

Утверждено
Приказом Генерального директора
ООО «ИК ВЕЛЕС Капитал» № 02фл
от 14 января 2020 года

Спецификация внебиржевого поставочного опциона пут
на акции российских эмитентов

Москва, 2020

Спецификация

внебиржевого поставочного опциона пут на обыкновенные акции российских эмитентов

1. Настоящая Спецификация внебиржевого поставочного опциона пут определяет условия, на которых заключается и исполняется внебиржевой поставочный опцион пут в ходе исполнения Обществом с ограниченной ответственностью «ИК ВЕЛЕС Капитал» (далее - Компания) поручений клиентов на совершение срочной сделки по покупке/продаже опциона пут, содержащих ссылку на настоящую спецификацию.

2. Для целей исполнения содержащих ссылку на настоящую спецификацию поручений клиента на покупку/продажу поставочного опциона пут на ценные бумаги, которые могут быть базисным активом в соответствии с настоящей спецификацией, и определения условий их исполнения Компания устанавливает следующие термины и определения:

Опцион (опционный договор) – договор, предусматривающий обязанность стороны договора (продавца опциона) в случае предъявления требования другой стороной (покупателем опциона) купить или продать ценные бумаги, путем заключения стороной договора купли-продажи ценных бумаг. Опцион предусматривает покупку базисного актива, т.е. является поставочным.

Опцион пут – опцион, предоставляющий право покупателю опциона в дату исполнения опциона продать базисный актив по цене исполнения опциона.

Европейский стиль опциона – опцион, который может быть исполнен только в дату истечения срока действия опциона.

Базисный актив – ценные бумаги, в отношении которых покупатель опциона приобретает право продать, а продавец опциона, принимает обязательство купить их. К ценным бумагам, которые могут выступать базисным активом в соответствии с настоящей спецификацией относятся:

обыкновенные именные бездокументарные акции Акционерной компании «АЛРОСА» (публичное акционерное общество) (ISIN RU0007252813);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Аэрофлот – российские авиалинии» (ISIN RU0009062285);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Газпром» (ISIN RU0007661625);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Мобильные ТелеСистемы» (ISIN RU0007775219);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Нефтяная компания «Роснефть» (ISIN RU000A0J2Q06);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Сбербанк России» (ISIN RU0009029540);

привилегированные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Сбербанк России» (ISIN RU0009029557);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Северсталь» (ISIN RU0009046510);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-ПТС» (ISIN RU000A0JR4A1);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Новолипецкий металлургический комбинат» (ISIN RU0009046452);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «НОВАТЭК» (ISIN RU000A0DKVS5);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Ростелеком» (ISIN RU0008943394);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Сургутнефтегаз» (ISIN RU0008926258);

привилегированные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Сургутнефтегаз» (ISIN RU0009029524);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Татнефть» им. В.Д. Шашина (ISIN RU0009033591);

привилегированные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Транснефть» (ISIN RU0009091573);

обыкновенные именные бездокументарные акции Банка ВТБ (публичное акционерное общество) (ISIN RU000A0JP5V6);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Магнит» (ISIN RU000A0JKQU8);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Горно-металлургическая компания «Норильский никель» (ISIN RU0007288411);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Нефтяная компания «ЛУКОЙЛ» (ISIN RU0009024277);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Федеральная гидрогенерирующая компания - РусГидро» (ISIN RU000A0JPKH7);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Федеральная сетевая компания Единой энергетической системы» (ISIN RU000A0JPNN9);

обыкновенные именные бездокументарные акции Публичного акционерного общества «Полюс» (ISIN RU000A0JNAA8).

Дата исполнения опциона – дата, в которую покупатель опциона вправе заявить продавцу опциона требование купить базисный актив.

Значение (цена) базисного актива – цена закрытия соответствующего базисного актива, рассчитанная в фондовой секции ПАО Московская Биржа в режиме основных торгов на дату исполнения опциона.

Покупатель опциона – лицо, приобретающее право требовать от продавца опциона купить базисный актив.

Продавец опциона – лицо, принимающее на себя обязанность купить базисный актив, в случае реализации покупателем опциона своего права.

Цена исполнения опциона – определяемая на основании поручения клиента, цена за одну единицу базисного актива, по которой покупатель опциона имеет право продать базисный актив, а продавец опциона обязуется купить базисный актив в дату исполнения опциона.

Поручение клиента - содержащее ссылку на настоящую спецификацию поручение на совершение внебиржевой срочной сделки по покупке/продаже поставочного опциона пут на ценные бумаги, которые могут быть базисным активом в соответствии с настоящей спецификацией.

Премия – сумма денежных средств, перечисляемая покупателем опциона продавцу опциона, за предоставление покупателю опциона права требовать от продавца опциона купить ценные бумаги, являющиеся базисным активом.

Сумма инвестирования – общая стоимость базисного актива, определяемая как произведение количества базисного актива и цены исполнения опциона.

3. Условием исполнения поручения клиента на продажу является наличие в распоряжении Компании, действующей в качестве брокера, денежных средств продавца опциона в размере не менее суммы инвестирования.

В целях обеспечения надлежащего исполнения продавцом опциона обязательства по покупке базисного актива, находящаяся в распоряжении брокера сумма денежных средств, соответствующая сумме инвестирования, является гарантийным обеспечением и не может быть выведена клиентом из распоряжения брокера до даты исполнения опциона. На сумму гарантийного обеспечения проценты не начисляются и не уплачиваются.

4. На основании поручения клиента Общество с ограниченной ответственностью «ИК ВЕЛЕС Капитал», действуя от своего имени за счет клиента заключает *внебиржевой опционный договор* на следующих условиях:

Условия опциона	Порядок их определения
Тип опциона	пут
Тип исполнения	поставочный
Стиль опциона	европейский
Вид (направление) сделки	определяется поручением клиента
Дата исполнения опциона	определяется поручением клиента и должна соответствовать дате исполнения квартального биржевого опциона на фьючерс на акции, являющиеся базисным активом опциона, обращающегося в секции срочного рынка ПАО Московская Биржа
Количество опционов	определяется поручением клиента, при этом покупка/продажа одного опциона пут означает приобретение права/принятия на себя обязанности продать/купить один лот ценных бумаг, являющихся базисным активом; объем лота определяется поручением клиента на основании Списка параметров поставочных фьючерсных контрактов на акции российских эмитентов, размещенным на странице ПАО Московская Биржа в сети «Интернет»
Ценные бумаги	определяется поручением клиента (из перечня ценных бумаг, которые могут быть базисным активом в соответствии с настоящей спецификацией)
Цена исполнения	определяется поручением клиента
Премия	определяется поручением клиента
Иные существенные условия:	<ol style="list-style-type: none"> 1. покупатель опциона передает продавцу опциона премию не позднее четырех рабочих дней с даты исполнения опциона 2. в дату исполнения опциона требование покупателя опциона о необходимости его исполнить считается заявленным, если на дату исполнения опциона значение (цена) базисного актива ниже цены исполнения опциона либо равно ему. В этом случае Компания, действующая от своего имени за счет клиента, заключает внебиржевой договор купли-продажи ценных бумаг, в порядке и на условиях, установленных п. 5 настоящей спецификации 3. в рабочий день, следующий за датой исполнения опциона, сумма инвестирования становится доступной продавцу опциона для совершения сделок или операций, если на дату исполнения значение (цена) базисного актива выше цены исполнения опциона

5. Направляя в Компанию поручение на совершение срочной сделки, содержащее ссылку на настоящую спецификацию, клиент направляет Компании длящееся поручение на совершение сделки купли-продажи ценных бумаг на следующих условиях:

Условие сделки купли-продажи	Порядок их определения
Вид сделки	покупка (для продавца опциона) / продажа (для покупателя опциона)
Тип приказа	лимитный

Наименование эмитента	соответствует эмитенту базисного актива, указанного в поручении клиента
ISIN	соответствует ISIN базисного актива, указанного в поручении клиента
Количество, шт.	определяется произведением количества опционов, указанного в поручении клиента, и объема лота ценных бумаг соответствующего ISIN, указанного в поручении клиента
Цена (за одну ценную бумагу)	соответствует цене исполнения опциона
Условие, при котором длящееся поручение исполняется	если на дату исполнения опциона значение (цена) базисного актива ниже цены исполнения опциона либо равно ему Компания, действующая от своего имени за счет клиента, не позднее рабочего дня, следующего за датой исполнения опциона, заключает договор купли-продажи ценных бумаг, являющихся базисным активом
Иные существенные условия договора купли-продажи	<ol style="list-style-type: none"> 1. продавец (покупатель опциона) не позднее четырех рабочих дней с даты исполнения опциона передает покупателю (продавцу опциона) ценные бумаги в количестве, соответствующем количеству опционов, путем их зачисления на счет депо покупателя (продавца опциона) в депозитарии ООО «ИК ВЕЛЕС Капитал». 2. покупатель (продавец опциона) перечисляет не позднее четырех рабочих дней с даты исполнения опциона продавцу (покупателю опциона) сумму инвестирования.