки;
- (Б) применительно к Срочной сделке на корзину индексов Расчетная цена или Окончательная цена определяются в порядке, установленном в Стандартных условиях, с учетом того, что в отношении каждого Индекса, к которому применяется Оценка стоимости фьючерса, Биржевой ценой будет Официальная цена (взвешенная или скорректированная по отношению к этому Индексу в соответствии с Подтверждением) в эту Дату оценки.
- (г) **Корректировка условий Биржевого контракта.** С учетом пунктов 12.1–12.2 Стандартных условий, положения которых имеют преимущественную силу, в случае корректировки Биржей условий Биржевого контракта Расчетный агент при необходимости корректирует одно или более следующих условий: Цена исполнения, Количество опционов, Первоначальная цена, Форвардная цена, Минимальная форвардная цена, Максимальная форвардная цена, Барьерная цена и/или иная переменная, имеющая отношение к условиям расчетов по Сделке — с целью обеспечить каждой из сторон получение экономического эквивалента одного или более платежей (если соблюдены все отлагательные условия) от другой стороны по Сделке, подлежащих уплате после вступления в силу указанных изменений.
- (д) **Отсутствие или прекращение торгов Биржевыми контрактами.** В случае отсутствия Официальной цены по причине того, что торги Биржевым

контрактом никогда не проводились либо прекращены на постоянной основе в любой момент времени до или в Дату оценки, Официальной ценой для этой Даты оценки будет являться значение соответствующего Индекса по состоянию на момент закрытия торгов в режиме основных торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

В случае применения настоящего пункта Датой истечения срока применительно к Сделке опцион или соответствующей Датой оценки применительно к Сделке форвард или Сделке своп будет считаться день, в который (если бы начались торги с Биржевым контрактом, и они не были бы прекращены на постоянной основе) была бы опубликована Официальная цена, за исключением случая, когда в этот день имеет место Чрезвычайная ситуация, и подлежит применению пункт 3.1(д) или 7.5 Стандартных условий).

- (е) **Внесение исправлений в Официальную цену.** В случае внесения исправлений в Официальную цену и опубликования соответствующей биржей результатов исправления Официальной цены в течение одного Расчетного цикла по соответствующему Биржевому контракту после первоначальной публикации, любая из сторон вправе уведомить другую сторону о внесении таких исправлений, а Расчетный агент обязан определить сумму, подлежащую уплате в результате внесения исправлений Официальной цены, и при необходимости скорректировать условия Сделки с тем, чтобы учесть указанные исправления Официальной цены.

8. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ РАСЧЕТОВ

- 8.1. **Выбор способа расчетов.** Условия Сделки могут предусматривать право одной из сторон выбрать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки (далее — **«Выбор способа расчетов»**). В этом случае сторона, наделенная правом выбора (а при отсутствии указания на такую сторону — Покупатель или Получатель индексируемой суммы), обязана направить другой стороне безотзывное уведомление о выбранном ею применительно к Сделке способе расчетов.

Указанное в настоящем пункте уведомление должно быть направлено не позднее Даты выбора способа расчетов (включительно).

Если уведомление о Выборе способа расчетов не направлено в соответствии с настоящим пунктом, расчеты по Сделке осуществляются в соответствии со способом расчетов по умолчанию (далее — **«Способ расчетов по умолчанию»**), указанным в Подтверждении или иным образом согласованным сторонами применительно к Сделке. При отсутствии такого указания:

- (а) расчеты по Срочной сделке на индекс или по Сделке своп осуществляются в порядке, установленном для Беспоставочной сделки;
- (б) расчеты по Сделке форвард на акции или Сделке форвард на корзину акций осуществляются в порядке, установленном для Поставочной сделки.

Применительно к Сделке опцион на акции и Сделке опцион на корзину акций
Способ расчетов по умолчанию указывается в Подтверждении.

8.2. **Дата выбора способа расчетов** означает день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а если этот день не является Плановым торговым днем, ближайший следующий Плановый торговый день.

8.3. **Расчетная цена** означает применительно к Дате оценки:

(а) применительно к Сделке беспоставочный опцион на акции или Сделке форвард на акции — цену одной Акции, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, а при отсутствии такого порядка — Биржевую цену Акции;

(б) применительно к Сделке беспоставочный опцион на корзину акций или Сделке форвард на корзину акций — стоимость одной Корзины, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки (или каждое Время оценки) в Дату оценки в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, а при отсутствии такого порядка — стоимость одной Корзины, равную суммарной стоимости Акции, включенных в Корзину. При этом стоимость Акции каждого из Эмитентов рассчитывается как произведение (i) Биржевой цены такой Акции и (ii) соответствующего Количества акций в Корзине;

(в) применительно к Сделке поставочный опцион на акции или Сделке поставочный опцион на корзину акций — Цену исполнения;

(г) применительно к Сделке индексный опцион или Сделке индексный форвард — значение Индекса, определенное Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, а при отсутствии такого порядка — значение Индекса по состоянию на Время оценки в Дату оценки;

(д) применительно к Сделке опцион на корзину индексов или Сделке форвард на корзину индексов — стоимость одной Корзины, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, а при отсутствии такого порядка — стоимость одной Корзины, равную сумме Биржевых цен (взвешенных или скорректированных применительно к каждому Индексу в порядке, установленном в Подтверждении) Индексов, включенных в Корзину.

8.4. **Дата расчетов** означает:

(а) применительно к Беспоставочным сделкам любой день, указанный в этом качестве в Подтверждении, иным образом определяемый в соответствии с ним или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания в Подтверждении и иного соглашения сто-

рон — день, наступающий через один Расчетный цикл после Даты оценки. Если день, определенный в соответствии с настоящим пунктом в качестве Даты расчетов, не является Банковским днем, Датой расчетов считается ближайший следующий Банковский день.

Применительно к Срочной сделке на корзину индексов или Срочной сделке на корзину акций, если в результате наступления Чрезвычайной ситуации возникло более одной Даты оценки по отношению к Индексам или Акциям, включенным в Корзину, Дата расчетов определяется путем отсчета от последней наступившей Даты оценки.

(б) применительно к Поставочным сделкам:

(А) применительно к Акциям, подлежащим поставке по Сделке опцион, день, наступающий через один Расчетный цикл после соответствующей Даты осуществления права на исполнение (или, если этот день не является Клиринговым днем, ближайший следующий Клиринговый день);

(Б) применительно к Акциям, подлежащим поставке по Сделке форвард или Сделке своп, день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания в Подтверждении и иного соглашения сторон — день, наступающий через один Расчетный цикл после Даты оценки (или, если этот день не является Клиринговым днем, ближайший следующий Клиринговый день);

(В) если Акции не могут быть поставлены в день, указанный в пункте 8.4(б)(А) или 8.4(б)(Б) Стандартных условий, по причине наступления События, препятствующего проведению расчетов, Датой расчетов считается ближайший следующий день, когда поставка Акции через согласованную Клиринговую организацию становится возможной;

(Г) если Акции не могут быть поставлены по причине наступления События, препятствующего проведению расчетов, в течение восьми Клиринговых дней, следующих после дня, который первоначально должен был быть Датой расчетов:

(аа) если Акции могут быть поставлены иным разумным способом, Дата расчетов наступает в первый день, когда расчеты по продаже Акции, совершенной в такой восьмой Клиринговый день, обычно проводятся с использованием такого разумного способа поставки (и такой способ признается поставкой Акции через согласованную Клиринговую организацию);

(бб) если Акции не могут быть поставлены иным разумным способом, Дата расчетов признается отложенной до дня, когда поставка через согласованную Клиринговую организацию или иным разумным способом станет возможной;

(Д) применительно к Срочной сделке на корзину акций, если некоторые (но не все) Акции из включенных в Корзину Акции не могут быть постав-

лены по причине наступления События, препятствующего проведению расчетов:

- (аа) Дата расчетов в отношении Акции, затронутых Событием, препятствующим проведению расчетов, определяется в соответствии с подпунктами (В) и (Г) настоящего пункта 8.4(б);
- (бб) Акции, не затронутые Событием, препятствующим проведению расчетов, подлежат поставке в первоначально согласованную Дату расчетов;
- (вв) если в Дату расчетов поставлены не все Акции, включенные в Корзину, Расчетный агент определяет по своему усмотрению размер пропорционально изменяющегося платежа, причитающегося от другой стороны в оплату такой неполной поставки.

8.5. Если условиями Сделки не предусмотрен способ расчетов (по Поставочной сделке или по Беспоставочной сделке):

- (а) расчеты по Сделке опцион на акции, Сделке опцион на корзину акций, Сделке форвард на акции и Сделке форвард на корзину акций осуществляются в порядке, установленном для Поставочной сделки;
- (б) расчеты по Срочной сделке на индекс или по Сделке своп осуществляются в порядке, установленном для Беспоставочной сделки.

9. РАСЧЕТЫ ПО БЕСПОСТАВОЧНОЙ СДЕЛКЕ

9.1. **Сумма платежа** означает, если иное не предусмотрено Подтверждением или иным образом не согласовано сторонами применительно к Сделке, применительно к каждой Дате оценки:

- (а) в Сделке индексный опцион или Сделке опцион на корзину индексов — сумму, равную произведению количества Опционов, осуществленных в соответствующую Дату осуществления права на исполнение, Дифференциала цены исполнения, одной единицы Валюты платежа и Множителя;

$$\text{Сумма платежа} = \text{количество осуществленных Опционов} \times \text{Дифференциал цены исполнения} \times \text{одна единица Валюты платежа} \times \text{Множитель}$$

- (б) в Сделке опцион на акции или Сделке опцион на корзину акций — сумму, равную произведению количества Опционов, осуществленных в соответствующую Дату осуществления права на исполнение, Предмета опциона и Дифференциала цены исполнения.

$$\text{Сумма платежа} = \text{количество осуществленных Опционов} \times \text{Предмет опциона} \times \text{Дифференциал цены исполнения}$$

- (в) в Сделке индексный форвард или Сделке форвард на корзину индексов, к которым не применимо условие о Предварительной оплате — сумму, равную произведению разности Расчетной цены и Форвардной цены, одной единицы Валюты платежа и Множителя;

$$\text{Сумма платежа} = \left(\begin{array}{c} \text{Расчетная} \\ \text{цена} \end{array} - \begin{array}{c} \text{Форвардная} \\ \text{цена} \end{array} \right) \times \begin{array}{c} \text{одна единица} \\ \text{Валюты} \\ \text{платежа} \end{array} \times \text{Множитель}$$

- (г) в Сделке индексный форвард или Сделке форвард на корзину индексов, к которым применимо условие о Предварительной оплате — сумму, равную произведению Расчетной цены, одной единицы Валюты платежа и Множителя;

$$\text{Сумма платежа} = \begin{array}{c} \text{Расчетная} \\ \text{цена} \end{array} \times \begin{array}{c} \text{одна единица} \\ \text{Валюты платежа} \end{array} \times \text{Множитель}$$

- (д) в Сделке форвард на акции или Сделке форвард на корзину акций, к которым не применимы условия о Предварительной оплате и о Переменной сумме обязательства, — сумму, равную произведению Количества акций или Количества корзин и разности Расчетной цены и Форвардной цены;

$$\text{Сумма платежа} = \begin{array}{c} \text{Количество акций} \\ \text{или Количество} \\ \text{корзин} \end{array} \times \left(\begin{array}{c} \text{Расчетная} \\ \text{цена} \end{array} - \begin{array}{c} \text{Форвардная} \\ \text{цена} \end{array} \right)$$

- (е) в Сделке форвард на акции или Сделке форвард на корзину акций, к которым применимо условие о Предварительной оплате и не применимо условие о Переменной сумме обязательства, — сумму, равную произведению Количества акций или Количества корзин и Расчетной цены;

$$\text{Сумма платежа} = \begin{array}{c} \text{Количество акций} \\ \text{или Количество} \\ \text{корзин} \end{array} \times \begin{array}{c} \text{Расчетная} \\ \text{цена} \end{array}$$

- (ж) в Сделке форвард на акции или Сделке форвард на корзину акций, к которым не применимо условие о Предварительной оплате и применимо условие о Переменной сумме обязательства, — сумму, равную произведению Количества акций или Количества корзин и:

(А) разности Расчетной цены и Минимальной форвардной цены, если Расчетная цена меньше или равна Минимальной форвардной цене;

(Б) ноля, если Расчетная цена больше Минимальной форвардной цены, но меньше или равна Максимальной форвардной цене;

(В) разности Расчетной цены и Максимальной форвардной цены, если Расчетная цена больше Максимальной форвардной цены;

- (з) в Сделке форвард на акции или Сделке форвард на корзину акций, к которым применимы оба условия о Предварительной оплате и о Переменной

сумме обязательства, — сумму, равную произведению Количества акций, подлежащих поставке, или Количества корзин, подлежащих поставке, без округления и Расчетной цены.

$$\begin{array}{rcccl} & & \text{Количество акций,} & & \\ & & \text{подлежащих поставке,} & & \\ \text{Сумма} & = & & \times & \text{Расчетная} \\ \text{платежа} & & \text{или} & & \text{цена} \\ & & \text{Количество корзин,} & & \\ & & \text{подлежащих поставке} & & \end{array}$$

9.2. **Дифференциал цены исполнения** означает, если иное не предусмотрено Подтверждением или иным образом не согласовано сторонами применительно к Сделке, применительно к каждой Дате оценки сумму, равную разности:

- (а) по Опциону на покупку (колл) Расчетной цены и Цены исполнения;
- (б) по Опциону на продажу (пут) Цены исполнения и Расчетной цены;

в случае если полученная разность имеет отрицательное значение, Дифференциал цены исполнения считается равным нулю.

Расчеты по Сделке беспоставочный опцион

9.3. По Сделке беспоставочный опцион применительно к каждой Дате осуществления права на исполнение Продавец обязан уплатить Покупателю Сумму платежа в каждую соответствующую Дату расчетов по всем Опционам, осуществленным в эту Дату осуществления права на исполнение.

Расчеты по Сделке беспоставочный форвард

9.4. По Сделке беспоставочный форвард применительно к каждой Дате расчетов:

- (а) если условие о Предварительной оплате не применимо:
 - (А) если Сумма платежа имеет положительное значение, Продавец обязан уплатить Покупателю Сумму платежа в соответствующую Дату расчетов;
 - (Б) если Сумма платежа имеет отрицательное значение, Покупатель обязан уплатить Продавцу абсолютную величину Суммы платежа в соответствующую Дату расчетов;
- (б) если условие о Предварительной оплате применимо, Продавец обязан уплатить Покупателю Сумму платежа и Сумму внеочередных дивидендов в соответствующую Дату расчетов.

Расчеты по Сделке беспоставочный своп

9.5. **Индексированная сумма** означает применительно к каждой Дате расчетов и Плательщику индексированной суммы сумму, определяемую Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в соответствующую ей Дату оценки, равную произведению Номинальной суммы сделки и Суммы дохода.

9.6. По Сделке беспоставочный своп применительно к каждой Дате расчетов, установленной для Плательщика индексируемой суммы:

- (а) если стороны выбрали «Индексирование к цене» как «Метод индексирования»:
 - (А) если Индексируемая сумма, определенная Расчетным агентом применительно к Плательщику индексируемой суммы, имеет положительное значение, Плательщик индексируемой суммы обязан уплатить Получателю индексируемой суммы (в дополнение к другим суммам, уплачиваемым этим Плательщиком индексируемой суммы) Индексируемую сумму в соответствующую Дату расчетов;
 - (Б) если Индексируемая сумма, определенная Расчетным агентом применительно к Плательщику индексируемой суммы, имеет отрицательное значение, Получатель индексируемой суммы обязан уплатить Плательщику индексируемой суммы (в дополнение к другим суммам, уплачиваемым этим Получателем индексируемой суммы) абсолютную величину Индексируемой суммы в соответствующую Дату расчетов;
- (б) если стороны выбрали «Индексирование к совокупному результату» как «Метод индексирования», и условие о Капитализации дивидендов не применимо, применяются положения пункта 9.6(а) Стандартных условий, как если бы «Индексирование к цене» было выбрано сторонами как «Метод индексирования», и в каждую Дату выплаты дивидендов соответствующей Плательщик индексируемой суммы обязан уплатить Получателю индексируемой суммы соответствующую Сумму дивидендов (при ее наличии), причитающуюся с этого Плательщика индексируемой суммы в эту Дату выплаты дивидендов;
- (в) если стороны выбрали «Индексирование к совокупному результату» как «Метод индексирования», и условие о Капитализации дивидендов применимо, применяются положения пункта 9.6(а) Стандартных условий, как если бы «Индексирование к цене» было выбрано сторонами как «Метод индексирования», при условии, что для целей определения соответствующей Индексируемой суммы для каждой следующей Даты расчетов Расчетный агент обязан производить корректировку в соответствии с пунктом 11.4 Стандартных условий.

10. РАСЧЕТЫ ПО ПОСТАВОЧНОЙ СДЕЛКЕ

Расчеты по Сделке поставочный опцион

10.1. По Сделке поставочный опцион применительно к каждой Дате осуществления права на исполнение в соответствующую Дату расчетов:

- (а) по Опциону на покупку (колл) Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, равную произведению Расчетной цены и Количества акций, подлежащих поставке (без округления), или Количества корзин, подлежащих поставке

(без округления), а Продавец обязан передать Покупателю в собственность Количество акций, подлежащих поставке, или Количество корзин, подлежащих поставке, соответственно и уплатить Стоимость дробной части акций (при ее наличии);

- (б) по Опциону на продажу (пут) Покупатель обязан передать Продавцу в собственность Количество акций, подлежащих поставке, или Количество корзин, подлежащих поставке, и уплатить Стоимость дробной части акций (при ее наличии), а Продавец обязан уплатить Покупателю сумму, равную произведению Расчетной цены и Количества акций, подлежащих поставке (без округления), или Количества корзин, подлежащих поставке (без округления);

при этом любые из указанных в настоящем пункте 10.1 платежей или поставок должны осуществляться в соответствующую Дату расчетов на счета, указанные в Подтверждении.

Расчеты по Сделке поставочный форвард

10.2. По Сделке поставочный форвард в соответствующую Дату расчетов:

- (а) применительно к Сделке форвард на акции:
 - (А) если условия о Предварительной оплате и о Переменной сумме обязательства не применимы, Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, равную произведению Форвардной цены и Количества акций, а Продавец обязан передать Покупателю в собственность Количество акций;
 - (Б) если условие о Предварительной оплате не применимо, а условие о Переменной сумме обязательства применимо, Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, равную произведению Минимальной форвардной цены и Количества акций, а Продавец обязан передать Покупателю в собственность Количество акций, подлежащих поставке, и уплатить Стоимость дробной части акций (при ее наличии);
 - (В) если условие о Предварительной оплате применимо, а условие о Переменной сумме обязательства не применимо, Продавец обязан передать Покупателю в собственность Количество акций, и уплатить Сумму внеочередных дивидендов (при ее наличии);
 - (Г) если условия о Предварительной оплате и о Переменной сумме обязательства применимы, Продавец обязан передать Покупателю в собственность Количество акций, подлежащих поставке, и уплатить Сумму внеочередных дивидендов и Стоимость дробной части акций (при их наличии);
- (б) применительно к Сделке форвард на корзину акций:
 - (А) если условия о Предварительной оплате и о Переменной сумме обязательства не применимы, Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, равную произведению Форвардной цены и Количества корзин, а Про-

давец применительно к каждому Эмитенту, Акции которого включены в Корзину, обязан передать Покупателю в собственность Количество акций такого Эмитента, умноженное на Количество корзин;

- (Б) если условие о Предварительной оплате не применимо, а условие о Переменной сумме обязательства применимо, Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, равную произведению Минимальной форвардной цены и Количества корзин, а Продавец применительно к каждому Эмитенту, Акции которого включены в Корзину, обязан передать Покупателю в собственность Количество акций такого Эмитента, умноженное на Количество корзин, подлежащих поставке (округленное в порядке, установленном пунктом 10.5 Стандартных условий), и уплатить Стоимость дробной части акций (при ее наличии);
- (В) если условие о Предварительной оплате применимо, а условие о Переменной сумме обязательства не применимо, Продавец применительно к каждому Эмитенту, Акции которого включены в Корзину, обязан передать Покупателю в собственность Количество акций такого Эмитента, умноженное на Количество корзин, и уплатить Сумму внеочередных дивидендов (при ее наличии);
- (Г) если условия о Предварительной оплате и о Переменной сумме обязательства применимы, Продавец применительно к каждому Эмитенту, Акции которого включены в Корзину, обязан передать Покупателю в собственность Количество акций такого Эмитента, умноженное на Количество корзин, подлежащих поставке (округленное в порядке, установленном пунктом 10.5 Стандартных условий), и уплатить Сумму внеочередных дивидендов и Стоимость дробной части акций (при их наличии).

При этом любые из указанных в настоящем пункте платежей или поставок должны осуществляться на счета, указанные в Подтверждении.

Расчеты по Сделке поставочный своп

- 10.3. По Сделке поставочный своп в Дату расчетов, установленную для Плательщика индексируемой суммы, Плательщик индексируемой суммы обязан передать Получателю индексируемой суммы в собственность Количество акций или Количество корзин, а Получатель индексируемой суммы обязан уплатить Продавцу индексируемой суммы Номинальную сумму сделки.

Указанные платежи и поставка должны осуществляться в соответствующую Дату расчетов на счета, указанные в Подтверждении.

Определения терминов применительно к расчетам по Поставочной сделке

- 10.4. **Количество акций, подлежащих поставке**, означает количество Акции, рассчитываемое в следующем порядке:
- (а) применительно к Дате осуществления права на исполнение по Сделке опцион на акции — количество Акции, равное произведению количества

Опционов, осуществленных в эту Дату осуществления права на исполнение, и Предмета опциона;

- (б) по Сделке форвард на акции, к которой применимо условие о Переменной сумме обязательства:

(А) если Расчетная цена меньше или равна Минимальной форвардной цене — Количество акций;

(Б) если Расчетная цена больше Минимальной форвардной цены, но меньше или равна Максимальной форвардной цене — количество Акций, равное:

$$\frac{\text{Минимальная форвардная цена}}{\text{Расчетная цена}} \times \text{Количество акций}$$

(В) если Расчетная цена больше Максимальной форвардной цены, количество Акций, равное:

$$\frac{\text{Минимальная форвардная цена} + (\text{Расчетная цена} - \text{Максимальная форвардная цена})}{\text{Расчетная цена}} \times \text{Количество акций}$$

Количество акций, подлежащих поставке, должно включать только целые Акции. Если количество Акций, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом, включает дробную часть, вместо поставки Акций, составляющих дробную часть, соответствующая сторона обязана уплатить Стоимость дробной части акций.

10.5. Количество корзин, подлежащих поставке, означает:

- (а) применительно к Дате осуществления права на исполнение по Сделке опцион на корзину акций — количество Корзин, равное произведению количества Опционов, осуществленных в эту Дату осуществления права на исполнение, и Предмета опциона;

- (б) по Сделке форвард на корзину акций, к которой применимо условие о Переменной сумме обязательства:

(А) если Расчетная цена меньше или равна Минимальной форвардной цене — Количество корзин;

(Б) если Расчетная цена больше Минимальной форвардной цены, но меньше или равна Максимальной форвардной цене — количество Корзин, равное:

$$\frac{\text{Минимальная форвардная цена}}{\text{Расчетная цена}} \times \text{Количество корзин}$$

(В) если Расчетная цена больше Максимальной форвардной цены, количество Корзин, равное:

$$\frac{\text{Минимальная форвардная цена} + (\text{Расчетная цена} - \text{Максимальная форвардная цена})}{\text{Расчетная цена}} \times \text{Количество корзин}$$

Применительно к Эмитенту, Акции которого включены в Корзину, общее количество Акций этого Эмитента, подлежащих поставке, должно включать только целые Акции. Если общее количество Акций такого Эмитента, рассчитанное как произведение соответствующего Количества акций и Количества корзин, подлежащих поставке, включает дробную часть, вместо поставки Акций, составляющих дробную часть, соответствующая сторона обязана уплатить Стоимость дробной части акций.

- 10.6. **Стоимость дробной части акций** означает сумму в Валюте платежа, представляющую дробную часть Акции, полученную при расчете Количества акций, подлежащих поставке, или Количества корзин, подлежащих поставке, определенного Расчетным агентом, умноженную на:
- (а) применительно к Сделке опцион на акции или Сделке опцион на корзину акций — Расчетную цену соответствующей Акции в Дату осуществления права на исполнение (определенную в порядке, установленном для расчетов по Беспоставочной сделке, как если бы Датой оценки была бы Дата осуществления права на исполнение);
 - (б) применительно к Сделке форвард на акции или Сделке форвард на корзину акций — Расчетную цену соответствующей Акции в Дату оценки, относящуюся в соответствующей Дате расчетов (или при отсутствии такой Даты оценки в день, предшествующий этой Дате расчетов на один Расчетный цикл);
 - (в) применительно к Сделке своп на акции или Сделке своп на корзину акций, — Окончательная цена соответствующей Акции в Дату оценки, относящуюся к соответствующей Дате расчетов (или при отсутствии такой Даты оценки в день, предшествующий этой Дате расчетов на один Расчетный цикл).
- 10.7. **Событие, препятствующее проведению расчетов**, означает применительно к Акции событие, находящееся вне контроля сторон, в результате которого согласованная сторонами Клиринговая организация не может провести расчеты по этой Акции.
- 10.8. **Расходы**. Все расходы, связанные с передачей Акций, подлежащих поставке по Сделке (в частности, биржевые и иные сборы, налоги), несет сторона, осуществляющая поставку соответствующих Акций.
- 10.9. **Заявления и прочие обязательства**. Сторона, обязанная поставить Акции по Сделке, принимает на себя обязательство по передаче Акций свободными от:

- (а) любых прав третьих лиц, в частности залога, иного обременения или притязаний третьих лиц, а также прочих ограничений любого характера, за исключением ограничений, которые могут быть установлены законодательством Российской Федерации, в отношении продажи приобретателем таких Акций третьим лицам;
- (б) любых ограничений, устанавливающих необходимость получения стороной, обязанной поставить Акции, от какого-либо лица, включая Эмитента, согласия на продажу, цессию или иную передачу Акций или ее одобрения таким лицом;
- (в) любых ограничений, касающихся правового или финансового положения или иного состояния покупателя, залогодержателя, цессионария или иного приобретателя таких Акций;
- (г) любых требований по передаче какого-либо сертификата, разрешения, одобрения, соглашения, заключения, уведомления или иного документа какого-либо лица в адрес Эмитента этих Акций, регистратора или трансфер-агента до их продажи, передачи в залог, цессии или иной передачи этих Акций;
- (д) любых регистрационных или квалификационных требований или требований по регистрации проспекта этих Акций в соответствии с законодательством Российской Федерации о ценных бумагах.

10.10. **Возмещение за неосуществление поставки.** Если сторона не исполняет какое-либо обязательство по поставке Акций по Сделке, до досрочного прекращения обязательств по этой Сделке она обязана возместить другой стороне по ее требованию любые расходы, убытки или затраты (включая затраты по приобретению соответствующих Акций по сделке РЕПО, если применимо), возникшие в результате такого неисполнения обязательства по поставке Акций.

11. Дивиденды

11.1. **Сумма дивидендов** означает применительно к Акции, Периоду начисления дивидендов и Дате выплаты дивидендов сумму объявленных дивидендов или иную сумму, определяемую в соответствии с Подтверждением либо иным образом согласованную сторонами или включенную в Сумму дивидендов при осуществлении корректировки в соответствии с пунктами 12.3–12.5 Стандартных условий.

В случае объявления дивидендов, если день составления списка лиц, имеющих право получения дивидендов, наступает в течение соответствующего Периода начисления дивидендов, Сумма дивидендов будет равна 100 процентов совокупной суммы дивидендов по одной Акции, объявленных Эмитентом.

Под совокупной суммой дивидендов понимается сумма до удержания или вычета налогов у источника выплаты, не включающая возмещение суммы налога, компенсации или налоговое вычеты, предоставленные налоговым органом, а также Внеочередные дивиденды и Суммы внеочередных дивидендов, если Подтверждением или иным соглашением сторон, не предусмотрено иное.

- 11.2. Дата выплаты дивидендов означает применительно к Периоду начисления дивидендов каждый день, указанный в этом качестве в Подтверждении, иным образом определяемый в соответствии с ним или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а если этот день не является Банковским днем, то ближайший следующий Банковский день. При отсутствии в Подтверждении и ином соглашении сторон такого указания Датой выплаты дивидендов считается Дата расчетов, относящаяся к концу соответствующего Периода начисления дивидендов.
- 11.3. **Период начисления дивидендов** означает Первый период или Второй период в зависимости от того, какой из них указан в Подтверждении или иным образом согласован сторонами, либо иной период, определяемый в соответствии с Подтверждением или иным образом согласованный сторонами, — а при отсутствии такого указания Второй период.
- (а) **Первый период** означает каждый период с одной Датой расчетов (включительно) по (исключая) следующую Дату расчетов, за исключением того, что (i) первый Период начисления дивидендов начинается в Клиринговый день (включительно), наступающий через один Расчетный цикл после Датой сделки, и (ii) последний Период начисления дивидендов заканчивается в последнюю Дату расчетов (исключая эту дату).
- (б) **Второй период** означает каждый период с одной Датой оценки (исключая эту дату) по (включительно) следующую Дату оценки, за исключением того, что (i) первый Период начисления дивидендов начинается в Дату сделки (исключая эту дату), и (ii) последний Период начисления дивидендов заканчивается в последнюю Дату оценки или применительно к Сделке поставочный форвард, к которой условие о Переменной сумме обязательства не применимо, в день, предшествующий Дате расчетов на один Расчетный цикл.
- 11.4. **Капитализация дивидендов.** Условиями Сделки может быть предусмотрено условие о капитализации дивидендов (далее — **«Капитализация дивидендов»**) применительно к обязательству Плательщика индексированной суммы и соответствующей Дате выплаты дивидендов. В этом случае для каждой следующей Датой расчетов Расчетный агент корректирует Номинальную сумму сделки, установленную применительно к Плательщику индексированной суммы, путем добавления к ней Суммы дивидендов, установленной применительно к Плательщику индексированной суммы и Дате выплаты дивидендов.
- 11.5. **Обязательства по выплате дивидендов в Сделках поставочный опцион.** Все дивиденды по Акциям, подлежащим поставке по Сделке поставочный опцион, уплачиваются той стороне, которая получила бы эти дивиденды в соответствии с рыночной практикой продажи таких Акций, расчеты по которой проходят в соответствующую Дату осуществления права на исполнение.
- 11.6. **Внеочередные дивиденды** означает сумму по одной Акций, указанную в этом качестве в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами, а при отсутствии такого указания или определения:

- (а) при наличии утвержденной Эмитентом политики выплаты дивидендов — сумма дивидендов или ее часть, выплачиваемая в сроки, не предусмотренные утвержденной политикой выплаты дивидендов, определенная в качестве Внеочередных дивидендов Расчетным агентом;
- (б) при отсутствии утвержденной Эмитентом политики выплаты дивидендов — сумму любых дивидендов, в том числе выплачиваемых по результатам первого квартала, полугодия, девяти месяцев финансового года, за исключением дивидендов, выплачиваемых по результатам финансового года.

11.7. **Сумма внеочередных дивидендов** означает применительно к Периоду начисления дивидендов сумму объявленных Внеочередных дивидендов или иную сумму, определяемую в соответствии с Подтверждением или иным образом согласованную сторонами.

В случае объявления дивидендов, если день составления списка лиц, имеющих право получения дивидендов, наступает в течение соответствующего Периода начисления дивидендов, Сумма внеочередных дивидендов будет равна 100 процентов суммы Внеочередных дивидендов по одной Акции, объявленных Эмитентом.

12. КОРРЕКТИРОВКА И ИЗМЕНЕНИЯ, ВЛИЯЮЩИЕ НА ИНДЕКСЫ, АКЦИИ И СДЕЛКИ

Корректировка Индексов

12.1. Если применительно к Срочной сделке на индекс или Срочной сделке на корзину индексов Индекс:

- (а) рассчитывается и объявляется не Разработчиком индекса, а его преемником, приемлемым по мнению Расчетного агента,
- (б) заменен другим индексом, при расчете которого, по заключению Расчетного агента, используется та же или в значительной степени похожая формула или метод,

в таком случае такой индекс (далее — «**Заменяющий индекс**») будет считаться Индексом.

12.2. Если применительно к Срочной сделке на индекс или Срочной сделке на корзину индексов:

- (а) в Дату оценки или до ее наступления Разработчик индекса:
 - (А) объявляет о том, что в формулу или метод расчета Индекса вносятся существенные изменения либо Индекс изменяется иным существенным образом, кроме предусмотренных правилами расчета Индекса изменений формулы или метода расчета Индекса, отражающих изменения в составе входящих в него акций или капитализации их эмитентов либо другие события обычного характера (далее — «**Изменение индекса**»);
 - (Б) прекращает расчет Индекса без введения Заменяющего индекса (далее — «**Прекращение расчета индекса**»);

- (б) в Дату оценки Разработчик индекса не выполняет расчет Индекса и не объявляет значение Индекс (далее — **«Сбой индекса»**), а вместе с Изменением индекса и Прекращением расчета индекса — **«Событие, требующее корректировки индекса»**), то,

если при этом в качестве последствия наступления События, требующего корректировки индекса, Подтверждением предусмотрено:

- (в) условие **«Корректировка расчетным агентом»**, Расчетный агент (если он придет к выводу, что Событие, требующее корректировки индекса, существенно влияет на Срочную сделку на индекс) рассчитывает Расчетную цену, Окончательную цену, Цену исполнения, Форвардную цену, Минимальную форвардную цену, Максимальную форвардную цену, Барьерную цену, используя вместо опубликованного значения Индекса его значение на соответствующую Дату оценки, определенное Расчетным агентом в соответствии с формулой или методом расчета Индекса, действовавшим непосредственно перед наступлением События, требующего корректировки, используя только те акции, на основе сделок с которыми рассчитывался Индекс непосредственно перед наступлением События, требующего корректировки индекса;
- (г) условие **«Ликвидационный неттинг по соглашению сторон»**, стороны вправе досрочно прекратить обязательства по Сделке на согласованных условиях. Если стороны не достигнут соглашения о досрочном прекращении обязательств по Сделке, условия такой Сделки сохраняют силу с учетом применения формул и методов расчета, действующих в период времени, когда требуется провести очередной расчет;
- (д) условие **«Расторжение с выплатой»**, то:
- (А) при Сбое индекса Сделка расторгается в Дату оценки;
- (Б) при Прекращении расчета индекса Сделка расторгается в Биржевой день, предшествующий Прекращению расчета индекса, или в день, в который Разработчик индекса объявил о Прекращении расчета индекса, в зависимости от того, который из них наступил позже;
- (В) при Изменении индекса каждая из сторон вправе, если направит другой стороне уведомление за два Плановых торговых дня (или меньший срок, если при этом возможно расторгнуть Сделку не позднее дня Изменения индекса), расторгнуть Сделку после объявления об Изменении индекса, но не позднее Планового торгового дня, предшествующего Изменению индекса. При этом:
- (аа) по Сделке опцион на индекс или Сделке опцион на корзину индексов Продавец обязан уплатить Покупателю сумму, указанную в пункте 13.7(б)(Б) Стандартных условий;
- (бб) по Сделке своп на индекс, Сделке своп на корзину индексов, Сделке форвард на индекс или Сделке форвард на корзину индексов сумма, рассчитанная в соответствии с пунктом 13.7(в) Стандартных условий, уплачивается одной стороной другой стороне.

Сделка, расторгнутая в результате наступления События, требующего корректировки индекса, подлежит оценке с использованием формулы или метода расчета Индекса, действовавшего на момент, предшествующий наступлению События, требующего корректировки индекса.

Корректировка Срочных сделок на акции или Срочных сделок на корзину акций

12.3. *Метод корректировки* означает метод определения корректировки, которую необходимо внести в условия Срочной сделки на акции или Срочной сделки на корзину акций в результате наступления события, которое, по мнению Расчетного агента, может повлиять на оценку стоимости Акции вследствие увеличения или уменьшения доли в уставном капитале, приходящейся на каждую Аксию.

Если в качестве Метода корректировки Подтверждением по Срочной сделке на акции или Срочной сделке на корзину акций предусмотрено:

- (а) метод «*Биржевая корректировка*», то при каждой корректировке порядка исполнения, расчетов, платежа или иных условий опционов на Акции, торгуемых на Бирже опционов, Расчетный агент корректирует одно или более следующих условий:
 - (А) по Сделке опцион на акции или Сделке опцион на корзину акций Цену исполнения, Количество опционов, Предмет опциона, Барьерную цену и Количество акций;
 - (Б) по Сделке форвард на акции или Сделке форвард на корзину акций Форвардную цену, Минимальную форвардную цену, Максимальную форвардную цену, Барьерную цену и Количество акций;
 - (В) по Сделке своп на акции или Сделке своп на корзину акций Первоначальную цену, Номинальную сумму сделки, Барьерную цену и Количество акций;

а также любой другой параметр или значение, связанное с исполнением, расчетами, платежом или иными условиями Сделки. Скорректированные таким образом параметры и значения вступают в силу в день, определенный Расчетным агентом как день, в который вступили в силу условия, скорректированные Биржей опционов.

Если опционы на Акции не торгуются на Бирже опционов, Расчетный агент корректирует один или более параметров или значений, указанных выше, если посчитает это необходимым. При этом он может принять во внимание правила, установленные Биржей опционов, и сложившиеся на ней прецеденты, с тем, чтобы учесть влияние какого-либо события на оценку стоимости Акции вследствие увеличения или уменьшения доли в уставном капитале, приходящейся на каждую Аксию, если, по мнению Расчетного агента, такое событие могло бы привести к корректировке условий опционов на Акции Биржей опционов, если бы такие опционы торговались на Бирже опционов;

(б) метод «*Корректировка расчетным агентом*» (или если Метод корректировки в Подтверждении не определен), то в случае объявления Эмитентом условий Потенциального события корректировки Расчетный агент, если он придет к выводу, что такое Потенциальное событие корректировки влияет на оценку стоимости Акций вследствие увеличения или уменьшения доли в уставном капитале, приходящейся на каждую Акцию:

(А) корректирует одно или более следующих условий:

(аа) по Сделке опцион на акции или Сделке опцион на корзину акций Цену исполнения, Количество опционов, Предмет опциона, Барьерную цену и Количество акций;

(бб) по Сделке форвард на акции или Сделке форвард на корзину акций Форвардную цену, Минимальную форвардную цену, Максимальную форвардную цену, Барьерную цену и Количество акций;

(вв) по Сделке своп на акции или Сделке своп на корзину акций — Первоначальную цену, Номинальную сумму сделки, Барьерную цену и Количество акций;

а также любой другой параметр или значение, связанное с исполнением, расчетами, платежом или иными условиями Сделки. Корректировка должна осуществляться с целью учесть влияние указанного события на оценку стоимости Акций. При этом изменения волатильности, ожидаемых дивидендов, ставки РЕПО или ликвидности, имеющие отношение к Акции, не могут быть единственным основанием для корректировки условий Сделки;

(Б) определяет дату или даты вступления в силу скорректированных параметров и значений.

Определяя необходимые корректировки, Расчетный агент может принять во внимание корректировки, внесенные биржей опционов в условия торгуемых на ней опционов на Акции применительно к такому Потенциальному событию корректировки.

12.4. **Биржа опционов** означает биржу, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами, на которой торгуются опционные договоры (контракты) на Ацию, а при отсутствии такого указания в Подтверждении и ином соглашении сторон — Биржа срочных контрактов (если на такой Бирже срочных контрактов торгуются опционные договоры (контракты) на Ацию, а если Подтверждением предусмотрено более одной Биржи срочных контрактов — Биржа срочных контрактов, выбранная Расчетным агентом как основной рынок для включенных в котировальные списки опционных договоров (контрактов) на Ацию.

12.5. **Потенциальное событие корректировки** означает:

(а) дробление, консолидацию или конвертацию Акций (кроме случаев, когда это происходит в результате Поглощения) либо безвозмездное распределение Акций, в том числе в форме дивиденда, существующим акционером;

- (б) распределение, выпуск или выплату в форме дивиденда существующим акционерам:
 - (А) Акций;
 - (Б) других акций или иных ценных бумаг, предоставляющих право на получение дивидендов от Эмитента, а в случае его ликвидации — право на получение части имущества Эмитента;
 - (В) акций или иных ценных бумаг другого эмитента, приобретенных (прямо или косвенно) Эмитентом в результате выделения или аналогичной сделки;
 - (Г) любых других ценных бумаг или иного имущества, в каждом случае за плату или иное встречное предоставление, меньшее чем преобладающая рыночная цена, определенная Расчетным агентом;
- (в) объявление Внеочередных дивидендов;
- (г) приобретение Акций Эмитентом, его дочерним или зависимым обществом;
- (д) выпуск Эмитентом опционов эмитента, в соответствии с которыми цена размещения акций во исполнение требований по опционам эмитента ниже их рыночной стоимости, определенной Расчетным агентом;
- (е) любое иное событие, которое может повлиять на оценку стоимости Акций вследствие увеличения или уменьшения доли в уставном капитале, приходящейся на каждую Акцию.

Внесение исправлений в цену Акции и значение Индекса

12.6. В случае если в цену или значение, опубликованное на Бирже или Разработчиком индекса, которое используется для каких-либо расчетов или определения параметров или значений по Сделке, вносится исправление, и результаты исправления публикуются Биржей или Разработчиком индекса не позднее одного Расчетного цикла после дня первоначальной публикации, любая из сторон вправе уведомить другую сторону о внесении таких исправлений. При этом Расчетный агент обязан определить сумму, подлежащую уплате, или количество Акций, подлежащих поставке, в результате внесения исправлений, и при необходимости скорректировать условия Сделки с тем, чтобы учесть указанные исправления.

13. ОСОБЫЕ ОБСТОЯТЕЛЬСТВА

13.1. Общие положения об Особых обстоятельствах.

- (а) *Особое обстоятельство* означает Поглощение, Приобретение по публичной оферте, Событие, требующее корректировки индекса, Национализацию, Делистинг или применимое Иное событие, препятствующее исполнению.
- (б) *Поглощение* означает применительно к Акции:
 - (А) конвертацию или обмен Акции, в результате которого происходит передача или возникает обязанность передать все Акции, находящиеся в обращении, третьему лицу или лицам;

(Б) присоединение Эмитента к другому юридическому лицу или слияние Эмитента с одним или более юридическими лицами;

(В) требование о выкупе, добровольное или обязательное предложение, уведомление о праве требовать выкупа, иное предложение или действие лица, направленное на покупку или приобретение иным образом 100 процентов находящихся в обращении Акций Эмитента, в результате которого происходит передача или возникает обязанность передать такому лицу все указанные Акции (кроме Акции, принадлежащих такому лицу напрямую или контролируемых им через третьих лиц),

в каждом из случаев, если Дата поглощения наступает до или в:

(аа) Дату истечения срока или последнюю из Дат расчетов в зависимости от того, какая из этих дат наступает позднее, — применительно к Сделкам поставочный опцион;

(бб) соответствующую Дату расчетов — применительно к Сделкам поставочный форвард и Сделкам поставочный своп;

(вв) последнюю из Дат оценки — в остальных случаях.

(в) **Дата поглощения** означает:

(А) при передаче Акции без слияния или присоединения юридических лиц дату внесения записи о переходе прав собственности на Акции в реестре или по счету депо приобретателя;

(Б) при слиянии юридических лиц дату государственной регистрации вновь возникшего юридического лица;

(В) при присоединении юридического лица дату внесения в единый государственный реестр юридических лиц записи о прекращении деятельности присоединенного юридического лица;

(Г) если Дата поглощения не может быть определена в соответствии с подпунктами (А)–(В) настоящего пункта 13.1(в), день, определенный Расчетным агентом в качестве Даты поглощения в соответствии с законодательством Российской Федерации.

(г) **Приобретение по публичной оферте** означает требование о выкупе, добровольное или обязательное предложение, уведомление о праве требовать выкупа, иное предложение или действие лица, в результате которого это лицо покупает, иным образом приобретает или получает право на приобретение путем конвертации или иным способом более 10 процентов, но менее 100 процентов находящихся в обращении голосующих акций Эмитента, в соответствии с заключением Расчетного агента, сделанным на основе сведений, раскрываемых в уведомлениях государственным органам или саморегулируемым организациям, либо иной информации, которую Расчетный агент посчитает имеющей значение.

(д) **Дата приобретения по публичной оферте** означает применительно к Приобретению по публичной оферте день, определяемый Расчетным агентом,

в который голосующие акции в установленном количестве были куплены или иным образом приобретены.

- (е) Форма оплаты «**Акция за акцию**» означает применительно к Поглощению или Приобретению по публичной оферте, что встречное предоставление за соответствующие Акции составляют исключительно Новые акции.
- (ж) Форма оплаты «**Акция за иное предоставление**» означает применительно к Поглощению или Приобретению по публичной оферте, что встречное предоставление за соответствующие Акции составляет исключительно Иное предоставление.
- (з) Форма оплаты «**Акция за смешанное предоставление**» означает применительно к Поглощению или Приобретению по публичной оферте, что встречное предоставление за соответствующие Акции составляет Смешанное предоставление.
- (и) **Новые акции** означает обыкновенные акции, выпущенные лицом (кроме Эмитента), участвующим в Поглощении или Приобретении по публичной оферте, либо третьим лицом, которые на Дату поглощения или Дату приобретения по публичной оферте:
 - (А) допущены к торгам, торгуются на бирже или включены в котировальные списки биржи в Российской Федерации;
 - (Б) к ним не применяются ограничения, установленные валютным законодательством Российской Федерации, а также ограничения на их приобретение и обращение, а также другие ограничения торговли.
- (к) **Иное предоставление** означает денежные средства и/или ценные бумаги (кроме Новых акций), принадлежащие лицу (кроме Эмитента), участвующему в Поглощении или Приобретении по публичной оферте, либо третьему лицу.
- (л) **Смешанное предоставление** означает Новые акции в сочетании с Иным предоставлением.
- (м) **Дата объявления** означает:
 - (А) применительно к Поглощению день, в который впервые публично объявлено о решении совершить сделку (независимо от последующих изменений и/или уточнений этого объявления), которая повлечет Поглощение;
 - (Б) применительно к Приобретению по публичной оферте день, в который впервые публично объявлено о решении приобрести соответствующее количество голосующих акций (независимо от последующих изменений и/или уточнений этого объявления), которое повлечет Приобретение по публичной оферте;
 - (В) применительно к Сбою индекса и Прекращению расчета индекса день, в который Разработчик индекса впервые публично объявил о любом

изменении Индекса или прекращении его расчета, предусмотренном пунктом 12.2 Стандартных условий, которое повлечет Сбой индекса или Прекращение расчета индекса;

- (Г) применительно к Изменению индекса Биржевой день, непосредственно предшествующий дню, с которого вводится Изменение индекса;
- (Д) применительно к Национализации день, в который впервые публично объявлено о намерении национализировать имущество (независимо от последующих изменений и/или уточнений этого объявления), которое повлечет Национализацию;
- (Е) применительно к Делистингу день, в который Биржа впервые публично объявила о предстоящем исключении Акций из котировального списка или прекращении торгов Акциями в случаях, предусмотренных пунктом 13.6(б) Стандартных условий.

Применительно к любому Особому обстоятельству, кроме Сбоя индекса, если о таком Особом обстоятельстве объявлено после фактического времени закрытия торговой сессии режима основных торгов на соответствующей Бирже, без учета послеторгового и других периодов за рамками периода проведения торгов в режиме основных торгов, Датой объявления будет следующий Плановый торговый день.

- (н) **Подразумеваемая волатильность** означает применительно к Биржевому дню среднее между ценой спроса и ценой предложения значение подразумеваемой волатильности соответствующих Акций, определенное Расчетным агентом путем интерполяции или экстраполяции из наиболее сопоставимого из допущенных к торгам опционов на продажу (пут) или на покупку (колл) (который должен быть того же типа, что и расторгаемая Сделка опцион) на соответствующие Акции, выбранного Расчетным агентом с учетом ближайших по значению цены исполнения, срока и суммы платежа, а также других условий, которые Расчетный агент сочтет имеющими значение. При отсутствии такого, допущенного к торгам, опциона, или если Расчетный агент посчитает, что рынок такого допущенного к торгам опциона не достаточно ликвидный для целей соответствующего расчета, Подразумеваемая волатильность определяется Расчетным агентом методом, который он сочтет приемлемым.
- (о) **Затронутые акции** означает Акции, затронутые Поглощением или Приобретением по публичной оферте.

Последствия Поглощения

13.2. Если в качестве последствия Поглощения (далее — «**Последствие поглощения**») в отношении форм оплаты «Акция за акцию», «Акция за иное предоставление» или «Акция за смешанное предоставление» указано:

- (а) условие «**Замена базового актива**», это означает, что в или после Даты поглощения Новые акции и/или Иное предоставление, а также их эмитент

(при его наличии) будут считаться Акциями и Эмитентом, а количество Новых акций и/или размер Иного предоставления, право на которое лицо, владевшее соответствующим Количеством акций непосредственно перед Поглощением, приобретет после Поглощения, будет считаться Количеством акций.

При необходимости Расчетный агент корректирует соответствующие условия Сделки, при этом изменения волатильности, ожидаемых дивидендов, ставки РЕПО или ликвидности, имеющие отношение к Акции или Сделке, не могут быть единственным основанием для корректировки условий Сделки;

- (б) условие «**Расторжение с выплатой**», это означает:
 - (А) применительно к Сделке опцион, что она расторгается в Дату поглощения и Продавец обязан уплатить Покупателю сумму, рассчитанную в соответствии с пунктом 13.7(б) Стандартных условий;
 - (Б) применительно к Сделке форвард или Сделке своп, что она расторгается в Дату поглощения и одна сторона обязана уплатить другой стороне сумму, рассчитанную в соответствии с пунктом 13.7(в) Стандартных условий;
- (в) условие «**Биржевая корректировка**», это означает, что после каждой корректировки порядка расчетов по опционам на соответствующие Акции, торгуемым на Бирже опционов, Расчетный агент осуществляет корректировку условий Сделки в соответствии с пунктом 12.3(а) Стандартных условий;
- (г) условие «**Корректировка расчетным агентом**», это означает, что в или после Даты поглощения:
 - (А) Расчетный агент:
 - (аа) корректирует порядок исполнения, расчетов, платежа или иные условия Сделки, которые Расчетный агент сочтет необходимым в целях учета экономического эффекта, произведенного на Сделку Поглощением (при этом изменения волатильности, ожидаемых дивидендов, ставки РЕПО или ликвидности, имеющие отношение к Акции или Сделке, не могут быть единственным основанием для корректировки условий Сделки). Определяя необходимые корректировки, Расчетный агент может принять во внимание корректировки, внесенные биржей опционов в условия торгуемых на ней опционов на Акции в связи с Поглощением; и
 - (бб) определяет день, с которого скорректированные таким образом параметры и значения вступают в силу; либо
 - (Б) если Расчетный агент придет к выводу о том, что корректировка, которую он мог бы внести в соответствии с подпунктом (А) настоящего пункта 13.2(г), не будет иметь коммерчески обоснованного результата, он уведомляет стороны о том, что соответствующим последствием должно быть расторжение Сделки в соответствии с условием «Расторжение с выплатой», и сумма, подлежащая уплате одной стороной

другой стороне, рассчитывается в соответствии с пунктом 13.7 Стандартных условий, а применительно к Сделке опцион Расчетный агент определяет сумму такого платежа, как если бы к Сделке опцион применялось условие «Определение расчетным агентом»;

(д) условие «**Расширенная корректировка расчетным агентом**», это означает, что в или после Даты поглощения:

(А) Расчетный агент:

(аа) корректирует порядок исполнения, расчетов, платежа или иные условия Сделки (в том числе в условии о спреде), которые Расчетный агент сочтет необходимым в целях учета экономического эффекта, произведенного на Сделку Поглощением (с учетом изменений волатильности, ожидаемых дивидендов, ставки РЕПО или ликвидности, имеющих отношение к Акции или Сделке). Определяя необходимые корректировки, Расчетный агент может принять во внимание корректировки, внесенные биржей опционов в условия торгуемых на ней опционов на Акции в связи с Поглощением; и

(бб) определяет день, с которого скорректированные таким образом параметры и значения вступают в силу; либо

(Б) если Расчетный агент придет к выводу о том, что корректировка, которую он мог бы внести в соответствии с подпунктом (А) настоящего пункта 13.2(д), не будет иметь коммерчески обоснованного результата, он уведомляет стороны о том, что соответствующим последствием должно быть расторжение Сделки в соответствии с условием «Расторжение с выплатой», и сумма, подлежащая уплате одной стороной другой стороне, рассчитывается в соответствии с пунктом 13.7 Стандартных условий, а применительно к Сделке опцион Расчетный агент определяет сумму такого платежа, как если бы условие «Определение расчетным агентом» применялось к Сделке опцион;

(е) условие «**Частичное расторжение с выплатой**», это означает, что применительно к Срочной сделке на корзину акций:

(А) часть Срочной сделки на корзину акций, касающаяся Затронутых акций расторгается в Дату поглощения;

(Б) сумма, рассчитанная в соответствии с пунктом 13.7 Стандартных условий в отношении таких Затронутых акций, подлежит уплате одной стороной другой стороне;

(В) прочие части Срочной сделки на корзину акций сохраняют силу применительно к Корзине, включающей Акции, не являющиеся Затронутыми акциями;

(Г) Расчетный агент уточняет при необходимости соответствующие условия с тем, чтобы сохранить в максимальной с практической точки зрения степени экономические условия Сделки применительно к оставшимся Акциям;

- (ж) условие «**Смешанная корректировка**», это означает, что применительно к Поглощению с формой оплаты «Акция за смешанное предоставление» последствия, согласованные сторонами применительно к форме оплаты «Акция за акцию», применяются к той части предоставления, которое включает в себя Новые акции, а последствия, согласованные сторонами применительно к форме оплаты «Акция за иное предоставление», применяются к той части предоставления, которое включает в себя Иное предоставление, как это будет определено Расчетным агентом.

Последствия Приобретения по публичной оферте

13.3. Если условиями Сделки предусмотрено применение положений о Приобретении по публичной оферте, и в качестве последствия Приобретения по публичной оферте в отношении форм оплаты «Акция за акцию», «Акция за иное предоставление» или «Акция за смешанное предоставление» указано:

- (а) условие «**Расторжение с выплатой**», это означает:
- (А) применительно к Сделке опцион, что она расторгается в Дату приобретения по публичной оферте и Продавец обязан уплатить Покупателю сумму, рассчитанную в соответствии с пунктом 13.7(б) Стандартных условий;
 - (Б) применительно к Сделке форвард или Сделке своп, что она расторгается в Дату приобретения по публичной оферте и одна сторона обязана уплатить другой стороне сумму, рассчитанную в соответствии с пунктом 13.7(в) Стандартных условий;
- (б) условие «**Биржевая корректировка**», это означает, что после каждой корректировки порядка расчетов по опционам на соответствующие Акции, торгуемым на Бирже опционов, Расчетный агент осуществляет корректировку в соответствии с пунктом 12.3(а) Стандартных условий;
- (в) условие «**Корректировка расчетным агентом**», это означает, что в или после Даты приобретения по публичной оферте Эмитент и Акции не изменяются, однако:
- (А) Расчетный агент:
 - (аа) корректирует порядок исполнения, расчетов, платежа или иные условия Сделки, которые Расчетный агент сочтет необходимыми в целях учета экономического эффекта, произведенного на Сделку Приобретением по публичной оферте (при этом изменения волатильности, ожидаемых дивидендов, ставки РЕПО или ликвидности, имеющие отношение к Акции или Сделке, не могут быть единственным основанием для корректировки условий Сделки). Определяя необходимые корректировки, Расчетный агент может принять во внимание корректировки, внесенные биржей опционов в условия торгуемых на ней опционов на Акции в связи с Приобретением по публичной оферте; и

- (бб) определяет день, с которого скорректированные таким образом параметры и значения вступают в силу; либо
- (Б) если Расчетный агент придет к выводу о том, что корректировка, которую он мог бы внести в соответствии с подпунктом (А) настоящего пункта 13.3(в), не будет иметь коммерчески обоснованного результата, он уведомляет стороны о том, что соответствующим последствием должно быть расторжение Сделки в соответствии с условием «Расторжение с выплатой», и сумма, подлежащая уплате одной стороной другой стороне, рассчитывается в соответствии с пунктом 13.7 Стандартных условий, а применительно к Сделке опцион Расчетный агент определяет сумму такого платежа, как если бы условие «Определение расчетным агентом» применялось к Сделке опцион;
- (г) условие «**Расширенная корректировка расчетным агентом**», это означает, что в или после Даты приобретения по публичной оферте Эмитент и Акции остаются неизменными, однако:
- (А) Расчетный агент:
- (аа) корректирует порядок исполнения, расчетов, платежа или иные условия Сделки (в том числе в условии о спреде), которые Расчетный агент сочтет необходимыми в целях учета экономического эффекта, произведенного на Сделку Приобретением по публичной оферте (с учетом изменений волатильности, ожидаемых дивидендов, ставки РЕПО или ликвидности, имеющих отношение к Акции или Сделке). Определяя необходимые корректировки, Расчетный агент может принять во внимание корректировки, внесенные биржей опционов в условия торгуемых на ней опционов на Акции в связи с Приобретением по публичной оферте; и
- (бб) определяет день, с которого скорректированные таким образом параметры и значения вступают в силу; либо
- (Б) если Расчетный агент придет к выводу о том, что корректировка, которую он мог бы внести в соответствии с подпунктом (А) настоящего пункта 13.3(г), не будет иметь коммерчески обоснованного результата, он уведомляет стороны о том, что соответствующим последствием должно быть расторжение Сделки в соответствии с условием «Расторжение с выплатой», и сумма, подлежащая уплате одной стороной другой стороне, рассчитывается в соответствии с пунктом 13.7 Стандартных условий, а применительно к Сделке опцион Расчетный агент определяет сумму такого платежа, как если бы к Сделке опцион применялось условие «Определение расчетным агентом»;
- (д) условие «**Частичное расторжение с выплатой**», это означает, что применительно к Срочной сделке на корзину акций:
- (А) часть Срочной сделки на корзину акций, касающаяся Затронутых акций расторгается в Дату приобретения по публичной оферте;

- (Б) сумма, рассчитанная в соответствии с пунктом 13.7 Стандартных условий в отношении таких Затронутых акций, подлежит уплате одной стороной другой стороне;
 - (В) прочие части Срочной сделки на корзину акций сохраняют силу применительно к Корзине, включающей Акции, не являющиеся Затронутыми акциями;
 - (Г) Расчетный агент уточняет при необходимости соответствующие условия с тем, чтобы сохранить в максимальной с практической точки зрения степени экономические условия Сделки применительно к оставшимся Акциям;
- (е) условие «*Смешанная корректировка*», это означает, что применительно к Приобретению по публичной оферте с формой оплаты «Акция за смешанное предоставление» последствия, согласованные сторонами применительно к форме оплаты «Акция за акцию», применяются к той части предоставления, которое включает в себя Новые акции, а последствия, согласованные сторонами применительно к форме оплаты «Акция за иное предоставление», применяются к той части предоставления, которое включает в себя Иное предоставление, как это будет определено Расчетным агентом.

13.4. Расчеты после Поглощения или Приобретения по публичной оферте.

- (а) Если требуется оценка Иного предоставления применительно к Беспоставочной сделке, условия которой были скорректированы в результате Поглощения или Приобретения по публичной оферте, Иное предоставление подлежит оценке Расчетным агентом в каждую Дату оценки. При этом положения настоящих Стандартных условий о Чрезвычайных ситуациях не применяются к Иному предоставлению.
- (б) Если Новые акции подлежат поставке по Поставочной сделке, условия которой были скорректированы в результате Поглощения или Приобретения по публичной оферте, обязанная сторона осуществляет поставку Новых акций другой стороне в соответствии с условиями расчетов, предусмотренными в Подтверждении или иным образом согласованными сторонами. При этом, если на соответствующую Дату расчетов владелец Акции еще не получил Новые акции, право на получение которых он имеет, Датой расчетов в отношении таких Новых акций считается первый Клиринговый день, совпадающий с или наступающий после первого дня, когда владелец соответствующих Акции, получив Новые акции, сможет поставить их другой стороне.
- (в) Если Иное предоставление подлежит передаче по Поставочной сделке, условия которой были скорректированы в результате Поглощения или Приобретения по публичной оферте, обязанная сторона осуществляет передачу Иного предоставления другой стороне в соответствии с разумными и добросовестными указаниями другой стороны в возможно короткие сроки после (в зависимости от того, что наступит позже) соответствующей Даты расчетов либо первого дня, когда владелец соответствующих Акции, получив Иное предоставление, сможет передать его другой стороне.

Состав Смешанного предоставления

13.5. Если применительно к Поглощению или Приобретению по публичной оферте, в которых предусмотрена форма оплаты «Акция за смешанное предоставление»:

- (а) в Подтверждении предусмотрена применимость условия «*Состав смешанного предоставления*», то:
 - (А) в случае если состав Смешанного предоставления эквивалентен Предмету опциона или Количеству акций, и владелец Акции может получить Новые акции как часть Смешанного предоставления, Смешанное предоставление должно состоять из Новых акций в максимально допустимой степени;
 - (Б) если владелец Акции может выбрать иной состав Смешанного предоставления, не включающий Новые акции, состав Смешанного предоставления определяется следующим образом:
 - (аа) получатель поставки или платежа может определить состав Смешанного предоставления, если направит уведомление стороне, обязанной осуществить поставку или платеж, не менее чем за два Плановых торговых дня до истечения срока, в течение которого такой владелец Акции может своевременно выбрать состав Смешанного предоставления;
 - (бб) в иных случаях сторона, обязанная осуществить поставку или платеж, может определить состав Смешанного предоставления по своему усмотрению;
- (б) в Подтверждении не предусмотрена применимость условия «*Состав смешанного предоставления*», то:
 - (А) в случае если состав Смешанного предоставления эквивалентен Предмету опциона или Количеству акций, и владелец Акции может получить Новые акции как часть Смешанного предоставления, Смешанное предоставление должно состоять из Новых акций в максимально допустимой степени;
 - (Б) если владелец Акции может выбрать иной состав Смешанного предоставления, не включающий Новые акции, состав Смешанного предоставления определяется Расчетным агентом по его усмотрению.

13.6. Национализация и Делистинг.

- (а) **Национализация** означает, что все Акции или все либо существенная часть имущества Эмитента национализирована, реквизирована, конфискована или по иным основаниям подлежит обращению в государственную собственность;
- (б) **Делистинг** означает, что Биржа объявляет о том, что в соответствии с ее правилами Акции исключаются или подлежат исключению из всех ее котировальных списков, торги этими Акциями на этой Бирже прекращаются или подлежат прекращению по любому основанию (кроме Поглощения и

Приобретения по публичной оферте) без незамедлительного включения Акций в котировальные списки или их допуска к торгам иным образом на какой-либо иной бирже в Российской Федерации.

- (в) Сторона, как только ей станет известно о Национализации или Делистинге, обязана незамедлительно уведомить об этом другую сторону.
- (г) Для целей определения последствий Национализации или Делистинга:

(А) условие «**Ликвидационный неттинг по соглашению сторон**» означает, что стороны вправе досрочно прекратить обязательства по Сделке на согласованных условиях.

Если стороны не достигнут соглашения о досрочном прекращении обязательств по Сделке, условия такой Сделки сохраняют силу с учетом того, что условие о поставке Акций в любой Сделке может быть по усмотрению любой из сторон заменено на условие о выплате Суммы платежа или Индексированной суммы, за исключением того, что если в Первоначальную дату оценки возникает или имеет место Чрезвычайная ситуация, Расчетный агент не применяет последствия возникновения Чрезвычайной ситуации, установленные пунктом 7.5 Стандартных условий, а добросовестно определяет Расчетную цену или Окончательную цену по состоянию на Время оценки в эту Дату оценки;

(Б) условие «**Расторжение с выплатой**» означает, что Сделка расторгается в Дату объявления и:

(аа) по Сделке опцион Продавец обязан уплатить Покупателю сумму, рассчитанную в соответствии с пунктом 13.7(б) Стандартных условий;

(бб) по Сделке форвард или Сделке своп одна сторона обязана уплатить другой стороне сумму, рассчитанную в соответствии с пунктом 13.7(в) Стандартных условий;

(В) условие «**Частичное расторжение с выплатой**» означает, что применительно к Срочной сделке на корзину акций:

(аа) часть Срочной сделки на корзину акций, касающаяся Затронутых акций расторгается в Дату объявления;

(бб) сумма, рассчитанная в соответствии с пунктом 13.7 Стандартных условий в отношении таких Затронутых акций, подлежит уплате одной стороной другой стороне;

(вв) прочие части Срочной сделки на корзину акций сохраняют силу применительно к Корзине, включающей Акции, не являющиеся Затронутыми акциями;

(гг) Расчетный агент уточняет при необходимости соответствующие условия с тем, чтобы сохранить в максимальной с практической точки зрения степени экономические условия Сделки применительно к оставшимся Акциям.

13.7. Платежи в результате наступления отдельных Особых обстоятельств.

- (а) Если при наступлении Особого обстоятельства в соответствии с условиями Сделки применяется условие «Расторжение с выплатой» или «Частичное расторжение с выплатой», одна сторона обязана уплатить другой стороне сумму, определяемую в соответствии с подпунктом (б) или (в) настоящего пункта 13.7, в срок не позднее трех Банковских дней после дня направления Расчетным агентом или Определяющей стороной уведомления о такой сумме с указанием стороны, обязанной ее уплатить. Указанное уведомление должно быть направлено Расчетным агентом или Определяющей стороной незамедлительно после определения этой суммы. При этом сумма должна быть выражена в валюте расчетов по Сделке в соответствии с тем, как это определит Расчетный агент или Определяющая сторона.
- (б) Применительно к Сделке опцион сумма, подлежащая уплате Продавцом Покупателю, определяется по соглашению сторон не позднее пяти Биржевых дней после Даты поглощения, Даты приобретения по публичной оферте, даты прекращения расчета Индекса при наступлении События, требующего корректировки индекса, или даты наступления события, указанного в пункте 13.6 Стандартных условий (далее каждая из этих дат — **«Дата события»**).

Если стороны не могут определить указанную сумму, то:

- (А) если условие **«Согласованный способ»** предусмотрено Подтверждением в качестве применимого, сумма определяется Расчетным агентом как сумма Стоимости без учета коррекции и Стоимости коррекции.

При этом Покупатель не обязан уплачивать Продавцу какие-либо суммы в связи с расторжением Сделки опцион, за исключением невыплаченной Премии, причитающейся Продавцу на дату платежа суммы, определенной в соответствии с настоящим пунктом 13.7(б)(А).

- (аа) **Стоимость без учета коррекции** означает сумму, определенную Расчетным агентом в качестве стоимости Сделки опцион (или части Сделки опцион) на Дату события на основе:

- (I) волатильности, равной среднему арифметическому значений Подразумеваемой волатильности соответствующих Акций на каждый из пятнадцати Биржевых дней, предшествующих Дате события (включительно);
- (II) ожидаемых дивидендов за период с Даты события до Даты истечения срока, рассчитанных исходя из размера и графика выплат:
 - (1) суммы до уплаты налогов обыкновенных дивидендов, выплачиваемых в денежной форме по соответствующим Акциям в течение одного года, предшествующего Дате события и оканчивающегося в эту дату; или
 - (2) в случае опубликования Эмитентом изменений политики выплаты дивидендов по соответствующим

Акциям (по заключению Расчетного агента) до Даты события, ожидаемые дивиденды, определенные с учетом таких изменений;

в обоих случаях за вычетом Внеочередных дивидендов;

- (III) стоимости соответствующих Акций, определенной Расчетным агентом и, если применимо, равной стоимости предоставления или возмещения (при его наличии), выплачиваемого или поставляемого в отношении таких Акций их владельцам при наступлении Особого обстоятельства;
 - (IV) процентной ставки и ставки РЕПО в совокупности, указанных в Подтверждении или иным образом согласованных сторонами применительно к Сделке и применяемых к периоду с Даты события (исключая ее) до Даты истечения срока (включительно);
 - (V) срока Сделки опцион с Даты события до Даты истечения срока.
- (бб) **Стоимость коррекции** означает разницу между суммами, определяемыми в соответствии с подпунктами (I) и (II) настоящего подпункта (бб):

- (I) стоимость Сделки опцион (или части Сделки опцион), определенная Расчетным агентом на основе:
 - (1) волатильности, равной среднему арифметическому значений Подразумеваемой волатильности соответствующих Акций на каждый из пятнадцати Биржевых дней, предшествующих Дате объявления (исключая ее);
 - (2) ожидаемых дивидендов за период с Даты объявления до Даты истечения срока, рассчитанных исходя из размера и графика выплат:
 - суммы до уплаты налогов обыкновенных дивидендов, выплачиваемых в денежной форме по соответствующим Акциям в течение одного года, предшествующего Дате объявления и оканчивающегося в эту дату; или
 - в случае опубликования Эмитентом изменений политики выплаты дивидендов по соответствующим Акциям (по заключению Расчетного агента) до Даты объявления, ожидаемые дивиденды, определенные с учетом таких изменений;

в обоих случаях за вычетом Внеочередных дивидендов;

- (3) стоимости соответствующих Акции, равной Расчетной цене этих Акции (как если бы это была Беспоставочная сделка) по состоянию на Время оценки (при этом Датой оценки считается Дата объявления);
 - (4) процентной ставки и ставки РЕПО в совокупности, указанных в Подтверждении или иным образом согласованных сторонами применительно к Сделке и применяемых к периоду с Даты объявления (включительно) до Даты истечения срока (исключая ее);
 - (5) срока Сделки опцион с Даты объявления до Даты истечения срока;
- (II) стоимость Сделки опцион (или части Сделки опцион), основанная на показателях, указанных в подпунктах (I)(aa)–(I)(ee) выше, за исключением того, что в расчет принимается волатильность, равная среднему арифметическому значений Подразумеваемой волатильности соответствующих Акции на каждый из пятнадцати Биржевых дней, предшествующих Дате объявления (включительно).
- (Б) если условие **«Определение расчетным агентом»** предусмотрено Подтверждением в качестве применимого, сумма определяется Расчетным агентом, который при этом вправе, но не обязан, принимать во внимание факторы и коррекцию, предусмотренные пунктом 13.7(б)(А) Стандартных условий.
- (в) Применительно к Сделке форвард или Сделке своп, такая Сделка расторгается, а соответствующая сторона или стороны (в соответствии с правилами, установленными ниже) определяют Сумму выплаты при расторжении применительно к каждой расторгаемой Сделке.
- (А) Если условиями расторгаемой Сделки предусмотрена одна Определяющая сторона, то Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении и определяет, какая из сторон Сделки обязана уплатить ее другой стороне.
- (Б) Если условиями расторгаемой Сделки предусмотрены две Определяющие стороны, каждая из сторон рассчитывает Сумму выплаты при расторжении. Сторона, Сумма выплаты при расторжении которой меньше, уплачивает Стороне, Сумма выплаты при расторжении которой больше, половину разницы между Суммами выплаты при расторжении, рассчитанными сторонами.

13.8. Сумма выплаты при расторжении.

- (а) **Сумма выплаты при расторжении** означает сумму, рассчитываемую Определяющей стороной в порядке, установленном для расчета Ликвидационной суммы, как если бы:
- (А) Событие, требующее корректировки индекса, или Особое обстоятельство было определено как Дополнительное основание прекращения;

- (Б) все применимые Льготные периоды истекли;
- (В) все уведомления, необходимые для возникновения права на прекращение обязательств по Сделке, были получены в день, указанный в качестве даты расторжения Сделки в пункте 12.2(д) или пунктах 13.2–13.6 Стандартных условий соответственно;
- (Г) Определяющая сторона была бы Незатронутой стороной, а если обе стороны являются Определяющими сторонами — обе стороны были бы Затронутыми сторонами;
- (Д) Сделка являлась единственной Затронутой сделкой.

Термины «Дополнительное основание прекращения», «Льготный период», «Незатронутая сторона», «Затронутые стороны» и «Затронутая сделка» имеют значение, указанное в Примерных условиях договора, если Генеральным соглашением не предусмотрено иное.

- (б) **Определяющая сторона** означает сторону, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке.

13.9. Иные события, препятствующие исполнению.

- (а) Для целей настоящего пункта 13.9 следующие термины имеют следующие значения.
 - (А) **Иное событие, препятствующее исполнению**, означает любое из событий, указанных в подпунктах (Б)–(З) настоящего пункта 13.9(а) ниже.
 - (Б) **Изменение законодательства** означает, что в или после Даты сделки в результате:
 - (аа) принятия нормативного правового акта Российской Федерации, в том числе нормативного акта Банка России, включая внесение изменений и/или дополнений в действующие нормативные правовые акты Российской Федерации;
 - (бб) провозглашения решения Конституционного Суда Российской Федерации;
 - (вв) письменного разъяснения по вопросу применения нормативного правового акта Российской Федерации, в том числе нормативного акта Банка России, данного стороне либо неопределенному кругу лиц уполномоченным органом государственной власти (уполномоченным должностным лицом этого органа), в том числе Банком России, в пределах его компетенции;
 - (гг) принятия Верховным Судом Российской Федерации и/или Высшим Арбитражным Судом Российской Федерации судебного акта или разъяснения по вопросам судебной практики,

сторона соответствующей Сделки приходит к выводу, действуя разумно и добросовестно, что приобретение, владение или распоряжение

Акциями, являющимися предметом Сделки, является неправомерным либо что ее расходы в связи с исполнением ее обязательств по Сделке (в том числе в связи с увеличением налогового бремени) возрастут существенным образом;

- (В) **Нарушение обязательства по поставке** означает неисполнение или ненадлежащее исполнение стороной в установленный срок обязательства по поставке Акций по Сделке в случае, когда это вызвано отсутствием ликвидности на рынке таких Акций;
- (Г) **Банкротство** имеет значение, определенное в Генеральном соглашении, при этом ссылки на Сторону, ее Связанное лицо или Лицо, предоставляющее обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, считаются ссылками на Эмитента.
- (Д) **Невозможность хеджирования** означает, что Хеджирующая сторона не может, добросовестно предприняв все разумные усилия:
 - (аа) заключить, изменить или расторгнуть сделку по хеджированию риска изменения цены Акции или значения Индекса в связи с заключением ею Сделки и исполнением ее обязательств по Сделке; или
 - (бб) приобрести или распорядиться доходами по какой-либо из сделок или от имущества, указанных в подпункте (А) настоящего пункта 13.9(а);
- (Е) **Увеличение расходов на хеджирование** означает существенное увеличение (по сравнению с обстоятельствами, существовавшими на Дату сделки) затрат Хеджирующей стороны по уплате налогов, сборов, расходов или вознаграждения (кроме комиссии брокера) при:
 - (аа) заключении, изменении или расторжении сделки по хеджированию риска изменения цены Акции или значения Индекса в связи с заключением ею Сделки и исполнением ее обязательств по Сделке; или
 - (бб) приобретении или распоряжении доходами по какой-либо из сделок или от имущества, указанных в подпункте (А) настоящего пункта 13.9(а);при этом существенное увеличение затрат, вызванное ухудшением платежеспособности Хеджирующей стороны, не является Увеличением расходов на хеджирование;
- (Ж) **Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО** означает, что Хеджирующая сторона не имеет возможности, добросовестно предприняв все разумные усилия, приобрести Акции по сделке РЕПО в количестве, равном Акциям по сделке хеджирования (количество которых не может превышать количество Акций по Сделке) по ставке, равной или менее Максимальной ставки РЕПО;
- (З) **Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО** означает, что ставка РЕПО, по которой Хеджирующая сторона

может приобрести Акции в целях исполнения своих обязательств по Сделке, становится больше Первоначальной ставки РЕПО;

- (И) **Хеджирующая сторона** означает сторону, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания — каждую из сторон Сделки;
 - (К) **Акции по сделке хеджирования** означает количество Акции, которые Хеджирующая сторона считает необходимым приобрести для хеджирования риска изменения цены Акции или значения Индекса в связи с заключением Сделки и исполнением ее обязательств по Сделке, если к Сделке применимы условия «Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО» или «Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО»;
 - (Л) **Продавец по первой части сделки РЕПО** означает третье лицо, которое Хеджирующая сторона рассматривает в качестве приемлемого контрагента, действуя добросовестно и разумно, принимая во внимание другие сделки, которые могут быть заключены Хеджирующей стороной с этим контрагентом;
 - (М) **Нехеджирующая сторона** означает сторону, не являющуюся Хеджирующей стороной;
 - (Н) **Максимальная ставка РЕПО** означает применительно к Сделке, к которой применяется условие «Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО», ставку РЕПО, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке;
 - (О) **Первоначальная ставка РЕПО** означает применительно к Сделке, к которой применяется условие «Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО» ставку РЕПО, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке;
 - (П) **Корректировка цены** означает корректировку Цены исполнения, Первоначальной цены, Форвардной цены, Минимальной форвардной цены, Максимальной форвардной цены, Барьерной цены, спреда или иного параметра либо значения применительно к соответствующей Сделке.
- (б) Для целей определения последствий наступления Иного события, препятствующего исполнению:
- (А) если Изменение законодательства или Банкротство предусмотрено Подтверждением в качестве применимого Иного события, препятствующего исполнению, в случае его наступления любая сторона вправе по своему выбору расторгнуть Сделку, если направит другой стороне уведомление с указанием даты расторжения не менее чем за два Пла-

новых торговых дня, если меньший срок не требуется в соответствии с Изменением законодательства. В этом случае Сделка расторгается, а Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении, подлежащую уплате одной стороной другой стороне;

- (Б) если Нарушение обязательства по поставке предусмотрено Подтверждением в качестве применимого Иного события, препятствующего исполнению, такое событие не будет являться Нарушением обязательства в соответствии с Генеральным соглашением, и в случае его наступления сторона, обязанная произвести поставку соответствующих акций (далее — «**Поставщик**»), обязана:
- (аа) уведомить другую сторону (далее — «**Получатель**») о Нарушении обязательства по поставке:
 - (I) применительно к Сделке опцион не позднее следующего Клирингового дня после Даты осуществления права на исполнение;
 - (II) применительно к Сделке форвард или Сделке своп не менее чем за один Расчетный цикл до Даты расчетов;
 - (бб) в Дату расчетов передать Получателю в собственность такое количество Акции, которое Поставщик может поставить в этот день.

Обязательство Получателя произвести какой-либо платеж или встречную поставку Поставщику уменьшается пропорционально количеству Акции, которое он получит от Поставщика.

Применительно к Европейскому опциону или Сделке форвард Получатель вправе по своему выбору расторгнуть Сделку, если направит Поставщику уведомление об этом. В этом случае Сделка расторгается в день получения такого уведомления. Получатель как Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении (с учетом частично исполненной поставки, если применимо).

Применительно к Американскому опциону или Бермудскому опциону Получатель вправе по своему выбору досрочно прекратить обязательства по Сделке в части осуществленных Опционов, если направит Поставщику уведомление об этом. В день получения этого уведомления обязательства по Сделке в части осуществленных Опционов прекращаются досрочно. Получатель как Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении, подлежащую уплате применительно к досрочно прекращенным обязательствам по Сделке (с учетом частично исполненной поставки, если применимо).

Применительно к Сделке своп Получатель вправе по своему выбору досрочно прекратить обязательства по Сделке в части поставки Количества акций или Количества корзин в соответствующую Дату расчетов, если направит Поставщику уведомление об этом. По получении Поставщиком этого уведомления обязательства сторон по Сделке в ча-

сти поставки Количества акций или Количества корзин в соответствующую Дату расчетов прекращаются досрочно в такую Дату расчетов. Получатель как Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении, подлежащую уплате применительно к досрочно прекращенным обязательствам по Сделке (с учетом частично исполненной поставки, если применимо).

Применительно к:

(аа) Американскому опциону или Бермудскому опциону, если применимо условие о Многократном исполнении и при этом осуществлена часть Опционов в соответствующую Дату осуществления права на исполнение;

(бб) Сделке своп, по которой не наступила одна или несколько Дат расчетов,

в пределах одного Расчетного цикла с Даты расчетов, когда обязательства по Сделке были прекращены досрочно, Получатель вправе досрочно прекратить обязательства по оставшейся части Сделки, если направит Поставщику уведомление об этом не менее чем за два Плановых торговых дня. В этом случае обязательства по Сделке прекращаются досрочно в день получения указанного уведомления. Получатель как Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении, подлежащую уплате применительно к досрочно прекращенным обязательствам по Сделке (с учетом частично исполненной поставки, если применимо);

(В) если Невозможность хеджирования предусмотрена Подтверждением в качестве применимого Иного события, препятствующего исполнению, в случае наступления этого события Хеджирующая сторона вправе при условии, что Невозможность хеджирования продолжает иметь место, расторгнуть Сделку, если направит Нехеджирующей стороне уведомление с указанием даты расторжения не менее чем за два Плановых торговых дня. При этом Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении, подлежащую уплате одной стороной другой стороне.

(Г) если Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО предусмотрена Подтверждением в качестве применимого Иного события, препятствующего исполнению, в случае ее наступления Хеджирующая сторона вправе уведомить Нехеджирующую сторону об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО, а Нехеджирующая сторона вправе:

(аа) предоставить Хеджирующей стороне Акции по сделке РЕПО в количестве, равном Акциям по сделке хеджирования, по ставке, равной или менее Максимальной ставки РЕПО; или

(бб) рекомендовать Хеджирующей стороне Продавца по первой части сделки РЕПО, который предоставит Хеджирующей стороне Акции

по сделке РЕПО в количестве, равном Акциям по сделке хеджирования, по ставке, равной или менее Максимальной ставки РЕПО, в каждом случае не позднее двух Плановых торговых дней со дня получения уведомления об Утрате возможности приобрести ценные бумаги по сделкам РЕПО.

Если Нехеджирующая сторона и Продавец по первой части сделки РЕПО не могут предоставить Акции по сделке РЕПО в количестве, равном Акциям по сделке хеджирования, либо приемлемый Продавец по первой части сделки РЕПО не найден в течение указанного срока, Хеджирующая сторона вправе расторгнуть Сделку, если направит Нехеджирующей стороне уведомление с указанием даты расторжения, которая может быть днем получения такого уведомления. При этом Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении, подлежащую уплате одной стороной другой стороне.

- (Д) если Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО предусмотрено Подтверждением в качестве применимого Иного события, препятствующего исполнению, в случае его наступления Хеджирующая сторона обязана незамедлительно уведомить Нехеджирующую сторону о происшедшем Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО и о том, что по Сделке будет проведена Корректировка цены.

Нехеджирующая сторона обязана в срок не позднее двух Плановых торговых дней со дня получения уведомления об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО и проведении Корректировки цены уведомить Хеджирующую сторону о том, что она:

- (аа) соглашается с предложенным изменением условий Сделки в части Корректировки цены;
- (бб) уплачивает Хеджирующей стороне сумму, определенную Расчетным агентом, которая соответствует Корректировке цены; или
- (вв) расторгает Сделку в этот второй Плановый торговый день.

Если указанное уведомление не направлено по истечении указанного второго Планового торгового дня, Хеджирующая сторона вправе расторгнуть Сделку, если направит Нехеджирующей стороне уведомление с указанием даты расторжения, которая может быть днем получения такого уведомления.

Если какая-либо из сторон заявляет о расторжении Сделки, Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении, подлежащую уплате одной стороной другой стороне.

В течение указанного срока Нехеджирующая сторона вправе во избежание Корректировки цены или расторжения Сделки:

- (гг) предоставить Хеджирующей стороне Акции по сделке РЕПО в количестве, равном Акциям по сделке хеджирования, по ставке, равной или менее Первоначальной ставки РЕПО; или

- (дд) рекомендовать Хеджирующей стороне Продавца по первой части сделки РЕПО, который предоставит Хеджирующей стороне Акции по сделке РЕПО в количестве, равном Акциям по сделке хеджирования, по ставке, равной или менее Первоначальной ставки РЕПО.
- (Е) если Увеличение расходов на хеджирование предусмотрено Подтверждением в качестве применимого Иного события, препятствующего исполнению, в случае его наступления Хеджирующая сторона обязана незамедлительно уведомить Нехеджирующую сторону о произошедшем Увеличении расходов на хеджирование и о том, что по Сделке будет проведена Корректировка цены.
- Нехеджирующая сторона обязана в срок не позднее двух Плановых торговых дней со дня получения уведомления об Увеличении расходов на хеджирование и проведении Корректировки цены уведомить Хеджирующую сторону о том, что она:
- (Ж) соглашается с предложенным изменением условий Сделки в части Корректировки цены;
- (З) уплачивает Хеджирующей стороне сумму, определенную Расчетным агентом, которая соответствует Корректировке цены; или
- (И) расторгает Сделку в этот второй Плановый торговый день.
- Если указанное уведомление не направлено по истечении указанного второго Планового торгового дня, Хеджирующая сторона вправе расторгнуть Сделку, если направит Нехеджирующей стороне уведомление с указанием даты расторжения, которая может быть днем получения такого уведомления.
- Если какая-либо из сторон заявляет о расторжении Сделки, Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении, подлежащую уплате одной стороной другой стороне.
- (в) Если Подтверждением предусмотрено, что к Сделке применимы как Невозможность хеджирования, так и Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО, и событие, которое при отсутствии настоящего пункта могло бы рассматриваться как Невозможность хеджирования, также представляет собой Утрату возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО, к такому событию применяются последствия, установленные для Утраты возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО.
- (г) Акции, предоставляемые Нехеджирующей стороной или Продавцом по первой части сделки РЕПО при Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО или Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО, не должны быть ограничены в обращении в соответствии с законодательством Российской Федерации. Сделка РЕПО в отношении Акции должна быть оформлена в соответствии с требованиями Хеджирующей стороны.

(д) Сумма выплаты при расторжении, подлежащая уплате одной стороной другой стороне, должна быть уплачена обязанной стороной не позднее трех Банковских дней после получения ею уведомления с указанием:

(А) этой суммы, рассчитанной Определяющей стороной, в валюте расчетов по Сделке в соответствии с тем, как это определит Определяющая сторона, и

(Б) стороны, которая обязана уплатить Сумму выплаты при расторжении.

Такое уведомление должно быть направлено Определяющей стороной незамедлительно после проведения расчета.

АЛФАВИТНО-ПРЕДМЕТНЫЙ УКАЗАТЕЛЬ

Термин	Пункт
Акции	1.1
Акции по сделке хеджирования	13.9(а)(К)
«Акция за акцию	13.1(е)
«Акция за иное предоставление	13.1(ж)
«Акция за смешанное предоставление	13.1(з)
Американский опцион	2.2(а)
Базовый актив	1.2
Банковский день	1.3
Банкротство	13.9(а)(Г)
Барьерная цена	6.2
Барьерное отлагательное условие	6.1(а)
Барьерное отменительное условие	6.1(б)
Барьерный ориентир	6.3
Бермудский опцион	2.2(б)
Беспоставочная сделка	1.4
Биржа	1.5
Биржа опционов	12.4
Биржа срочных контрактов	1.6
Биржевая цена	1.7
Биржевой день	1.8
Биржевой контракт	7.6(б)(А)
Валюта платежа	1.9
Внеочередные дивиденды	11.6
Внеплановое закрытие	7.3(в)
Время закрытия	3.1(а)
Время закрытия торгов	1.10
Время оценки	7.1
Второй период	11.3(б)
Выбор способа расчетов	8.1
Генеральное соглашение	1.11
Дата выбора способа расчетов	8.2
Дата выплаты дивидендов	11.2
Дата истечения срока	3.1(д)
Дата начала срока	2.1(а)
Дата объявления	13.1(м)
Дата окончательного платежа	5.1(е)

Дата осуществления права на исполнение	3.1(б)
Дата оценки	7.2
Дата первоначального платежа	5.1(г)
Дата поглощения	13.1(в)
Дата предварительной оплаты	4.2(а)
Дата приобретения по публичной оферте	13.1(д)
Дата расчетов	8.4
Дата сделки	1.12
Дата события	13.7(б)
Дата уплаты премии	2.4(а)
Делистинг	13.6(б)
Дифференциал цены исполнения	13.6(б)9.2
Европейский опцион	2.2(в)
Заменяющий индекс	12.1
Затронутые акции	13.1(о)
Изменение законодательства	13.9(а)(Б)
Изменение индекса	12.2(а)(А)
Индекс	1.13
Индексированная сумма	9.5
Иное предоставление	13.1(к)
Иное событие, препятствующее исполнению	13.9(а)(А)
Капитализация дивидендов	11.4
Клиринговая организация	1.14
Клиринговый день	1.15
Количество акций	1.16
Количество акций, подлежащих поставке	10.4
Количество корзин	1.17
Количество корзин, подлежащих поставке	10.5
Количество опционов	2.1(б)
Контрольная дата	6.4
Контрольное время	6.5
Корзина	1.18
Корректировка цены	13.9(а)(П)
Максимальная ставка РЕПО	13.9(а)(Н)
Максимальная форвардная цена	4.1(в)
Максимальное число	3.2(в)
Метод корректировки	12.3
Минимальная форвардная цена	4.1(б)
Минимальное число	3.2(в)
Множественное исполнение	3.2(в)
Множитель	1.19

Нарушение обязательства по поставке	13.9(a)(B)
Национализация	13.6(a)
Невозможность хеджирования	13.9(a)(Д)
Нехеджирующая сторона	13.9(a)(M)
Новые акции	13.1(и)
Номинальная сумма сделки	1.20
Окончательная цена	5.1(и)
Определяющая сторона	13.8(б)
Опцион	2.1(г)
Опцион на покупку (колл)	2.3(a)
Опцион на продажу (пут)	2.3(б)
Особое обстоятельство	13.1(a)
Официальная цена	7.6(б)(B)
Оценка стоимости фьючерса	7.6
Первоначальная дата оценки	7.4
Первоначальная ставка РЕПО	13.9(a)(O)
Первоначальная цена	5.1(з)
Первый период	11.3(a)
Пересчет номинальной суммы сделки	5.1(к)
Период начисления дивидендов	11.3
Плановый торговый день	1.21
Плательщик индексированной суммы	5.1(a)
Поглощение	13.1(б)
Подразумеваемая волатильность	13.1(н)
Подтверждение	1.22
Покупатель	1.23
Получатель	13.9(б)(B)(aa)
Получатель индексированной суммы	5.1(б)
Пороговая цена	3.2(ж)
(далее — « <i>Последствие поглощения</i> »	13.2
Поставочная сделка	1.24
Поставщик	13.9(б)(B)
Потенциальное событие корректировки	12.5
Право на исполнение	1.31
Предварительная оплата	4.2(a)
Предмет опциона	2.1(в)
Прекращение расчета индекса	12.2(a)(B)
Премия	2.4(a)
Примерные условия договора	1.25
Приобретение по публичной оферте	13.1(г)
Продавец	1.26

Продавец по первой части сделки РЕПО	13.9(а)(Л)
Разработчик индекса	1.27
Расчетная цена	8.3
Расчетный агент	1.28
Расчетный цикл	1.29
Сбой в проведении торгов	7.3(а)
Сбой в работе биржи	7.3(б)
Сбой индекса	12.2(б)
Сделка	1.30
Сделка беспоставочный опцион	1.31(а)
Сделка беспоставочный опцион на акции	1.31(а)(Б)
Сделка беспоставочный опцион на корзину акций	1.31(а)(Г)
Сделка индексный своп	1.35(а)(А)
Сделка поставочный своп на акции	1.35(б)(А)
Сделка беспоставочный своп	1.35(а)
Сделка беспоставочный своп на акции	1.35(а)(Б)
Сделка беспоставочный своп на корзину акций	1.35(а)(Г)
Сделка беспоставочный форвард	1.39(а)
Сделка беспоставочный форвард на акции	1.39(а)(Б)
Сделка беспоставочный форвард на корзину акций	1.39(а)(Г)
Сделка индексный опцион	1.31(а)(А)
Сделка индексный своп	1.35(а)(А)
Сделка индексный форвард	1.39(а)(А)
Сделка опцион	1.31
Сделка опцион на акции	1.32
Сделка опцион на корзину	1.33
Сделка опцион на корзину акций	1.34
Сделка опцион на корзину индексов	1.31(а)(В)
Сделка поставочный опцион	1.31(в)
Сделка поставочный опцион на акции	1.31(б)
Сделка поставочный опцион на корзину акций	1.31(в)
Сделка поставочный своп	1.35(б)(Б)
Сделка поставочный своп на акции	1.35(б)(А)
Сделка поставочный своп на корзину акций	1.35(б)(Б)
Сделка поставочный форвард	1.39(в)
Сделка поставочный форвард на акции	1.39(б)
Сделка поставочный форвард на корзину акций	1.39(в)
Сделка своп	1.35
Сделка своп на акции	1.36
Сделка своп на корзину	1.37
Сделка своп на корзину акций	1.38

Сделка своп на корзину индексов	1.35(a)(B)
Сделка форвард	1.39
Сделка форвард на акции	1.40
Сделка форвард на корзину	1.41
Сделка форвард на корзину акций	1.42
Сделка форвард на корзину индексов	1.39(a)(B)
Смешанное предоставление	13.1(л)
Событие, препятствующее проведению расчетов	10.7
Событие, требующее корректировки индекса	12.2(б)
Способ расчетов по умолчанию	8.1
Срок осуществления права на исполнение	3.1(в)
Срочная сделка на акции	1.43
Срочная сделка на индекс	1.44
Срочная сделка на корзину акций	1.45
Срочная сделка на корзину индексов	1.46
Стандартные условия	Преамбула
Стоимость без учета коррекции	13.7(б)(A)(aa)
Стоимость дробной части акций	10.6
Стоимость коррекции	13.7(б)(A)(bb)
Сумма внеочередных дивидендов	11.7
Сумма выплаты при расторжении	13.8(a)
Сумма дивидендов	11.1
Сумма дохода	5.1(ж)
Сумма окончательного платежа	5.1(д)
Сумма первоначального платежа	5.1(в)
Сумма платежа	9.1
Требование об исполнении	3.1(г)
Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО	13.9(a)(З)
Увеличение расходов на хеджирование	13.9(a)(Е)
Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО	13.9(a)(Ж)
Форвардная цена	4.1(a)
Хеджирующая сторона	13.9(a)(И)
Целый множитель	3.2(в)
Цена исполнения	2.1(д)
Чрезвычайная ситуация	7.3
Эмитент	1.47

СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ
СРОЧНЫХ СДЕЛОК С АКЦИЯМИ
И ФОНДОВЫМИ ИНДЕКСАМИ

2011 г.

(Часть 2)

This 2011 Standard Terms of Share and Index Derivatives Transactions — Forms of Confirmation, is based, in part, on selected provisions of the 2002 ISDA Equity Derivatives Definitions, © 2002 International Swaps and Derivatives Association, Inc., («ISDA®») and the Forms of Confirmation for use with the 2002 Equity Derivative Definitions and is used with its permission. ISDA takes no position as to this Russian-version 2011 Standard Terms of Share and Index Derivatives Transactions' — Forms of Confirmation's suitability for use in any particular transaction. Prospective users should seek independent legal advice before using this instrument.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Стиль опциона:

[Американский/Бермудский/
Европейский]

Тип опциона:

[Опцион на продажу (пут) [●] /
Опцион на покупку (колл) [●]]

Продавец:

[Сторона Б] [Сторона А]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Индекс:

Количество опционов:

[Множитель:]¹

Цена исполнения:²

Премия:

[●] [(Премия за Опцион [●])]³

Дата уплаты премии:

Биржа:

Биржа (Биржи) срочных контрактов:⁴

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]⁵

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]⁶

[Барьерное отменительное условие:

[Применимо]⁷

¹ Условие о Множителе и его размер включаются, если Сумма платежа будет рассчитываться исходя из процента изменения Индекса или иной суммы.

² Выражается как уровень Индекса.

³ Если указана Премия за Опцион, то общая сумма Премии составляет произведение Премии за Опцион и Количества опционов.

⁴ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Индекс.

⁵ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

⁶ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

⁷ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

- Барьерная цена:
- Барьерный ориентир:
- Контрольная дата (даты):
- Контрольное время:]⁸
- (б) Порядок осуществления Права на исполнение:
- [Дата начала срока:]⁹
- [Дата (Даты) осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону:]¹⁰
- Время закрытия: [●] ч. [●] мин.
по московскому времени
- Дата истечения срока:
- Многokrатное исполнение: [Применимо][Не применимо]
- [Минимальное число:
- Максимальное число:
- Целый множитель:]¹¹
- Автоматическое исполнение: [Применимо][Не применимо]
- (в) Оценка:
- Время оценки: [●] ч. [●] мин.
по московскому времени¹²
- Дата оценки: [Каждая]¹³ Дата осуществления права на исполнение
- [Оценка стоимости фьючерса: [Применимо][Не применимо]
- Биржевой контракт:]¹⁴
- (г) Условия расчетов:
- Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки: Применимо
- Валюта платежа:
- Расчетная цена:

⁸ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

⁹ Стороны должны указать данную информацию для Американского опциона. Если Дата начала срока не указана, то Датой начала срока является Дата сделки.

¹⁰ Стороны должны указать данную информацию для Бермудского опциона.

¹¹ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

¹² Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

¹³ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

¹⁴ Включить, если условие об оценке стоимости фьючерса применимо к Индексу.

Дата расчетов:	[В отношении каждой Даты осуществления права на исполнение,] ¹⁵ [●] Банковских дней после соответствующей Даты оценки
[Сумма платежа: Дифференциал цены исполнения:] ¹⁶	
(д) Событие, требующее корректировки индекса:	
Прекращение расчета индекса:	[Корректировка расчетным агентом] [Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой]
Изменение индекса:	[Корректировка расчетным агентом] [Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой]
Сбой индекса:	[Корректировка расчетным агентом] [Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой]
(е) Иные события, препятствующие исполнению:	
[Изменение законодательства:	[Применимо]] ¹⁷
[Невозможность хеджирования:	[Применимо]
Хеджирующая сторона:] ¹⁸	
[Увеличение расходов на хеджирование:	[Применимо]
Хеджирующая сторона:] ¹⁹	
[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО:	[Применимо]
Максимальная ставка РЕПО:	
Хеджирующая сторона:] ²⁰	

¹⁵ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

¹⁶ Стороны указывают, как будет определяться Сумма платежа и/или Дифференциал цены исполнения, если они намерены изменить пункты 9.1 и/или 9.2 Стандартных условий.

¹⁷ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

¹⁸ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

¹⁹ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

²⁰ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

[Увеличение расходов
на приобретение ценных бумаг
по сделкам РЕПО:

[Применимо]

Максимальная ставка РЕПО:

Первоначальная ставка РЕПО:

Хеджирующая сторона:]²¹

[Определяющая сторона:

[Покупатель] [Продавец]
[Покупатель и Продавец]]²²

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

²¹ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

²² Включить, если условие о каком-либо Ином событии, препятствующем исполнению, применимо.

ПРИЛОЖЕНИЕ 2
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки беспоставочный опцион на акции

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Стиль опциона:

[Американский/Бермудский/
Европейский]

Тип опциона:

[Опцион на продажу (пут) [●] /
Опцион на покупку (колл) [●]]

Продавец:

[Сторона Б] [Сторона А]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Акции:

[*Полное наименование, категория (тип), и/или номинальная стоимость Акций, идентификационный номер выпуска или иные идентификационные признаки Акций*] [полное фирменное наименование Эмитента Акций]

Количество опционов:

[Предмет опциона:

[●] Акция (-и/-й) по одному Опциону]²³

Цена исполнения:²⁴

Премия:

[●] [(Премия за Опцион [●])]²⁵

Дата уплаты премии:

Биржа:

Биржа срочных контрактов:²⁶

[Барьерное

[Применимо]²⁷

отлагательное условие:

Барьерная цена:

²³ По умолчанию Предмет опциона составляет одну Ацию. Предмет опциона необходимо указывать только в случае, когда Предмет опциона составляет количество Аций, отличное от установленного по умолчанию.

²⁴ Выражается как Цена исполнения за одну Ацию. Стороны могут указать сумму или формулу, по которой рассчитывается Цена исполнения, и корректировки, обусловленные какой-либо выплатой дивидендов.

²⁵ Если указана Премия за Опцион, то общая сумма Премии составляет произведение Премии за Опцион и Количества опционов.

²⁶ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Ация.

²⁷ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

- Барьерный ориентир:
 Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]²⁸
 [Барьерное отменительное условие: [Применимо]²⁹
 Барьерная цена:
 Барьерный ориентир:
 Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]³⁰
- (б) Порядок осуществления Права на исполнение:
 [Дата начала срока:]³¹
 [Дата (Даты) осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону:]³²
 [Время закрытия: [●] ч. [●] мин. по московскому времени]
 Дата истечения срока:
 Многократное исполнение: [Применимо][Не применимо]
 [Минимальное число:
 Максимальное число:
 Целый множитель:]³³
 Автоматическое исполнение: [Применимо][Не применимо]
- (в) Оценка:
 Время оценки: [●] ч. [●] мин. по московскому времени³⁴
 Дата оценки: [Каждая]³⁵ Дата осуществления права на исполнение

²⁸ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

²⁹ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

³⁰ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

³¹ Стороны должны указать данную информацию для Американского опциона. Если Дата начала срока не указана, то Датой начала срока является Дата сделки.

³² Стороны должны указать данную информацию для Бермудского опциона.

³³ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

³⁴ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

³⁵ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

- (г) Условия расчетов:
- Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки: Применимо
- Валюта платежа:
- Расчетная цена:
- Дата расчетов: [В отношении каждой Даты осуществления права на исполнение,]³⁶
[●] Банковских дней после соответствующей Даты оценки
- [Сумма платежа:
- Дифференциал цены исполнения:]³⁷
- [Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]
- Сторона, наделенная правом выбора: [Покупатель][Продавец]
- Дата выбора способа расчетов:
- Способ расчетов по умолчанию: Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки]³⁸
- (д) Дивиденды:
- Внеочередные дивиденды:]³⁹
- (е) Корректировки по Акциям:
- Метод корректировки: [Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
- [Биржа опционов:]⁴⁰
- (ж) Особые обстоятельства:
- Последствия Поглощения:
- «Акция за акцию»: [Замена базового актива]
[Расторжение с выплатой ([Согласованный способ]
[Определение расчетным агентом])]
[Биржевая корректировка]

³⁶ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

³⁷ Стороны указывают, как будет определяться Сумма платежа и/или Дифференциал цены исполнения, если они намерены изменить пункты 9.1 и/или 9.2 Стандартных условий.

³⁸ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов.

³⁹ Если стороны не указывают, что относится к Внеочередным дивидендам, Расчетный агент определяет, являются ли дивиденды Внеочередными дивидендами.

⁴⁰ Включить, если в качестве Метода корректировки указана Биржевая корректировка.

- «Акция за иное предоставление»:
- [Корректировка расчетным агентом]
 - [Расширенная корректировка расчетным агентом]
 - [Замена базового актива]
 - [Расторжение с выплатой ([Согласованный способ])]
 - [Определение расчетным агентом]]
 - [Биржевая корректировка]
 - [Корректировка расчетным агентом]
 - [Расширенная корректировка расчетным агентом]
- «Акция за смешанное предоставление»:
- [Замена базового актива]
 - [Расторжение с выплатой ([Согласованный способ])]
 - [Определение расчетным агентом]]
 - [Биржевая корректировка]
 - [Корректировка расчетным агентом]
 - [Расширенная корректировка расчетным агентом]
 - [Смешанная корректировка]
- [Биржа опционов:]⁴¹
- [Ставка:]⁴²
- (з) [Приобретение по публичной оферте: Применимо]⁴³
- (и) Последствия Приобретения по публичной оферте:
- «Акция за акцию»:
- [Расторжение с выплатой ([Согласованный способ])]
 - [Определение расчетным агентом]]
 - [Биржевая корректировка]
 - [Корректировка расчетным агентом]
 - [Расширенная корректировка расчетным агентом]
- «Акция за иное предоставление»:
- [Расторжение с выплатой ([Согласованный способ])]
 - [Определение расчетным агентом]]
 - [Биржевая корректировка]

⁴¹ Включить, если в качестве последствия Поглощения указана Биржевая корректировка.

⁴² Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой (Согласованный способ). При этом указываются процентная ставка и ставка РЕПО в совокупности (пункт 13.7(b)(i)(A)(IV) Стандартных условий).

⁴³ Включить, если условие о Приобретении по публичной оферте применимо.

	[Корректировка расчетным агентом]
	[Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Расторжение с выплатой ([Согласованный способ] [Определение расчетным агентом])] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Смешанная корректировка] [Биржа опционов:] ⁴⁴ [Ставка:] ⁴⁵
(к) Состав Смешанного предоставления:	[Применимо][Не применимо]
(л) Национализация или Делистинг:	[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой ([Согласованный способ] [Определение расчетным агентом])] [Ставка:] ⁴⁶
(м) Иные события, препятствующие исполнению:	
[Изменение законодательства:	[Применимо]] ⁴⁷
[Нарушение обязательства по поставке:	[Применимо]] ⁴⁸
[Банкротство:	[Применимо]] ⁴⁹
[Невозможность хеджирования:	[Применимо]

⁴⁴ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указана Биржевая корректировка.

⁴⁵ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указано Расторжение с выплатой (Согласованный способ). При этом указываются процентная ставка и ставка РЕПО в совокупности (пункт 13.7(b)(i)(A)(IV) Стандартных условий).

⁴⁶ Включить, если в качестве последствия Национализации или Делистинга указано Расторжение с выплатой (Согласованный способ). При этом указываются процентная ставка и ставка РЕПО в совокупности (пункт 13.7(b)(i)(A)(IV) Стандартных условий).

⁴⁷ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

⁴⁸ Условие о Нарушении обязательства по поставке может быть применимо, если стороны договорились о применении Выбора способа расчетов, поскольку в этом случае ими может быть выбран способ расчетов в порядке, установленном для Поставочной сделки.

⁴⁹ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

Хеджирующая сторона:]⁵⁰
[Увеличение расходов на хеджирование: [Применимо]
Хеджирующая сторона:]⁵¹
[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО: [Применимо]
Максимальная ставка РЕПО:
Хеджирующая сторона:]⁵²
[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО: [Применимо]
Максимальная ставка РЕПО:
Первоначальная ставка РЕПО:
Хеджирующая сторона:]⁵³
[Определяющая сторона: [Покупатель][Продавец]
[Покупатель и Продавец]]⁵⁴

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

⁵⁰ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

⁵¹ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

⁵² Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

⁵³ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

⁵⁴ Включить, если какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению, применимо.

ПРИЛОЖЕНИЕ 3
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки поставочный опцион на акции

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Стиль опциона:

[Американский/Бермудский/
Европейский]

Тип опциона:

[Опцион на продажу (пут) [●] /
Опцион на покупку (колл) [●]]

Продавец:

[Сторона Б] [Сторона А]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Акции:

[*Полное наименование, категория (тип), и/или номинальная стоимость Акции, идентификационный номер выпуска или иные идентификационные признаки Акции*] [*полное фирменное наименование Эмитента Акции*]

Количество опционов:

[Предмет опциона:

[●] Акция (-и/-й) по одному Опциону]⁵⁵

Цена исполнения:⁵⁶

Премия:

[●] [(Премия за Опцион [●])]⁵⁷

Дата уплаты премии:

Биржа:

Биржа (Биржи) срочных контрактов:⁵⁸

[Клиринговая организация:]⁵⁹

[Барьерное отлагательное условие: [Применимо]⁶⁰

⁵⁵ По умолчанию Предмет опциона составляет одну Аксию. Предмет опциона необходимо указывать только в случае, когда Предмет опциона составляет количество Акции, отличное от установленного по умолчанию.

⁵⁶ Выражается как Цена исполнения за одну Аксию. Стороны могут указать сумму или формулу, по которой рассчитывается Цена исполнения, и корректировки, обусловленные какой-либо выплатой дивидендов.

⁵⁷ Если указана Премия за Опцион, то общая сумма Премии составляет произведение Премии за Опцион и Количества опционов.

⁵⁸ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Аксию.

⁵⁹ Включить, если расчеты по Сделке будут проводиться через Клиринговую организацию.

⁶⁰ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-не) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]⁶¹

[Барьерное отменительное условие: [Применимо]⁶²

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]⁶³

(б) Порядок осуществления Права на исполнение:

[Дата начала срока:]⁶⁴

[Дата (Даты) осуществления
права на исполнение
по Бермудскому опциону:]⁶⁵

Время закрытия: [●] ч. [●] мин.
по московскому времени

Дата истечения срока:

Многократное исполнение: [Применимо][Не применимо]

[Минимальное число:

Максимальное число:

Целый множитель:]⁶⁶

Автоматическое исполнение: [Применимо][Не применимо]

[Пороговая цена:]⁶⁷

⁶¹ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

⁶² Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

⁶³ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

⁶⁴ Стороны должны указать данную информацию для Американского опциона. Если Дата начала срока не указана, то Датой начала срока является Дата сделки.

⁶⁵ Стороны должны указать данную информацию для Бермудского опциона.

⁶⁶ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

⁶⁷ Включить, если применимо условие об Автоматическом исполнении. Стороны могут определить Пороговую цену путем ссылки на какую-либо устанавливаемую цену (например, самую высокую цену спроса по состоянию на 11 часов), в том числе с указанием биржи.

- (в) Условия расчетов:
- | | |
|---|---|
| Расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки | Применимо |
| Валюта платежа: | |
| [Выбор способа расчетов: | [Применимо][Не применимо] |
| Сторона, наделенная правом выбора: | [Покупатель][Продавец] |
| Дата выбора способа расчетов: | |
| Способ расчетов по умолчанию: | Расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки ⁶⁸ |
- (г) [Дивиденды:
Внеочередные дивиденды:]⁶⁹
- (д) Корректировки:
- | | |
|---------------------------------|---|
| Метод корректировки: | [Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом] |
| [Биржа опционов:] ⁷⁰ | |
- (е) Особые обстоятельства:
- | | |
|--|--|
| Последствия Поглощения:
«Акция за акцию»: | [Замена базового актива]
[Расторжение с выплатой
([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]
[Биржевая корректировка]
[Расширенная корректировка
расчетным агентом] |
| «Акция за иное предоставление»: | [Замена базового актива]
[Расторжение с выплатой
([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]
[Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Расширенная корректировка
расчетным агентом] |

⁶⁸ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов.

⁶⁹ Если стороны не указывают, что относится к Внеочередным дивидендам, Расчетный агент определяет, являются ли дивиденды Внеочередными дивидендами.

⁷⁰ Включить, если в качестве Метода корректировки указана Биржевая корректировка.

- «Акция за смешанное предоставление»: [Замена базового актива]
 [Расторжение с выплатой
 ([Согласованный способ
 [Определение расчетным агентом]])]
 [Биржевая корректировка]
 [Корректировка расчетным агентом]
 [Расширенная корректировка
 расчетным агентом]
 [Смешанная корректировка]
 [Биржа опционов:]⁷¹
 [Ставка:]⁷²
- (ж) [Приобретение по публичной оферте: Применимо]⁷³
- (з) Последствия Приобретения по публичной оферте:
- «Акция за акцию»: [Расторжение с выплатой
 ([Согласованный способ
 [Определение расчетным агентом]])]
 [Биржевая корректировка]
 [Корректировка расчетным агентом]
 [Расширенная корректировка
 расчетным агентом]
- «Акция за иное предоставление»: [Расторжение с выплатой
 ([Согласованный способ
 [Определение расчетным агентом]])]
 [Биржевая корректировка]
 [Корректировка расчетным агентом]
 [Расширенная корректировка
 расчетным агентом]
- «Акция за смешанное предоставление»: [Расторжение с выплатой
 ([Согласованный способ
 [Определение расчетным агентом]])]
 [Биржевая корректировка]
 [Корректировка расчетным агентом]

⁷¹ Включить, если в качестве последствия Поглощения указана Биржевая корректировка.

⁷² Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой (Согласованный способ). При этом указываются процентная ставка и ставка РЕПО в совокупности (пункт 13.7(b)(i)(A)(IV) Стандартных условий).

⁷³ Включить, если условие о Приобретении по публичной оферте применимо.

- [Расширенная корректировка
расчетным агентом]
[Смешанная корректировка]
[Биржа опционов:]⁷⁴
[Ставка:]⁷⁵
- (и) Состав Смешанного предоставления: [Применимо][Не применимо]
- (к) Национализация или Делистинг: [Ликвидационный неттинг
по соглашению сторон]
[Расторжение с выплатой
([Согласованный способ]
[Определение расчетным агентом])]
[Ставка:]⁷⁶
- (л) Иные события, препятствующие исполнению:
- [Изменение законодательства: [Применимо]]⁷⁷
[Нарушение обязательства по поставке: [Применимо]]⁷⁸
[Банкротство: [Применимо]]⁷⁹
[Невозможность хеджирования: [Применимо]
Хеджирующая сторона:]⁸⁰
[Увеличение расходов на хеджирование: [Применимо]
Хеджирующая сторона:]⁸¹
[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО: [Применимо]
Максимальная ставка РЕПО:
Хеджирующая сторона:]⁸²

⁷⁴ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указана Биржевая корректировка.

⁷⁵ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указано Расторжение с выплатой (Согласованный способ). При этом указываются процентная ставка и ставка РЕПО в совокупности (пункт 13.7(b)(i)(A)(IV) Стандартных условий).

⁷⁶ Включить, если в качестве последствия Национализации или Делистинга указано Расторжение с выплатой (Согласованный способ). При этом указываются процентная ставка и ставка РЕПО в совокупности (пункт 13.7(b)(i)(A)(IV) Стандартных условий).

⁷⁷ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

⁷⁸ Включить, если условие о Нарушении обязательства по поставке применимо.

⁷⁹ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

⁸⁰ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

⁸¹ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

⁸² Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

[Увеличение расходов
на приобретение
ценных бумаг по сделкам РЕПО:

[Применимо]

Максимальная ставка РЕПО:

Первоначальная ставка РЕПО:

Хеджирующая сторона:]⁸³

[Определяющая сторона:

[Покупатель][Продавец]
[Покупатель и Продавец]]⁸⁴

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей и поставок:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для поставки Акций в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Реквизиты для поставки Акций в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

⁸³ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

⁸⁴ Включить, если какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению, применимо.

ПРИЛОЖЕНИЕ 4
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки опцион на корзину индексов

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Стиль опциона:

[Американский/Бермудский/
Европейский]

Тип опциона:

[Опцион на продажу (пут) [●] /
Опцион на покупку (колл) [●]]

Продавец:

[Сторона Б] [Сторона А]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Корзина:

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

Количество опционов:

[Множитель:]⁸⁵

Цена исполнения:⁸⁶

Премия:

[●] [(Премия за Опцион [●])] ⁸⁷

Дата уплаты премии:

Биржа (Биржи):

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

Биржа (Биржи) срочных контрактов:

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению⁸⁸

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]⁸⁹

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]⁹⁰

⁸⁵ Включить условие о Множителе, если основой Суммы платежа будет процентное выражение изменения Индекса или иная сумма.

⁸⁶ Выражается как сумма за Корзину.

⁸⁷ Если указана Премия за Опцион, то общая сумма Премии составляет произведение Премии за Опцион и Количества опционов.

⁸⁸ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Индекс.

⁸⁹ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

⁹⁰ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

- [Барьерное отменительное условие: [Применимо]⁹¹
- Барьерная цена:
- Барьерный ориентир:
- Контрольная дата (даты):
- Контрольное время:]⁹²
- (б) Порядок осуществления Права на исполнение:
- [Дата начала срока:]⁹³
- [Дата (Даты) осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону:]⁹⁴
- Время закрытия: [●] ч. [●] мин.
по московскому времени
- Дата истечения срока:
- Многokrатное исполнение: [Применимо][Не применимо]
- [Минимальное число:
- Максимальное число:
- Целый множитель:]⁹⁵
- Автоматическое исполнение: [Применимо][Не применимо]
- (в) Оценка:
- Время оценки: [●] ч. [●] мин.
по московскому времени⁹⁶
- Дата оценки: [Каждая]⁹⁷ Дата осуществления права на исполнение
- [Оценка стоимости фьючерса: [Применимо][Не применимо]
- Биржевой контракт:]⁹⁸

⁹¹ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

⁹² Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

⁹³ Стороны должны указать данную информацию для Американского опциона. Если Дата начала срока не указана, то Датой начала срока является Дата сделки.

⁹⁴ Стороны должны указать данную информацию для Бермудского опциона.

⁹⁵ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

⁹⁶ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

⁹⁷ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

⁹⁸ Включить, если условие об оценке стоимости фьючерса применимо к Индексу.

- (г) Условия расчетов:
- | | |
|---|---|
| Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки: | Применимо |
| Валюта платежа: | |
| Расчетная цена: | |
| Дата расчетов: | [В отношении каждой Даты осуществления права на исполнение,] ⁹⁹
[●] Банковских дней после соответствующей Даты оценки |
| [Сумма платежа: | |
| Дифференциал цены исполнения:] ¹⁰⁰ | |
- (д) Событие, требующее корректировки индекса:
- | | |
|------------------------------|--|
| Прекращение расчета индекса: | [Корректировка расчетным агентом]
[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон]
[Расторжение с выплатой] |
| Изменение индекса: | [Корректировка расчетным агентом]
[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон]
[Расторжение с выплатой] |
| Сбой индекса: | [Корректировка расчетным агентом]
[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон]
[Расторжение с выплатой] |
- (е) Иные события, препятствующие исполнению:
- | | |
|--|-----------------------------|
| [Изменение законодательства: | [Применимо]] ¹⁰¹ |
| [Невозможность хеджирования: | [Применимо] |
| Хеджирующая сторона:] ¹⁰² | |
| [Увеличение расходов на хеджирование: | [Применимо] |
| Хеджирующая сторона:] ¹⁰³ | |
| [Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО: | [Применимо] |

⁹⁹ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

¹⁰⁰ Стороны указывают, как будет определяться Сумма платежа и/или Дифференциал цены исполнения, если они намерены изменить пункты 9.1 и/или 9.2 Стандартных условий.

¹⁰¹ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

¹⁰² Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

¹⁰³ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

Максимальная ставка РЕПО:

Хеджирующая сторона:]¹⁰⁴

[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО:

[Применимо]

Максимальная ставка РЕПО:

Первоначальная ставка РЕПО:

Хеджирующая сторона:]¹⁰⁵

[Определяющая сторона:

[Покупатель][Продавец]

[Покупатель и Продавец]]¹⁰⁶

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату, указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

¹⁰⁴ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

¹⁰⁵ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

¹⁰⁶ Включить, если применимо какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению.

ДОПОЛНЕНИЕ 1
Индексы, входящие в Корзину

Корзина состоит из следующих Индексов в следующей пропорции.

<i>Индекс</i>	<i>Биржа (Биржи)</i>	<i>Биржа (Биржи) срочных контрактов</i>	<i>Пропорция в Корзине</i>
			[] процентов
			[] процентов
			[] процентов
			[] процентов
			[] процентов

ПРИЛОЖЕНИЕ 5
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки беспоставочный опцион
на корзину акций

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Стиль опциона:

[Американский/Бермудский/
Европейский]

Тип опциона:

[Опцион на продажу (пут) [●] /
Опцион на покупку (колл) [●]]

Продавец:

[Сторона Б] [Сторона А]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Корзина:

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

Количество опционов:

[Предмет опциона:

[●] Корзина (-н/-ы)
по одному Опциону]¹⁰⁷

Цена исполнения:¹⁰⁸

Премия:

[●] [(Премия за Опцион [●])]¹⁰⁹

Дата уплаты премии:

Биржа (Биржи):

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

Биржа (Биржи) срочных контрактов:

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению¹¹⁰

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]¹¹¹

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

¹⁰⁷ По умолчанию Предмет опциона составляет одну Корзину. Предмет опциона необходимо указывать только в случае, когда Предмет опциона составляет количество Корзин, отличное от установленного по умолчанию.

¹⁰⁸ Выражается как Цена исполнения за одну Корзину. Стороны могут указать сумму или формулу, по которой рассчитывается Цена исполнения, и корректировки, обусловленные выплатой дивидендов.

¹⁰⁹ Если указана Премия за Опцион, то общая сумма Премии составляет произведение Премии за Опцион и Количества опционов.

¹¹⁰ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Акция.

¹¹¹ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

- Контрольное время:]¹¹²
 [Барьерное отменительное условие: [Применимо]¹¹³
 Барьерная цена:
 Барьерный ориентир:
 Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]¹¹⁴
- (б) Порядок осуществления Права на исполнение:
 [Дата начала срока:]¹¹⁵
 [Дата (Даты) осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону:]¹¹⁶
 Время закрытия: [●] ч. [●] мин.
 по московскому времени
- Дата истечения срока:
 Многократное исполнение: [Применимо][Не применимо]
 [Минимальное число:
 Максимальное число:
 Целый множитель:]¹¹⁷
 Автоматическое исполнение: [Применимо][Не применимо]
- (в) Оценка:
 Время оценки: [●] ч. [●] мин.
 по московскому времени¹¹⁸
 Дата оценки: [Каждая]¹¹⁹ Дата осуществления права на исполнение
- (г) Условия расчетов:
 Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки: Применимо

¹¹² Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

¹¹³ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

¹¹⁴ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо

¹¹⁵ Стороны должны указать данную информацию для Американского опциона. Если Дата начала срока не указана, то Датой начала срока является Дата сделки.

¹¹⁶ Стороны должны указать данную информацию для Бермудского опциона.

¹¹⁷ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

¹¹⁸ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

¹¹⁹ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

Валюта платежа:	
Расчетная цена:	
Дата расчетов:	[В отношении каждой Даты осуществления права на исполнение,] ¹²⁰ [●] Банковских дней после соответствующей Даты оценки
[Сумма платежа:	
Дифференциал цены исполнения:] ¹²¹	
[Выбор способа расчетов:	[Применимо][Не применимо]
Сторона, наделенная правом выбора:	[Покупатель][Продавец]
Дата выбора способа расчетов:	
Способ расчетов по умолчанию:	Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки ¹²²
(д) [Дивиденды:	
Внеочередные дивиденды:] ¹²³	
(е) [Корректировки по Акциям:	
Метод корректировки:	[Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом]
[Биржа опционов:] ¹²⁴	
(ж) [Особые обстоятельства:	
Последствия Поглощения:	
«Акция за акцию»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплато ([Согласованный способ] [Определение расчетным агентом])] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]

¹²⁰ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением

¹²¹ Стороны указывают, как будет определяться Сумма платежа и/или Дифференциал цены исполнения, если они намерены изменить пункты 9.1 и/или 9.2 Стандартных условий.

¹²² Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов.

¹²³ Если стороны не указывают, что относится к Внеочередным дивидендам, Расчетный агент определяет, являются ли дивиденды Внеочередными дивидендами.

¹²⁴ Включить, если в качестве Метода корректировки указана Биржевая корректировка.

- «Акция за иное предоставление»:
- [Частичное расторжение с выплатой
([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]
 - [Замена базового актива]
 - [Расторжение с выплатой
([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]
 - [Биржевая корректировка]
 - [Корректировка расчетным агентом]
 - [Расширенная корректировка
расчетным агентом]
 - [Частичное расторжение
с выплатой ([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]
- «Акция за смешанное предоставление»:
- [Замена базового актива]
 - [Расторжение с выплатой
([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]
 - [Биржевая корректировка]
 - [Корректировка расчетным агентом]
 - [Расширенная корректировка
расчетным агентом]
 - [Частичное расторжение с выплатой
([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]
 - [Смешанная корректировка]
 - [Биржа опционов:]¹²⁵
 - [Ставка:]¹²⁶
- (з) [Приобретение по публичной оферте: Применимо]¹²⁷
- (и) Последствия Приобретения по публичной оферте:
- «Акция за акцию»:
 - [Расторжение с выплатой
([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]
 - [Биржевая корректировка]

¹²⁵ Включить, если в качестве последствия Поглощения указана Биржевая корректировка.

¹²⁶ Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой (Согласованный способ) или Частичное расторжение с выплатой (Согласованный способ). При этом указываются процентная ставка и ставка РЕПО в совокупности (пункт 13.7(b)(i)(A)(IV) Стандартных условий).

¹²⁷ Включить, если условие о Приобретении по публичной оферте применимо.

	[Корректировка расчетным агентом]
	[Расширенная корректировка расчетным агентом]
	[Частичное расторжение с выплатой ([Согласованный способ] [Определение расчетным агентом])]
«Акция за иное предоставление»:	[Расторжение с выплатой ([Согласованный способ] [Определение расчетным агентом])]
	[Биржевая корректировка]
	[Корректировка расчетным агентом]
	[Расширенная корректировка расчетным агентом]
	[Частичное расторжение с выплатой ([Согласованный способ] [Определение расчетным агентом])]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Расторжение с выплатой ([Согласованный способ] [Определение расчетным агентом])]
	[Биржевая корректировка]
	[Корректировка расчетным агентом]
	[Расширенная корректировка расчетным агентом]
	[Частичное расторжение с выплатой ([Согласованный способ] [Определение расчетным агентом])]
	[Смешанная корректировка]
[Биржа опционов:] ¹²⁸	
[Ставка:] ¹²⁹	
(к) Состав Смешанного предоставления:	[Применимо][Не применимо]
(л) Национализация или Делистинг:	[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон]
	[Расторжение с выплатой ([Согласованный способ] [Определение расчетным агентом])]

¹²⁸ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указана Биржевая корректировка.

¹²⁹ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указано Расторжение с выплатой (Согласованный способ) или Частичное расторжение с выплатой (Согласованный способ). При этом указываются процентная ставка и ставка РЕПО в совокупности (пункт 13.7(b) (i)(A)(IV) Стандартных условий).

[Частичное расторжение с выплатой
([Согласованный способ]
[Определение расчетным агентом])]

[Ставка:]¹³⁰

(м) Иные события, препятствующие исполнению:

[Изменение законодательства: [Применимо]]¹³¹

[Нарушение обязательства по поставке: [Применимо]]¹³²

[Банкротство: [Применимо]]¹³³

[Невозможность хеджирования: [Применимо]

Хеджирующая сторона:]¹³⁴

[Увеличение расходов на хеджирование: [Применимо]

Хеджирующая сторона:]¹³⁵

[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО: [Применимо]

Максимальная ставка РЕПО:

Хеджирующая сторона:]¹³⁶

[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО: [Применимо

Максимальная ставка РЕПО:

Первоначальная ставка РЕПО:

Хеджирующая сторона:]¹³⁷

[Определяющая сторона: [Покупатель][Продавец]
[Покупатель и Продавец]]¹³⁸

¹³⁰ Включить, если в качестве последствия Национализации или Делистинга указано Расторжение с выплатой (Согласованный способ) или Частичное расторжение с выплатой (Согласованный способ). При этом указываются процентная ставка и ставка РЕПО в совокупности (пункт 13.7(b) (i)(A)(IV) Стандартных условий).

¹³¹ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

¹³² Условие о Нарушении обязательства по поставке может быть применимо, если стороны договорились о применении Выбора способа расчетов, поскольку в этом случае ими может быть выбран способ расчетов в порядке, установленном для Поставочной сделки.

¹³³ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

¹³⁴ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

¹³⁵ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

¹³⁶ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

¹³⁷ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

¹³⁸ Включить, если какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению, применимо.

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ДОПОЛНЕНИЕ 1

Акции, входящие в Корзину

Корзина состоит из следующих Акции каждого из Эмитентов, перечисленных ниже, в пропорции и количестве, указанном для каждого Эмитента.

<i>Эмитент</i>	<i>Идентификационный номер выпуска</i>	<i>Категория (тип) Акции</i>	<i>Количество Акции в Корзине</i>	<i>Биржа</i>	<i>Биржа срочных контрактов</i>	<i>Клиринговая организация¹³⁹</i>

¹³⁹ Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов и стороны договорились о расчетах через Клиринговую организацию.

ПРИЛОЖЕНИЕ 6
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки поставочный опцион на корзину акций

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — «*Подтверждение*») является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — «*Сторона А*») и [●] (далее — «*Сторона Б*») от [●] (далее — «*Генеральное соглашение*»).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Стиль опциона:

[Американский/Бермудский/
Европейский]

Тип опциона:

[Опцион на продажу (пут) [●] /
Опцион на покупку (колл) [●]]

Продавец:

[Сторона Б] [Сторона А]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Корзина:

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

Количество корзин:

Количество опционов:

[Предмет опциона:

[●] Корзина (-н/-ы) по одному
Опциону]¹⁴⁰

Цена исполнения:¹⁴¹

Премия:

[●] [(Премия за Опцион [●])]¹⁴²

Дата уплаты премии:

Биржа (Биржи):

Биржа (Биржи) срочных контрактов:¹⁴³

[Клиринговая организация
(организации):

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению]¹⁴⁴

[Барьерное отлагательное условие:]

[Применимо]¹⁴⁵

Барьерная цена:

¹⁴⁰ По умолчанию Предмет опциона составляет одну Корзину. Предмет опциона необходимо указывать только в случае, когда Предмет опциона составляет количество Корзин, отличное от установленного по умолчанию.

¹⁴¹ Выражается как Цена исполнения за одну Корзину. Стороны могут указать сумму или формулу, по которой рассчитывается Цена исполнения, и корректировки, обусловленные выплатой дивидендов.

¹⁴² Если указана Премия за Опцион, то общая сумма Премии составляет произведение Премии за Опцион и Количества опционов.

¹⁴³ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Акция.

¹⁴⁴ Включить, если расчеты по Сделке будут проводиться через Клиринговую организацию.

¹⁴⁵ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

- Барьерный ориентир:
 Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]¹⁴⁶
 [Барьерное отменительное условие: [Применимо]¹⁴⁷
 Барьерная цена:
 Барьерный ориентир:
 Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]¹⁴⁸
- (б) Порядок осуществления Права на исполнение:
 [Дата начала срока:]¹⁴⁹
 [Дата (Даты) осуществления права
 на исполнение по Бермудскому опциону:]¹⁵⁰
 [Время закрытия: [●] ч. [●] мин.
 по московскому времени]
- Дата истечения срока:
 Многократное исполнение: [Применимо][Не применимо]
 [Минимальное число:
 Максимальное число:
 Целый множитель:]¹⁵¹
 Автоматическое исполнение: [Применимо][Не применимо]
 [Пороговая цена:]¹⁵²
- (в) Условия расчетов:
 Расчеты в порядке, установленном Применимо
 для Поставочной сделки:
 Валюта платежа:
 [Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]

¹⁴⁶ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

¹⁴⁷ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

¹⁴⁸ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

¹⁴⁹ Стороны должны указать данную информацию для Американского опциона. Если Дата начала срока не указана, то Датой начала срока является Дата сделки.

¹⁵⁰ Стороны должны указать данную информацию для Бермудского опциона.

¹⁵¹ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

¹⁵² Включить, если применимо условие об Автоматическом исполнении. Стороны могут определить Пороговую цену путем ссылки на какую-либо устанавливаемую цену (например, самую высокую цену спроса по состоянию на 11 часов), в том числе с указанием биржи.

Сторона, наделенная правом выбора:	[Покупатель][Продавец]
Дата выбора способа расчетов:	
Способ расчетов по умолчанию:	Расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки] ¹⁵³
(г) [Дивиденды: Внеочередные дивиденды:] ¹⁵⁴	
(д) [Корректировки: Метод корректировки:	[Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом]
[Биржа опционов:] ¹⁵⁵	
(е) [Особые обстоятельства: Последствия Поглощения: «Акция за акцию»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой ([Согласованный способ] [Определение расчетным агентом])] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой ([Согласованный способ] [Определение расчетным агентом])]
[«Акция за иное предоставление»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой ([Согласованный способ] [Определение расчетным агентом])] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой ([Согласованный способ] [Определение расчетным агентом])]

¹⁵³ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов.

¹⁵⁴ Если стороны не указывают, что относится к Внеочередным дивидендам, Расчетный агент определяет, являются ли дивиденды Внеочередными дивидендами.

¹⁵⁵ Включить, если в качестве Метода корректировки указана Биржевая корректировка.

«Акция за смешанное предоставление»: [Замена базового актива]
[Расторжение с выплатой
([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]
[Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Расширенная корректировка
расчетным агентом]
[Частичное расторжение с выплатой
([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]
[Смешанная корректировка]

[Биржа опционов:]¹⁵⁶

[Ставка:]¹⁵⁷

(ж) [Приобретение по публичной оферте: Применимо]¹⁵⁸

(з) [Последствия Приобретения по публичной оферте:

«Акция за акцию»: [Расторжение с выплатой
([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]
[Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Расширенная корректировка
расчетным агентом]
[Частичное расторжение с выплатой
([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]

«Акция за иное предоставление»: [Расторжение с выплатой
([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]
[Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Расширенная корректировка
расчетным агентом]
[Частичное расторжение с выплатой
([Согласованный способ
[Определение расчетным агентом]])]

¹⁵⁶ Включить, если в качестве последствия Поглощения указана Биржевая корректировка.

¹⁵⁷ Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой (Согласованный способ) или Частичное расторжение с выплатой (Согласованный способ). При этом указываются процентная ставка и ставка РЕПО в совокупности (пункт 13.7(b)(i)(A)(IV) Стандартных условий).

¹⁵⁸ Включить, если условие о Приобретении по публичной оферте применимо.

- «Акция за смешанное предоставление»: [Расторжение с выплатой
([Согласованный способ]
[Определение расчетным агентом])]
[Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Расширенная корректировка
расчетным агентом]
[Частичное расторжение с выплатой
([Согласованный способ]
[Определение расчетным агентом])]
[Смешанная корректировка]
- [Биржа опционов:]¹⁵⁹
[Ставка:]¹⁶⁰
- (и) Состав Смешанного предоставления: [Применимо][Не применимо]
- (к) Национализация или Делистинг: [Ликвидационный неттинг
по соглашению сторон]
[Расторжение с выплатой
([Согласованный способ]
[Определение расчетным агентом])]
[Частичное расторжение с выплатой
([Согласованный способ]
[Определение расчетным агентом])]
- [Ставка:]¹⁶¹
- (л) Иные события, препятствующие исполнению:
- [Изменение законодательства: [Применимо]]¹⁶²
[Нарушение обязательства по поставке: [Применимо]]¹⁶³
[Банкротство: [Применимо]]¹⁶⁴
[Невозможность хеджирования: [Применимо]
Хеджирующая сторона:]¹⁶⁵

¹⁵⁹ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указана Биржевая корректировка.

¹⁶⁰ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указано Расторжение с выплатой (Согласованный способ) или Частичное расторжение с выплатой (Согласованный способ).

¹⁶¹ Включить, если в качестве последствия Национализации или Делистинга указано Расторжение с выплатой (Согласованный способ) или Частичное расторжение с выплатой (Согласованный способ). При этом указываются процентная ставка и ставка РЕПО в совокупности (пункт 13.7(b) (i)(A)(IV) Стандартных условий).

¹⁶² Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

¹⁶³ Включить, если условие о Нарушении обязательства по поставке применимо.

¹⁶⁴ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

¹⁶⁵ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

[Увеличение расходов на хеджирование: Хеджирующая сторона:] ¹⁶⁶	[Применимо]
[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО: Максимальная ставка РЕПО: Хеджирующая сторона:] ¹⁶⁷	[Применимо]
[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО: Максимальная ставка РЕПО: Первоначальная ставка РЕПО: Хеджирующая сторона:] ¹⁶⁸	[Применимо]
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ¹⁶⁹

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей и поставок:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для поставки Акций в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Реквизиты для поставки Акций в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

¹⁶⁶ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

¹⁶⁷ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

¹⁶⁸ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

¹⁶⁹ Включить, если применимо какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению.

ДОПОЛНЕНИЕ 1

Акции, входящие в Корзину

Корзина состоит из следующих Акции каждого из Эмитентов, перечисленных ниже, в пропорции и количестве, указанном для каждого Эмитента.

<i>Эмитент</i>	<i>Идентификационный номер выпуска</i>	<i>Категория (тип) Акции</i>	<i>Количество Акции в Корзине</i>	<i>Биржа</i>	<i>Биржа срочных контрактов</i>	<i>Клиринговая организация¹⁷⁰</i>

¹⁷⁰ Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов и стороны договорились о расчетах через Клиринговую организацию.

ПРИЛОЖЕНИЕ 7
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки индексный форвард

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — «*Подтверждение*») является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — «*Сторона А*») и [●] (далее — «*Сторона Б*») от [●] (далее — «*Генеральное соглашение*»).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Продавец:

[Сторона Б] [Сторона А]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Индекс:

Форвардная цена:¹⁷¹

Множитель:

[Предварительная оплата:

[Применимо]

Сумма Предварительной оплаты:

Дата предварительной оплаты:]¹⁷²

[Переменная сумма обязательства:

[Применимо]

Минимальная форвардная цена:¹⁷³

Максимальная форвардная цена:¹⁷⁴]¹⁷⁵

Биржа:

Биржа (Биржи) срочных контрактов:¹⁷⁶

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]¹⁷⁷

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]¹⁷⁸

Барьерное отменительное условие:

[Применимо]¹⁷⁹

¹⁷¹ Выражается как уровень Индекса.

¹⁷² Включить, если условие о Предварительной оплате применимо.

¹⁷³ Выражается как уровень Индекса.

¹⁷⁴ Выражается как уровень Индекса.

¹⁷⁵ Включить, если условие о Переменной сумме обязательства применимо

¹⁷⁶ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Индекс.

¹⁷⁷ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

¹⁷⁸ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

¹⁷⁹ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

- Барьерная цена
 Барьерный ориентир:
 Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]¹⁸⁰
- (б) Оценка:
 Время оценки: [●] ч. [●] мин.
 по московскому времени¹⁸¹
- Дата оценки:
 [Оценка стоимости фьючерса: [Применимо][Не применимо]
 Биржевой контракт]¹⁸²
- (в) Условия расчетов:
 Расчеты в порядке, установленном
 для Беспоставочной сделки: Применимо
- Валюта платежа:
 Расчетная цена:
 Дата расчетов: [●] Банковских дней после
 соответствующей Даты оценки
- [Сумма платежа:]¹⁸³
- (г) Событие, требующее корректировки индекса:
 Прекращение расчета индекса: [Корректировка расчетным агентом]
 [Ликвидационный неттинг
 по соглашению сторон]
 [Расторжение с выплатой]
- Изменение индекса: [Корректировка расчетным агентом]
 [Ликвидационный неттинг
 по соглашению сторон]
 [Расторжение с выплатой]
- Сбой индекса: [Корректировка расчетным агентом]
 [Ликвидационный неттинг
 по соглашению сторон]
 [Расторжение с выплатой]

¹⁸⁰ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

¹⁸¹ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

¹⁸² Включить, если условие об оценке стоимости фьючерса применимо.

¹⁸³ Стороны должны указать, как будет определяться Сумма платежа, если они намерены изменить правило пункта 9.1 Стандартных условий.

[Определяющая сторона: [Покупатель][Продавец]
[Покупатель и Продавец]]¹⁸⁴

(д) Иные события, препятствующие исполнению:

[Изменение законодательства: [Применимо]]¹⁸⁵

[Невозможность хеджирования: [Применимо]

Хеджирующая сторона:]¹⁸⁶

[Увеличение расходов на хеджирование: [Применимо]

Хеджирующая сторона:]¹⁸⁷

[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО: [Применимо]

Максимальная ставка РЕПО:

Хеджирующая сторона:]¹⁸⁸

[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО: [Применимо]

Максимальная ставка РЕПО:

Первоначальная ставка РЕПО:

Хеджирующая сторона:]¹⁸⁹

[Определяющая сторона: [Покупатель][Продавец]
[Покупатель и Продавец]]¹⁹⁰

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

¹⁸⁴ Включить, если в качестве последствия какого-либо События, требующего корректировки индекса, указано Расторжение с выплатой.

¹⁸⁵ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

¹⁸⁶ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

¹⁸⁷ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

¹⁸⁸ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

¹⁸⁹ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

¹⁹⁰ Включить, если какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению, применимо.

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ПРИЛОЖЕНИЕ 8
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки беспоставочный форвард на акции

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:	
Продавец:	[Сторона Б] [Сторона А]
Покупатель:	[Сторона А] [Сторона Б]
Акции:	[<i>Полное наименование, категория (тип), и/или номинальная стоимость Акции, идентификационный номер выпуска или иные идентификационные признаки Акции</i>] [<i>полное фирменное наименование Эмитента Акции</i>]
Количество акций:	
Форвардная цена: ¹⁹¹	
[Предварительная оплата:	[Применимо]
Сумма Предварительной оплаты:	
Дата предварительной оплаты:] ¹⁹²	
[Переменная сумма обязательства:	[Применимо]
Минимальная форвардная цена: ¹⁹³	
Максимальная форвардная цена: ¹⁹⁴] ¹⁹⁵	
Биржа:	
Биржа (Биржи) срочных контрактов: ¹⁹⁶	
[Барьерное отлагательное условие:	[Применимо] ¹⁹⁷
Барьерная цена:	
Барьерный ориентир:	
Контрольная дата (даты):	

¹⁹¹ Выражается как Форвардная цена за одну Аксию. Стороны могут указать сумму или формулу, по которой рассчитывается Форвардная цена, и корректировки, обусловленные выплатой дивидендов.

¹⁹² Включить, если условие о Предварительной оплате применимо.

¹⁹³ Выражается как цена за одну Аксию.

¹⁹⁴ Выражается как цена за одну Аксию.

¹⁹⁵ Включить, если условие о Переменной сумме обязательства применимо.

¹⁹⁶ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Акция.

¹⁹⁷ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

Контрольное время:] ¹⁹⁸	
Барьерное отменительное условие:	[Применимо] ¹⁹⁹
Барьерная цена:	
Барьерный ориентир:	
Контрольная дата (даты):	
Контрольное время:] ²⁰⁰	
(б) Оценка:	
Время оценки:	[●] ч. [●] мин.
по московскому времени ²⁰¹	
Дата оценки:	
(в) Условия расчетов:	
Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки:	Применимо
Валюта платежа:	
Расчетная цена:	
Дата расчетов	[●] Банковских дней после соответствующей Даты оценки
[Сумма платежа:] ²⁰²	
[Выбор способа расчетов:	[Применимо][Не применимо]
Сторона, наделенная правом выбора:	[Покупатель][Продавец]
Дата выбора способа расчетов:	
Способ расчетов по умолчанию:	Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки] ²⁰³
(г) Дивиденды:	
[Период начисления дивидендов:	[Первый период][Второй период]

¹⁹⁸ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

¹⁹⁹ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

²⁰⁰ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

²⁰¹ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

²⁰² Стороны должны указать, как будет определяться Сумма платежа, если они намерены изменить правило пункта 9.1 Стандартных условий.

²⁰³ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов.

Сумма внеочередных дивидендов:	[●]
Дата выплаты дивидендов:] ²⁰⁴	
[Внеочередные дивиденды:] ²⁰⁵	
(д) Корректировки по Акциям:	
Метод корректировки:	[Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом]
[Биржа опционов:] ²⁰⁶	
(е) Особые обстоятельства:	
Последствия Поглощения:	
«Акция за акцию»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за иное предоставление»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Смешанная корректировка]
[Биржа опционов:] ²⁰⁷	
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ²⁰⁸
(ж) [Приобретение по публичной оферте:	Применимо] ²⁰⁹

²⁰⁴ Включить, если условие о Предварительной оплате применимо.

²⁰⁵ Если стороны не указывают, что относится к Внеочередным дивидендам, Расчетный агент определяет, являются ли дивиденды Внеочередными дивидендами.

²⁰⁶ Включить, если в качестве Метода корректировки указана Биржевая корректировка

²⁰⁷ Включить, если в качестве последствия Поглощения указана Биржевая корректировка.

²⁰⁸ Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом или Расширенная корректировка расчетным агентом.

²⁰⁹ Включить, если условие о Приобретении по публичной оферте применимо.

Последствия Приобретения по публичной оферте:

«Акция за акцию»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за иное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Смешанная корректировка]]
[Биржа опционов:] ²¹⁰	
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ²¹¹
(з) Состав Смешанного предоставления:	[Применимо][Не применимо]
(и) Национализация или Делистинг:	[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой]
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ²¹²
(к) Иные события, препятствующие исполнению:	
[Изменение законодательства:	[Применимо]] ²¹³
[Нарушение обязательства по поставке:	[Применимо]] ²¹⁴
[Банкротство:	[Применимо]] ²¹⁵
[Невозможность хеджирования:	[Применимо]

²¹⁰ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указана Биржевая корректировка.

²¹¹ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указано Расторжение с выплатой или Корректировка расчетным агентом.

²¹² Включить, если в качестве последствия Национализации или Делистинга указано Расторжение с выплатой.

²¹³ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

²¹⁴ Условие о Нарушении обязательства по поставке может быть применимо, если стороны договорились о применении Выбора способа расчетов, поскольку в этом случае ими может быть выбран способ расчетов в порядке, установленном для Поставочной сделки.

²¹⁵ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

Хеджирующая сторона:] ²¹⁶	
[Увеличение расходов на хеджирование:	[Применимо]
Хеджирующая сторона:] ²¹⁷	
[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО:	[Применимо]
Хеджирующая сторона:] ²¹⁸	
[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО:	[Применимо]
Максимальная ставка РЕПО:	
Первоначальная ставка РЕПО:	
Хеджирующая сторона:] ²¹⁹	
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ²²⁰

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату, указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

²¹⁶ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

²¹⁷ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

²¹⁸ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

²¹⁹ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

²²⁰ Включить, если какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению, применимо.

ПРИЛОЖЕНИЕ 9
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки поставочный форвард на акции

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Продавец:

[Сторона Б] [Сторона А]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Акции:

[Полное наименование, категория (тип), и/или номинальная стоимость Акции, идентификационный номер выпуска или иные идентификационные признаки Акции] [полное фирменное наименование Эмитента Акции]

Количество акций:

Форвардная цена:²²¹

[Предварительная оплата:

[Применимо]

Сумма Предварительной оплаты:

Дата предварительной оплаты:]²²²

[Переменная сумма обязательства:

[Применимо]

Минимальная форвардная цена:²²³

Максимальная форвардная цена:²²⁴]²²⁵

Биржа:

Биржа (Биржи) срочных контрактов:²²⁶

[Клиринговая организация:]²²⁷

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]²²⁸

Барьерная цена:

²²¹ Выражается как Форвардная цена за одну Аксию. Стороны могут указать сумму или формулу, по которой рассчитывается Форвардная цена, и корректировки, обусловленные выплатой дивидендов.

²²² Включить, если условие о Предварительной оплате применимо.

²²³ Выражается как цена за одну Аксию.

²²⁴ Выражается как цена за одну Аксию.

²²⁵ Включить, если условие о Переменной сумме обязательства применимо.

²²⁶ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Акция.

²²⁷ Включить, если расчеты по Сделке будут проводиться через Клиринговую организацию.

²²⁸ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

- Барьерный ориентир:
 Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]²²⁹
 [Барьерное отменительное условие: [Применимо]²³⁰
 Барьерная цена:
 Барьерный ориентир:
 Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]²³¹
- (б) [Оценка:
 Время оценки: [●] ч. [●] мин.
 по московскому времени²³²
 Дата оценки:
- (в) Условия расчетов:
 Расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки: Применимо
 Валюта платежа:
 Расчетная цена:
 Дата расчетов:
 [Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]
 Сторона, наделенная правом выбора: [Покупатель][Продавец]
 Дата выбора способа расчетов:
 Способ расчетов по умолчанию: Расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки]²³³
- (г) Дивиденды:
 [Период начисления дивидендов: [Первый период][Второй период]

²²⁹ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

²³⁰ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

²³¹ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

²³² Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в соответствующую Дату оценки.

²³³ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов. Если Способ расчетов по умолчанию не указан, Способом расчетов по умолчанию являются расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки.

Сумма внеочередных дивидендов:	[●]
Дата выплаты дивидендов:] ²³⁴	
[Внеочередные дивиденды:] ²³⁵	
(д) Корректировки по Акциям:	
Метод корректировки:	[Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом]
[Биржа опционов:] ²³⁶	
(е) Особые обстоятельства:	
Последствия Поглощения:	
«Акция за акцию»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за иное предоставление»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой] [Смешанная корректировка]
[Биржа опционов:] ²³⁷	
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ²³⁸
(ж) [Приобретение по публичной оферте:	Применимо] ²³⁹

²³⁴ Включить, если условие о Предварительной оплате применимо.

²³⁵ Если стороны не указывают, что относится к Внеочередным дивидендам, Расчетный агент определяет, являются ли дивиденды Внеочередными дивидендами.

²³⁶ Включить, если в качестве Метода корректировки указана Биржевая корректировка.

²³⁷ Включить, если в качестве последствия Поглощения указана Биржевая корректировка.

²³⁸ Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом или Расширенная корректировка расчетным агентом.

²³⁹ Включить, если условие о Приобретении по публичной оферте применимо.

Последствия Приобретения по публичной оферте:

«Акция за акцию»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за иное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Смешанная корректировка]]
[Биржа опционов:] ²⁴⁰	
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ²⁴¹
(з) Состав Смешанного предоставления:	[Применимо][Не применимо]
(и) Национализация или Делистинг:	[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой]
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ²⁴²
(к) Иные события, препятствующие исполнению:	
[Изменение законодательства:	[Применимо]] ²⁴³
[Нарушение обязательства по поставке:	[Применимо]] ²⁴⁴
[Банкротство:	[Применимо]] ²⁴⁵
[Невозможность хеджирования:	[Применимо]
Хеджирующая сторона:] ²⁴⁶	

²⁴⁰ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указана Биржевая корректировка.

²⁴¹ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указано Расторжение с выплатой или Корректировка расчетным агентом.

²⁴² Включить, если в качестве последствия Национализации или Делистинга указано Расторжение с выплатой.

²⁴³ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

²⁴⁴ Включить, если условие о Нарушении обязательства по поставке применимо.

²⁴⁵ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

²⁴⁶ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

[Увеличение расходов на хеджирование: Хеджирующая сторона:] ²⁴⁷	[Применимо]
[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО: Максимальная ставка РЕПО: Хеджирующая сторона:] ²⁴⁸	[Применимо]
[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО: Максимальная ставка РЕПО: Первоначальная ставка РЕПО: Хеджирующая сторона:] ²⁴⁹	[Применимо]
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ²⁵⁰

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей и поставок:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для поставки Акций в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Реквизиты для поставки Акций в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

²⁴⁷ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

²⁴⁸ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

²⁴⁹ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

²⁵⁰ Включить, если какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению, применимо.

ПРИЛОЖЕНИЕ 10
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки форвард на корзину индексов

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Продавец:

[Сторона Б] [Сторона А]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Корзина:

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

Количество корзин:

Форвардная цена:²⁵¹

[Множитель:]

[Предварительная оплата:

[Применимо]

Сумма Предварительной оплаты:

Дата предварительной оплаты:]²⁵²

[Переменная сумма обязательства:

[Применимо]

Минимальная форвардная цена:²⁵³

Максимальная форвардная цена:²⁵⁴]²⁵⁵

Биржа (Биржи):

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

Биржа (Биржи) срочных контрактов:

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению²⁵⁶

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]²⁵⁷

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]²⁵⁸

²⁵¹ Выражается как сумма за Корзину.

²⁵² Включить, если условие о Предварительной оплате применимо.

²⁵³ Выражается как цена за Корзину.

²⁵⁴ Выражается как цена за Корзину.

²⁵⁵ Включить, если условие о Переменной сумме обязательства применимо.

²⁵⁶ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Индекс.

²⁵⁷ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

²⁵⁸ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

- Барьерное отменительное условие: [Применимо]²⁵⁹
- Барьерная цена:
- Барьерный ориентир:
- Контрольная дата (даты):
- Контрольное время:]²⁶⁰
- (б) Оценка:
- Время оценки: [●] ч. [●] мин.
по московскому времени²⁶¹
- Дата оценки:
- [Оценка стоимости фьючерса: [Применимо][Не применимо]
- Биржевой контракт]²⁶²
- (в) Условия расчетов:
- Расчеты в порядке, установленном
для Беспоставочной сделки: Применимо
- Валюта платежа:
- Расчетная цена:
- Дата расчетов: [●] Банковских дней после
соответствующей Даты оценки
- [Сумма платежа:]²⁶³
- (г) Событие, требующее корректировки индекса:
- Прекращение расчета индекса: [Корректировка расчетным агентом]
[Ликвидационный неттинг
по соглашению сторон]
[Расторжение с выплатой]
- Изменение индекса: [Корректировка расчетным агентом]
[Ликвидационный неттинг
по соглашению сторон]
[Расторжение с выплатой]

²⁵⁹ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

²⁶⁰ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

²⁶¹ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

²⁶² Включить, если условие об Оценке стоимости фьючерса применимо к какому-либо Индексу в Корзине.

²⁶³ Стороны должны указать, как будет определяться Сумма платежа, если они намерены изменить правило пункта 9.1 Стандартных условий.

Сбой индекса:	[Корректировка расчетным агентом] [Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой]
(д) [Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ²⁶⁴
(е) Иные события, препятствующие исполнению:	
[Изменение законодательства:	Применимо] ²⁶⁵
[Невозможность хеджирования:	Применимо
Хеджирующая сторона:]] ²⁶⁶	
[Увеличение расходов на хеджирование:	Применимо
Хеджирующая сторона:]] ²⁶⁷	
[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО:	Применимо
Максимальная ставка РЕПО:	
Хеджирующая сторона:]] ²⁶⁸	
[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО:	Применимо
Максимальная ставка РЕПО:	
Первоначальная ставка РЕПО:	
Хеджирующая сторона:]] ²⁶⁹	
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ²⁷⁰

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

²⁶⁴ Включить, если в качестве последствия какого-либо События, требующего корректировки индекса, указано Расторжение с выплатой.

²⁶⁵ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

²⁶⁶ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

²⁶⁷ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

²⁶⁸ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

²⁶⁹ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

²⁷⁰ Включить, если условие о каком-либо Ином событии, препятствующем исполнению, применимо.

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ДОПОЛНЕНИЕ 1
Индексы, входящие в Корзину

Корзина состоит из следующих Индексов в следующей пропорции.

<i>Индекс</i>	<i>Биржа (Биржи)</i>	<i>Биржа (Биржи) срочных контрактов</i>	<i>Пропорция в Корзине</i>
			[] процентов
			[] процентов
			[] процентов
			[] процентов
			[] процентов

ПРИЛОЖЕНИЕ 11
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения
для Сделки беспоставочный форвард на корзину акций

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Продавец:

[Сторона Б] [Сторона А]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Корзина:

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

Количество корзин:

Форвардная цена:²⁷¹

[Предварительная оплата:

[Применимо]

Сумма Предварительной оплаты:

Дата предварительной оплаты:]²⁷²

[Переменная сумма обязательства:

[Применимо]

Минимальная форвардная цена:²⁷³

Максимальная форвардная цена:²⁷⁴]²⁷⁵

Биржа (Биржи):

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

Биржа (Биржи) срочных контрактов:

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению²⁷⁶

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]²⁷⁷

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]²⁷⁸

²⁷¹ Выражается как цена за Корзину.

²⁷² Включить, если условие о Предварительной оплате применимо.

²⁷³ Выражается как цена за Корзину.

²⁷⁴ Выражается как цена за Корзину.

²⁷⁵ Включить, если условие о Переменной сумме обязательства применимо.

²⁷⁶ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Акция.

²⁷⁷ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

²⁷⁸ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

[Барьерное отменительное условие:	[Применимо] ²⁷⁹
Барьерная цена:	
Барьерный ориентир:	
Контрольная дата (даты):	
Контрольное время:] ²⁸⁰	
(б) Оценка:	
Время оценки:	[●] ч. [●] мин. по московскому времени ²⁸¹
Дата оценки:	
(в) Условия расчетов:	
Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки:	Применимо
Валюта платежа:	
Расчетная цена:	
Дата расчетов:	[●] Банковских дней после соответствующей Даты оценки
[Сумма платежа:] ²⁸²	
[Выбор способа расчетов:	[Применимо][Не применимо]
Определяющая сторона	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец] ²⁸³
Сторона, наделенная правом выбора:	[Покупатель][Продавец]
Дата выбора способа расчетов:	
Способ расчетов по умолчанию:	Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки] ²⁸⁴

²⁷⁹ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

²⁸⁰ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

²⁸¹ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

²⁸² Стороны должны указать, как будет определяться Сумма платежа, если они намерены изменить правило пункта 9.1 Стандартных условий.

²⁸³ Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом, Расширенная корректировка расчетным агентом или Частичное расторжение с выплатой.

²⁸⁴ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов. Если Способ расчетов по умолчанию не указан, Способом расчетов по умолчанию являются расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки.

- (г) Дивиденды:
- [Период начисления дивидендов: [Первый период][Второй период]
- Сумма внеочередных дивидендов: [●]
- Дата выплаты дивидендов:]²⁸⁵
- [Внеочередные дивиденды:]²⁸⁶
- (д) Корректировки:
- Метод корректировки: [Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
- [Биржа опционов:]²⁸⁷
- (е) Особые обстоятельства:
- Последствия Поглощения:
- «Акция за акцию»: [Замена базового актива]
[Расторжение с выплатой]
[Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Расширенная корректировка
расчетным агентом]
[Частичное расторжение с выплатой]
- «Акция за иное предоставление»: [Замена базового актива]
[Расторжение с выплатой]
[Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Расширенная корректировка
расчетным агентом]
[Частичное расторжение с выплатой]
- «Акция за смешанное предоставление»: [Замена базового актива]
[Расторжение с выплатой]
[Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Расширенная корректировка
расчетным агентом]
[Частичное расторжение с выплатой]
[Смешанная корректировка]
- [Биржа опционов:]²⁸⁸

²⁸⁵ Включить, если условие о Предварительной оплате применимо.

²⁸⁶ Если стороны не указывают, что относится к Внеочередным дивидендам, Расчетный агент определяет, являются ли дивиденды Внеочередными дивидендами.

²⁸⁷ Включить, если в качестве Метода корректировки указана Биржевая корректировка.

²⁸⁸ Включить, если в качестве последствия Поглощения указана Биржевая корректировка.

[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ²⁸⁹
(ж) [Приобретение по публичной оферте:	Применимо] ²⁹⁰
Последствия Приобретения по публичной оферте:	
«Акция за акцию»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за иное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой] [Смешанная корректировка]]
[Биржа опционов:] ²⁹¹	
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ²⁹²
(з) Состав Смешанного предоставления:	[Применимо][Не применимо]
(и) Национализация или Делистинг:	[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой] [Частичное расторжение с выплатой]
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ²⁹³

²⁸⁹ Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом или Частичное расторжение с выплатой.

²⁹⁰ Включить, если условие о Приобретении по публичной оферте применимо.

²⁹¹ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указана Биржевая корректировка.

²⁹² Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом или Частичное расторжение с выплатой.

²⁹³ Включить, если в качестве последствия Национализации или Делистинга указано Расторжение с выплатой или Частичное расторжение с выплатой.

- (к) Иные события, препятствующие исполнению:
- | | |
|--|---|
| [Изменение законодательства: | [Применимо]] ²⁹⁴ |
| [Нарушение обязательства по поставке: | [Применимо]] ²⁹⁵ |
| [Банкротство: | [Применимо]] ²⁹⁶ |
| [Невозможность хеджирования: | [Применимо] |
| Хеджирующая сторона:] ²⁹⁷ | |
| [Увеличение расходов на хеджирование: | [Применимо] |
| Хеджирующая сторона:] ²⁹⁸ | |
| [Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО: | [Применимо] |
| Максимальная ставка РЕПО: | |
| Хеджирующая сторона:] ²⁹⁹ | |
| [Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО: | [Применимо] |
| Максимальная ставка РЕПО: | |
| Первоначальная ставка РЕПО: | |
| Хеджирующая сторона:] ³⁰⁰ | |
| [Определяющая сторона: | [Покупатель][Продавец]
[Покупатель и Продавец]] ³⁰¹ |

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

²⁹⁴ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

²⁹⁵ Условие о Нарушении обязательства по поставке может быть применимо, если стороны договорились о применении Выбора способа расчетов, поскольку в этом случае ими может быть выбран способ расчетов в порядке, установленном для Поставочной сделки.

²⁹⁶ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

²⁹⁷ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

²⁹⁸ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

²⁹⁹ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

³⁰⁰ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

³⁰¹ Включить, если какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению, применимо.

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ДОПОЛНЕНИЕ 1
Акции, входящие в Корзину

Корзина состоит из следующих Акции каждого из Эмитентов, перечисленных ниже, в пропорции и количестве, указанном для каждого Эмитента.

<i>Эмитент</i>	<i>Идентификационный номер выпуска</i>	<i>Категория (тип) Акции</i>	<i>Количество Акции в Корзине</i>	<i>Биржа</i>	<i>Биржа срочных контрактов</i>	<i>Клиринговая организация³⁰²</i>

³⁰² Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов и стороны договорились о расчетах через Клиринговую организацию.

ПРИЛОЖЕНИЕ 12
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки поставочный форвард
на корзину акций

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Продавец:	[Сторона Б] [Сторона А]
Покупатель:	[Сторона А] [Сторона Б]
Корзина:	Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению
Количество корзин:	
Форвардная цена: ³⁰³	
[Предварительная оплата:	[Применимо]
Сумма Предварительной оплаты:	
Дата предварительной оплаты:] ³⁰⁴	
[Переменная сумма обязательства:	Применимо]
Минимальная форвардная цена: ³⁰⁵	
Максимальная форвардная цена: ^{306]} ³⁰⁷	
Биржа (Биржи):	Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению
Биржа (Биржи) срочных контрактов:	Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению ³⁰⁸
[Клиринговая организация (организации):	Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению] ³⁰⁹
[Барьерное отлагательное условие:	[Применимо] ³¹⁰

³⁰³ Выражается как Форвардная цена за одну Корзину. Стороны могут указать сумму или формулу, по которой рассчитывается Форвардная цена, и корректировки, обусловленные выплатой дивидендов.

³⁰⁴ Включить, если условие о Предварительной оплате применимо.

³⁰⁵ Выражается как цена за Корзину.

³⁰⁶ Выражается как цена за Корзину.

³⁰⁷ Включить, если условие о Переменной сумме обязательства применимо.

³⁰⁸ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Акция.

³⁰⁹ Включить, если расчеты по Сделке будут проводиться через Клиринговую организацию.

³¹⁰ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]³¹¹

[Барьерное отменительное условие: [Применимо]³¹²

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]³¹³

(б) [Оценка:

Время оценки: [●] ч. [●] мин.
по московскому времени³¹⁴

Дата оценки:

(в) Условия расчетов:

Расчеты в порядке, установленном
для Поставочной сделки: Применимо

Валюта платежа:

Расчетная цена:

Дата расчетов:

[Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]

Сторона, наделенная правом выбора: [Покупатель][Продавец]

Дата выбора способа расчетов:

Способ расчетов по умолчанию: Расчеты в порядке, установленном
для Поставочной сделки]³¹⁵

³¹¹ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

³¹² Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

³¹³ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

³¹⁴ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в соответствующую Дату оценки.

³¹⁵ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов. Если Способ расчетов по умолчанию не указан, Способом расчетов по умолчанию являются расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки.

- (г) Дивиденды:
- [Период начисления дивидендов: [Первый период][Второй период]
- Сумма внеочередных дивидендов: [●]
- Дата выплаты дивидендов:]³¹⁶
- [Внеочередные дивиденды:]³¹⁷
- (д) Корректировки по Акциям:
- Метод корректировки: [Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
- [Биржа опционов:]³¹⁸
- (е) Особые обстоятельства:
- Последствия Поглощения:
- «Акция за акцию»: [Замена базового актива]
[Расторжение с выплатой]
[Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Расширенная корректировка
расчетным агентом]
[Частичное расторжение с выплатой]
- «Акция за иное предоставление»: [Замена базового актива]
[Расторжение с выплатой]
[Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Расширенная корректировка
расчетным агентом]
[Частичное расторжение с выплатой]
- «Акция за смешанное предоставление»: [Замена базового актива]
[Расторжение с выплатой]
[Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Расширенная корректировка
расчетным агентом]
[Частичное расторжение с выплатой]
[Смешанная корректировка]
- [Биржа опционов:]³¹⁹

³¹⁶ Включить, если условие о Предварительной оплате применимо.

³¹⁷ Если стороны не указывают, что относится к Внеочередным дивидендам, Расчетный агент определяет, являются ли дивиденды Внеочередными дивидендами.

³¹⁸ Включить, если в качестве Метода корректировки указана Биржевая корректировка.

³¹⁹ Включить, если в качестве последствия Поглощения указана Биржевая корректировка.

[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ³²⁰
(ж) [Приобретение по публичной оферте:	Применимо] ³²¹
Последствия Приобретения по публичной оферте:	
«Акция за акцию»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой]
«Акция за иное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой] [Смешанная корректировка]]
[Биржа опционов:] ³²²	
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ³²³
(з) Состав Смешанного предоставления:	[Применимо][Не применимо]
(и) Национализация или Делистинг:	[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой] [Частичное расторжение с выплатой]
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]] ³²⁴

³²⁰ Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом или Частичное расторжение с выплатой.

³²¹ Включить, если условие о Приобретении по публичной оферте применимо.

³²² Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указана Биржевая корректировка.

³²³ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом или Частичное расторжение с выплатой.

³²⁴ Включить, если в качестве последствия Национализации или Делистинга указано Расторжение с выплатой или Частичное расторжение с выплатой.

- (к) Иные события, препятствующие исполнению:
- | | |
|--|---|
| [Изменение законодательства: | [Применимо]] ³²⁵ |
| [Нарушение обязательства по поставке: | [Применимо]] ³²⁶ |
| [Банкротство: | [Применимо]] ³²⁷ |
| [Невозможность хеджирования: | [Применимо] |
| Хеджирующая сторона:] ³²⁸ | |
| [Увеличение расходов на хеджирование: | [Применимо] |
| Хеджирующая сторона:] ³²⁹ | |
| [Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО: | [Применимо] |
| Максимальная ставка РЕПО: | |
| Хеджирующая сторона:] ³³⁰ | |
| [Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО: | [Применимо] |
| Максимальная ставка РЕПО: | |
| Первоначальная ставка РЕПО: | |
| Хеджирующая сторона:] ³³¹ | |
| [Определяющая сторона: | [Покупатель][Продавец]
[Покупатель и Продавец]] ³³² |

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей и поставок:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для поставки Акций в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Реквизиты для поставки Акций в пользу Стороны Б:

³²⁵ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

³²⁶ Включить, если условие о Нарушении обязательства по поставке применимо.

³²⁷ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

³²⁸ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

³²⁹ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

³³⁰ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

³³¹ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

³³² Включить, если какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению, применимо.

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ДОПОЛНЕНИЕ 1

Акции, входящие в Корзину

Корзина состоит из следующих Акции каждого из Эмитентов, перечисленных ниже, в пропорции и количестве, указанном для каждого Эмитента.

<i>Эмитент</i>	<i>Идентификационный номер выпуска</i>	<i>Категория (тип) Акции</i>	<i>Количество Акции в Корзине</i>	<i>Биржа</i>	<i>Биржа срочных контрактов</i>	<i>Клиринговая организация³³³</i>

³³³ Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов и стороны договорились о расчетах через Клиринговую организацию.

ПРИЛОЖЕНИЕ 13
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки индексный своп

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г., разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее — *«Стандартные условия сделок с акциями и индексами»*), и Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011г., разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее — *«Стандартные условия сделок на процентные ставки»*), а вместе со Стандартными условиями сделок с акциями

и индексами — «*Стандартные условия*»). В случае противоречия между Стандартными условиями сделок с акциями и индексами, с одной стороны, и Стандартными условиями сделок на процентные ставки, с другой стороны, Стандартные условия сделок с акциями и индексами имеют преимущественную силу. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.

2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Дата начала срока:

Дата истечения срока:

[●][с учетом переноса срока
в соответствии с Условием
об окончании срока
в нерабочий день [●]]

Индекс:

Биржа (Биржи):

Биржа (Биржи) срочных контрактов:³³⁴

[Барьерное отлагательное условие: [Применимо]³³⁵

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:³³⁶

[Барьерное отменительное условие: [Применимо]³³⁷

³³⁴ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Индекс.

³³⁵ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

³³⁶ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

³³⁷ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

- Барьерная цена:
- Барьерный ориентир:
- Контрольная дата (даты):
- Контрольное время:]³³⁸
- (б) Индексированные суммы, подлежащие уплате [Стороной А][Стороной Б]:
- Плательщик индексированной суммы: [Сторона А][Сторона Б]
- [Получатель индексированной суммы: [Сторона А][Сторона Б]]
- Номинальная сумма сделки:
- Пересчет номинальной суммы сделки: [Применимо][Не применимо]
- Метод индексирования: [Индексирование к цене]
[Индексирование к совокупному результату]
- [Множитель:]³³⁹
- Первоначальная цена:
- Окончательная цена:
- Время оценки: [●] ч. [●] мин.
по московскому времени³⁴⁰
- Дата (Даты) оценки:
- [Оценка стоимости фьючерса: [Применимо][Не применимо]
- Биржевой контракт:]³⁴¹
- (б) Плавающие суммы, подлежащие уплате [Стороной А][Стороной Б]:
- Плательщик плавающей суммы: [Сторона А][Сторона Б]
- Номинальная сумма: [Номинальная сумма сделки]³⁴²
- Даты платежа: [●] с учетом переноса срока в соответствии с Условием об окончании срока в нерабочий день [●] /, при этом если к соответствующему дню Дата расчетов еще не наступила, то Дата платежа переносится на день, являющийся Датой расчетов, и Пла-

³³⁸ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

³³⁹ Указывается, если применимо.

³⁴⁰ Если Время оценки не указано, то Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в соответствующую Дату оценки.

³⁴¹ Указывается, если условие об Оценке стоимости фьючерса применимо.

³⁴² Стороны могут определить Номинальную сумму через Номинальную сумму сделки, если они хотят, чтобы все изменения Номинальной суммы сделки отражались в Номинальной сумме.

Плательщик плавающей суммы должен уплатить Плавающую сумму в отношении Процентного периода, заканчивающегося в такую перенесенную Дату платежа³⁴³ [, при этом, если к соответствующему дню (далее — «Первоначальная дата платежа») Дата расчетов еще не наступила, (i) Процентный период считается оконченным в Первоначальную дату платежа (исключая ее), (ii) [начиная с Даты расчетов (включительно)] на Плавающую сумму начисляются проценты по ставке [●] [с ежедневной капитализацией исходя из фактического количества прошедших дней] и (iii) Плательщик плавающей суммы должен уплатить соответствующую Плавающую сумму вместе с начисленными процентами в Дату расчетов.³⁴⁴

Способ определения плавающей ставки:

Период плавающей ставки:

Спред:

Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки:

Даты изменения плавающей ставки:

Рабочие дни:

(в) [Первоначальный платеж][Стороны А][Стороны Б]:

Сумма первоначального платежа [Стороны А][Стороны Б]:

Дата первоначального платежа [Стороны А][Стороны Б].³⁴⁵

³⁴³ Указывается, если стороны хотят продлить Процентный период для Плательщика плавающей суммы.

³⁴⁴ Включить, если стороны вместо продления Процентного периода для Плательщика плавающей суммы намерены отложить платеж Плавающей до Даты расчетов и начислить проценты за период отсрочки.

³⁴⁵ Указывается, если условие о Сумме первоначального платежа применимо.

- (г) [Окончательный платеж [Стороны А][Стороны Б]:
 Сумма окончательного платежа
 [Стороны А][Стороны Б]:
 Дата окончательного платежа
 [Стороны А][Стороны Б]:]³⁴⁶
- (д) Условия расчетов:
 Валюта платежа:
 Расчеты в порядке, установленном
 для Беспоставочной сделки: Применимо
 Дата расчетов: [●] Банковских дней после
 соответствующей Даты оценки³⁴⁷
- (е) Событие, требующее корректировки индекса:
 Изменение индекса: [Корректировка расчетным агентом]
 [Ликвидационный неттинг
 по соглашению сторон]
 [Расторжение с выплатой]
 Прекращение расчета индекса: [Корректировка расчетным агентом]
 [Ликвидационный неттинг
 по соглашению сторон]
 [Расторжение с выплатой]
 Сбой индекса: [Корректировка расчетным агентом]
 [Ликвидационный неттинг
 по соглашению сторон]
 [Расторжение с выплатой]
 [Определяющая сторона: [Сторона А][Сторона Б]
 [Сторона А и Сторона Б]]³⁴⁸
- (ж) Иные события, препятствующие исполнению:
 [Изменение законодательства: Применимо]³⁴⁹
 [Невозможность хеджирования: Применимо]
 Хеджирующая сторона:]³⁵⁰
 [Увеличение расходов на хеджирование: Применимо]

³⁴⁶ Указывается, если условие о Сумме окончательного платежа применимо.

³⁴⁷ Если Дата расчетов не указана, Датой расчетов признается день, наступающий через один Расчетный цикл после Даты оценки. Если день, определенный таким образом в качестве Даты расчетов, не является Банковским днем, Датой расчетов считается ближайший следующий Банковский день.

³⁴⁸ Включить, если в качестве последствия какого-либо События, требующего корректировки индекса, указано Расторжение с выплатой.

³⁴⁹ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

³⁵⁰ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

Хеджирующая сторона:]³⁵¹

[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО: Применимо

Максимальная ставка РЕПО:

Хеджирующая сторона:]³⁵²

[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО: Применимо

Максимальная ставка РЕПО:

Первоначальная ставка РЕПО:

Хеджирующая сторона:]³⁵³

[Определяющая сторона: [Плательщик индексированной суммы]
[Получатель индексированной суммы]
[Плательщик индексированной суммы и Получатель индексированной суммы]]³⁵⁴

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату, указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

³⁵¹ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

³⁵² Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

³⁵³ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

³⁵⁴ Включить, если какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению, применимо.

ПРИЛОЖЕНИЕ 14
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки беспоставочный своп на акции

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г., разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее — *«Стандартные условия сделок с акциями и индексами»*), и Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г., разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее — *«Стандартные условия сделок на*

процентные ставки», а вместе со Стандартными условиями сделок с акциями и индексами — «*Стандартные условия*»). В случае противоречия между Стандартными условиями сделок с акциями и индексами, с одной стороны, и Стандартными условиями сделок на процентные ставки, с другой стороны, Стандартные условия сделок с акциями и индексами имеют преимущественную силу. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.

2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.
3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Дата начала срока:

Дата истечения срока:

[●][с учетом переноса срока в соответствии с Условием об окончании срока в нерабочий день [●]]

Акции:

[*Полное наименование, категория (тип), и/или номинальная стоимость Акции, идентификационный номер выпуска или иные идентификационные признаки Акции*] [*полное фирменное наименование Эмитента Акции*]

Биржа:

Биржа (Биржи) срочных контрактов:³⁵⁵

[Барьерное отлагательное условие: [Применимо]³⁵⁶

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]³⁵⁷

³⁵⁵ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Акция.

³⁵⁶ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

³⁵⁷ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

[Барьерное отменительное условие:	[Применимо] ³⁵⁸
Барьерная цена:	
Барьерный ориентир:	
Контрольная дата (даты):	
Контрольное время:] ³⁵⁹	
(б) Индексированные суммы, подлежащие уплате [Стороной А][Стороной Б]:	
Плательщик индексированной суммы:	[Сторона А][Сторона Б]
[Получатель индексированной суммы:	[Сторона А][Сторона Б]
Количество акций:	
Номинальная сумма сделки:	[●][на Дату сделки представляет собой произведение Количества акций на Первоначальную цену]
[Пересчет номинальной суммы сделки:	[Применимо][Не применимо]
Метод индексирования	[Индексирование к цене] [Индексирование к совокупному результату]
[Множитель:] ³⁶⁰	
Первоначальная цена:	
Окончательная цена:	
Время оценки:	[●] ч. [●] мин. по московскому времени ³⁶¹
Дата (Даты) оценки:	
(в) Плавающие суммы, подлежащие уплате [Стороной А][Стороной Б]:	
Плательщик плавающей суммы:	[Сторона А][Сторона Б]
Номинальная сумма:	[Номинальная сумма сделки] ³⁶²
Даты платежа:	[●] с учетом переноса срока в соответствии с Условием об окончании срока в нерабочий день [●] /, при этом если к соответствующему дню Дата расчетов еще не

³⁵⁸ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

³⁵⁹ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

³⁶⁰ Указывается, если применимо.

³⁶¹ Если Время оценки не указано, то Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

³⁶² Стороны могут определить Номинальную сумму через Номинальную сумму сделки, если они хотят, чтобы все изменения Номинальной суммы сделки отражались в Номинальной сумме.

наступила, то Дата платежа переносится на день, являющийся Датой расчетов, и Плательщик плавающей суммы должен уплатить Плавающую сумму в отношении Процентного периода, заканчивающегося в такую перенесенную Дату платежа]³⁶³ [, при этом, если к соответствующему дню (далее — «**Первоначальная дата платежа**») Дата расчетов еще не наступила, (i) Процентный период считается оконченным в Первоначальную дату платежа (исключая ее), (ii) [начиная с Даты расчетов (включительно)] на Плавающую сумму начисляются проценты по ставке [●] [с ежедневной капитализацией исходя из фактического количества прошедших дней] и (iii) Плательщик плавающей суммы должен уплатить соответствующую Плавающую сумму вместе с начисленными процентами в Дату расчетов.]³⁶⁴

Способ определения плавающей ставки:

Период плавающей ставки:

Спред:

Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки:

Даты изменения плавающей ставки:

Рабочие дни:

(г) [Первоначальный платеж [Стороны А][Стороны Б]:

Сумма первоначального платежа
[Стороны А][Стороны Б]

Дата первоначального платежа
[Стороны А][Стороны Б]³⁶⁵

³⁶³ Указывается, если стороны хотят продлить Процентный период для Плательщика плавающей суммы.

³⁶⁴ Включить, если стороны вместо продления Процентного периода для Плательщика плавающей суммы намерены отложить платеж Плавающей до Даты расчетов и начислить проценты за период отсрочки.

³⁶⁵ Указывается, если условие о Сумме первоначального платежа применимо.

- (д) [Окончательный платеж [Стороны А][Стороны Б]:
Сумма окончательного платежа
[Стороны А][Стороны Б]:
Дата окончательного платежа
[Стороны А][Стороны Б]]³⁶⁶
- (е) Условия расчетов:
Расчеты в порядке, установленном
для Беспоставочной сделки: Применимо
Валюта платежа:
Дата расчетов: [●] Банковских дней после
соответствующей Даты оценки
[Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]
Сторона, наделенная правом выбора: [Покупатель][Продавец]
Дата выбора способа расчетов:
Способ расчетов по умолчанию: Расчеты в порядке, установленном
для Беспоставочной сделки³⁶⁷
- (ж) Дивиденды:
[Период начисления дивидендов: [Первый период][Второй период]
Сумма дивидендов: [●]
Дата выплаты дивидендов:
Внеочередные дивиденды:
Капитализация дивидендов: [Применимо] [Не применимо]
- (з) Корректировки:
Метод корректировки: [Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Биржа опционов:]³⁶⁸
- (и) Особые обстоятельства:
Последствия Поглощения:
«Акция за акцию»: [Замена базового актива]
[Расторжение с выплатой]

³⁶⁶ Указывается, если условие о Сумме окончательного платежа применимо.

³⁶⁷ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов. Если Способ расчетов по умолчанию не указан, Способом расчетов по умолчанию являются расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки.

³⁶⁸ Включить, если в качестве Метода корректировки указана Биржевая корректировка.

	[Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за иное предоставление»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Смешанная корректировка]
[Биржа опционов:] ³⁶⁹	
[Определяющая сторона:	[Сторона А][Сторона Б] [Сторона А и Страна Б]] ³⁷⁰
(к) [Приобретение по публичной оферте:	Применимо] ³⁷¹
Последствия Приобретения по публичной оферте:	
«Акция за акцию»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за иное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Смешанная корректировка]]

³⁶⁹ Включить, если в качестве последствия Поглощения указана Биржевая корректировка.

³⁷⁰ Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом или Расширенная корректировка расчетным агентом.

³⁷¹ Включить, если условие о Приобретении по публичной оферте применимо.

[Биржа опционов:] ³⁷²	
[Определяющая сторона:	[Сторона А][Сторона Б] [Сторона А и Сторона Б]] ³⁷³
(л) Состав Смешанного предоставления:	[Применимо][Не применимо]
(м) Национализация или Делистинг:	[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой]
[Определяющая сторона:	[Сторона А][Сторона Б] [Сторона А и Сторона Б]] ³⁷⁴
(н) Иные события, препятствующие исполнению:	
[Изменение законодательства:	[Применимо]] ³⁷⁵
[Нарушение обязательства по поставке:	[Применимо]] ³⁷⁶
[Банкротство:	[Применимо]] ³⁷⁷
[Невозможность хеджирования:	[Применимо]
Хеджирующая сторона:] ³⁷⁸	
[Увеличение расходов на хеджирование:	[Применимо]
Хеджирующая сторона:] ³⁷⁹	
[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО: [Применимо]	
Максимальная ставка РЕПО:	
Хеджирующая сторона:] ³⁸⁰	
[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО:	[Применимо]

³⁷² Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указана Биржевая корректировка.

³⁷³ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом или Расширенная корректировка расчетным агентом.

³⁷⁴ Включить, если в качестве последствия Национализации или Делистинга указано Расторжение с выплатой.

³⁷⁵ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

³⁷⁶ Условие о Нарушении обязательства по поставке может быть применимо, если стороны договорились о применении Выбора способа расчетов, поскольку в этом случае ими может быть выбран способ расчетов в порядке, установленном для Поставочной сделки.

³⁷⁷ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

³⁷⁸ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

³⁷⁹ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

³⁸⁰ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

Максимальная ставка РЕПО:

Первоначальная ставка РЕПО:

Хеджирующая сторона:]³⁸¹

[Определяющая сторона:

[Сторона А][Сторона Б]
[Сторона А и Сторона Б]]³⁸²

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

³⁸¹ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

³⁸² Включить, если какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению, применимо.

ПРИЛОЖЕНИЕ 15
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки поставочный своп на акции

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г., разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее — *«Стандартные условия сделок с акциями и индексами»*), и Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г., разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее — *«Стандартные условия сделок на*

процентные ставки», а вместе со Стандартными условиями сделок с акциями и индексами — «**Стандартные условия»**). В случае противоречия между Стандартными условиями сделок с акциями и индексами, с одной стороны, и Стандартными условиями сделок на процентные ставки, с другой стороны, Стандартные условия сделок с акциями и индексами имеют преимущественную силу. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.

2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия::

Дата сделки:

Дата начала срока:

Дата истечения срока:

[●][с учетом переноса срока в соответствии с Условием об окончании срока в нерабочий день [●]]

Акции:

[*Полное наименование, категория (тип), и/или номинальная стоимость Акции, идентификационный номер выпуска или иные идентификационные признаки Акции*] [*полное фирменное наименование Эмитента Акции*]

Биржа:

Биржа (Биржи) срочных контрактов:³⁸³

[Клиринговая организация:]³⁸⁴

[Барьерное отлагательное условие: [Применимо]³⁸⁵

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]³⁸⁶

³⁸³ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Акция.

³⁸⁴ Включить, если расчеты по Сделке будут проводиться через Клиринговую организацию.

³⁸⁵ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

³⁸⁶ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

- [Барьерное отменительное условие: [Применимо]³⁸⁷
 Барьерная цена
 Барьерный ориентир:
 Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]³⁸⁸
- (б) Индексированные суммы, подлежащие уплате [Стороной А][Стороной Б]:
 Платательщик индексированной суммы: [Сторона А][Сторона Б]
 [Получатель индексированной суммы: [Сторона А][Сторона Б]]
 Количество Акций:
 Номинальная сумма сделки: [●][на Дату сделки представляет собой произведение Количества акций на Первоначальную цену]
 [Пересчет номинальной суммы сделки: [Применимо][Не применимо]]³⁸⁹
 Метод индексирования [Индексирование к цене]
 [Индексирование к совокупному результату]³⁹⁰
- [Множитель:]³⁹¹
- (в) Плавающие суммы, подлежащие уплате [Стороной А][Стороной Б]:
 Платательщик плавающей суммы: [Сторона А][Сторона Б]
 Номинальная сумма: [Номинальная сумма сделки]³⁹²
 Даты платежа: [●] с учетом переноса срока в соответствии с Условием об окончании срока в нерабочий день [●] /, при этом если к соответствующему дню Дата расчетов еще не наступила, то Дата платежа переносится на день, являющийся Датой расчетов, и Платательщик плавающей суммы должен уплатить Плавающую сум-

³⁸⁷ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

³⁸⁸ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

³⁸⁹ Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов.

³⁹⁰ Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов.

³⁹¹ Указывается, если применимы условие о Выборе способа расчетов и условие о Множителе.

³⁹² Стороны могут определить Номинальную сумму через Номинальную сумму сделки, если они хотят, чтобы все изменения Номинальной суммы сделки отражались в Номинальной сумме.

му в отношении Процентного периода, заканчивающегося в такую перенесенную Дату платежа³⁹³ [, при этом, если к соответствующему дню (далее — «**Первоначальная дата платежа**») Дата расчетов еще не наступила, (i) Процентный период считается оконченным в Первоначальную дату платежа (исключая ее), (ii) [начиная с Даты расчетов (включительно)] на Плавающую сумму начисляются проценты по ставке [●] [с ежедневной капитализацией исходя из фактического количества прошедших дней] и (iii) Плательщик плавающей суммы должен уплатить соответствующую Плавающую сумму вместе с начисленными процентами в Дату расчетов.]³⁹⁴

Способ определения плавающей ставки:

Период плавающей ставки:

Спред:

Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки:

Даты изменения плавающей ставки:

Рабочие дни:

(г) [Первоначальный платеж [Стороны А][Стороны Б]:

Сумма первоначального платежа [Стороны А][Стороны Б]

Дата первоначального платежа [Стороны А][Стороны Б]³⁹⁵

(д) [Окончательный платеж [Стороны А][Стороны Б]:

Сумма окончательного платежа [Стороны А][Стороны Б]:

³⁹³ Указывается, если стороны хотят продлить Процентный период для Плательщика плавающей суммы.

³⁹⁴ Включить, если стороны вместо продления Процентного периода для Плательщика плавающей суммы намерены отложить платеж Плавающей до Даты расчетов и начислить проценты за период отсрочки.

³⁹⁵ Указывается, если условие о Сумме первоначального платежа применимо.

- Дата окончательного платежа
[Стороны А][Стороны Б]:³⁹⁶
- (е) Условия расчетов:
Расчеты в порядке, установленном
для Поставочной сделки: Применимо³⁹⁷
Дата расчетов:³⁹⁸
Валюта платежа:
[Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]
Сторона, наделенная правом выбора: [Сторона А][Сторона Б]
Дата выбора способа расчетов:
Способ расчетов по умолчанию: Расчеты в порядке, установленном
для Поставочной сделки]³⁹⁹
- (ж) Дивиденды:
[Период начисления дивидендов: [Первый период][Второй период]
Сумма дивидендов: [•]
Дата выплаты дивидендов:
[Внеочередные дивиденды:
Капитализация дивидендов: [Применимо] [Не применимо]]⁴⁰⁰
- (з) Корректировки:
Метод корректировки: [Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Биржа опционов:]⁴⁰¹
- (и) Особые обстоятельства:
Последствия Поглощения:
«Акция за акцию»: [Замена базового актива]
[Расторжение с выплатой]

³⁹⁶ Указывается, если условие о Сумме окончательного платежа применимо.

³⁹⁷ Включается все необходимые сведения о порядке проведения расчетов.

³⁹⁸ Если Дата расчетов не указана, Датой расчетов признается день, наступающий через один Расчетный цикл после Даты оценки. Если день, определенный таким образом в качестве Даты расчетов, не является Банковским днем, Датой расчетов считается ближайший следующий Банковский день.

³⁹⁹ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов. Если Способ расчетов по умолчанию не указан, Способом расчетов по умолчанию являются расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки.

⁴⁰⁰ Включить, если применимо условие о Выборе способа расчетов. Если условие о Суммах дивиденда будет применяться к Сделкам поставочный своп, потребуются дополнительные изменения.

⁴⁰¹ Включить, если в качестве Метода корректировки указана Биржевая корректировка.

	[Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за иное предоставление»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Смешанная корректировка]
[Биржа опционов:] ⁴⁰²	
[Определяющая сторона:	[Сторона А][Сторона Б] [Сторона А и Сторона Б]] ⁴⁰³
(к) [Приобретение по публичной оферте:	Применимо] ⁴⁰⁴
(л) Последствия Приобретения по публичной оферте:	
«Акция за акцию»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за иное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Смешанная корректировка]]

⁴⁰² Включить, если в качестве последствия Поглощения указана Биржевая корректировка.

⁴⁰³ Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом или Расширенная корректировка расчетным агентом.

⁴⁰⁴ Включить, если условие о Приобретении по публичной оферте применимо.

[Биржа опционов:] ⁴⁰⁵	
[Определяющая сторона: [Сторона А и Сторона Б]] ⁴⁰⁶	[Сторона А][Сторона Б]
(м) Состав Смешанного предоставления:	[Применимо][Не применимо]
(н) Национализация или Делистинг:	[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой]
[Определяющая сторона:	[Сторона А][Сторона Б] [Сторона А и Сторона Б]] ⁴⁰⁷
(о) Иные события, препятствующие исполнению:	
[Изменение законодательства:	[Применимо]] ⁴⁰⁸
[Нарушение обязательства по поставке:	[Применимо]] ⁴⁰⁹
[Банкротство:	[Применимо]] ⁴¹⁰
[Невозможность хеджирования:	[Применимо]
Хеджирующая сторона:] ⁴¹¹	
[Увеличение расходов на хеджирование:	[Применимо]
Хеджирующая сторона:] ⁴¹²	
[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО:	[Применимо]
Максимальная ставка РЕПО: Хеджирующая сторона:] ⁴¹³	
[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО:	[Применимо]
Максимальная ставка РЕПО: Первоначальная ставка РЕПО:	

⁴⁰⁵ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указана Биржевая корректировка.

⁴⁰⁶ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом или Расширенная корректировка расчетным агентом.

⁴⁰⁷ Включить, если в качестве последствия Национализации или Делистинга указано Расторжение с выплатой.

⁴⁰⁸ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

⁴⁰⁹ Включить, если условие о Нарушении обязательства по поставке применимо.

⁴¹⁰ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

⁴¹¹ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

⁴¹² Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

⁴¹³ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

Хеджирующая сторона:]⁴¹⁴

[Определяющая сторона:

[Сторона А][Сторона Б]

[Сторона А и Сторона Б]]⁴¹⁵

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей и поставок:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для поставки Акций в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Реквизиты для поставки Акций в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

⁴¹⁴ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

⁴¹⁵ Включить, если какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению, применимо.

ПРИЛОЖЕНИЕ 16
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки своп на корзину индексов

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г., разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее — *«Стандартные условия сделок с акциями и индексами»*), и Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г., разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее — *«Стандартные условия сделок на процентные ставки»*), а вместе со Стандартными условиями сделок с акциями и индекса-

ми — «*Стандартные условия*»). В случае противоречия между Стандартными условиями сделок с акциями и индексами, с одной стороны, и Стандартными условиями сделок на процентные ставки, с другой стороны, Стандартные условия сделок с акциями и индексами имеют преимущественную силу. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.

2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия::

Дата сделки:

Дата начала срока:

Дата истечения срока:

[●][с учетом переноса срока в соответствии с Условием об окончании срока в нерабочий день [●]]

Корзина:

Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению

Биржа(Биржи):

Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению

Биржа срочных контрактов:

Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению⁴¹⁶

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]⁴¹⁷

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:⁴¹⁸

[Барьерное отменительное условие:

[Применимо]⁴¹⁹

⁴¹⁶ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Индекс.

⁴¹⁷ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

⁴¹⁸ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

⁴¹⁹ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекраще-

- Барьерная цена:
 Барьерный ориентир:
 Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]⁴²⁰
- (б) Индексированные суммы, подлежащие уплате [Стороной А][Стороной Б]:
 Плательщик индексированной суммы: [Сторона А][Сторона Б]
 [Получатель индексированной суммы: [Сторона А][Сторона Б]]
 Номинальная сумма сделки:
 Пересчет номинальной суммы сделки: [Применимо][Не применимо]
 Метод индексирования [Индексирование к цене]
 [Индексирование
 к совокупному результату]
- [Множитель:]⁴²¹
 Первоначальная цена:
 Окончательная цена:
 Время оценки: [●] ч. [●] мин.
 по московскому времени⁴²²
- Дата (Даты) оценки:
 [Оценка стоимости фьючерса: [Применимо][Не применимо]
 Биржевой контракт:]⁴²³
- (в) Плавающие суммы, подлежащие уплате [Стороной А][Стороной Б]:
 Плательщик плавающей суммы: [Сторона А][Сторона Б]
 Номинальная сумма: [Номинальная сумма сделки]⁴²⁴
 Даты платежа: [●] с учетом переноса срока в соответствии с Условием об окончании срока в нерабочий день [●] /, при этом если к соответствующему дню Дата расчетов еще не наступила, то Дата платежа переносится на день, являющийся Датой расчетов, и Плательщик плавающей суммы

ние каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

⁴²⁰ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

⁴²¹ Указывается, если применимо.

⁴²² Если Время оценки не указано, то Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в соответствующую Дату оценки.

⁴²³ Включить, если условие об оценке стоимости фьючерса применимо к Индексу.

⁴²⁴ Стороны могут определить Номинальную сумму через Номинальную сумму сделки, если они хотят, чтобы все изменения Номинальной суммы сделки отражались в Номинальной сумме.

должен уплатить Плавающую сумму в отношении Процентного периода, заканчивающегося в такую перенесенную Дату платежа⁴²⁵ [, при этом, если к соответствующему дню (далее — «**Первоначальная дата платежа**») Дата расчетов еще не наступила, (i) Процентный период считается оконченным в Первоначальную дату платежа (исключая ее), (ii) [начиная с Даты расчетов (включительно)] на Плавающую сумму начисляются проценты по ставке [●] [с ежедневной капитализацией исходя из фактического количества прошедших дней] и (iii) Плательщик плавающей суммы должен уплатить соответствующую Плавающую сумму вместе с начисленными процентами в Дату расчетов.]⁴²⁶

Способ определения плавающей ставки:

Период плавающей ставки:

Спред:

Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки:

Даты изменения плавающей ставки:

Рабочие дни:

(г) [Первоначальный платеж [Стороны А][Стороны Б]:

Сумма первоначального платежа [Стороны А][Стороны Б]:

Дата первоначального платежа [Стороны А][Стороны Б]]⁴²⁷

(д) [Окончательный платеж [Стороны А][Стороны Б]:

Сумма окончательного платежа [Стороны А][Стороны Б]:

⁴²⁵ Указывается, если стороны хотят продлить Процентный период для Плательщика плавающей суммы.

⁴²⁶ Включить, если стороны вместо продления Процентного периода для Плательщика плавающей суммы намерены отложить платеж Плавающей до Даты расчетов и начислить проценты за период отсрочки.

⁴²⁷ Указывается, если условие о Сумме первоначального платежа применимо.

- Дата окончательного платежа
[Стороны А][Стороны Б]]⁴²⁸
- (е) Условия расчетов:
 Расчеты в порядке, установленном
 для Беспоставочной сделки: Применимо
 Валюта платежа:
 Дата расчетов: [●] Банковских дней после
 соответствующей Даты оценки⁴²⁹
- (ж) Дивиденды:
 [Период начисления дивидендов: [Первый период][Второй период]
 Сумма дивидендов: [●]
 Дата выплаты дивидендов:
 Внеочередные дивиденды: [●] на Акцию
 Капитализация дивидендов: [Применимо] [Не применимо]
- (з) Событие, требующее корректировки индекса:
 Изменение индекса: [Корректировка расчетным агентом]
 [Ликвидационный неттинг
 по соглашению сторон]
 [Расторжение с выплатой]
 Прекращение расчета индекса: [Корректировка расчетным агентом]
 [Ликвидационный неттинг
 по соглашению сторон]
 [Расторжение с выплатой]
 Сбой индекса: [Корректировка расчетным агентом]
 Ликвидационный неттинг
 по соглашению сторон]
 [Расторжение с выплатой]
 [Определяющая сторона: [Плательщик индексированной суммы]
 [Получатель индексированной суммы]
 [Плательщик индексированной суммы
 и Получатель индексированной суммы]]⁴³⁰
- (и) Иные события, препятствующие исполнению:
 [Изменение законодательства: Применимо]⁴³¹
 [Невозможность хеджирования: Применимо]

⁴²⁸ Указывается, если условие о Сумме окончательного платежа применимо.

⁴²⁹ Если Дата расчетов не указана, Датой расчетов признается день, наступающий через один Расчетный цикл после Даты оценки. Если день, определенный таким образом в качестве Даты расчетов, не является Банковским днем, Датой расчетов считается ближайший следующий Банковский день.

⁴³⁰ Включить, если в качестве последствия какого-либо События, требующего корректировки индекса, указано Расторжение с выплатой.

⁴³¹ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

Хеджирующая сторона:]⁴³²

[Увеличение расходов на хеджирование: Применимо

Хеджирующая сторона:]⁴³³

[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО: Применимо

Максимальная ставка РЕПО:

Хеджирующая сторона:]⁴³⁴

[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО: Применимо

Первоначальная ставка РЕПО:

Хеджирующая сторона:]⁴³⁵

[Определяющая сторона: [Плательщик индексируемой суммы]
[Получатель индексируемой суммы]
[Плательщик индексируемой суммы и Получатель индексируемой суммы]]⁴³⁶

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату, указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

⁴³² Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

⁴³³ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

⁴³⁴ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

⁴³⁵ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

⁴³⁶ Включить, если условие о каком-либо Ином событии, препятствующем исполнению, применимо.

ДОПОЛНЕНИЕ 1
Индексы, входящие в Корзину

Корзина состоит из следующих Индексов в следующей пропорции.

<i>Индекс</i>	<i>Биржа (Биржи)</i>	<i>Биржа (Биржи) срочных контрактов</i>	<i>Пропорция в Корзине</i>
			[] процентов
			[] процентов
			[] процентов
			[] процентов
			[] процентов

и индексами — «*Стандартные условия*»). В случае противоречия между Стандартными условиями сделок с акциями и индексами, с одной стороны, и Стандартными условиями сделок на процентные ставки, с другой стороны, Стандартные условия сделок с акциями и индексами имеют преимущественную силу. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.

2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Дата начала срока:

Дата истечения срока:

[●][с учетом переноса срока в соответствии с Условием об окончании срока в нерабочий день [●]]

Корзина:

Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению

Биржа (Биржи):

Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению

Биржа (Биржи) срочных контрактов:

Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению⁴³⁷

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]⁴³⁸

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]⁴³⁹

[Барьерное отменительное условие:

[Применимо]⁴⁴⁰

⁴³⁷ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Акция.

⁴³⁸ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

⁴³⁹ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

⁴⁴⁰ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

- Барьерная цена
 Барьерный ориентир:
 Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]⁴⁴¹
- (б) Индексированные суммы, подлежащие уплате [Стороной А][Стороной Б]:
- Плательщик индексированной суммы: [Сторона А][Сторона Б]
 [Получатель индексированной суммы: [Сторона А][Сторона Б]]
 Количество Корзин:
 Номинальная сумма сделки: [●][на Дату сделки представляет собой произведение Количества акций на Первоначальную цену]
 Пересчет номинальной суммы сделки: [Применимо][Не применимо]
 Метод индексирования: [Индексирование к цене]
 [Индексирование к совокупному результату]
 [Множитель:]⁴⁴²
 Первоначальная цена:
 Окончательная цена:
 Время оценки: [●] ч. [●] мин.
 по московскому времени⁴⁴³
 Дата (Даты) оценки:
- (в) Плавающие суммы, подлежащие уплате [Стороной А][Стороной Б]:
- Плательщик плавающей суммы: [Сторона А][Сторона Б]
 Номинальная сумма: [Номинальная сумма сделки]⁴⁴⁴
 Даты платежа: [●] с учетом переноса срока в соответствии с Условием об окончании срока в нерабочий день [●] /, при этом если к соответствующему дню Дата расчетов еще не наступила, то Дата платежа переносится на день, являющийся-

⁴⁴¹ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

⁴⁴² Указывается, если применимо.

⁴⁴³ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

⁴⁴⁴ Стороны могут определить Номинальную сумму через Номинальную сумму сделки, если они хотят, чтобы все изменения Номинальной суммы сделки отражались в Номинальной сумме.

ся Датой расчетов, и Платательщик плавающей суммы должен уплатить Плавающую сумму в отношении Процентного периода, заканчивающегося в такую перенесенную Дату платежа⁴⁴⁵ [, при этом, если к соответствующему дню (далее — «**Первоначальная дата платежа**») Дата расчетов еще не наступила, (i) Процентный период считается оконченным в Первоначальную дату платежа (исключая ее), (ii) [начиная с Даты расчетов (включительно)] на Плавающую сумму начисляются проценты по ставке [●] [с ежедневной капитализацией исходя из фактического количества прошедших дней] и (iii) Платательщик плавающей суммы должен уплатить соответствующую Плавающую сумму вместе с начисленными процентами в Дату расчетов.]⁴⁴⁶

Способ определения плавающей ставки:

Период плавающей ставки:

Спред:

Коэффициент для расчета дней
в процентном периоде
для Плавающей ставки:

Даты изменения плавающей ставки:

Рабочие дни:

(г) [Первоначальный платеж [Стороны А][Стороны Б]:

Сумма первоначального платежа
[Стороны А][Стороны Б]:

Дата первоначального платежа
[Стороны А][Стороны Б]:⁴⁴⁷

⁴⁴⁵ Указывается, если стороны хотят продлить Процентный период для Плательщика плавающей суммы.

⁴⁴⁶ Включить, если стороны вместо продления Процентного периода для Плательщика плавающей суммы намерены отложить платеж Плавающей до Даты расчетов и начислить проценты за период отсрочки.

⁴⁴⁷ Указывается, если условие о Сумме первоначального платежа применимо.

- (д) [Окончательный платеж [Стороны А][Стороны Б]:
Сумма окончательного платежа
[Стороны А][Стороны Б]:
Дата окончательного платежа
[Стороны А][Стороны Б]:⁴⁴⁸
- (е) Условия расчетов:
Расчеты в порядке, установленном
для Беспоставочной сделки: Применимо
Валюта платежа:
Дата расчетов: [●] Банковских дней после
соответствующей Даты оценки
[Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]
Сторона, наделенная правом выбора: [Плательщик индексируемой суммы]
[Получатель индексируемой суммы]
Дата выбора способа расчетов:
Способ расчетов по умолчанию: Расчеты в порядке,
установленном
для Беспоставочной сделки]⁴⁴⁹
- (ж) Дивиденды:
Период начисления дивидендов: [Первый период][Второй период]
Сумма дивидендов: [●]
Дата выплаты дивидендов:
Внеочередные дивиденды: [●] на Аксию
Капитализация дивидендов: [Применимо] [Не применимо]
- (з) Корректировки:
Метод корректировки: [Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Биржа опционов:]⁴⁵⁰
- (и) Особые обстоятельства:
Последствия Поглощения:

⁴⁴⁸ Указывается, если условие о Сумме окончательного платежа применимо.

⁴⁴⁹ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов. Если Способ расчетов по умолчанию не указан, Способом расчетов по умолчанию являются расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки.

⁴⁵⁰ Включить, если в качестве Метода корректировки указана Биржевая корректировка.

«Акция за акцию»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой]
«Акция за иное предоставление»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Замена базового актива] [Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой] [Смешанная корректировка]
[Биржа опционов:] ⁴⁵¹	
[Определяющая сторона:	[Сторона А][Сторона Б] [Сторона А и Сторона Б]] ⁴⁵²
(к) [Приобретение по публичной оферте:	Применимо] ⁴⁵³
(л) Последствия Приобретения по публичной оферте:	
«Акция за акцию»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой]
«Акция за иное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка]

⁴⁵¹ Включить, если в качестве последствия Поглощения указана Биржевая корректировка.

⁴⁵² Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом, Расширенная корректировка расчетным агентом или Частичное расторжение с выплатой.

⁴⁵³ Включить, если условие о Приобретении по публичной оферте применимо.

	расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой] [Смешанная корректировка]
[Биржа опционов:] ⁴⁵⁴	
[Определяющая сторона:	[Сторона А][Сторона Б] [Сторона А и Страна Б]] ⁴⁵⁵
(м) Состав Смешанного предоставления:	[Применимо][Не применимо]
(н) Национализация или Делистинг:	[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой] [Частичное расторжение с выплатой]
[Определяющая сторона:	[Сторона А][Сторона Б] [Сторона А и Страна Б]] ⁴⁵⁶
(о) Иные события, препятствующие исполнению:	
[Изменение законодательства:	[Применимо]] ⁴⁵⁷
[Нарушение обязательства по поставке:	[Применимо]] ⁴⁵⁸
[Банкротство:	[Применимо]] ⁴⁵⁹
[Невозможность хеджирования:	[Применимо]
Хеджирующая сторона:] ⁴⁶⁰	
[Увеличение расходов на хеджирование:	[Применимо]
Хеджирующая сторона:] ⁴⁶¹	

⁴⁵⁴ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указана Биржевая корректировка.

⁴⁵⁵ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом, Расширенная корректировка расчетным агентом или Частичное расторжение с выплатой.

⁴⁵⁶ Включить, если в качестве последствия Национализации или Делистинга указано Расторжение с выплатой или Частичное расторжение с выплатой.

⁴⁵⁷ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

⁴⁵⁸ Условие о Нарушении обязательства по поставке может быть применимо, если стороны договорились о применении Выбора способа расчетов, поскольку в этом случае ими может быть выбран способ расчетов в порядке, установленном для Поставочной сделки.

⁴⁵⁹ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

⁴⁶⁰ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

⁴⁶¹ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО:	[Применимо]
Максимальная ставка РЕПО:	
Хеджирующая сторона:] ⁴⁶²	
[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО:	[Применимо]
Максимальная ставка РЕПО:	
Первоначальная ставка РЕПО:	
Хеджирующая сторона:] ⁴⁶³	
[Определяющая сторона:	[Сторона А][Сторона Б] [Сторона А и Сторона Б]] ⁴⁶⁴

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

⁴⁶² Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

⁴⁶³ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

⁴⁶⁴ Включить, если какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению, применимо.

ДОПОЛНЕНИЕ 1

Акции, входящие в Корзину

Корзина состоит из следующих Акции каждого из Эмитентов, перечисленных ниже, в пропорции и количестве, указанном для каждого Эмитента.

<i>Эмитент</i>	<i>Идентификационный номер выпуска</i>	<i>Категория (тип) Акции</i>	<i>Количество Акции в Корзине</i>	<i>Биржа</i>	<i>Биржа срочных контрактов</i>	<i>Клиринговая организация⁴⁶⁵</i>

⁴⁶⁵ Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов и стороны договорились о расчетах через Клиринговую организацию.

ПРИЛОЖЕНИЕ 18
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Подтверждения для Сделки поставочный своп на корзину акций

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г., разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее — *«Стандартные условия сделок с акциями и индексами»*), и Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г., разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее — *«Стандартные условия сделок на*

процентные ставки», а вместе со Стандартными условиями сделок с акциями и индексами — «**Стандартные условия**»). В случае противоречия между Стандартными условиями сделок с акциями и индексами, с одной стороны, и Стандартными условиями сделок на процентные ставки, с другой стороны, Стандартные условия сделок с акциями и индексами имеют преимущественную силу. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.

2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.
3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия::

Дата сделки:

Дата начала срока:

Дата истечения срока:

[●][с учетом переноса срока в соответствии с Условием об окончании срока в нерабочий день [●]]

Корзина:

Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению

Биржа (Биржи):

Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению

Биржа (Биржи) срочных контрактов:

Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению⁴⁶⁶

[Клиринговая организация:

Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению]⁴⁶⁷

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]⁴⁶⁸

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

⁴⁶⁶ Если стороны в качестве Биржи срочных контрактов указывают «Все биржи», Биржа срочных контрактов означает каждую биржу, торги на которой имеют существенное (по заключению Расчетного агента) влияние на весь рынок фьючерсных, опционных или иных срочных договоров (контрактов), базовым активом которых является Акция.

⁴⁶⁷ Включить, если расчеты по Сделке будут проводиться через Клиринговую организацию.

⁴⁶⁸ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

- Контрольное время:]⁴⁶⁹
- [Барьерное отменительное условие: [Применимо]⁴⁷⁰
- Барьерная цена:
- Барьерный ориентир:
- Контрольная дата (даты):
- Контрольное время:]⁴⁷¹
- (б) Индексированные суммы, подлежащие уплате [Стороной А][Стороной Б]:
- Плательщик индексированной суммы: [Сторона А][Сторона Б]
- [Получатель индексированной суммы: [Сторона А][Сторона Б]]
- Количество корзин:
- Номинальная сумма сделки: [●][на Дату сделки представляет собой произведение Количества акций на Первоначальную цену]
- [Пересчет номинальной суммы сделки: [Применимо][Не применимо]]⁴⁷²
- Метод индексирования [Индексирование к цене]
[Индексирование к совокупному результату]⁴⁷³
- [Множитель]⁴⁷⁴
- (в) Плавающие суммы, подлежащие уплате [Стороной А][Стороной Б]:
- Плательщик плавающей суммы: [Сторона А][Сторона Б]
- Номинальная сумма: [Номинальная сумма сделки]⁴⁷⁵
- Даты платежа: [●] с учетом переноса срока в соответствии с Условием об окончании срока в нерабочий день [●] /, при этом если к соответствующему дню Дата расчетов еще не наступила, то Дата платежа переносится на день, являющийся Датой расчетов, и Плательщик

⁴⁶⁹ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

⁴⁷⁰ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

⁴⁷¹ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

⁴⁷² Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов.

⁴⁷³ Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов.

⁴⁷⁴ Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов и условие о Множителе.

⁴⁷⁵ Стороны могут определить Номинальную сумму через Номинальную сумму сделки, если они хотят, чтобы все изменения Номинальной суммы сделки отражались в Номинальной сумме.

плавающей суммы должен уплатить Плавающую сумму в отношении Процентного периода, заканчивающегося в такую перенесенную Дату платежа⁴⁷⁶ [, при этом, если к соответствующему дню (далее — «**Первоначальная дата платежа**») Дата расчетов еще не наступила, (i) Процентный период считается оконченным в Первоначальную дату платежа (исключая ее), (ii) [начиная с Даты расчетов (включительно)] на Плавающую сумму начисляются проценты по ставке [●] [с ежедневной капитализацией исходя из фактического количества прошедших дней] и (iii) Плательщик плавающей суммы должен уплатить соответствующую Плавающую сумму вместе с начисленными процентами в Дату расчетов.⁴⁷⁷

Способ определения плавающей ставки:

Период плавающей ставки:

Спред:

Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки:

Даты изменения плавающей ставки:

Рабочие дни:

(г) [Первоначальный платеж [Стороны А][Стороны Б]:

Сумма первоначального платежа [Стороны А][Стороны Б]:

Дата первоначального платежа [Стороны А][Стороны Б]:⁴⁷⁸

⁴⁷⁶ Указывается, если стороны хотят продлить Процентный период для Плательщика плавающей суммы.

⁴⁷⁷ Включить, если стороны вместо продления Процентного периода для Плательщика плавающей суммы намерены отложить платеж Плавающей до Даты расчетов и начислить проценты за период отсрочки.

⁴⁷⁸ Указывается, если условие о Сумме первоначального платежа применимо.

- (д) [Окончательный платеж [Стороны А][Стороны Б]:
Сумма окончательного платежа
[Стороны А][Стороны Б]:
Дата окончательного платежа
[Стороны А][Стороны Б]]⁴⁷⁹
- (е) Условия расчетов:
Расчеты в порядке, установленном
для Поставочной сделки: Применимо⁴⁸⁰
Валюта платежа:
[Дата расчетов:]⁴⁸¹
[Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]
Сторона, наделенная правом выбора: [Плательщик индексированной суммы]
[Получатель индексированной суммы]
Дата выбора способа расчетов:
Способ расчетов по умолчанию: Расчеты в порядке, установленном
для Поставочной сделки]⁴⁸²
- (ж) [Дивиденды:
[Период начисления дивидендов: [Первый период][Второй период]
Сумма дивидендов: [•]
Дата выплаты дивидендов:
Внеочередные дивиденды:
Капитализация дивидендов: [Применимо] [Не применимо]]⁴⁸³
- (з) Корректировки:
Метод корректировки: [Биржевая корректировка]
[Корректировка расчетным агентом]
[Биржа опционов:]⁴⁸⁴

⁴⁷⁹ Указывается, если условие о Сумме окончательного платежа применимо.

⁴⁸⁰ Включается все необходимые сведения о порядке проведения расчетов.

⁴⁸¹ Если Дата расчетов не указана, Датой расчетов признается день, наступающий через один Расчетный цикл после Даты оценки. Если день, определенный таким образом в качестве Даты расчетов, не является Банковским днем, Датой расчетов считается ближайший следующий Банковский день.

⁴⁸² Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов. Если Способ расчетов по умолчанию не указан, Способом расчетов по умолчанию являются расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки.

⁴⁸³ Включить, если применимо условие о Выборе способа расчетов. Если условие о Суммах дивиденда будет применяться к Сделкам поставочный своп, потребуются дополнительные изменения.

⁴⁸⁴ Включить, если в качестве Метода корректировки указана Биржевая корректировка.

- (и) **Особые обстоятельства:**
Последствия Поглощения:
 «Акция за акцию»: [Замена базового актива]
 [Расторжение с выплатой]
 [Биржевая корректировка]
 [Корректировка расчетным агентом]
 [Расширенная корректировка
 расчетным агентом]
 [Частичное расторжение с выплатой]
 «Акция за иное предоставление»: [Замена базового актива]
 [Расторжение с выплатой]
 [Биржевая корректировка]
 [Корректировка расчетным агентом]
 [Расширенная корректировка
 расчетным агентом]
 [Частичное расторжение с выплатой]
 «Акция за смешанное предоставление»: [Замена базового актива]
 [Расторжение с выплатой]
 [Биржевая корректировка]
 [Корректировка расчетным агентом]
 [Расширенная корректировка
 расчетным агентом]
 [Частичное расторжение с выплатой]
 [Смешанная корректировка]
 [Биржа опционов:]⁴⁸⁵
 [Определяющая сторона: [Сторона А][Сторона Б]
 [Сторона А и Сторона Б]]⁴⁸⁶
- (к) **Приобретение по публичной оферте:** Применимо⁴⁸⁷
Последствия Приобретения по публичной оферте:
 «Акция за акцию»: [Расторжение с выплатой]
 [Биржевая корректировка]
 [Корректировка расчетным агентом]
 [Расширенная корректировка
 расчетным агентом]
 [Частичное расторжение с выплатой]
 «Акция за иное предоставление»: [Расторжение с выплатой]
 [Биржевая корректировка]
 [Корректировка расчетным агентом]

⁴⁸⁵ Включить, если в качестве последствия Поглощения указана Биржевая корректировка.

⁴⁸⁶ Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом, Расширенная корректировка расчетным агентом или Частичное расторжение с выплатой.

⁴⁸⁷ Включить, если условие о Приобретении по публичной оферте применимо.

	[Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой]
«Акция за смешанное предоставление»:	[Расторжение с выплатой] [Биржевая корректировка] [Корректировка расчетным агентом] [Расширенная корректировка расчетным агентом] [Частичное расторжение с выплатой] [Смешанная корректировка]
[Биржа опционов:] ⁴⁸⁸	
[Определяющая сторона:	[Сторона А][Сторона Б] [Сторона А и Сторона Б]] ⁴⁸⁹
(л) Состав Смешанного предоставления:	[Применимо][Не применимо]
(м) Национализация или Делистинг:	[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой] [Частичное расторжение с выплатой]
[Определяющая сторона:	[Сторона А] [Сторона Б] [Сторона А и Сторона Б]] ⁴⁹⁰
(н) Иные события, препятствующие исполнению:	
[Изменение законодательства:	[Применимо]] ⁴⁹¹
[Нарушение обязательства по поставке:	[Применимо]] ⁴⁹²
[Банкротство:	[Применимо]] ⁴⁹³
[Невозможность хеджирования:	[Применимо]
Хеджирующая сторона:] ⁴⁹⁴	
[Увеличение расходов на хеджирование:	[Применимо]
Хеджирующая сторона:] ⁴⁹⁵	

⁴⁸⁸ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указана Биржевая корректировка.

⁴⁸⁹ Включить, если в качестве последствия Приобретения по публичной оферте указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом, Расширенная корректировка расчетным агентом или Частичное расторжение с выплатой.

⁴⁹⁰ Включить, если в качестве последствия Национализации или Делистинга указано Расторжение с выплатой или Частичное расторжение с выплатой.

⁴⁹¹ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

⁴⁹² Включить, если условие о Нарушении обязательства по поставке применимо.

⁴⁹³ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

⁴⁹⁴ Включить, если условие о Невозможности хеджирования применимо.

⁴⁹⁵ Включить, если условие об Увеличении расходов на хеджирование применимо.

[Утрата возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО:	[Применимо]
Максимальная ставка РЕПО:	
Хеджирующая сторона:] ⁴⁹⁶	
[Увеличение расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО:	[Применимо]
Максимальная ставка РЕПО:	
Первоначальная ставка РЕПО:	
Хеджирующая сторона:] ⁴⁹⁷	
[Определяющая сторона:	[Сторона А] [Сторона Б] [Сторона А и Сторона Б]] ⁴⁹⁸

4. Расчетный агент: [Сторона А].

[5.] Реквизиты для платежей и поставок:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для поставки Акций в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Реквизиты для поставки Акций в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

⁴⁹⁶ Включить, если условие об Утрате возможности приобретать ценные бумаги по сделкам РЕПО применимо.

⁴⁹⁷ Включить, если условие об Увеличении расходов на приобретение ценных бумаг по сделкам РЕПО применимо.

⁴⁹⁸ Включить, если какое-либо Иное событие, препятствующее исполнению, применимо.

ДОПОЛНЕНИЕ 1

Акции, входящие в Корзину

Корзина состоит из следующих Акции каждого из Эмитентов, перечисленных ниже, в пропорции и количестве, указанном для каждого Эмитента.

<i>Эмитент</i>	<i>Идентификационный номер выпуска</i>	<i>Категория (тип) Акции</i>	<i>Количество Акции в Корзине</i>	<i>Биржа</i>	<i>Биржа срочных контрактов</i>	<i>Клиринговая организация⁴⁹⁹</i>

⁴⁹⁹ Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов и стороны договорились о расчетах через Клиринговую организацию.

ПРИЛОЖЕНИЕ 19
к Стандартным условиям срочных сделок с акциями
и фондовыми индексами 2011

Форма Требования об исполнении по Сделке опцион

[На бланке Покупателя]

[Дата]

[Наименование и адрес Продавца]

Кас.: Требование об исполнении [наименование Сделки опцион]

Уважаемые господа!

Мы ссылаемся на Сделку опцион, заключенную между нами [дата], [регистрационный номер Сделки] (далее — «Сделка»), на основании Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] и [●] от [●].

Настоящее Требование об исполнении направляется вам в порядке и в целях осуществления нами Права на исполнение по Сделке в соответствии с пунктом 3.2 Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. (далее — «Стандартные условия»), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков и применяемых в соответствии с Подтверждением по Сделке.

Все термины, использованные в настоящем Требовании об исполнении с заглавной буквы, имеют значение, определенное в Стандартных условиях.

С уважением,

[Покупатель]

Ф. И. О.:

Должность:

СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ
СРОЧНЫХ СДЕЛОК С ОБЛИГАЦИЯМИ
2011 г.

This 2011 Standard Terms of Bond Derivatives Transactions is based, in part, on selected provisions of the 2002 ISDA Equity Derivatives Definitions, © 2002 International Swaps and Derivatives Association, Inc., («ISDA®») and the 1997 ISDA Government Bond Option Definitions, © 1997 International Swaps and Derivatives Association, Inc., and are used with its permission. ISDA takes no position as to this Russian-version 2011 Standard Terms of Bond Derivatives Transactions' suitability for use in any particular transaction. Prospective users should seek independent legal advice before using this instrument.

СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ СРОЧНЫХ СДЕЛОК С ОБЛИГАЦИЯМИ 2011 г.

Настоящие Стандартные условия срочных сделок с облигациями (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков, устанавливают особенности заключения, исполнения и прекращения Сделок, как они определены в пункте 1.24 Стандартных условий. Настоящие Стандартные условия применяются к Сделке, (а) если они полностью или частично включены в Подтверждение по Сделке путем указания в нем о применении Стандартных условий срочных сделок с облигациями 2011 г. полностью или в соответствующей части; (б) по умолчанию при отсутствии Подтверждения применительно к Сделкам, заключенным после даты согласования Примерных условий договора (как они определены в Стандартных условиях) федеральным органом исполнительной власти по рынку ценных бумаг. Если какой-либо термин настоящих Стандартных условий употребляется в Подтверждении наряду с указанием стороны, он применяется исключительно к этой стороне.

1. ОБЩИЕ ОПРЕДЕЛЕНИЯ

- 1.1. **Базовый актив** означает Облигации, как они определены в пункте 1.14 Стандартных условий и Корзину Облигаций, как она определена в пункте 1.13 Стандартных условий, которые являются предметом поставки или в зависимости от изменения цен на которые осуществляется исполнение обязательств по Сделкам.
- 1.2. **Беспоставочная сделка** означает Сделку беспоставочный опцион или Сделку беспоставочный форвард.
- 1.3. **Биржа** означает применительно к Облигации и Срочной Сделке на облигации или Срочной Сделке на корзину облигаций — каждую биржу или иного организатора торговли, где Облигация включена в котировальные списки или иным образом допущена к торгам, указанного применительно к этой Облигации в Подтверждении или иным образом согласованного сторонами. Если согласованная сторонами Биржа прекращает торги Облигациями или они исключаются из ее котировальных списков, но при этом Облигации включены в котировальные списки или допущены к торгам на другой бирже или у иного организатора торговли, стороны добросовестно договариваются о другой бирже или ином организаторе торговли.
- 1.4. **Биржевая цена** означает применительно к Облигации цену одной Облигации, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки

в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, а при отсутствии такого порядка — среднее арифметическое значение между максимальной ценой в заявках на покупку и минимальной ценой в заявках на продажу по данной Облигации, зарегистрированных на Бирже по состоянию на Время оценки в Дату оценки (или при их отсутствии на Время оценки между последней максимальной ценой в заявках на покупку и последней минимальной ценой в заявках на продажу по данной Облигации, зарегистрированных непосредственно перед наступлением Времени оценки), без учета адресных (внесистемных) заявок и совершенных на их основе сделок (переговорных сделок), а также сделок на основании заявок, поданных за счет одного участника торгов или одного клиента участника торгов (кросс-сделок), и сделок РЕПО.

- 1.5. **Валюта платежа** означает валюту, в которой проводятся расчеты по Сделке, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке.
- 1.6. **Время закрытия торгов** означает применительно к Бирже, а также Плановому торговому дню время закрытия торгов на Бирже по расписанию в этот Плановый торговый день без учета послеторгового и других периодов за рамками периода проведения торгов в режиме основных торгов.
- 1.7. **Генеральное соглашение** означает Генеральное соглашение в значении, определенном в Примерных условиях договора.
- 1.8. **Дата калькуляции** означает применительно к Дате расчетов наиболее ранний день, когда Расчетный агент может представить расчет (калькуляцию) для целей этой Даты расчетов. Такой расчет (калькуляция) должен быть представлен не позднее окончания Рабочего дня, непосредственно предшествующего Дате расчетов.
- 1.9. **Дата сделки** означает применительно к Сделке Дату сделки в значении, определенном в Генеральном соглашении.
- 1.10. **Клиринговая организация** означает применительно к Поставочным сделкам клиринговую организацию, указанную в этом качестве применительно к Облигации в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к этой Облигации либо любую заменяющую ее клиринговую организацию, определяемую Расчетным агентом, а при отсутствии такого указания — основную клиринговую организацию для расчетов по операциям с Облигациями на Бирже в Дату расчетов. Если Клиринговая организация прекращает осуществлять расчеты по Облигации, стороны добросовестно договариваются о другом способе поставки.
- 1.11. **Количество облигаций** означает:
 - (а) применительно к Сделке опцион на облигации — количество Облигаций, полученное путем умножения Количества опционов на Предмет опциона;
 - (б) применительно к Сделке форвард на облигации — количество Облигаций, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке;

- (в) применительно к Срочной Сделке на корзину облигаций в отношении Облигаций каждого Эмитента, включенных в Корзину, — количество Облигаций в одной Корзине, указанное в Подтверждении, иным образом определяемое в соответствии с ним или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке.
- 1.12. **Количество корзин** означает применительно к Срочной Сделке на корзину облигаций количество Корзин, указанное в Подтверждении, иным образом определяемое в соответствии с ним или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке.
- 1.13. **Корзина** означает применительно к Срочной Сделке на корзину облигаций — набор Облигаций каждого из Эмитентов, перечисленных в Подтверждении в пропорции или количестве, указанном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами применительно к Сделке.
- 1.14. **Облигации** означает применительно к Срочной Сделке на облигации и Срочной Сделке на корзину облигаций облигации в значении, определенном законодательством Российской Федерации о рынке ценных бумаг, указанные в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованные сторонами применительно к Сделке.
- 1.15. **Плановый торговый день** означает любой день, в который Биржа (или каждая Биржа, если сторонами согласовано более одной Биржи) должна быть открыта в соответствии с графиком работы для проведения торгов в режиме основных торгов.
- 1.16. **Подтверждение** означает Подтверждение в значении, определенном в Генеральном соглашении, которое может быть составлено по форме, установленной в приложениях 1-8 к Стандартным условиям в зависимости от вида Сделки, или иной форме, согласованной сторонами.
- 1.17. **Покупатель** означает сторону Сделки, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке.
- 1.18. **Поставочная сделка** означает Сделку поставочный опцион или Сделку поставочный форвард.
- 1.19. **Примерные условия договора** означает Примерные условия договора о срочных сделках на финансовых рынках, опубликованные в сети Интернет на страницах Ассоциации российских банков, Национальной Валютной Ассоциации и Национальной ассоциации участников фондового рынка.
- 1.20. **Продавец** означает сторону Сделки, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке.
- 1.21. **Рабочий день** означает:
- (а) если употребляется в связи с понятием «Биржа», — любой Плановый торговый день, в который Биржа (или каждая Биржа, если сторонами согласовано

более одной Биржи) открыта для проведения торгов в режиме основных торгов, за исключением дней, в которые Время закрытия торгов наступает раньше обычного ежедневного расписания;

- (б) если употребляется применительно к Клиринговой организации, в том числе для целей расчетов по Сделке через Клиринговую организацию и События, препятствующего проведению расчетов, — любой день, в который такая Клиринговая организация открыта (или, если бы не наступление События, препятствующего проведению расчетов, была бы открыта) для принятия и исполнения поручений на осуществление расчетов;
- (в) применительно к платежам в случаях, не указанных в подпунктах (а) и (б) настоящего пункта 1.21, — любой день, являющийся Рабочим днем в значении, определенном в Генеральном соглашении, и:
 - (А) если евро является Валютой платежа, днем, когда открыта Трансъевропейская автоматическая система валовых расчетов и экспресс-переводов в режиме реального времени (Система TARGET);
 - (Б) если другая иностранная валюта является Валютой платежа, днем, когда кредитные организации осуществляют банковские операции и другие сделки (в том числе на валютном рынке) в основном финансовом центре этой иностранной валюты, определенном для соответствующей валюты в приложении 7 к Стандартным условиям конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г., разработанным и утвержденным Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованным в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков;
- (г) в иных целях — любой день, являющийся Рабочим днем в значении, определенном в Генеральном соглашении.

1.22. **Расчетный агент** означает лицо, указанное в этом качестве в Генеральном соглашении, если иное лицо не назначено в этом качестве по Сделке в Подтверждении или иным образом не согласовано сторонами применительно к Сделке. Расчетный агент:

- (а) рассчитывает Количество облигаций, Количество корзин и Расчетную цену применительно к каждой Дате расчетов по Поставочным сделкам;
- (б) рассчитывает Расчетную цену и Сумму платежа применительно к каждой Дате расчетов по Беспоставочным сделкам;
- (в) определяет корректировки, необходимые в результате внесения исправлений в цену Облигации;
- (г) направляет уведомление сторонам Сделки в Дату калькуляции для целей соответствующей Даты расчетов с указанием:

- (А) Даты расчетов;
- (Б) стороны или сторон, обязанных произвести каждый из платежей или каждую из поставок;
- (В) суммы, подлежащей уплате, и/или количества Базового актива, подлежащего поставке;
- (Г) того, как была определена каждая сумма или количество;
- (д) выполняет другие действия в соответствии с настоящими Стандартными условиями, Генеральным соглашением и Подтверждением.

Расчетный агент обязан действовать разумно и добросовестно при любых обстоятельствах. Расчет (калькуляция), произведенный Расчетным агентом, является обязательным для сторон, кроме случаев очевидной ошибки.

- 1.23. **Расчетный цикл** означает применительно к Облигации количество Рабочих дней, в течение которого в соответствии с правилами Биржи обычно осуществляются расчеты по результатам торгов такими Облигациями.
- 1.24. **Сделка** означает Сделку опцион, как она определена в пункте 1.25 Стандартных условий, Сделку форвард, как она определена в пункте 1.28 Стандартных условий, любое сочетание названных Сделок или иную сделку, в отношении которой в Подтверждении стороны указали о том, что к ней применяются настоящие Стандартные условия.
- 1.25. **Сделка опцион** означает сделку, по которой на условиях, согласованных сторонами, и с учетом других положений настоящих Стандартных условий Покупатель уплачивает Продавцу Премию и приобретает право (далее — **«Право на исполнение»**), но не обязанность:
- (а) потребовать от Продавца выплаты Суммы платежа в Дату расчетов, а Продавец обязуется выплатить Покупателю такую Сумму платежа (далее — **«Сделка беспоставочный опцион»**). Сумма платежа может рассчитываться применительно к:
 - (А) одной категории (типу) Облигаций одного Эмитента (такая Сделка далее именуется **«Сделка беспоставочный опцион на облигации»**);
 - (Б) Корзине Облигаций (такая Сделка далее именуется **«Сделка беспоставочный опцион на корзину облигаций»**);
 - (б) в Дату расчетов по Опциону колл получить от Продавца в собственность Облигации одной категории (типа) одного Эмитента или по Опциону пут передать Продавцу в собственность такие Облигации по Цене исполнения, а Продавец обязуется соответственно передать Покупателю в собственность такие Облигации или получить от Покупателя в собственность такие Облигации по Цене исполнения (далее — **«Сделка поставочный опцион на облигации»**);
 - (в) в Дату расчетов по Опциону колл получить от Продавца в собственность Корзину или Корзины Облигаций или по Опциону пут передать Продавцу

в собственность Корзину или Корзины Облигаций по Цене исполнения, а Продавец обязуется соответственно передать Покупателю в собственность Корзину или Корзины Облигаций или получить от Покупателя в собственность Корзину или Корзины Облигаций по Цене исполнения (далее — «*Сделка поставочный опцион на корзину облигаций*», а вместе со Сделкой поставочный опцион на облигации — «*Сделка поставочный опцион*»).

- 1.26. *Сделка опцион на корзину облигаций* означает Сделку поставочный опцион на корзину облигаций или Сделку беспоставочный опцион на корзину облигаций.
- 1.27. *Сделка опцион на облигации* означает Сделку поставочный опцион на облигации или Сделку беспоставочный опцион на облигации.
- 1.28. *Сделка форвард* означает сделку, по которой на условиях, согласованных сторонами, и с учетом других положений настоящих Стандартных условий:
 - (а) в Дату расчетов Продавец обязуется уплатить Покупателю Сумму платежа при ее положительном значении, а Покупатель обязуется уплатить Продавцу абсолютное значение Суммы платежа при ее отрицательном значении (далее — «*Сделка беспоставочный форвард*»). Сумма платежа может рассчитываться применительно к:
 - (А) одной категории (типу) Облигаций одного Эмитента (такая Сделка далее именуется «*Сделка беспоставочный форвард на облигации*»);
 - (Б) Корзине Облигаций (такая Сделка далее именуется «*Сделка беспоставочный форвард на корзину облигаций*»);
 - (б) в Дату расчетов Продавец обязуется передать Покупателю в собственность согласованное количество Облигаций одной категории (типа) одного Эмитента, а Покупатель обязуется оплатить их в сумме, рассчитанной на основе Форвардной цены (далее — «*Сделка поставочный форвард на облигации*»);
 - (в) в Дату расчетов Продавец обязуется передать Покупателю в собственность согласованное количество Облигаций в одной или более Корзин, а Покупатель обязуется оплатить их в сумме, рассчитанной на основе Форвардной цены (далее — «*Сделка поставочный форвард на корзину облигаций*», а вместе со Сделкой поставочный форвард на облигации — «*Сделка поставочный форвард*»).
- 1.29. *Сделка форвард на корзину облигаций* означает Сделку беспоставочный форвард на корзину облигаций или Сделку поставочный форвард на корзину облигаций.
- 1.30. *Сделка форвард на облигации* означает Сделку беспоставочный форвард на облигации или Сделку поставочный форвард на облигации.
- 1.31. *Срочная сделка на корзину облигаций* означает Сделку опцион на корзину облигаций или Сделку форвард на корзину облигаций.
- 1.32. *Срочная сделка на облигации* означает Сделку опцион на облигации или Сделку форвард на облигации.

1.33. **Условие об окончании срока в нерабочий день** означает условие, в соответствии с которым определяется день окончания срока, если последний день срока приходится на нерабочий день. В Подтверждении стороны могут указать в качестве Условия об окончании срока в нерабочий день:

- (а) «**Следующий рабочий день**» — в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день;
- (б) «**Предшествующий рабочий день**» — в этом случае днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день;
- (в) «**Рабочий день в отчетном периоде**» — в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день, а если этот ближайший следующий Рабочий день является днем следующего месяца, то днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день.

Если последний день срока в соответствии с настоящими Стандартными условиями приходится на нерабочий день, день окончания срока определяется по правилу «Следующий рабочий день», указанному в пункте (в) выше, если иное не предусмотрено другими положениями Стандартных условий, Подтверждением или иным образом не согласовано сторонами применительно к какому-либо сроку или в целом.

1.34. **Эмитент** означает применительно к Облигациям эмитента этих Облигаций.

2. Сделки опцион

2.1. Применительно к Сделке опцион следующие термины имеют следующие значения:

- (а) **Дата начала срока** означает применительно к Американскому опциону день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а если этот день не является Плановым торговым днем — ближайший следующий Плановый торговый день; а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — Дату сделки.
- (б) **Количество опционов** означает количество Предметов опциона, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, в отношении которых по Сделке опцион может быть осуществлено Право на исполнение.
- (в) **Опцион** означает применительно к Сделке опцион Право на исполнение в отношении одного Предмета опциона.
- (г) **Предмет опциона** означает:
 - (А) применительно к Сделке опцион на облигации количество Облигаций, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания — одну Облигацию;

(Б) применительно к Сделке опцион на корзину облигаций количество Корзин, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — одну Корзину.

(д) **Цена исполнения** означает:

(А) применительно к Сделке опцион на облигации сумму денежных средств в соответствующей валюте или процент от номинальной стоимости Облигации, указанный в Подтверждении, иным образом определяемый в соответствии с ним или иным образом согласованный сторонами;

(Б) применительно к Сделке опцион на корзину облигаций стоимость одной Корзины, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами.

2.2. Стили опционов.

(а) **Американский опцион** означает вид Сделки опцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено в любой Плановый торговый день в течение Срока осуществления права на исполнение, состоящего из двух и более Плановых торговых дней.

(б) **Бермудский опцион** означает вид Сделки опцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено исключительно в одну из Дат осуществления права на исполнение, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами, и в Дату истечения срока.

(в) **Европейский опцион** означает вид Сделки опцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено только в Дату истечения срока.

2.3. Типы опционов.

(а) **Опцион на покупку (колл)** означает тип Сделки опцион, по которому Покупатель вправе при осуществлении Права на исполнение:

(А) по Сделке поставочный опцион получить от Продавца в собственность Облигации или Корзины Облигаций в обмен на уплату суммы, рассчитанной исходя из Цены исполнения за Облигацию или Корзину;

(Б) по Сделке беспоставочный опцион получить от Продавца Сумму платежа, если Расчетная цена превышает Цену исполнения,

в обоих случаях с учетом того, что предусмотрено другими положениями настоящих Стандартных условий и Подтверждением.

(б) **Опцион на продажу (пут)** означает тип Сделки опцион, по которому Покупатель вправе при осуществлении Права на исполнение:

(А) по Сделке поставочный опцион передать Продавцу в собственность Облигации или Корзины Облигаций в обмен на уплату суммы, рассчитанной исходя из Цены исполнения за Облигацию или Корзину;

(Б) по Сделке беспоставочный опцион получить от Продавца Сумму платежа, если Цена исполнения превышает Расчетную цену,

в обоих случаях с учетом того, что предусмотрено другими положениями настоящих Стандартных условий и Подтверждением.

2.4. Уплата Премии.

- (а) В одну или в каждую из дат, согласованных сторонами (далее — «*Дата уплаты премии*») Покупатель обязан уплатить Продавцу премию (далее — «*Премия*»), указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами. Если день, определенный в соответствии с настоящим пунктом в качестве Даты уплаты премии, не является Рабочим днем для расчетов в валюте, в которой должна быть уплачена Премия, Датой уплаты премии считается ближайший следующий Рабочий день для расчетов в этой валюте.
- (б) Если в Подтверждении указана Премия за Опцион, то общая сумма Премии составляет произведение Премии за Опцион и Количества опционов.

2.5. Существенные условия Сделки опцион.

- (а) Существенными условиями Сделок опцион, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки в отношении каждой из этих Сделок, являются:
 - (А) Покупатель;
 - (Б) Продавец;
 - (В) Стиль опциона;
 - (Г) Тип опциона;
 - (Д) Базовый актив;
 - (Е) Количество опционов;
 - (Ж) Цена исполнения;
 - (З) Дата истечения срока;
 - (И) Даты осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону (применительно к Бермудскому опциону);
 - (К) размер Премии;
 - (Л) Биржа (применительно к Сделке беспоставочный опцион).
- (б) Другие условия Сделок опцион подлежат согласованию в качестве существенных условий по требованию одной из сторон.

3. Порядок осуществления Права на исполнение по Сделке опцион

3.1. Применительно к порядку осуществления Права на исполнение по Сделке опцион следующие термины имеют следующие значения:

- (а) **Время закрытия** означает время в течение Планового торгового дня, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, не позднее которого должно быть получено Требование об исполнении, а при отсутствии такого указания — Время оценки.

- (б) **Дата истечения срока** означает день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, в который прекращается Право на исполнение по Сделке опцион в случае его неосуществления до Времени закрытия (а если этот день не является Плановым торговым днем, то ближайший следующий за ним Плановый торговый день) при условии, что в этот день не возникло Чрезвычайной ситуации до наступления Времени закрытия. Если в день, определенный в качестве Даты истечения срока, возникла Чрезвычайная ситуация, Датой истечения срока считается:
- (А) ближайший следующий Плановый торговый день после окончания Чрезвычайной ситуации;
 - (Б) если Чрезвычайная ситуация продолжается в течение восьми Плановых торговых дней подряд после дня, первоначально указанного в качестве Даты истечения срока, — восьмой Плановый торговый день, независимо от того, что Чрезвычайная ситуация продолжает иметь место.
- (в) **Дата осуществления права на исполнение** означает Плановый торговый день в течение Срока осуществления права на исполнение, когда Право на исполнение по Сделке опцион может быть осуществлено в порядке, установленном настоящей статьёй 0.

Применительно к Бермудскому опциону, если Дата осуществления права на исполнение, указанная в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованная сторонами, не является Плановым торговым днем, Датой осуществления права на исполнение считается ближайший следующий Плановый торговый день. Если в день, определенный в качестве Даты осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону, до наступления Времени закрытия возникла Чрезвычайная ситуация, Датой осуществления права на исполнение считается:

- (А) ближайший следующий Плановый торговый день после окончания Чрезвычайной ситуации;
- (Б) если Чрезвычайная ситуация продолжается в течение восьми Плановых торговых дней подряд после дня, первоначально указанного в качестве Даты осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону, — восьмой Плановый торговый день, независимо от того, что Чрезвычайная ситуация продолжает иметь место.

Если, несмотря на вышеизложенное, Право на исполнение по Бермудскому опциону было осуществлено в Плановый торговый день, который был бы Датой осуществления права на исполнение, если бы не возникло Чрезвычайной ситуации, указанный день считается Датой осуществления права на исполнение для целей определения того, было ли осуществлено Право на исполнение в пределах Срока осуществления права на исполнение.

- (г) **Срок осуществления права на исполнение** означает:
- (А) в Американском опционе — все Плановые торговые дни с Даты начала срока до Даты истечения срока (обе даты включительно) в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия;

- (Б) в Европейском опционе — Дату истечения срока в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия;
- (В) в Бермудском опционе — каждую Дату осуществления права на исполнение, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами, с Даты начала срока до Даты истечения срока (обе даты включительно) в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия.
- (д) **Требование об исполнении** означает безотзывное требование, которое может быть составлено Покупателем по форме, установленной в приложении 9 к Стандартным условиям, или иной форме, согласованной сторонами. Требование об исполнении может быть доставлено по факсу, если стороны не договорились об ином.

3.2. **Предъявление Требования об исполнении.**

- (а) Если Право на исполнение не осуществляется автоматически в соответствии с пунктом 3.5 Стандартных условий, Покупатель осуществляет свое Право на исполнение по Сделке опцион путем направления Продавцу Требования об исполнении в течение Срока осуществления права на исполнение.
- (б) Если применительно к Сделке опцион установлена возможность Частичного исполнения в соответствии с пунктом 3.3 Стандартных условий либо применительно к Американскому опциону или Бермудскому опциону установлена возможность Многократного исполнения в соответствии с пунктом 3.4 Стандартных условий, в Требовании об исполнении Покупатель обязан указать количество Опционов, осуществляемых в соответствующую Дату осуществления права на исполнение по Сделке опцион.
- (в) С учетом пункта 3.4 Стандартных условий в случаях, когда условие о Многократном исполнении применимо к Сделке опцион и количество неисполненных Опционов составляет менее Минимального числа или превышает Максимальное число, если Покупатель не указывает количество Опционов в Требовании об исполнении в соответствии с пунктом 3.2(б) Стандартных условий, такое Требование об исполнении считается предъявленным в соответствующую Дату осуществления права на исполнение в отношении всех неисполненных Опционов.

3.3. **Частичное исполнение.** Условиями Европейского опциона может быть предусмотрена возможность частичного исполнения Сделки опцион (далее — «**Частичное исполнение**»). В этом случае в Дату истечения срока Покупатель вправе осуществить не все Количество опционов, предусмотренное условиями Европейского опциона, а только его часть. Частичное исполнение применяется к Европейскому опциону, если иное не предусмотрено условиями Сделки опцион.

3.4. **Многократное исполнение.**

- (а) Условиями Американского опциона или Бермудского опциона может быть предусмотрена возможность многократного исполнения Сделки опцион (далее — «**Многократное исполнение**»). В этом случае Покупатель вправе

осуществить все или часть неисполненных Опционов в один или более Плановых торговых дней в течение Срока осуществления права на исполнение. При этом Опционы не могут быть осуществлены в количестве ниже минимального предела (далее — «*Минимальное число*») и/или выше максимального предела (далее — «*Максимальное число*»), установленного условиями Сделки опцион. Максимальное число, установленное условиями Сделки опцион, не может быть менее Минимального числа, установленного условиями той же Сделки опцион. Если условиями Сделки опцион также установлен целый множитель (далее — «*Целый множитель*»), количество осуществляемых Опционов должно быть равным или кратным Целому множителю.

- (б) При установлении ограничений, указанных в пункте 3.4(а) Стандартных условий, если в какой-либо из указанных Плановых торговых дней Покупатель предпринимает действия по осуществлению Опционов в количестве:
 - (А) превышающем Максимальное число, осуществляется Максимальное число Опционов (Опционы в количестве, превышающем Максимальное число, остаются неисполненными);
 - (Б) менее Минимального числа, Опционы не осуществляются;
 - (В) не равном или не кратном Целому множителю, Опционы осуществляются в количестве, уменьшенном до ближайшего кратного Целому множителю значения (Опционы в количестве, превышающем это значение, остаются неисполненными).
- (в) В любой из указанных Плановых торговых дней Покупатель вправе осуществить любое количество Опционов (без учета требований пунктов 3.4(б)(Б) и 3.4(б)(В) Стандартных условий), не превышающее Максимальное число, если при этом осуществляются все неисполненные Опционы. При этом в Дату истечения срока Покупатель вправе осуществить любое количество неисполненных Опционов без ограничений.

3.5. Автоматическое исполнение.

- (а) Если условиями Сделки опцион предусмотрено, что Право на исполнение осуществляется автоматически, каждый неисполненный Опцион по такой Сделке опцион считается осуществленным автоматически (кроме случаев, когда при применении условия о Многократном исполнении в соответствии с пунктом 3.4 Стандартных условий количество неисполненных Опционов по состоянию на Дату истечения срока составляет менее Минимального числа или превышает Максимальное число и, вследствие этого, такие Опционы не подлежат исполнению):
 - (А) применительно к Сделке беспоставочный опцион — во Время закрытия в Дату истечения срока, если до наступления Времени закрытия Покупатель не уведомит Продавца о том, что Опционы не подлежат автоматическому исполнению;
 - (Б) применительно к Сделке поставочный опцион — во Время закрытия в Дату истечения срока, если по заключению Расчетного агента в указанное Время закрытия:

- (аа) по Опциону на покупку (колл) Пороговая цена равна или превышает 101 процент Цены исполнения;
- (бб) по Опциону на продажу (пут) Пороговая цена равна или меньше 99 процентов Цены исполнения,

за исключением случаев, когда до наступления Времени закрытия Покупатель уведомит Продавца о том, что Опционы не подлежат автоматическому исполнению, либо если Пороговая цена не может быть определена во Время закрытия в Дату истечения срока.

- (б) При этом если стороны направляют какие-либо уведомления или иные сообщения с напоминанием о наступлении срока исполнения обязательств по Сделке опцион, по которой Право на исполнение осуществляется автоматически в соответствии с настоящим пунктом, в том числе если они направляются в форме, установленной для Требования об исполнении, такие уведомления или иные сообщения носят исключительно уведомительный характер и не направлены на возникновение, изменение или прекращение прав и обязанностей сторон по Сделке опцион.
- (в) **Пороговая цена** означает цену за Облигацию или стоимость одной Корзины, определяемую в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, по состоянию на Время закрытия в Дату истечения срока, а при отсутствии такого порядка:
 - (А) применительно к Сделке опцион на облигации — Биржевую цену Облигации по состоянию на Время закрытия в Дату истечения срока, добросовестно определенную Продавцом, о чем последний должен незамедлительно уведомить Расчетного агента;
 - (Б) применительно к Сделке опцион на корзину облигаций — сумму стоимостей, рассчитанных по состоянию на Время закрытия в Дату истечения срока в отношении Облигаций каждого из Эмитентов как произведение Биржевой цены Облигации во Время закрытия в Дату истечения срока и соответствующего Количества облигаций, включенного в Корзину.

4. СДЕЛКИ ФОРВАРД

4.1. **Форвардная цена** означает:

- (а) применительно к Сделке форвард на облигации цену за Облигацию, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами;
- (б) применительно к Сделке форвард на корзину облигаций стоимость одной Корзины, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами.

4.2. **Существенные условия Сделки форвард.**

- (а) Существенными условиями Сделок форвард, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки в отношении каждой из этих Сделок, являются:

- (А) Покупатель;
 - (Б) Продавец;
 - (В) Базовый актив;
 - (Г) применительно к Сделке форвард на облигации Количество облигаций;
 - (Д) применительно к Сделке форвард на корзину облигаций Количество корзин;
 - (Е) Форвардная цена;
 - (Ж) Дата оценки;
 - (З) Биржа (применительно к Сделке беспоставочный форвард).
- (б) Другие условия Сделок форвард подлежат согласованию в качестве существенных условий по требованию одной из сторон.

5. БАРЬЕРЫ В СДЕЛКАХ

5.1. Сделка может быть совершена под отлагательным или отменительным условием, в соответствии с которым Право на исполнение, право на получение платежа или поставки либо обязанность совершить платеж или поставку в соответствии с условиями Сделки опцион или Сделки форвард, если условиями Сделки не предусмотрено иное:

- (а) возникает (такое условие Сделки именуется — **«Барьерное отлагательное условие»**) или
- (б) прекращается (такое условие Сделки именуется — **«Барьерное отменительное условие»**)

у соответствующей стороны, если цена или стоимость согласованного сторонами Барьерного ориентира достигла уровня Барьерной цены или преодолела его по состоянию на Контрольное время в Контрольную дату.

5.2. **Барьерная цена** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, цену или стоимость, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами в целях определения наступления Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

5.3. **Барьерный ориентир** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, облигацию, иную ценную бумагу или корзину, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — Облигацию или Корзину по этой Сделке.

5.4. **Контрольная дата** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, каждый из Плановых торговых дней, указанный в этом качестве в Подтверждении

или иным образом согласованный сторонами, если в этот день не возникло Чрезвычайной ситуации до наступления Контрольного времени. Если в день, указанный в качестве Контрольной даты, возникла Чрезвычайная ситуация, Контрольной датой считается:

- (а) ближайший следующий Плановый торговый день после окончания Чрезвычайной ситуации;
- (б) если Чрезвычайная ситуация продолжается в течение восьми Плановых торговых дней подряд после дня, первоначально указанного в качестве Контрольной даты, — восьмой Плановый торговый день независимо от того, что Чрезвычайная ситуация продолжает иметь место. При этом Расчетный агент определяет значение Барьерного ориентира в порядке, установленном пунктом 6.5(а)(Б) или 6.5(б) Стандартных условий.

Если в Подтверждении не указано Контрольных дат (и они иным образом не согласованы сторонами), Контрольной датой является каждый из Плановых торговых дней в течение периода начиная с Даты сделки (включительно) по (включая) последнюю Дату оценки, Дату истечения срока или в случае их отсутствия день, предшествующий последней Дате расчетов по Сделке на один Расчетный цикл (с учетом положений пунктов 3.1(б) и 6.5 Стандартных условий о переносе срока, если применимо).

5.5. **Контрольное время** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием:

- (а) время дня в Контрольную дату, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами;
- (б) при отсутствии этого — Время оценки, указанное в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами;
- (в) при отсутствии в Подтверждении или ином соглашении сторон Времени оценки — Время закрытия торгов на соответствующей бирже в отношении Барьерного ориентира в Контрольную дату;
- (г) если такая биржа закрывается до наступления Времени закрытия торгов — фактическое время закрытия торгов в режиме основных торгов.

5.6. Если условиями Сделки предусмотрены Барьерный ориентир, который также является Облигацией или Корзиной по этой Сделке, и Барьерная цена, то Барьерное отлагательное условие или Барьерное отменительное условие считается наступившим, если на Контрольное время в Контрольную дату:

- (а) цена или стоимость Барьерного ориентира равна или превышает Барьерную цену, если на Дату сделки Барьерная цена превышала Первоначальную цену, Цену исполнения, Форвардную цену или иной установленный условиями Сделки первоначальный ориентир;
- (б) цена или стоимость Барьерного ориентира равна или меньше Барьерной цены, если на Дату сделки Барьерная цена была меньше Первоначальной цены, Цены исполнения, Форвардной цены или иного установленного условиями Сделки первоначального ориентира.

- 5.7. Существенными условиями Сделки, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки помимо существенных условий соответствующего вида Сделок, предусмотренных Стандартными условиями, являются:
- (а) Тип условия о барьере (отлагательное или отменительное);
 - (б) Барьерный ориентир (если отличается от Базового актива);
 - (в) Барьерная цена.
- 5.8. В случае возникновения у сторон разногласий по вопросу о наступлении Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия Расчетный агент определяет, наступило ли соответствующее условие.

6. ОЦЕНКА

6.1. **Время оценки** означает время в течение Даты оценки, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки применительно к каждой Облигации, стоимость которой подлежит оценке. Если Биржа закрывается раньше Времени закрытия торгов, и указанное в Подтверждении Время оценки наступает по окончании проведения торгов в режиме основных торгов, Временем закрытия будет фактическое время закрытия Биржи.

6.2. **Дата оценки** означает:

- (а) применительно к Сделке опцион каждую Дату осуществления права на исполнение;
- (б) применительно к Сделке форвард каждый день, указанный в этом качестве в Подтверждении, иным образом определяемый в соответствии с ним или иным образом согласованный сторонами, а если этот день не является Плановым торговым днем, — ближайший следующий Плановый торговый день, в каждом случае с учетом пункта 6.5 Стандартных условий.

6.3. **Общие положения о Чрезвычайных ситуациях.** Если применительно к Облигации наступает или имеет место одно из событий, указанных в подпунктах (а)-(в) настоящего пункта 6.3, с учетом подпункта (г) настоящего пункта 6.3 (далее каждое из таких событий — «**Чрезвычайная ситуация**»), к Сделке применяются последствия, установленные пунктом 6.5 Стандартных условий:

- (а) **Сбой в проведении торгов** означает любое приостановление или ограничение торгов Облигацией на Бирже, вводимое Биржей или иным образом по причине изменения цен, превышающего лимиты, установленные Биржей, либо по другой причине.
- (б) **Сбой в работе биржи** означает:
 - (А) любое событие, не являющееся Внеплановым закрытием, которое по заключению Расчетного агента нарушает или затрудняет возможность

участников рынка в целом заключать сделки (или получать данные о котировках) с Облигациями на Бирже;

(Б) случаи, когда Биржа не открывается для проведения торгов в режиме основных торгов в Плановый торговый день.

(в) **Внеплановое закрытие** означает закрытие Биржи в какой-либо Рабочий день до наступления Времени закрытия торгов, кроме случаев, когда Биржа объявляет о таком досрочном закрытии не менее чем за один час до (в зависимости от того, что наступит раньше):

(А) фактического закрытия торгов в режиме основных торгов на этой Бирже в этот Рабочий день;

(Б) срока завершения подачи заявок для их регистрации в системе Биржи в целях их исполнения во Время оценки в этот Рабочий день.

(г) Сбой в проведении торгов или Сбой в работе биржи (кроме указанного в подпункте (б)(Б) настоящего пункта 6.3) является Чрезвычайной ситуацией, если он происходит не ранее одного часа до наступления Времени оценки, Времени закрытия, Контрольного времени и является по заключению Расчетного агента существенным.

6.4. **Первоначальная дата оценки** означает любой день, который, если бы не возникла Чрезвычайная ситуация, был бы Датой оценки (не принимая во внимание для целей настоящего пункта перенос Даты осуществления права на исполнение или Даты истечения срока по причине возникновения Чрезвычайной ситуации, при условии, что первоначальная Дата осуществления права на исполнение или Дата истечения срока была бы Датой оценки).

6.5. **Последствия возникновения Чрезвычайной ситуации.** Если Чрезвычайная ситуация возникает или имеет место в Дату оценки:

(а) применительно к Срочной Сделке на облигации Датой оценки считается:

(А) ближайший следующий Плановый торговый день после окончания Чрезвычайной ситуации;

(Б) если Чрезвычайная ситуация продолжается в течение восьми Плановых торговых дней подряд после Первоначальной даты оценки — восьмой Плановый торговый день, независимо от того, что Чрезвычайная ситуация продолжает иметь место. При этом Расчетный агент определяет стоимость Облигации по состоянию на Время оценки в этот восьмой Плановый торговый день, исходя из своей добросовестной оценки;

(б) применительно к Срочной Сделке на корзину облигаций Датой оценки считается:

(А) для Облигации, не затронутой Чрезвычайной ситуацией, Первоначальная дата оценки;

(Б) для Облигации, затронутой Чрезвычайной ситуацией:

(аа) ближайший следующий Плановый торговый день после окончания Чрезвычайной ситуации;

- (бб) если Чрезвычайная ситуация продолжается в течение восьми Плановых торговых дней после Первоначальной даты оценки — восьмой Плановый торговый день, независимо от того, что Чрезвычайная ситуация продолжает иметь место. При этом Расчетный агент определяет стоимость Облигации по состоянию на Время оценки в этот восьмой Плановый торговый день, исходя из своей добросовестной оценки.

7. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ О РАСЧЕТАХ ПО СДЕЛКАМ

7.1. Выбор способа расчетов.

- (а) Условия Сделки могут предусматривать право одной из сторон выбрать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки (далее — **«Выбор способа расчетов»**). В этом случае сторона, наделенная правом выбора (а при отсутствии указания на такую сторону — Покупатель), обязана направить другой стороне безотзывное уведомление о выбранном ею применительно к Сделке способе расчетов.

Указанное в настоящем пункте уведомление должно быть направлено не позднее Даты выбора способа расчетов (включительно).

- (б) Если уведомление о Выборе способа расчетов не направлено в соответствии с настоящим пунктом, расчеты по Сделке осуществляются в соответствии со способом расчетов по умолчанию (далее — **«Способ расчетов по умолчанию»**), указанным в Подтверждении или иным образом согласованным сторонами применительно к Сделке. При отсутствии такого указания расчеты по Сделке форвард на облигации или Сделке форвард на корзину облигаций осуществляются в порядке, установленном для Поставочной сделки.

Применительно к Сделке опцион на облигации и Сделке опцион на корзину облигаций Способ расчетов по умолчанию указывается в Подтверждении.

- (в) **Дата выбора способа расчетов** означает день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а если этот день не является Плановым торговым днем, ближайший следующий Плановый торговый день.

7.2. Расчетная цена означает применительно к Дате оценки:

- (а) применительно к Сделке беспоставочный опцион на облигации или Сделке форвард на облигации — цену одной Облигации, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, а при отсутствии такого порядка — Биржевую цену Облигации;
- (б) применительно к Сделке беспоставочный опцион на корзину облигаций или Сделке форвард на корзину облигаций — стоимость одной Корзины,

определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки (или каждое Время оценки) в Дату оценки в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, а при отсутствии такого порядка — стоимость одной Корзины, равную суммарной стоимости Облигаций, включенных в Корзину. При этом стоимость Облигаций каждого из Эмитентов рассчитывается как произведение (i) Биржевой цены такой Облигации и (ii) соответствующего Количества облигаций в Корзине;

- (в) применительно к Сделке поставочный опцион на облигации или Сделке поставочный опцион на корзину облигаций — Цену исполнения,

в каждом из случаев, указанных в подпунктах (а)–(в) настоящего пункта 7.2, увеличенную на сумму процентов, при их наличии, начисленных на Облигации, являющиеся Базовым активом.

7.3. **Внесение исправлений в цену Облигации.**

- (а) Для целей определения Расчетной цены в какой-либо день, если в цену, опубликованную или иным образом объявленную в соответствующий день и используемую Расчетным агентом в целях определения Расчетной цены, вносится исправление, и результаты исправления публикуются или иным образом объявляются лицом, ответственным за такую публикацию или объявление, то в течение тридцати календарных дней после дня первоначальной публикации или объявления, любая из сторон вправе уведомить другую сторону о:

- (А) внесении таких исправлений и

- (Б) сумме, при ее наличии, подлежащей уплате какой-либо из сторон в результате этих исправлений.

- (б) Если в соответствии с подпунктом (а) настоящего пункта 7.3 какая-либо из сторон направляет уведомление об уплате соответствующей суммы, то сторона, которая первоначально получила или сохранила такую сумму, обязана не позднее трех Рабочих дней после получения такого уведомления какой-либо из сторон (в зависимости от обстоятельств) уплатить другой стороне причитающуюся сумму и проценты, начисленные на эту сумму за период начиная со дня (исключая такой день), когда платеж был (или не был) сделан первоначально, по день (включая такой день) возврата или уплаты суммы в результате указанных исправлений цены Облигации.

Размер процентов определяется существующей в месте нахождения получателя платежа учетной ставкой банковского процента на день уплаты указанной суммы, определенной Расчетным агентом.

7.4. **Дата расчетов** означает:

- (а) применительно к Беспоставочным сделкам любой день, указанный в этом качестве в Подтверждении, иным образом определяемый в соответствии с ним или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания в Подтверждении или иного соглашения

сторон — день, наступающий через один Расчетный цикл после Даты оценки. Если день, определенный в соответствии с настоящим пунктом в качестве Даты расчетов, не является Рабочим днем, Датой расчетов считается ближайший следующий Рабочий день.

Применительно к Срочной Сделке на корзину облигаций, если в результате наступления Чрезвычайной ситуации возникло более одной Даты оценки по отношению к Облигациям, включенным в Корзину, Дата расчетов определяется путем отсчета от последней наступившей Даты оценки.

(б) применительно к Поставочным сделкам:

(А) применительно к Облигациям, подлежащим поставке по Сделке опцион, день, наступающий через один Расчетный цикл после соответствующей Даты осуществления права на исполнение (или, если этот день не является Рабочим днем, ближайший следующий Рабочий день);

(Б) применительно к Облигациям, подлежащим поставке по Сделке форвард, день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания в Подтверждении или иного соглашения сторон — день, наступающий через один Расчетный цикл после Даты оценки (или, если этот день не является Рабочим днем, ближайший следующий Рабочий день);

(В) если Облигации не могут быть поставлены в день, указанный в пункте 7.4(б)(А) или 7.4(б)(Б) Стандартных условий, по причине наступления События, препятствующего проведению расчетов, Датой расчетов считается ближайший следующий день, когда поставка Облигаций через согласованную Клиринговую организацию становится возможной;

(Г) если Облигации не могут быть поставлены по причине наступления События, препятствующего проведению расчетов, в течение восьми Рабочих дней, следующих после дня, который первоначально должен был быть Датой расчетов:

(аа) если Облигации могут быть поставлены иным разумным способом, Дата расчетов наступает в первый день, когда расчеты по продаже Облигаций, совершенной в такой восьмой Рабочий день, обычно проводятся с использованием такого разумного способа поставки (и такой способ признается поставкой Облигаций через согласованную Клиринговую организацию);

(бб) если Облигации не могут быть поставлены иным разумным способом, Дата расчетов признается отложенной до дня, когда поставка через согласованную Клиринговую организацию или иным разумным способом станет возможной;

(Д) применительно к Срочной Сделке на корзину облигаций, если некоторые (но не все) Облигации из включенных в Корзину Облигаций не могут быть поставлены по причине наступления События, препятствующего проведению расчетов:

- (aa) Дата расчетов в отношении Облигаций, затронутых Событием, препятствующим проведению расчетов, определяется в соответствии с подпунктами (В) и (Г) настоящего пункта 7.4(б);
- (бб) Облигации, не затронутые Событием, препятствующим проведению расчетов, подлежат поставке в первоначально согласованную Дату расчетов;
- (вв) если в Дату расчетов поставлены не все Облигации, включенные в Корзину, Расчетный агент определяет по своему усмотрению размер пропорционально изменяющегося платежа, причитающегося от другой стороны в оплату такой неполной поставки.

7.5. Если условиями Сделки не предусмотрен способ расчетов, расчеты по Сделке осуществляются в порядке, установленном для Поставочной сделки.

8. РАСЧЕТЫ ПО БЕСПОСТАВОЧНОЙ СДЕЛКЕ

8.1. **Сумма платежа** означает, если иное не предусмотрено Подтверждением, применительно к каждой Дате оценки:

- (а) в Сделке опцион на облигации или Сделке опцион на корзину облигаций — сумму, равную произведению количества Опционов, осуществленных в соответствующую Дату осуществления права на исполнение, Предмета опциона и Дифференциала цены исполнения.

$$\text{Сумма платежа} = \frac{\text{количество осуществленных Опционов}}{\text{Предмет опциона}} \times \text{Дифференциал цены исполнения}$$

- (б) в Сделке форвард на облигации или Сделке форвард на корзину облигаций — сумму, равную произведению Количества облигаций или Количества корзин и разности Расчетной цены и Форвардной цены;

$$\text{Сумма платежа} = \frac{\text{Количество облигаций или Количество корзин}}{\text{Количество корзин}} \times (\text{Расчетная цена} - \text{Форвардная цена})$$

8.2. **Дифференциал цены исполнения** означает, если иное не предусмотрено Подтверждением или иным образом не согласовано сторонами, применительно к каждой Дате оценки:

- (а) если Цена исполнения определена как сумма денежных средств в соответствующей валюте, — сумму, равную разности:
 - (А) по Опциону на покупку (колл) Расчетной цены и Цены исполнения;
 - (Б) по Опциону на продажу (пут) Цены исполнения и Расчетной цены;
- (б) если Цена исполнения определена как процент от номинальной стоимости Облигаций (например, 103 процента от номинальной стоимости), — сумму, равную разности:

- (А) по Опциону на покупку (колл) произведения Расчетной цены и номинальной стоимости Облигации, с одной стороны, и произведения Цены исполнения и номинальной стоимости Облигации, с другой стороны;
 - (Б) по Опциону на продажу (пут) произведения Цены исполнения и номинальной стоимости Облигации, с одной стороны, и произведения Расчетной цены и номинальной стоимости Облигации, с другой стороны;
- в случае если разность, полученная в соответствии с подпунктом (а) или (б) настоящего пункта 8.2, имеет отрицательное значение, Дифференциал цены исполнения считается равным нулю;
- (в) если Цена исполнения определена как доходность, — сумму, определенную методом, указанным в Подтверждении или определяемым в соответствии с ним либо иным образом согласованным сторонами.

8.3. **Расчеты по Сделке беспоставочный опцион.** По Сделке беспоставочный опцион применительно к каждой Дате осуществления права на исполнение Продавец обязан уплатить Покупателю Сумму платежа в каждую соответствующую Дату расчетов по всем Опционам, осуществленным в эту Дату осуществления права на исполнение.

8.4. **Расчеты по Сделке беспоставочный форвард.** По Сделке беспоставочный форвард применительно к каждой Дате расчетов:

- (а) если Сумма платежа имеет положительное значение, Продавец обязан уплатить Покупателю Сумму платежа в соответствующую Дату расчетов;
- (б) если Сумма платежа имеет отрицательное значение, Покупатель обязан уплатить Продавцу абсолютную величину Суммы платежа в соответствующую Дату расчетов.

9. РАСЧЕТЫ ПО ПОСТАВОЧНОЙ СДЕЛКЕ

9.1. **Расчеты по Сделке поставочный опцион.** По Сделке поставочный опцион применительно к каждой Дате осуществления права на исполнение в соответствующую Дату расчетов:

- (а) по Опциону на покупку (колл) Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, равную произведению Расчетной цены и (без округления) Количества облигаций или Количества корзин, а Продавец обязан передать Покупателю в собственность Количество облигаций или Количество корзин соответственно;
- (б) по Опциону на продажу (пут) Покупатель обязан передать Продавцу в собственность Количество облигаций или Количество корзин, а Продавец обязан уплатить Покупателю сумму, равную произведению Расчетной цены и (без округления) Количества облигаций или Количества корзин;

при этом любые из указанных в настоящем пункте 9.1 платежей или поставок должны осуществляться в соответствующую Дату расчетов на счета, указанные в Подтверждении.

9.2. **Расчеты по Сделке поставочный форвард.** По Сделке поставочный форвард в соответствующую Дату расчетов:

- (а) применительно к Сделке форвард на облигации Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, равную произведению Форвардной цены и Количества облигаций, а Продавец обязан передать Покупателю в собственность Количество облигаций;
- (б) применительно к Сделке форвард на корзину облигаций Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, равную произведению Форвардной цены и Количества корзин, а Продавец применительно к каждому Эмитенту, Облигации которого включены в Корзину, обязан передать Покупателю в собственность Количество облигаций такого Эмитента, умноженное на Количество корзин;

при этом любые из указанных в настоящем пункте 9.2 платежей или поставок должны осуществляться на счета, указанные в Подтверждении.

9.3. **Поставка Облигаций частями.** Если условиями Поставочной сделки предусмотрено, что поставка Облигаций может быть осуществлена частями (далее — *«Поставка облигаций частями»*), то сторона, обязанная поставить Облигации, вправе, уведомив об этом другую сторону, разделить подлежащие поставке Облигации на такое количество лотов такого размера, которые уведомляющая сторона посчитает необходимыми в целях облегчения поставки. Если стороны не договорились об ином, условие о Поставке облигаций частями применяется к Поставочной Сделке по умолчанию.

9.4. **Просрочка поставки и право покупки Облигаций у третьего лица или лиц.**

- (а) Неисполнение или ненадлежащее исполнение стороной обязательства по поставке Облигаций в установленный условиями Сделки срок составляет Нарушение обязательства, как оно определено в подпункте (а) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора, только в том случае, если не позднее следующего Рабочего дня после получения стороной-должником уведомления о такой просрочке сторона-должник:

- (А) не исправит нарушения; или
- (Б) не предоставит стороне-кредитору обеспечения или иных гарантий исполнения своего обязательства, которые сторона-кредитор, действуя добросовестно, но по своему усмотрению, сочтет приемлемыми.

Если условие о Поставке облигаций частями применимо к Поставочной Сделке, обязательство по поставке Облигаций считается нарушенным только применительно к тем лотам подлежащих поставке Облигаций, которые не были поставлены.

- (б) В дополнение к требованию о предоставлении стороной-должником обеспечения или иных гарантий исполнения своего обязательства сторона-кредитор вправе в любое время досрочно прекратить обязательства по Поставочной Сделке, приобрести соответствующие Облигации у третьего лица

или лиц, предприняв при этом все усилия к тому, чтобы осуществить это не позднее сорока пяти календарных дней после указанного нарушения (при условии отсутствия Нарушения обязательства по подпункту (а) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора), и требовать от стороны-должника возмещения расходов по приобретению Облигаций у третьего лица или лиц.

При этом сторона-кредитор обязана письменно уведомить сторону-должника:

- (А) о своем намерении приобрести Облигации у третьего лица или лиц — не позднее двух Рабочих дней до дня такого приобретения Облигаций;
- (Б) о количестве приобретенных Облигаций и цене их приобретения — в день приобретения Облигаций.

Сторона-должник обязана возместить расходы стороны-кредитора на приобретение Облигаций у третьего лица или лиц не позднее пяти Рабочих дней после дня их приобретения.

- (в) Если надлежащее исполнение стороной-должником обязательства по поставке Облигаций невозможно по причине их отсутствия или сторона-кредитор не может приобрести Облигации у третьего лица или лиц, Поставочная сделка подлежит прекращению в соответствии с любыми применимыми положениями Генерального соглашения или соответствующего Подтверждения, как если бы:
 - (А) неисполнение или ненадлежащее исполнение стороной-должником обязательства по поставке Облигаций составляло Иное основание досрочного прекращения в соответствии с пунктом 5.3 статьи 5 Примерных условий договора;
 - (Б) сторона-должник была единственной Затронутой стороной;
 - (В) сторона-кредитор была вправе прекратить Сделки в соответствии с пунктом 6.6 статьи 6 Примерных условий договора;
 - (Г) Поставочная сделка (с учетом любой частичной поставки) была единственной Затронутой сделкой (при этом в отношении Американского опциона или Бермудского опциона, к которому применимо условие о Многократном исполнении, если в соответствующую Дату осуществления права на исполнение Право на исполнение было осуществлено в отношении не всех Опционов, Сделка поставочный опцион (с учетом любой частичной поставки) для целей настоящего подпункта считается состоящей только из Опционов, в отношении которых было осуществлено Право на исполнение).
- (г) Термины «Нарушение обязательства», «Иное основание прекращения», «Затронутая сторона» и «Затронутая сделка» имеют значение, указанное в Примерных условиях договора, если Генеральным соглашением не предусмотрено иное.

9.5. Событие, препятствующее проведению расчетов.

- (а) *Событие, препятствующее проведению расчетов*, означает применительно к Облигации событие, находящееся вне контроля сторон, в результате которого согласованная сторонами Клиринговая организация не может провести расчеты по этой Облигации.
- (б) Если применительно к Поставочной Сделке наступило Событие, препятствующее проведению расчетов, в результате чего поставка Облигаций в день, который, если бы не наступление События, препятствующего проведению расчетов, был бы Датой расчетов, становится невозможной, то Дата расчетов наступает в первый из последующих дней, когда поставка Облигаций через согласованную сторонами Клиринговую организацию становится возможной, за исключением случаев, когда по причине наступления События, препятствующего проведению расчетов, проведение расчетов невозможно в каждый из дней, когда Клиринговая организация открыта (или была бы открыта, если бы не Событие, препятствующее проведению расчетов) в течение тридцати календарных дней со дня, первоначально указанного в качестве Даты расчетов.

Если Дата расчетов не наступает в течение указанных тридцати календарных дней, сторона, обязанная поставить Облигации по Сделке, предпринимает все зависящие от нее меры с целью передать другой стороне согласованное Количество облигаций в возможно короткий срок после истечения этих тридцати календарных дней иным коммерчески разумным способом без использования Клиринговой организации.

9.6. **Расходы.** Все расходы, связанные с передачей Облигаций по Сделке (в частности, биржевые и иные сборы, налоги), несет сторона, осуществляющая поставку соответствующих Облигаций.

9.7. **Заявления и прочие обязательства.** Сторона, обязанная поставить Облигации по Сделке, принимает на себя обязательство по передаче Облигаций свободными от:

- (а) любых прав третьих лиц, в частности залога, иного обременения или притязаний третьих лиц, а также прочих ограничений любого характера, за исключением ограничений, которые могут быть установлены законодательством Российской Федерации, в отношении продажи приобретателем таких Облигаций третьим лицам;
- (б) любых ограничений, устанавливающих необходимость получения сторонней, обязанной поставить Облигации, от какого-либо лица, включая Эмитента, согласия на продажу, цессию или иную передачу Облигаций или ее одобрения таким лицом;
- (в) любых ограничений, касающихся правового или финансового положения или иного состояния покупателя, залогодержателя, цессионария или иного приобретателя таких Облигаций;
- (г) любых требований по передаче какого-либо сертификата, разрешения, одобрения, соглашения, заключения, уведомления или иного документа како-

го-либо лица в адрес Эмитента этих Облигаций, регистратора или трансфер-агента до их продажи, передачи в залог, цессии или иной передачи этих Облигаций;

- (д) любых регистрационных или квалификационных требований или требований по регистрации проспекта этих Облигаций в соответствии с законодательством Российской Федерации о ценных бумагах.

10. ОСОБЫЕ ОБСТОЯТЕЛЬСТВА

10.1. **Особое обстоятельство** означает Делистинг, Изменение законодательства, Нарушение обязательства по поставке, Банкротство или применимое Иное событие, препятствующее исполнению.

10.2. **Делистинг** означает, что Биржа объявляет о том, что в соответствии с ее правилами Облигации исключаются или подлежат исключению из всех ее котировальных списков, торги этими Облигациями на этой Бирже прекращаются или подлежат прекращению по любому основанию без незамедлительного включения Облигаций в котировальные списки или их допуска к торгам иным образом на какой-либо иной бирже в Российской Федерации.

- (а) Применительно к Делистингу «**Дата объявления**» означает день, в который Биржа впервые публично объявила о предстоящем исключении Облигаций из котировального списка или прекращении торгов Облигациями в случаях, предусмотренных абзацем первым настоящего пункта 10.2.

Если о Делистинге объявлено после фактического времени закрытия торговой сессии режима основных торгов на соответствующей Бирже, без учета послеторгового и других периодов за рамками периода проведения торгов в режиме основных торгов, Датой объявления будет следующий Плановый торговый день.

- (б) Сторона, как только ей станет известно о Делистинге, обязана незамедлительно уведомить об этом другую сторону. Для целей определения последствий Делистинга:

- (А) условие «**Ликвидационный неттинг по соглашению сторон**» означает, что стороны вправе досрочно прекратить обязательства по Сделке на согласованных ими условиях.

Если стороны не достигнут соглашения о досрочном прекращении обязательств по Сделке, условия такой Сделки сохраняют силу с учетом того, что условие о поставке Облигаций в любой Сделке может быть по усмотрению любой из сторон заменено на условие о выплате Суммы платежа, за исключением того, что если в Первоначальную дату оценки возникает или имеет место Чрезвычайная ситуация, Расчетный агент не применяет последствия возникновения Чрезвычайной ситуации, установленные пунктом 6.5 Стандартных условий, а добросовестно определяет Расчетную цену по состоянию на Время оценки в эту Дату оценки;

- (Б) условие «**Расторжение с выплатой**» означает, что Сделка расторгается в Дату объявления и:
 - (аа) по Сделке опцион Продавец обязан уплатить Покупателю сумму, рассчитанную в соответствии с пунктом 10.6(а)(А) Стандартных условий;
 - (аб) по Сделке форвард одна сторона обязана уплатить другой стороне сумму, рассчитанную в соответствии с пунктом 10.6(а)(Б) Стандартных условий;
- (В) условие «**Частичное расторжение с выплатой**» означает, что применительно к Срочной Сделке на корзину облигаций:
 - (аа) часть Срочной сделки на корзину облигаций, касающаяся Облигаций, в отношении которых произошел Делистинг (далее — «**Затронутые облигации**»), расторгается в Дату объявления;
 - (аб) сумма, рассчитанная в соответствии с пунктом 10.6 Стандартных условий в отношении Затронутых облигаций, подлежит уплате одной стороной другой стороне;
 - (ав) прочие части Срочной сделки на корзину облигаций сохраняют силу применительно к Корзине, включающей Облигации, не являющиеся Затронутыми облигациями;
 - (аг) Расчетный агент уточняет при необходимости соответствующие условия с тем, чтобы сохранить в максимальной с практической точки зрения степени экономические условия Сделки применительно к оставшимся Облигациям.

10.3. **Изменение законодательства** означает, что в или после Даты сделки в результате:

- (а) принятия нормативного правового акта Российской Федерации, в том числе нормативного акта Банка России, включая внесение изменений и/или дополнений в действующие нормативные правовые акты Российской Федерации;
- (б) провозглашения решения Конституционного Суда Российской Федерации;
- (в) письменного разъяснения по вопросу применения нормативного правового акта Российской Федерации, в том числе нормативного акта Банка России, данного стороне либо неопределенному кругу лиц уполномоченным органом государственной власти (уполномоченным должностным лицом этого органа), в том числе Банком России, в пределах его компетенции;
- (г) принятия Верховным Судом Российской Федерации и/или Высшим Арбитражным Судом Российской Федерации судебного акта или разъяснения по вопросам судебной практики,

сторона соответствующей Сделки приходит к выводу, действуя разумно и добросовестно, что приобретение, владение или распоряжение Облигациями, являющимися предметом Сделки, является неправомерным

либо что ее расходы в связи с исполнением ее обязательств по Сделке (в том числе в связи с увеличением налогового бремени) возрастут существенным образом.

- 10.4. **Нарушение обязательства по поставке** означает неисполнение или ненадлежащее исполнение стороной в установленный срок обязательства по поставке Облигаций по Сделке в случае, когда это вызвано отсутствием ликвидности на рынке таких Облигаций.
- 10.5. **Банкротство** имеет значение, определенное в Генеральном соглашении, при этом ссылки на Сторону, ее Связанное лицо или Лицо, предоставляющее обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, считаются ссылками на Эмитента.
- 10.6. **Последствия наступления Особых обстоятельств.**
- (а) Если в случае Делистинга в соответствии с условиями Сделки применяется условие «Расторжение с выплатой» или «Частичное расторжение с выплатой», одна сторона обязана уплатить другой стороне сумму, определяемую в соответствии с подпунктом (А) или (Б) настоящего пункта 10.6(а), в срок не позднее трех Рабочих дней после дня направления Расчетным агентом или Определяющей стороной уведомления о такой сумме с указанием стороны, обязанной ее уплатить. Указанное уведомление должно быть направлено Расчетным агентом или Определяющей стороной незамедлительно после определения этой суммы. При этом сумма должна быть выражена в валюте расчетов по Сделке в соответствии с тем, как это определит Расчетный агент или Определяющая сторона.
- (А) Применительно к Сделке опцион сумма, подлежащая уплате Продавцом Покупателю, определяется по соглашению сторон не позднее пяти Рабочих дней после Даты объявления.
- (Б) Применительно к Сделке форвард, такая Сделка расторгается, а соответствующая сторона или стороны (в соответствии с правилами, установленными ниже) определяют Сумму выплаты при расторжении применительно к каждой расторгаемой Сделке.
- (aa) Если условиями расторгаемой Сделки предусмотрена одна Определяющая сторона, то Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении и определяет, какая из сторон Сделки обязана уплатить ее другой стороне.
- (bb) Если условиями расторгаемой Сделки предусмотрены две Определяющие стороны, каждая из сторон рассчитывает Сумму выплаты при расторжении. Сторона, Сумма выплаты при расторжении которой меньше, уплачивает Стороне, Сумма выплаты при расторжении которой больше, половину разницы между Суммами выплаты при расторжении, рассчитанными сторонами.
- (б) Если Изменение законодательства или Банкротство предусмотрено условиями Сделки в качестве применимого Особого обстоятельства, в случае его

наступления любая сторона вправе по своему выбору расторгнуть Сделку, если направит другой стороне уведомление с указанием даты расторжения не менее чем за два Плановых торговых дня, если меньший срок не требуется в соответствии с Изменением законодательства. В этом случае Сделка расторгается, а Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении, подлежащую уплате одной стороной другой стороне;

- (в) Если Нарушение обязательства по поставке предусмотрено условиями Сделки в качестве применимого Особого обстоятельства, такое событие не будет являться Нарушением обязательства в соответствии с Генеральным соглашением, и в случае его наступления сторона, обязанная произвести поставку соответствующих облигаций (далее — «*Поставщик*»), обязана:
 - (аа) уведомить другую сторону (далее — «*Получатель*») о Нарушении обязательства по поставке:
 - (I) применительно к Сделке опцион не позднее следующего Рабочего дня после Даты осуществления права на исполнение;
 - (II) применительно к Сделке форвард не менее чем за один Расчетный цикл до Даты расчетов;
 - (бб) в Дату расчетов передать Получателю в собственность такое количество Облигаций, которое Поставщик может поставить в этот день.

Обязательство Получателя произвести какой-либо платеж или встречную поставку Поставщику уменьшается пропорционально количеству Облигаций, которое он получит от Поставщика.

- (Б) Применительно к Европейскому опциону или Сделке форвард Получатель вправе по своему выбору расторгнуть Сделку, если направит Поставщику уведомление об этом. В этом случае Сделка расторгается в день получения такого уведомления. Получатель как Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении (с учетом частично исполненной поставки, если применимо).
- (В) Применительно к Американскому опциону или Бермудскому опциону Получатель вправе по своему выбору досрочно прекратить обязательства по Сделке в части осуществленных Опционов, если направит Поставщику уведомление об этом. В день получения этого уведомления обязательства по Сделке в части осуществленных Опционов прекращаются досрочно. Получатель как Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении, подлежащую уплате применительно к досрочно прекращенным обязательствам по Сделке (с учетом частично исполненной поставки, если применимо).
- (Г) Применительно к Американскому опциону или Бермудскому опциону, если применимо условие о Многократном исполнении и при этом осуществлена часть Опционов в соответствующую Дату осуществления права на исполнение, в пределах одного Расчетного цикла с Даты расче-

тов, когда обязательства по Сделке были прекращены досрочно, Получатель вправе досрочно прекратить обязательства по оставшейся части Сделки, если направит Поставщику уведомление об этом не менее чем за два Плановых торговых дня. В этом случае обязательства по Сделке прекращаются досрочно в день получения указанного уведомления. Получатель как Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении, подлежащую уплате применительно к досрочно прекращенным обязательствам по Сделке (с учетом частично исполненной поставки, если применимо).

10.7. Сумма выплаты при расторжении.

(а) **Сумма выплаты при расторжении** означает сумму, рассчитываемую Определяющей стороной в порядке, установленном для расчета Ликвидационной суммы, как если бы:

- (А) Особое обстоятельство было определено как Дополнительное основание прекращения;
- (Б) все применимые Льготные периоды истекли;
- (В) все уведомления, необходимые для возникновения права на прекращение обязательств по Сделке, были получены в день, указанный в качестве даты расторжения Сделки в статье 10 Стандартных условий соответственно;
- (Г) Определяющая сторона была бы Незатронутой стороной, а если обе стороны являются Определяющими сторонами — обе стороны были бы Затронутыми сторонами;
- (Д) Сделка являлась единственной Затронутой сделкой.

Термины «Дополнительное основание прекращения», «Льготный период», «Незатронутая сторона», «Затронутые стороны» и «Затронутая сделка» имеют значение, указанное в Примерных условиях договора, если Генеральным соглашением не предусмотрено иное.

(б) **Определяющая сторона** означает сторону, указанную в этом качестве в Подтверждении.

(в) Сумма выплаты при расторжении, подлежащая уплате одной стороной другой стороне, должна быть уплачена обязанной стороной не позднее трех Рабочих дней после получения ею уведомления с указанием:

- (А) этой суммы, рассчитанной Определяющей стороной, в валюте расчетов по Сделке в соответствии с тем, как это определит Определяющая сторона, и
- (Б) стороны, которая обязана уплатить Сумму выплаты при расторжении.

Такое уведомление должно быть направлено Определяющей стороной незамедлительно после проведения расчета.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1
к стандартным условиям срочных сделок с облигациями
2011

Форма Подтверждения
для Сделки беспоставочный опцион на облигации

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является Подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с облигациями 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Стиль опциона:

[Американский/Бермудский/
Европейский]

Тип опциона:

[Опцион на продажу (пут) [●] /
Опцион на покупку (колл) [●]]

Продавец:

[Сторона А] [Сторона Б]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Облигации:

[*Полное наименование, категория (тип), и/или номинальная стоимость Облигаций, идентификационный номер выпуска или иные идентификационные признаки Облигаций*] [полное фирменное наименование Эмитента Облигаций]

Количество опционов:

[Предмет опциона:

[●] Облигация (-и/-й)
по одному Опциону]¹

Цена исполнения:²

Премия:

[●] [(Премия за Опцион [●])] ³

Дата уплаты премии:

[Условие об окончании срока
в нерабочий день применительно
к Дате уплаты премии:]

Биржа:

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]⁴

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

¹ По умолчанию Предмет опциона составляет одна Облигация. Предмет опциона необходимо указывать только в случае, когда Предмет опциона составляет количество Облигаций, отличное от установленного по умолчанию.

² Выражается как сумма денежных средств в соответствующей валюте или процент от номинальной стоимости Облигации.

³ Если указана Премия за Опцион, то общая сумма Премии составляет произведение Премии за Опцион и Количества опционов.

⁴ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

Контрольная дата (даты):	
Контрольное время:] ⁵	
[Барьерное отменительное условие:	[Применимо] ⁶
Барьерная цена:	
Барьерный ориентир:	
Контрольная дата (даты):	
Контрольное время:] ⁷	
(б) Порядок осуществления Права на исполнение:	
[Дата начала срока:] ⁸	
[Дата (Даты) осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону:] ⁹	
[Время закрытия:	[●] ч. [●] мин. по московскому времени]
Дата истечения срока:	
Частичное исполнение:	[Применимо][Не применимо] ¹⁰
Многократное исполнение:	[Применимо][Не применимо] ¹¹
[Минимальное число:	
Максимальное число:	
Целый множитель:] ¹²	
Автоматическое исполнение:	[Применимо][Не применимо]
[Пороговая цена:]	
(в) Оценка:	
Время оценки:	[●] ч. [●] мин. по московскому времени ¹³
Дата оценки:	[Каждая] ¹⁴ Дата осуществления права на исполнение

⁵ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

⁶ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

⁷ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

⁸ Стороны должны указать данную информацию для Американского опциона. Если Дата начала срока не указана, то Датой начала срока является Дата сделки.

⁹ Стороны должны указать данную информацию для Бермудского опциона.

¹⁰ Исключить, если Сделка является Американским опционом или Бермудским опционом.

¹¹ Исключить, если Сделка является Европейским опционом.

¹² Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

¹³ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

¹⁴ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

- (г) Условия расчетов:
 Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки: Применимо
 Валюта платежа:
 Расчетная цена:
 Дата расчетов: [В отношении каждой Даты осуществления права на исполнение,]¹⁵
 [●] Рабочих дней после соответствующей Даты оценки
- [Условие об окончании срока в нерабочий день применительно к Дате расчетов:]
 [Сумма платежа:
 Дифференциал цены исполнения:]¹⁶
 [Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]
 Сторона, наделенная правом выбора: [Покупатель][Продавец]
 Дата выбора способа расчетов:
 Способ расчетов по умолчанию: Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки]¹⁷
- (д) Особые обстоятельства:
 (е) Делистинг: [Ликвидационный неттинг по соглашению сторон]
 [Расторжение с выплатой]
 (ж) [Изменение законодательства: [Применимо]]¹⁸
 (з) [Нарушение обязательства по поставке: [Применимо]]¹⁹
 (и) [Банкротство: [Применимо]]²⁰
 (к) [Иное событие, препятствующее исполнению:]

¹⁵ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

¹⁶ Стороны указывают, как будет определяться Сумма платежа и/или Дифференциал цены исполнения, если они намерены изменить пункты 8.1 и/или 8.2 Стандартных условий.

¹⁷ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов.

¹⁸ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

¹⁹ Условие о Нарушении обязательства по поставке может быть применимо, если стороны договорились о применении Выбора способа расчетов, поскольку в этом случае ими может быть выбран способ расчетов в порядке, установленном для Поставочной сделки.

²⁰ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

[Определяющая сторона:

[Покупатель][Продавец]
[Покупатель и Продавец]]

4. Расчетный агент: [●].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ПРИЛОЖЕНИЕ 2
к стандартным условиям срочных сделок с облигациями
2011

Форма Подтверждения
для Сделки поставочный опцион на облигации

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является Подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с облигациями 2001 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Стиль опциона:

[Американский/Бермудский/
Европейский]

Тип опциона:

[Опцион на продажу (пут) [●] /
Опцион на покупку (колл) [●]]

Продавец:

[Сторона А] [Сторона Б]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Облигации:

[*Полное наименование, категория (тип), и/или номинальная стоимость Облигаций, идентификационный номер выпуска или иные идентификационные признаки Облигаций*] [*полное фирменное наименование Эмитента Облигаций*]

Количество опционов:

[Предмет опциона:

[●] Облигация (-и/-й)
по одному Опциону]²¹

Цена исполнения:²²

Премия:

[●] [(Премия за Опцион [●])]²³

Дата уплаты премии:

Биржа:

[Клиринговая организация:]²⁴

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]²⁵

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

²¹ По умолчанию Предмет опциона составляет одна Облигация. Предмет опциона необходимо указывать только в случае, когда Предмет опциона составляет количество Облигаций, отличное от установленного по умолчанию.

²² Выражается как сумма денежных средств в соответствующей валюте или процент от номинальной стоимости Облигации.

²³ Если указана Премия за Опцион, то общая сумма Премии составляет произведение Премии за Опцион и Количества опционов.

²⁴ Включить, если расчеты по Сделке будут проводиться через Клиринговую организацию.

²⁵ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

- Контрольное время:]²⁶
- [Барьерное отменительное условие: [Применимо]²⁷
- Барьерная цена:
- Барьерный ориентир:
- Контрольная дата (даты):
- Контрольное время:]²⁸
- (б) Порядок осуществления Права на исполнение:
- [Дата начала срока:]²⁹
- [Дата (Даты) осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону:]³⁰
- Время закрытия: [●] ч. [●] мин.
по московскому времени
- Дата истечения срока:
- Частичное исполнение: [Применимо][Не применимо]³¹
- Многократное исполнение: [Применимо][Не применимо]³²
- [Минимальное число:
- Максимальное число:
- Целый множитель:]³³
- Автоматическое исполнение: [Применимо][Не применимо]
- [Пороговая цена:]
- (в) Условия расчетов:
- Расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки Применимо
- Валюта платежа:
- [Поставка облигаций частями:] [Применимо][Не применимо]
- [Клиринговая организация:]
- [Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]

²⁶ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

²⁷ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

²⁸ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

²⁹ Стороны должны указать данную информацию для Американского опциона. Если Дата начала срока не указана, то Датой начала срока является Дата сделки.

³⁰ Стороны должны указать данную информацию для Бермудского опциона.

³¹ Исключить, если Сделка является Американским опционом или Бермудским опционом.

³² Исключить, если Сделка является Европейским опционом.

³³ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

Сторона, наделенная правом выбора:	[Покупатель][Продавец]
Дата выбора способа расчетов:	
Способ расчетов по умолчанию:	Расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки] ³⁴
(г) Особые обстоятельства:	
(д) Делистинг:	[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой]
(е) [Изменение законодательства:	[Применимо]] ³⁵
(ж) [Нарушение обязательства по поставке:	[Применимо]] ³⁶
(з) [Банкротство:	[Применимо]] ³⁷
(и) [Иное событие, препятствующее исполнению:]	
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]

4. Расчетный агент: [●].

[5.] Реквизиты для платежей и поставок:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для поставки Облигаций в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Реквизиты для поставки Облигаций в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату, указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

³⁴ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов.

³⁵ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

³⁶ Включить, если условие о Нарушении обязательства по поставке применимо.

³⁷ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

ПРИЛОЖЕНИЕ 3
к стандартным условиям срочных сделок с облигациями
2011

Форма Подтверждения
для Сделки беспоставочный опцион на корзину облигаций

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является Подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с облигациями 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Стиль опциона:

[Американский/Бермудский/
Европейский]

Тип опциона:

[Опцион на продажу (пут) [●] /
Опцион на покупку (колл) [●]]

Продавец:

[Сторона А] [Сторона Б]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Корзина:

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

Количество опционов:

[Предмет опциона:

[●] Корзина (-н/-ы)
по одному Опциону]³⁸

Цена исполнения:³⁹

Премия:

[●] [(Премия за Опцион [●])]⁴⁰

Дата уплаты премии:

[Условие об окончании срока
в нерабочий день применительно
к Дате уплаты премии:]

Биржа (Биржи):

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]⁴¹

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]⁴²

³⁸ По умолчанию Предмет опциона составляет одна Корзина. Предмет опциона необходимо указывать только в случае, когда Предмет опциона составляет количество Корзин, отличное от установленного по умолчанию.

³⁹ Выражается как стоимость одной Корзины. Стороны могут указать сумму или формулу, по которой рассчитывается Цена исполнения.

⁴⁰ Если указана Премия за Опцион, то общая сумма Премии составляет произведение Премии за Опцион и Количества опционов.

⁴¹ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

⁴² Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

- [Барьерное отменительное условие: [Применимо]⁴³
 Барьерная цена:
 Барьерный ориентир:
 Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]⁴⁴
- (б) Порядок осуществления Права на исполнение:
 [Дата начала срока:]⁴⁵
 [Дата (Даты) осуществления права
 на исполнение по Бермудскому опциону:]⁴⁶
 Время закрытия: [●] ч. [●] мин.
 по московскому времени
- Дата истечения срока:
 Частичное исполнение: [Применимо][Не применимо]⁴⁷
 Многократное исполнение: [Применимо][Не применимо]⁴⁸
 [Минимальное число:
 Максимальное число:
 Целый множитель:]⁴⁹
 Автоматическое исполнение: [Применимо][Не применимо]
 [Пороговая цена:]
- (в) Оценка:
 Время оценки: [●] ч. [●] мин.
 по московскому времени⁵⁰
 Дата оценки: [Каждая]⁵¹ Дата осуществления
 права на исполнение
- (г) Условия расчетов:
 Расчеты в порядке, установленном
 для Беспоставочной сделки: Применимо

⁴³ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

⁴⁴ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

⁴⁵ Стороны должны указать данную информацию для Американского опциона. Если Дата начала срока не указана, то Датой начала срока является Дата сделки.

⁴⁶ Стороны должны указать данную информацию для Бермудского опциона.

⁴⁷ Исключить, если Сделка является Американским опционом или Бермудским опционом.

⁴⁸ Исключить, если Сделка является Европейским опционом.

⁴⁹ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

⁵⁰ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

⁵¹ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

Валюта платежа:	
Расчетная цена:	
Дата расчетов:	[В отношении каждой Даты осуществления права на исполнение,] ⁵² [●] Рабочих дней после соответствующей Даты оценки
[Условие об окончании срока в нерабочий день применительно к Дате расчетов:]	
[Сумма платежа:	
Дифференциал цены исполнения:] ⁵³	
[Выбор способа расчетов:	[Применимо][Не применимо]
Сторона, наделенная правом выбора:	[Покупатель][Продавец]
Дата выбора способа расчетов:	
Способ расчетов по умолчанию:	Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки] ⁵⁴
(д) Особые обстоятельства:	
(е) Делистинг:	[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой] [Частичное расторжение с выплатой]
(ж) [Изменение законодательства:	[Применимо]] ⁵⁵
(з) [Нарушение обязательства по поставке:	[Применимо]] ⁵⁶
(и) [Банкротство:	[Применимо]] ⁵⁷
(к) [Иное событие, препятствующее исполнению:]	
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]]

⁵² Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

⁵³ Стороны указывают, как будет определяться Сумма платежа и/или Дифференциал цены исполнения, если они намерены изменить пункты 8.1 и/или 8.2 Стандартных условий.

⁵⁴ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов.

⁵⁵ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

⁵⁶ Условие о Нарушении обязательства по поставке может быть применимо, если стороны договорились о применении Выбора способа расчетов, поскольку в этом случае ими может быть выбран способ расчетов в порядке, установленном для Поставочной сделки.

⁵⁷ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

4. Расчетный агент: [●].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ДОПОЛНЕНИЕ 1

Облигации, входящие в Корзину

Корзина состоит из следующих Облигаций каждого из Эмитентов, перечисленных ниже, в пропорции и количестве, указанном для каждого Эмитента.

<i>Эмитент</i>	<i>Идентификационный номер выпуска</i>	<i>Категория (тип) Облигаций</i>	<i>Количество Облигаций в Корзине</i>	<i>Биржа</i>	<i>Клиринговая организация⁵⁸</i>

⁵⁸ Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов и стороны договорились о расчетах через Клиринговую организацию.

ПРИЛОЖЕНИЕ 4
к стандартным условиям срочных сделок с облигациями
2011

Форма Подтверждения
для Сделки поставочный опцион на корзину облигаций

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является Подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с облигациями 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:	
Стиль опциона:	[Американский/Бермудский/ Европейский]
Тип опциона:	[Опцион на продажу (пут) [●] / Опцион на покупку (колл) [●]]
Продавец:	[Сторона А] [Сторона Б]
Покупатель:	[Сторона А] [Сторона Б]
Корзина:	Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению
Количество корзин:	
Количество опционов:	
[Предмет опциона:	[●] Корзина (-н/-ы) по одному Опциону] ⁵⁹
Цена исполнения: ⁶⁰	
Премия:	[●] [(Премия за Опцион [●])] ⁶¹
Дата уплаты премии:	
[Условие об окончании срока в нерабочий день применительно к Дате уплаты премии:]	
Биржа (Биржи):	
[Клиринговая организация (организации):	Как указано в дополнении 1 к настоящему Подтверждению] ⁶²
[Барьерное отлагательное условие:]	[Применимо] ⁶³
Барьерная цена:	
Барьерный ориентир:	

⁵⁹ По умолчанию Предмет опциона составляет одну Корзину. Предмет опциона необходимо указывать только в случае, когда Предмет опциона составляет количество Корзин, отличное от установленного по умолчанию.

⁶⁰ Выражается как стоимость одной Корзины. Стороны могут указать сумму или формулу, по которой рассчитывается Цена исполнения.

⁶¹ Если указана Премия за Опцион, то общая сумма Премии составляет произведение Премии за Опцион и Количества опционов.

⁶² Включить, если расчеты по Сделке будут проводиться через Клиринговую организацию.

⁶³ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

- Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]⁶⁴
 [Барьерное отменительное условие: [Применимо]⁶⁵
 Барьерная цена:
 Барьерный ориентир:
 Контрольная дата (даты):
 Контрольное время:]⁶⁶
- (б) Порядок осуществления Права на исполнение:
 [Дата начала срока:]⁶⁷
 [Дата (Даты) осуществления права
 на исполнение по Бермудскому опциону:]⁶⁸
 [Время закрытия: [●] ч. [●] мин.
 по московскому времени]
- Дата истечения срока:
 Частичное исполнение: [Применимо][Не применимо]⁶⁹
 Многократное исполнение: [Применимо][Не применимо]⁷⁰
 [Минимальное число:
 Максимальное число:
 Целый множитель:]⁷¹
 Автоматическое исполнение: [Применимо][Не применимо]
 [Пороговая цена:]
- (в) Условия расчетов:
 Расчеты в порядке, установленном
 для Поставочной сделки: Применимо
 Валюта платежа:

⁶⁴ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

⁶⁵ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

⁶⁶ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

⁶⁷ Стороны должны указать данную информацию для Американского опциона. Если Дата начала срока не указана, то Датой начала срока является Дата сделки.

⁶⁸ Стороны должны указать данную информацию для Бермудского опциона.

⁶⁹ Исключить, если Сделка является Американским опционом или Бермудским опционом.

⁷⁰ Исключить, если Сделка является Европейским опционом.

⁷¹ Стороны должны указать данную информацию для Сделок опцион с Многократным исполнением.

Расчетная цена:	
[Поставка облигаций по частям:]	[Применимо][Не применимо]
[Сумма платежа:	
Дифференциал цены исполнения:] ⁷²	
[Выбор способа расчетов:	[Применимо][Не применимо]
Сторона, наделенная правом выбора:	[Покупатель][Продавец]
Дата выбора способа расчетов:	
Способ расчетов по умолчанию:	Расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки] ⁷³
(г) Особые обстоятельства:	
(д) Делистинг:	[Ликвидационный неттинг по соглашению сторон] [Расторжение с выплатой] [Частичное расторжение с выплатой]
(е) [Изменение законодательства:	[Применимо]] ⁷⁴
(ж) [Нарушение обязательства по поставке:	[Применимо]] ⁷⁵
(з) [Банкротство:	[Применимо]] ⁷⁶
(и) [Иное событие, препятствующее исполнению:]	
[Определяющая сторона:	[Покупатель][Продавец] [Покупатель и Продавец]

4. Расчетный агент: [●].

[5.] Реквизиты для платежей и поставок:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для поставки Облигаций в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Реквизиты для поставки Облигаций в пользу Стороны Б:

⁷² Стороны указывают, как будет определяться Сумма платежа и/или Дифференциал цены исполнения, если они намерены изменить пункты 8.1 и/или 8.2 Стандартных условий.

⁷³ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов.

⁷⁴ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

⁷⁵ Включить, если условие о Нарушении обязательства по поставке применимо.

⁷⁶ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ДОПОЛНЕНИЕ 1

Облигации, входящие в Корзину

Корзина состоит из следующих Облигаций каждого из Эмитентов, перечисленных ниже, в пропорции и количестве, указанном для каждого Эмитента.

<i>Эмитент</i>	<i>Идентификационный номер выпуска</i>	<i>Категория (тип) Облигаций</i>	<i>Количество Облигаций в Корзине</i>	<i>Биржа</i>	<i>Клиринговая организация⁷⁷</i>

⁷⁷ Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов и стороны договорились о расчетах через Клиринговую организацию.

ПРИЛОЖЕНИЕ 5
к стандартным условиям срочных сделок с облигациями
2011

Форма Подтверждения
для Сделки беспоставочный форвард на облигации

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является Подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с облигациями 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Продавец:

[Сторона А] [Сторона Б]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Облигации:

[Полное наименование, категория (тип), и/или номинальная стоимость Облигаций, идентификационный номер выпуска или иные идентификационные признаки Облигаций] [полное фирменное наименование Эмитента Облигаций]

Количество облигаций:

Форвардная цена:⁷⁸

Биржа:

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]⁷⁹

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:⁸⁰

Барьерное отменительное условие:

[Применимо]⁸¹

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:⁸²

⁷⁸ Выражается как цена за одну Облигацию. Стороны могут указать сумму или формулу, по которой рассчитывается Форвардная цена.

⁷⁹ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

⁸⁰ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

⁸¹ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

⁸² Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

- (б) Оценка:
 Время оценки: [●] ч. [●] мин.
 по московскому времени⁸³
 Дата оценки:
- (в) Условия расчетов:
 Расчеты в порядке, установленном
 для Беспоставочной сделки: Применимо
 Валюта платежа:
 Расчетная цена:
 Дата расчетов [●] Рабочих дней после
 соответствующей Даты оценки
- [Условие об окончании срока
 в нерабочий день
 применительно к Дате расчетов:]
 [Сумма платежа:]⁸⁴
 [Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]
 Сторона, наделенная правом выбора: [Покупатель][Продавец]
 Дата выбора способа расчетов:
 Способ расчетов по умолчанию: Расчеты в порядке,
 установленном
 для Беспоставочной сделки]⁸⁵
- (г) Особые обстоятельства:
- (д) Делистинг: [Ликвидационный неттинг
 по соглашению сторон]
 [Расторжение с выплатой]
- (е) [Изменение законодательства: [Применимо]]⁸⁶
- (ж) [Нарушение обязательства по поставке: [Применимо]]⁸⁷
- (з) [Банкротство: [Применимо]]⁸⁸

⁸³ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

⁸⁴ Стороны должны указать, как будет определяться Сумма платежа, если они намерены изменить правило пункта 8.1 Стан-дартных условий.

⁸⁵ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов.

⁸⁶ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

⁸⁷ Условие о Нарушении обязательства по поставке может быть применимо, если стороны договорились о применении Выбора способа расчетов, поскольку в этом случае ими может быть выбран способ расчетов в порядке, установленном для Поставочной сделки.

⁸⁸ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

(и) [Иное событие, препятствующее исполнению:]

[Определяющая сторона:

[Покупатель][Продавец]

[Покупатель и Продавец]]

4. Расчетный агент: [●].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ПРИЛОЖЕНИЕ 6
к стандартным условиям срочных сделок с облигациями
2011

Форма Подтверждения
для Сделки поставочный форвард на облигации

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является Подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с облигациями 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Продавец:

[Сторона А] [Сторона Б]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Облигации:

[Полное наименование, категория (тип), и/или номинальная стоимость Облигаций, идентификационный номер выпуска или иные идентификационные признаки Облигаций] [полное фирменное наименование Эмитента Облигаций]

Количество облигаций:

Форвардная цена:⁸⁹

Биржа:

[Клиринговая организация:]⁹⁰

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]⁹¹

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]⁹²

[Барьерное отменительное условие:

[Применимо]⁹³

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]⁹⁴

⁸⁹ Выражается как цена за одну Облигацию. Стороны могут указать сумму или формулу, по которой рассчитывается Форвардная цена.

⁹⁰ Включить, если расчеты по Сделке будут проводиться через Клиринговую организацию.

⁹¹ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

⁹² Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

⁹³ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

⁹⁴ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

- (б) [Оценка:
 Время оценки: [●] ч. [●] мин.
 по московскому времени⁹⁵
 Дата оценки:
- (в) Условия расчетов:
 Расчеты в порядке, установленном
 для Поставочной сделки: Применимо
 Валюта платежа:
 Расчетная цена:
 Дата расчетов:
 [Условие об окончании срока
 в нерабочий день применительно
 к Дате расчетов:]
 [Поставка облигаций частями:] [Применимо][Не применимо]
 [Сумма платежа:]⁹⁶
 [Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]
 Сторона, наделенная правом выбора: [Покупатель][Продавец]
 Дата выбора способа расчетов:
 Способ расчетов по умолчанию: Расчеты в порядке,
 установленном
 для Поставочной сделки]⁹⁷
- (г) Особые обстоятельства:
- (д) Делистинг: [Ликвидационный неттинг
 по соглашению сторон]
 [Расторжение с выплатой]
- (е) [Изменение законодательства: [Применимо]]⁹⁸
- (ж) [Нарушение обязательства по поставке: [Применимо]]⁹⁹

⁹⁵ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в соот-ветствующую Дату оценки.

⁹⁶ Стороны должны указать, как будет определяться Сумма платежа, если они намерены изменить правило пункта 8.1 Стандартных условий.

⁹⁷ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов. Если Способ расчетов по умолчанию не указан, Способом расчетов по умолчанию являются расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки.

⁹⁸ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

⁹⁹ Включить, если условие о Нарушении обязательства по поставке применимо.

- (з) [Банкротство: [Применимо]]¹⁰⁰
(и) [Иное событие, препятствующее исполнению:]
[Определяющая сторона: [Покупатель][Продавец]
[Покупатель и Продавец]]

4. Расчетный агент: [●].

[5.] Реквизиты для платежей и поставок:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для поставки Облигаций в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Реквизиты для поставки Облигаций в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

¹⁰⁰ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

ПРИЛОЖЕНИЕ 7
к стандартным условиям срочных сделок с облигациями
2011

Форма Подтверждения
для Сделки беспоставочный форвард на корзину облигаций

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является Подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с облигациями 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Продавец:

[Сторона А] [Сторона Б]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Корзина:

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

Количество корзин:

Форвардная цена:¹⁰¹

Биржа (Биржи):

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]¹⁰²

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]¹⁰³

[Барьерное отменительное условие:

[Применимо]¹⁰⁴

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]¹⁰⁵

(б) Оценка:

Время оценки:

[●] ч. [●] мин.
по московскому времени¹⁰⁶

Дата оценки:

¹⁰¹ Выражается как стоимость одной Корзины. Стороны могут указать сумму или формулу, по которой рассчитывается Форвардная цена.

¹⁰² Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

¹⁰³ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

¹⁰⁴ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

¹⁰⁵ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

¹⁰⁶ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки.

- (в) Условия расчетов:
- Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки: Применимо
- Валюта платежа:
- Расчетная цена:
- Дата расчетов: [●] Рабочих дней после соответствующей Даты оценки
- [Условие об окончании срока в нерабочий день применительно к Дате расчетов:]
- [Сумма платежа:]¹⁰⁷
- [Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]
- Определяющая сторона [Покупатель][Продавец]
[Покупатель и Продавец]¹⁰⁸
- Сторона, наделенная правом выбора: [Покупатель][Продавец]
- Дата выбора способа расчетов:
- Способ расчетов по умолчанию: Расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки]¹⁰⁹
- (г) Особые обстоятельства:
- (д) Делистинг: [Ликвидационный неттинг по соглашению сторон]
[Расторжение с выплатой]
[Частичное расторжение с выплатой]
- (е) [Изменение законодательства: [Применимо]]¹¹⁰
- (ж) [Нарушение обязательства по поставке: [Применимо]]¹¹¹
- (з) [Банкротство: [Применимо]]¹¹²

¹⁰⁷ Стороны должны указать, как будет определяться Сумма платежа, если они намерены изменить правило пункта 8.1 Стандартных условий.

¹⁰⁸ Включить, если в качестве последствия Поглощения указано Расторжение с выплатой, Корректировка расчетным агентом, Расширенная корректировка расчетным агентом или Частичное расторжение с выплатой.

¹⁰⁹ Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов. Если Способ расчетов по умолчанию не указан, Способом расчетов по умолчанию являются расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки.

¹¹⁰ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

¹¹¹ Условие о Нарушении обязательства по поставке может быть применимо, если стороны договорились о применении Выбора способа расчетов, поскольку в этом случае ими может быть выбран способ расчетов в порядке, установленном для Поставочной сделки.

¹¹² Включить, если условие о Банкротстве применимо.

(и) [Иное событие, препятствующее исполнению:]

[Определяющая сторона:

[Покупатель][Продавец]

[Покупатель и Продавец]]

4. Расчетный агент: [●].

[5.] Реквизиты для платежей:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ДОПОЛНЕНИЕ 1

Облигации, входящие в Корзину

Корзина состоит из следующих Облигаций каждого из Эмитентов, перечисленных ниже, в пропорции и количестве, указанном для каждого Эмитента.

<i>Эмитент</i>	<i>Идентификационный номер выпуска</i>	<i>Категория (тип) Облигаций</i>	<i>Количество Облигаций в Корзине</i>	<i>Биржа</i>	<i>Клиринговая организация¹¹³</i>

¹¹³ Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов и стороны договорились о расчетах через Клиринговую организацию.

ПРИЛОЖЕНИЕ 8
к стандартным условиям срочных сделок с облигациями
2011

Форма Подтверждения
для Сделки поставочный форвард на корзину облигаций

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является Подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — *«Сторона А»*) и [●] (далее — *«Сторона Б»*) от [●] (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с облигациями 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Продавец:

[Сторона А] [Сторона Б]

Покупатель:

[Сторона А] [Сторона Б]

Корзина:

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

Количество корзин:

Форвардная цена:¹¹⁴

Биржа (Биржи):

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению

[Клиринговая организация (организации):

Как указано в дополнении 1
к настоящему Подтверждению]¹¹⁵

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]¹¹⁶

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]¹¹⁷

[Барьерное отменительное условие:

[Применимо]¹¹⁸

Барьерная цена:

Барьерный ориентир:

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]¹¹⁹

(б) [Оценка:

Время оценки:

[●] ч. [●] мин.

по московскому времени¹²⁰

¹¹⁴ Выражается как стоимость одной Корзины. Стороны могут указать сумму или формулу, по которой рассчитывается Форвардная цена.

¹¹⁵ Включить, если расчеты по Сделке будут проводиться через Клиринговую организацию.

¹¹⁶ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

¹¹⁷ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

¹¹⁸ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

¹¹⁹ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

¹²⁰ Если Время оценки не указано, Временем оценки будет Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в соот-ветствующую Дату оценки.

- Дата оценки:
- (в) Условия расчетов:
- Расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки: Применимо
- Валюта платежа:
- Расчетная цена:
- Дата расчетов:
- [Условие об окончании срока в нерабочий день применительно к Дате расчетов:]
- [Поставка облигаций частями:] [Применимо][Не применимо]
- [Сумма платежа:]¹²¹
- [Выбор способа расчетов: [Применимо][Не применимо]
- Сторона, наделенная правом выбора: [Покупатель][Продавец]
- Дата выбора способа расчетов:
- Способ расчетов по умолчанию: Расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки]¹²²
- (г) Особые обстоятельства:
- (д) Делистинг: [Ликвидационный неттинг по соглашению сторон]
[Расторжение с выплатой]
[Частичное расторжение с выплатой]
- (е) [Изменение законодательства: [Применимо]]¹²³
- (ж) [Нарушение обязательства по поставке: [Применимо]]¹²⁴
- (з) [Банкротство: [Применимо]]¹²⁵
- (и) [Иное событие, препятствующее исполнению:]
- [Определяющая сторона: [Покупатель][Продавец]
[Покупатель и Продавец]]

¹²¹ Стороны должны указать, как будет определяться Сумма платежа, если они намерены изменить правило пункта 8.1 Стандартных условий.

¹²² Если применимо условие о Выборе способа расчетов, стороны должны указать один из двух способов расчетов: расчеты в порядке, установленном для Беспоставочной сделки, или расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки, а также сторону, наделенную правом такого выбора, Способ расчетов по умолчанию и Дату выбора способа расчетов. Если Способ расчетов по умолчанию не указан, Способом расчетов по умолчанию являются расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки.

¹²³ Включить, если условие об Изменении законодательства применимо.

¹²⁴ Включить, если условие о Нарушении обязательства по поставке применимо.

¹²⁵ Включить, если условие о Банкротстве применимо.

4. Расчетный агент: [●].

[5.] Реквизиты для платежей и поставок:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Реквизиты для поставки Облигаций в пользу Стороны А:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Реквизиты для поставки Облигаций в пользу Стороны Б:

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ДОПОЛНЕНИЕ 1

Облигации, входящие в Корзину

Корзина состоит из следующих Облигаций каждого из Эмитентов, перечисленных ниже, в пропорции и количестве, указанном для каждого Эмитента.

<i>Эмитент</i>	<i>Идентификационный номер выпуска</i>	<i>Категория (тип) Облигаций</i>	<i>Количество Облигаций в Корзине</i>	<i>Биржа</i>	<i>Клиринговая организация¹²⁶</i>

¹²⁶ Указывается, если применимо условие о Выборе способа расчетов и стороны договорились о расчетах через Клиринговую организацию.

ПРИЛОЖЕНИЕ 9
к стандартным условиям срочных сделок с облигациями
2011

Форма Требования об исполнении по Сделке опцион

[На бланке Покупателя]

[Дата]

[Наименование и адрес Продавца]

Кас.: Требование об исполнении [наименование Сделки опцион]

Уважаемые господа!

Мы ссылаемся на Сделку опцион, заключенную между нами [дата], [регистрационный номер Сделки] (далее — «Сделка»), на основании Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] и [●] от [●].

Настоящее Требование об исполнении направляется вам в порядке и в целях осуществления нами Права на исполнение по Сделке в соответствии с пунктом 3.2 Стандартных условий срочных сделок с облигациями 2011 г. (далее — «Стандартные условия»), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков и применяемых в соответствии с Подтверждением по Сделке.

Все термины, использованные в настоящем Требовании об исполнении с заглавной буквы, имеют значение, определенное в Стандартных условиях.

С уважением,

[Покупатель]

Ф. И. О.:

Должность:

АЛФАВИТНО-ПРЕДМЕТНЫЙ УКАЗАТЕЛЬ

Термин	Пункт
Американский опцион	2.2(a)
Базовый актив	1.1
Банкротство	10.5
Барьерная цена	5.2
Барьерное отлагательное условие	5.1(a)
Барьерное отменительное условие	5.1(б)
Барьерный ориентир	5.3
Бермудский опцион	2.2(б)
Беспоставочная сделка	1.2
Биржа	1.3
Биржевая цена	1.4
Валюта платежа	1.5
Внеплановое закрытие	6.3(в)
Время закрытия	3.1(a)
Время закрытия торгов	1.6
Время оценки	6.1
Выбор способа расчетов	7.1(a)
Генеральное соглашение	1.7
Дата выбора способа расчетов	7.1(в)
Дата истечения срока	3.1(б)
Дата калькуляции	1.8
Дата начала срока	2.1(a)
Дата объявления	10.2(a)
Дата осуществления права на исполнение	3.1(в)
Дата оценки	6.2
Дата расчетов	7.4
Дата сделки	1.9
Дата уплаты премии	2.4(a)
Делистинг	10.2
Дифференциал цены исполнения	8.2
Европейский опцион	2.2(в)
Затронутые облигации	10.2(б)(В)(aa)
Изменение законодательства	10.3

Клиринговая организация	1.10
Количество корзин	1.12
Количество облигаций	1.11
Количество опционов	2.1(б)
Контрольная дата	5.4
Контрольное время	5.5
Корзина	1.13
Ликвидационный неттинг по соглашению сторон	10.2(б)(А)
Максимальное число	3.4(а)
Минимальное число	3.4(а)
Многократное исполнение	3.4(а)
Нарушение обязательства по поставке	10.4
Облигации	1.14
Определяющая сторона	10.7(б)
Опцион	2.1(в)
Опцион на покупку (колл)	2.3(а)
Опцион на продажу (пут)	2.3(б)
Особое обстоятельство	10.1
Первоначальная дата оценки	6.4
Плановый торговый день	1.15
Подтверждение	1.16
Покупатель	1.17
Получатель	10.6(в)(аа)
Пороговая цена	3.5(в)
Поставка облигаций частями	9.3
Поставочная сделка	1.18
Поставщик	10.6(в)
Право на исполнение	1.25
Предмет опциона	2.1(г)
Предшествующий рабочий день	1.33(б)
Премия	2.4(а)
Примерные условия договора	1.19
Продавец	1.20
Рабочий день	1.21
Рабочий день в отчетном периоде	1.33(в)
Расторжение с выплатой	10.2(б)(Б)
Расчетная цена	7.2
Расчетный агент	1.22
Расчетный цикл	1.23
Сбой в проведении торгов	6.3(а)

Сбой в работе биржи	6.3(б)
Сделка	1.24
Сделка беспоставочный опцион	1.25(а)
Сделка беспоставочный опцион на корзину облигаций	1.25(а)(Б)
Сделка беспоставочный опцион на облигации	1.25(а)(А)
Сделка беспоставочный форвард	1.28(а)
Сделка беспоставочный форвард на корзину облигаций	1.28(а)(Б)
Сделка беспоставочный форвард на облигации	1.28(а)(А)
Сделка опцион	1.25
Сделка опцион на корзину облигаций	1.26
Сделка опцион на облигации	1.27
Сделка поставочный опцион	1.25(в)
Сделка поставочный опцион на корзину облигаций	1.25(в)
Сделка поставочный опцион на облигации	1.25(б)
Сделка поставочный форвард	1.28(в)
Сделка поставочный форвард на корзину облигаций	1.28(в)
Сделка поставочный форвард на облигации	1.28(б)
Сделка форвард	1.28
Сделка форвард на корзину облигаций	1.29
Сделка форвард на облигации	1.30
Следующий рабочий день	1.33(а)
Событие, препятствующее проведению расчетов	9.5(а)
Способ расчетов по умолчанию	7.1(б)
Срок осуществления права на исполнение	3.1(г)
Срочная сделка на корзину облигаций	1.31
Срочная сделка на облигации	1.32
Стандартные условия	Преамбула
Сумма выплаты при расторжении	10.7(а)
Сумма платежа	8.1
Требование об исполнении	3.1(д)
Условие об окончании срока в нерабочий день	1.33
Форвардная цена	4.1
Целый множитель	3.4(а)
Цена исполнения	2.1(д)
Частичное исполнение	3.3
Частичное расторжение с выплатой	10.2(б)(В)
Чрезвычайная ситуация	6.3
Эмитент	1.34

СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ
ДОГОВОРА О ПОРЯДКЕ УПЛАТЫ
ПЛАВАЮЩИХ МАРЖЕВЫХ СУММ
2011 г.

This 2011 Model Provisions of Agreement on Margin Transfers under Master Agreement for Derivative Transactions on Financial Markets is based, in part, on selected provisions of the 2001 ISDA Margin Provisions, © 2001 International Swaps and Derivatives Association, Inc., («ISDA®»), and is used with its permission. ISDA takes no position as to this Russian-version 2011 Model Provisions of Agreement on Margin Transfers under Master Agreement for Derivative Transactions on Financial Markets' suitability for use in any particular transaction. Prospective users should seek independent legal advice before using this instrument.

СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ ДОГОВОРА О ПОРЯДКЕ УПЛАТЫ ПЛАВАЮЩИХ МАРЖЕВЫХ СУММ 2011 г.

Настоящие стандартные условия договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм 2011 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков, устанавливают особенности исполнения и прекращения обязательств сторон (далее — «*Стороны*») по уплате Плавающих маржевых сумм (как они определены в Стандартных условиях).

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Термины, используемые в Стандартных условиях

- 1.1. Термины, используемые в Стандартных условиях с заглавной буквы, имеют значение, указанное в статье 9 Стандартных условий. Если какой-либо термин настоящих Стандартных условий употребляется в Договоре о порядке уплаты плавающих маржевых сумм (как он определен ниже) наряду с указанием одной стороны, он применяется исключительно к этой стороне.

Стандартные условия

- 1.2. Стандартные условия устанавливают общий порядок уплаты Сторонами Плавающих маржевых сумм.
- 1.3. Настоящие Стандартные условия применяются к Сделке, если они полностью или частично включены в Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм (как он определен ниже) по Сделке путем указания в нем о применении настоящих Стандартных условий полностью или в соответствующей части.

Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм

- 1.4. В целях регулирования отношений, возникающих в связи с уплатой Плавающих маржевых сумм, Стороны заключают договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм (далее — «*Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм*»). При этом Стороны могут использовать примерную форму Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, установленную в приложении 1 к Стандартным условиям .
- 1.5. Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением.

- 1.6. Для целей Генерального соглашения, в том числе пункта 1.6 статьи 1, пунктов 3.1–3.4 статьи 3, статей 5 и 6 Примерных условий договора, Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм является Сделкой, как она определена в Генеральном соглашении, а для целей пункта 2.7 статьи 2 Генерального соглашения экземпляр Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм представляет собой Подтверждение.
- 1.7. В Договоре о порядке уплаты плавающих маржевых сумм или условиях другой Сделки (применительно к этой Сделке) Стороны могут по своему усмотрению изменить положения Стандартных условий или договориться о неприменении их отдельных положений.

Преимущественная сила

- 1.8. В случае противоречия:
 - (а) между положениями Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм и Генерального соглашения Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм имеет преимущественную силу;
 - (б) между положениями Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм и положениями Стандартных условий Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм имеет преимущественную силу.

2. ПЛАВАЮЩИЕ МАРЖЕВЫЕ СУММЫ

- 2.1. Если пунктом 2.1 статьи 2 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не предусмотрено иное, Плавающая маржевая сумма, подлежащая уплате с учетом пунктов 2.2 и 2.3 ниже, на каждую Дату оценки составляет сумму, равную разности:
 - (а) Общей суммы маржевых обязательств и
 - (б) Накопленных маржевых сумм по состоянию на соответствующую Дату оценки (при этом в Накопленные маржевые суммы включаются Плавающие маржевые суммы, требование об уплате которых Получатель плавающих маржевых сумм предъявил ранее, и из Накопленных маржевых сумм исключаются Плавающие маржевые суммы, требование об уплате которых Плательщик плавающих маржевых сумм предъявил ранее, если какая-либо из этих сумм не была уплачена, и Дата платежа по обязательству об уплате такой суммы наступает в Дату оценки или после нее).
- 2.2. Если на Дату оценки Плавающая маржевая сумма, рассчитанная в соответствии с пунктом 2.1 настоящей статьи 2, составляет положительное число, равное Минимальной сумме платежа, установленной для Плательщика плавающих маржевых сумм, или превышающее такую Минимальную сумму платежа, Получатель плавающих маржевых сумм вправе в эту Дату оценки или незамедлительно после нее потребовать от Плательщика плавающих маржевых сумм уплаты Плавающей маржевой суммы (с учетом округления в соответствии с пунктом 2.5 статьи 2 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм). С учетом ста-

тей 3 и 4 Стандартных условий, Плательщик плавающих маржевых сумм обязан, получив такое требование от Получателя плавающих маржевых сумм, уплатить ему указанную сумму.

- 2.3. Если на Дату оценки Плавающая маржевая сумма, рассчитанная в соответствии с пунктом 2.1 настоящей статьи 2 составляет отрицательное число, абсолютная величина которого равна Минимальной сумме платежа, установленной для Получателя плавающих маржевых сумм, или превышает такую Минимальную сумму платежа, Плательщик плавающих маржевых сумм вправе в эту Дату оценки или незамедлительно после нее потребовать от Получателя плавающих маржевых сумм уплаты суммы в размере, не превышающем абсолютную величину Плавающей маржевой суммы (с учетом округления в соответствии с пунктом 2.5 статьи 2 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм 0). С учетом статей 3 и 4 Стандартных условий, Получатель плавающих маржевых сумм обязан, получив такое требование от Плательщика плавающих маржевых сумм, уплатить ему указанную сумму. Накопленные маржевые суммы уменьшаются на соответствующую сумму после осуществления такого платежа.
- 2.4. Требование, указанное в пунктах 2.2 и 2.3 настоящей статьи 2, может быть составлено по форме, предусмотренной в приложении 2 к Стандартным условиям.

3. ПЛАТЕЖИ И РАСЧЕТЫ (КАЛЬКУЛЯЦИЯ)

Платежи

- 3.1. Уплата Плавающих маржевых сумм в соответствии со статьями 2 Стандартных условий, а также уплата Процентов в соответствии со статьями 5 Стандартных условий осуществляются в валюте платежа, указанной в Договоре об уплате плавающих маржевых сумм, по реквизитам, указанным Стороной-получателем платежа.

С учетом статьи 4 Стандартных условий и в отсутствие соглашения Сторон об ином, если требование об уплате Плавающей маржевой суммы получено Стороной-плательщиком до наступления Времени уведомления, она обязана осуществить соответствующий платеж в Дату платежа, установленную применительно к такому требованию. Если указанное требование получено после наступления Времени уведомления, Сторона-плательщик осуществляет соответствующий платеж на следующий Рабочий день после Даты платежа.

Расчеты (калькуляция)

- 3.2. Расчет (калькуляция) Оценочной стоимости сделок для целей статьи 2 и пункта 4.1 статьи 4 Стандартных условий осуществляются Агентом по расчету плавающих маржевых сумм по состоянию на установленное Время оценки. Агент по расчету плавающих маржевых сумм обязан уведомить Стороны (или другую Сторону, если Агентом по расчету плавающих маржевых сумм является одна из Сторон) о произведенном им расчете (калькуляции) не позднее Времени уведомления на следующий Рабочий день после Даты оценки (или в случае, предусмотренном в пункте 4.1 статьи 4 Стандартных условий, — после Даты пересчета).

3.3. Стороны могут предусмотреть, что расчет (калькуляция) Общей суммы маржевых обязательств осуществляются в иностранной валюте. При этом Плавающая маржевая сумма уплачивается в указанной в Договоре об уплате плавающих маржевых сумм валюте платежа по курсу, согласованному Сторонами.

4. Порядок УРЕГУЛИРОВАНИЯ РАЗНОГЛАСИЙ

Разногласия по расчету (калькуляции) Плавающих маржевых сумм

4.1. Если какая-либо из Сторон (далее — «*Оспаривающая сторона*») обоснованно оспаривает расчет (калькуляцию) Плавающей маржевой суммы, произведенный Агентом по расчету плавающих маржевых сумм для целей статьи 2 Стандартных условий, то:

(а) Оспаривающая сторона обязана уведомить об этом другую Сторону и Агента по расчету плавающих маржевых сумм (если эта другая Сторона не является Агентом по расчету плавающих маржевых сумм) не позднее окончания рабочего времени следующего Рабочего дня после дня, когда получено соответствующее требование об уплате Плавающей маржевой суммы в соответствии со статьей 2 Стандартных условий;

(б) при этом Сторона-платательщик обязана перевести сумму в неоспариваемом размере другой Стороне не позднее окончания рабочего времени в Дату платежа, следующую за днем, когда получено требование об уплате Плавающей маржевой суммы в соответствии со статьей 2 Стандартных условий;

(в) Стороны обязаны предпринять попытку урегулировать возникшие разногласия путем переговоров;

(г) если разногласия не будут устранены до истечения Срока урегулирования разногласий, то, если пунктом 2.2 статьи 20 не предусмотрено иное, Агент по расчету плавающих маржевых сумм обязан пересчитать Оценочную стоимость сделок по состоянию на Дату пересчета следующим образом:

(А) использовать для целей пересчета любые расчеты той части Оценочной стоимости сделок, в отношении которой у Сторон отсутствуют разногласия;

(Б) применительно к той части Оценочной стоимости сделок, в отношении которой у Сторон имеются разногласия, запросить у третьих лиц четыре текущие котировки, содержащие среднее значение между ценой спроса и ценой предложения, используемые для расчета Ликвидационной суммы, и рассчитать среднее арифметическое значение указанных котировок;

при этом если применительно к Сделке будет получено менее четырех котировок, то полученные в меньшем количестве котировки также могут быть использованы для расчетов;

если применительно к Сделке не получено ни одной котировки, используется первоначальный расчет Агента по расчету плавающих маржевых сумм.

Агент по расчету плавающих маржевых сумм обязан уведомить Стороны (или другую Сторону, если Агентом по расчету плавающих маржевых сумм является одна из Сторон) о результатах пересчета, произведенного в соответствии с настоящим пунктом 4.1, в возможно короткий срок после его завершения, но не позднее Времени уведомления на следующий Рабочий день после истечения Срока урегулирования разногласий.

После уведомления Агента по расчету плавающих маржевых сумм о результатах пересчета или достижения соглашения об урегулировании разногласий в соответствии с подпунктом (в) настоящего пункта 4.1, Сторона, с которой причитается платеж, обязана по получении соответствующего требования от другой Стороны произвести такой платеж (с учетом пункта 3.1 статьи 3 Стандартных условий).

События, не являющиеся Нарушением обязательства

- 4.2. Просрочка Стороной платежа какой-либо суммы, которая является предметом разногласий, разрешаемых в порядке, установленном пунктом 4.1 настоящей статьи 4, не является Нарушением обязательства в течение периода времени, когда осуществляются процедуры урегулирования разногласий, установленные в настоящей статье 4.

После завершения процедур урегулирования разногласий, подпункт (а) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора применяется к обязательству Стороны осуществить платеж в соответствии с абзацем одиннадцатым пункта 4.1 настоящей статьи 4 в установленный срок, если этой Стороной допущена просрочка такого платежа.

5. Проценты на Накопленные маржевые суммы

Получатель плавающих маржевых сумм обязан перечислять Плательщику плавающих маржевых сумм в сроки, установленные пунктом 2.8(б) статьи 2 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, Проценты, начисленные на Накопленные маржевые суммы, при этом выплата Процентов не учитывается при расчете и не приводит к возникновению или увеличению Плавающих маржевых сумм, подлежащих уплате Плательщиком плавающих маржевых сумм. Сумма Процентов рассчитывается Агентом по расчету плавающих маржевых сумм, при этом дата такого расчета считается в этих целях Датой оценки.

6. Досрочное прекращение обязательств по Сделкам

В случае досрочного прекращения обязательств по Сделкам вследствие Нарушения обязательства, Банкротства или возникновения Иного основания досрочного прекращения (при котором досрочно прекращаются обязательства по всем Сделкам), Накопленные маржевые суммы по состоянию на соответствующую Дату досрочного прекращения включаются в Просроченные суммы, причитающиеся Плательщику плавающих маржевых сумм (который при этом может быть или может не быть Нарушившей стороной), для целей пункта 6.10 статьи 6 При-

мерных условий договора. При этом, учитывая, что Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм является Сделкой, Ликвидационная сумма применительно к Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не требует определения в соответствии с пунктом 6.9 статьи 6 Примерных условий договора и считается равной нулю.

7. ВОЗМЕЩЕНИЕ РАСХОДОВ

Расходы, связанные с исполнением обязательств в соответствии с Договором о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, несет Сторона, исполняющая соответствующее обязательство. Эти расходы не подлежат возмещению другой Стороной.

8. РАЗНОЕ

8.1. **Требования добросовестности и разумности.** При исполнении обязательств по Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, в том числе при осуществлении расчетов (калькуляций), оценки и определении сумм и значений, Стороны обязаны действовать добросовестно и разумно.

8.2. **Требования и уведомления.** Все требования и уведомления, направляемые Сторонами по Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, направляются в соответствии со статьей 10 Примерных условий договора, если Генеральным соглашением не предусмотрено иное.

9. ОПРЕДЕЛЕНИЯ ТЕРМИНОВ, ИСПОЛЪЗУЕМЫХ В СТАНДАРТНЫХ УСЛОВИЯХ

9.1. Термины, используемые в Стандартных условиях, имеют следующие значения.

Агент по расчету плавающих маржевых сумм имеет значение, указанное в пункте 2.6(а) статьи 20 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

Плавающая маржевая сумма означает сумму, указанную в пункте 2.1 статьи 2 Стандартных условий.

Время оценки имеет значение, указанное в пункте 2.6(в) статьи 20 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

Время уведомления имеет значение, указанное в пункте 2.6(г) статьи 20 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

Генеральное соглашение означает Генеральное соглашение в значении, определенном в Примерных условиях договора.

Дата оценки означает каждый день, указанный в этом качестве или иным образом определяемый в соответствии с пунктом 2.6(б) статьи 20 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

Дата пересчета означает Дату оценки, применительно к которой возникли разногласия, указанные в статье 4 Стандартных условий. При этом если следующая

Дата оценки наступает в соответствии со статьей 2 Стандартных условий до устранения разногласий, Датой пересчета будет последняя Дата оценки, наступившая в соответствии со статьей 2 Стандартных условий.

Дата платежа означает применительно к Дате оценки следующий Рабочий день.

Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм имеет значение, указанное в пункте 4.1.4 статьи 1 Стандартных условий.

Маржевая пороговая сумма означает применительно к Стороне сумму, указанную в этом качестве для этой Стороны в пункте 2.3 статьи 20 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, а при отсутствии такого указания — ноль.

Минимальная сумма платежа означает применительно к Стороне, сумму, указанную в этом качестве для этой Стороны в пункте 2.4 статьи 2 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, а при отсутствии такого указания — ноль.

Накопленные маржевые суммы означает в Дату оценки Плавающие маржевые суммы, в совокупности ранее уплаченные Получателю плавающих маржевых сумм в соответствии с Договором о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, за вычетом Плавающих маржевых сумм, уплаченных Получателем плавающих маржевых сумм в соответствии с пунктом 2.3 статьи 2 Стандартных условий. Проценты, начисленные, но не переведенные в соответствии со статьей 5 Стандартных условий добавляются к Накопленным маржевым суммам.

Общая сумма маржевых обязательств означает на Дату оценки, если пунктом 2.1 статьи 20 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не предусмотрено иное:

- (а) Оценочную стоимость сделок применительно к Получателю плавающих маржевых сумм и всех Первоначальных маржевых сумм, установленных для Плательщика плавающих маржевых сумм (при их наличии),
- (б) за вычетом всех Первоначальных маржевых сумм, установленных для Получателя плавающих маржевых сумм (при их наличии), и Маржевой пороговой суммы, установленной для Плательщика плавающих маржевых сумм.

При этом Общая сумма маржевых обязательств считается равной нулю, если результатом вышеуказанного расчета является отрицательное число.

Оспаривающая сторона имеет значение, указанное в абзаце первом пункта 4.1 статьи 4 Стандартных условий.

Оценочная стоимость сделок означает применительно к Стороне в Дату оценки (с учетом статьи 4 Стандартных условий при возникновении каких-либо разногласий) сумму, при ее наличии, которая подлежала бы уплате:

- (а) в пользу этой Стороны другой Стороной, если эта сумма выражена положительным числом (применительно к такой стороне Оценочная стоимость сделок считается имеющей положительное значение), или
- (б) этой Стороной в пользу другой Стороны, если эта сумма выражена отрицательным числом,

рассчитываемую на основе стоимости (цены) замещающих сделок, определяемой в соответствии с подпунктом (А) пункта 6.10(б) статьи 6 Примерных усло-

вий договора (без учета положений подпункта (В) указанного пункта 6.10(б)), если бы обязательства по всем Сделкам (за исключением Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм) подлежали досрочному прекращению по состоянию на соответствующее Время оценки.

При этом для целей расчета этой суммы:

- (а) указанная Сторона не являлась бы Затронутой стороной;
- (б) Ликвидационная сумма определялась бы Агентом по расчету плавающих маржевых сумм от имени указанной Стороны с использованием его оценок по среднему значению между ценой спроса и ценой предложения сумм, которые подлежали бы уплате по сделкам, предоставляющим экономический эквивалент существенных условий Сделок, включая платежи и поставки Сторон в соответствии с пунктом 3.1 статьи 3 Примерных условий договора по Сделкам, которые (если бы не досрочное прекращение обязательств по этим Сделкам) подлежали бы осуществлению после Даты досрочного прекращения (с учетом пунктов 3.3 и 3.4 статьи 3 Примерных условий договора).

Первоначальная маржевая сумма означает применительно к Стороне сумму, указанную для этой Стороны в пункте 2.2 статьи 2 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм0, а при отсутствии такого указания — ноль.

Плавающая маржевая сумма означает сумму, подлежащую уплате Стороной в соответствии со статьей 2 настоящего Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

Плательщик плавающих маржевых сумм означает по отношению к Получателю плавающих маржевых сумм другую Сторону.

Получатель плавающих маржевых сумм означает применительно к:

- (а) каждой Дате оценки Сторону, применительно к которой Оценочная стоимость сделок, рассчитанная в эту Дату оценки, имеет положительное значение;
- (б) Накопленным маржевым суммам Сторону, у которой в соответствии с Договором о порядке уплаты плавающих маржевых сумм существует обязательство по возврату другой Стороне указанных Накопленных маржевых сумм.

Примерные условия договора Примерные условия договора о срочных сделках на финансовых рынках 2011 г., разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков,.

Процентная ставка означает ставку, указанную в пункте 2.8(а) статьи 20 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

Процентный период означает период времени начиная с последнего Рабочего дня (исключая этот день), когда Проценты были переведены Плательщику плавающих маржевых сумм, или, если Проценты еще не переводились, с Рабочего

дня (исключая этот день), когда Плавающая маржевая сумма была получена Получателем плавающих маржевых сумм, по (включительно) Рабочий день, в который выплачиваются Проценты за этот период времени.

Проценты означает применительно к Процентному периоду сумму процентов, начисленных за каждый день в этом Процентном периоде на Накопленные маржевые суммы, и рассчитанных Агентом по расчету плавающих маржевых сумм на каждый такой день в следующем порядке:

- (а) Накопленные маржевые суммы по состоянию на этот день, умноженные на
- (б) Процентную ставку, действующую в этот день, и разделенные на
- (в) действительное число календарных дней в году (365 или 366 дней соответственно).

Рабочий день означает любой день, являющийся Рабочим днем в значении, определенном в Генеральном соглашении, если пунктом 2.10 статьи 20 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не предусмотрено иное.

Срок урегулирования разногласий имеет значение, указанное в пункте 2.7(а) статьи 20 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

- 9.2. Термины «Сделка», «Ликвидационная сумма», «Нарушение обязательства», «Банкротство», «Иное основание прекращения», «Просроченная сумма», «Нарушившая сторона», «Затронутая сторона», «Дата досрочного прекращения» имеют значение, указанное в Примерных условиях договора, если Генеральным соглашением не предусмотрено иное.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1
к Стандартным условиям договора о порядке уплаты
плавающих маржевых сумм

Примерная форма Договора
о порядке уплаты плавающих маржевых сумм

НАСТОЯЩИЙ ДОГОВОР О ПОРЯДКЕ УПЛАТЫ ПЛАВАЮЩИХ МАРЖЕВЫХ СУММ от «___» _____ (далее — *«Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм»*) заключен «___» _____ 20__ года

между

- [●] (далее — *«Сторона А»*), созданным и действующим в соответствии с законодательством Российской Федерации, с местонахождением по адресу: [●], Российская Федерация, в лице [президента/председателя правления/генерального директора] [●], действующего на основании [Устава], с одной стороны и
- [●] (далее — *«Сторона Б»*), созданным и действующим в соответствии с законодательством Российской Федерации, с местонахождением по адресу: [●], Российская Федерация, в лице [президента/председателя правления/генерального директора] [●], действующего на основании [Устава], с другой стороны,

далее совместно именуемыми *«Стороны»*, а по отдельности — *«Сторона»*.

Принимая во внимание, что

- (А) Стороны заключили Генеральное соглашение о срочных сделках на финансовых рынках от «___» _____ (далее — *«Генеральное соглашение»*);
- (Б) Стороны заключили и/или намереваются заключить Сделки, как они определены в Генеральном соглашении, в соответствии с Генеральным соглашением,

Стороны договорились о следующем.

1. ПРИМЕНЕНИЕ ПОЛОЖЕНИЙ СТАНДАРТНЫХ УСЛОВИЙ. ОПРЕДЕЛЕНИЕ ТЕРМИНОВ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ В ДОГОВОРЕ О ПОРЯДКЕ УПЛАТЫ ПЛАВАЮЩИХ МАРЖЕВЫХ СУММ
 - 1.1. К отношениям Сторон в связи с уплатой Плавающих маржевых сумм применяются положения Стандартных условий договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм 2011 г., утвержденные разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участ-

ников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее — «*Стандартные условия*»), с учетом изменений и дополнений, установленных в Договоре о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

- 1.2. Термины, используемые с заглавной буквы в Договоре о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, имеют значение, указанное в статье 9 Стандартных условий, если Договором о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не предусмотрено иное.
- 1.3. Для целей Генерального соглашения, в том числе для целей пункта 1.7 статьи 1, пункта 2.2 статьи 2, статьи 5 и статьи 6 Генерального соглашения, настоящий Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм представляет собой Сделку, а для целей пункта 2.7 статьи 2 Генерального соглашения настоящий экземпляр Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм представляет собой Подтверждение.

2. СПЕЦИАЛЬНЫЕ ДОГОВОРЕННОСТИ СТОРОН

2.1. *Плавающая маржевая сумма по Сделкам и Общая сумма маржевых обязательств.*

- (а) Плавающая маржевая сумма рассчитывается [в соответствии со статьей 2 Стандартных условий][в следующем порядке:

.....]¹;

- (б) Общая сумма маржевых обязательств рассчитывается [в соответствии со статьей 9 Стандартных условий][в следующем порядке:

.....]¹.

2.2. *Первоначальные маржевые суммы.*

- (а) «Первоначальная маржевая сумма» означает применительно к Стороне А:

.....

- (б) «Первоначальная маржевая сумма» означает применительно к Стороне Б:

.....

2.3. *Маржевая пороговая сумма.*

- (а) «Маржевая пороговая сумма» означает применительно к Стороне А:

.....

- (б) «Маржевая пороговая сумма» означает применительно к Стороне Б:

.....

¹ Ненужное исключить.

2.4. *Минимальная сумма платежа.*

«Минимальная сумма платежа» означает применительно к Стороне А:

.....

«Минимальная сумма платежа» означает применительно к Стороне Б:

.....

2.5. **Округление.** Плавающая маржевая сумма подлежит округлению [в сторону уменьшения до ближайшего целого числа, кратного или в сторону увеличения и в сторону уменьшения до ближайшего целого числа, кратного, соответственно]².

2.6. *Оценка и значения времени.*

(а) «Агент по расчету плавающих маржевых сумм» означает:

(А) для целей статей 2 и 4 Стандартных условий [Сторону, направляющую требование в соответствии со статьей 2 Стандартных условий]/[●]²;

(Б) для целей статьи 5 Стандартных условий [Получателя плавающих маржевых сумм]/[●]².

(б) «Дата оценки» означает

(в) «Время оценки» означает [●] часов по московскому времени

[] в Дату оценки или в день, когда осуществляются какие-либо расчеты (калькуляция);

[] в Рабочий день, непосредственно предшествующий Дате оценки или дню, когда осуществляются какие-либо расчеты (калькуляция).³

(г) «Время уведомления» означает [●] часов по московскому времени в любой Рабочий день/[●]².

2.7. *Порядок урегулирования разногласий.*

(а) «Срок урегулирования разногласий» означает [период времени, оканчивающийся в [●] часов по московскому времени в Рабочий день, следующий за днем, когда направлено уведомление о наличии разногласий в соответствии со статьей 4 Стандартных условий]/[●].

(б) **Альтернативный порядок урегулирования разногласий.** Статья 4 Стандартных условий [применяется.] [не применяется. Стороны договариваются о следующем порядке урегулирования разногласий по расчету (калькуляции) Плавающей маржевой суммы. [●].]⁴

² Ненужное исключить.

³ Отметить в соответствующем месте ([]) применимое положение.

⁴ Если альтернативный порядок урегулирования разногласий не предусмотрен, применяется Статья 4 Стандартных условий.

2.8. **Проценты.**

- (а) **Процентная ставка.** Процентная ставка составляет:
- (б) **Перевод Процентов.** Перевод Процентов осуществляется [в последний Рабочий день каждого календарного месяца, а также в Рабочий день, когда осуществляется платеж Плавающих маржевых сумм в соответствии с пунктом 2.3 статьи 2 Стандартных условий]/[●]⁵.
-

2.9. **Реквизиты для платежей.**

Для Стороны А:

.....

Для Стороны Б:

.....

2.10. **Прочие положения.**

.....

В ПОДТВЕРЖДЕНИЕ ВЫШЕИЗЛОЖЕННОГО Стороны подписали Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм в день, указанный в преамбуле Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

ПОДПИСАНО

Ф. И. О.:)
Должность:)
)
за и от имени)
[Наименование Стороны А])
[Печать])

)
)
)
Ф. И. О.:)
Должность:)
)
за и от имени)
[Наименование Стороны Б])
[Печать])

⁵ Ненужное исключить.

ПРИЛОЖЕНИЕ 2
к Стандартным условиям договора о порядке уплаты
плавающих маржевых сумм
по генеральному соглашению о срочных сделках на финансовых рынках

Примерная форма требования об уплате Плавающей маржевой суммы

[На бланке Получателя плавающих маржевых сумм/
Плательщика плавающих маржевых сумм⁶]

[Дата]

[Наименование и адрес Плательщика плавающих маржевых сумм/
Получателя плавающих маржевых сумм]⁶

Кас.: Уплаты Плавающей маржевой суммы

Уважаемые господа!

Мы ссылаемся на Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм от [●], заключенное между [●] и [●], от [●] (далее — *«Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм»*).

В соответствии с пунктами 2.1 и [2.2]/[2.3]⁶ статьи 2 Стандартных условий, настоящим просим уплатить Плавающую маржевую сумму, рассчитанную по состоянию на [●], в размере [●] по [реквизитам, указанным в пункте 2.9 статьи 20] [по следующим реквизитам [●]]⁶.

Все термины, использованные в настоящем с заглавной буквы, имеют значение, определенное в Договоре о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

С уважением,

[Наименование Стороны, направляющей требование]

Ф. И. О.:

Должность:

⁶ Ненужное исключить в зависимости от ситуации.