

Утверждено
Приказом Генерального директора
ООО «ИК ВЕЛЕС Капитал» № 10ЮД
от 7 февраля 2019г.

Спецификация внебиржевого поставочного опциона колл
на акции российских эмитентов

Москва, 2019

Спецификация

внебиржевого поставочного опциона колл на обыкновенные акции российских эмитентов

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

2. Для целей исполнения содержащих ссылку на настоящую спецификацию поручений клиента на покупку/продажу поставочного опциона колл 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 колл – опцион, предоставляющий право покупателю опциона в дату исполнения опциона купить 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 купить, а продавец опциона, принимает обязательство их продать. 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);

Публичное акционерное общество «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).

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

Продавец опциона – лицо, принимающее на себя обязанность продать 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 купить базисный актив, а продавец опциона обязуется продать базисный актив в дату исполнения опциона.

Поручение клиента - содержащее ссылку на настоящую спецификацию поручение на совершение внебиржевой срочной сделки по покупке/продаже поставочного опциона колл 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 продать 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 опциона является обеспечение клиентом наличия ценных бумаг в количестве, достаточном для реализации покупателем опциона права на покупку соответствующих ценных бумаг, путем фиксации на счете депо владельца продавца опциона в депозитарии ООО «ИК ВЕЛЕС Капитал» ограничения распоряжения ценными бумагами с установлением запрета на проведение по поручению продавца опциона или третьего лица, действующего в его интересах, операций, приводящих к уменьшению количества ценных бумаг ниже установленного количества. Такое ограничение должно действовать до рабочего дня, следующего за датой исполнения опциона.

В случае если на дату направления клиентом поручения на продажу опциона ценные бумаги учитываются на его торговом счете депо в депозитарии ООО «ИК ВЕЛЕС Капитал», одновременно с направлением поручения на продажу опциона клиент обязан направить в Компанию поручение на перевод ценных бумаг в необходимом количестве на счет депо владельца с последующей фиксацией ограничения распоряжения ценными бумагами. Такое поручение направляется по форме Приложения № 3-7 к Регламенту осуществления брокерской деятельности ООО «ИК ВЕЛЕС Капитал».

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	колл
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 колл означает приобретение права/принятия на себя обязанности продать/купить 100 штук ценных бумаг, являющихся базисным активом
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:	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 выше цены исполнения опциона. В этом случае Компания, действующая от своего имени за счет клиента, заключает внебиржевой договор купли-продажи

	<p>ценных бумаг, в порядке и на условиях, установленных п. 5 настоящей спецификации</p> <p>3. в рабочий день, следующий за датой исполнения опциона, ценные бумаги, являющиеся базисным активом соответствующего опциона колл, становятся доступными продавцу опциона для совершения сделок или операций, если на дату исполнения значение (цена) базисного актива ниже цены исполнения опциона либо равна ей.</p>
--	--

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	продажа (для продавца опциона) / покупка (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.	соответствует количеству опционов, указанному в поручении клиента, при этом одному опциону соответствует 100 штук ценных бумаг соответствующего ISIN
Цена (за одну ценную бумагу)	соответствует цене исполнения опциона
Условие, при котором длящееся поручение исполняется	если на дату исполнения опциона значение (цена) базисного актива выше цены исполнения опциона, 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	<p>1. продавец (продавец опциона) не позднее четырех рабочих дней с даты исполнения опциона передает покупателю (покупателю опциона) ценные бумаги в количестве, соответствующем количеству опционов, путем их зачисления на счет депо покупателя (покупателя опциона) в депозитарии ООО «ИК ВЕЛЕС Капитал».</p> <p>2. покупатель (покупатель опциона) перечисляет не позднее четырех рабочих дней с даты исполнения опциона продавцу (продавцу опциона) сумму инвестирования.</p>