

УСЛОВИЯ БРОКЕРСКОГО ОБСЛУЖИВАНИЯ НА СРОЧНОМ РЫНКЕ

1. Общие положения

1.1. Настоящие Условия брокерского обслуживания на срочном рынке являются Приложением к Регламенту оказания ООО «СПЭК ИНВЕСТМЕНТ» услуг на финансовых рынках (далее – Регламент) и содержат существенные условия брокерского обслуживания Клиента ООО «СПЭК ИНВЕСТМЕНТ» (далее – Компания) на срочном рынке. В соответствии с настоящими Условиями брокерского обслуживания на срочном рынке (далее – "Условия"), Компания предоставляет Клиенту услуги по брокерскому исполняющему обслуживанию Клиента в целях совершения за счет и в интересах Клиента операций на срочном рынке.

1.2. Настоящие Условия вступают в силу с учетом оговорок, сделанных Клиентом при присоединении к Регламенту и указанных в Заявлении на комплексное обслуживание на финансовых рынках (Приложение №3 к Регламенту), если в тексте Заявления на комплексное обслуживание на финансовых рынках, направленного Клиентом в Компанию, в порядке, предусмотренном Регламентом, сделана оговорка о том, что Клиент уведомляет Компанию о желании получать брокерское обслуживание на какой-либо Торговой площадке, на которой обращаются срочные инструменты - фьючерсы и/или опционы (Срочном рынке).

1.3. Для отказа от настоящих Условий, Клиент направляет в Компанию заявление об изменении условий акцепта Регламента в порядке, предусмотренном Регламентом с исключением всех Торговых площадок, на которых обращаются срочные инструменты- фьючерсы и/или опционы (Срочного рынка) из числа Торговых площадок (рынков), на которых Клиент желает получать брокерское обслуживание.

1.4. При совершении сделок на срочном рынке Компания и Клиент руководствуются настоящими Условиями. При совершении срочных сделок Компания действует от своего имени и за счет Клиента (как комиссионер). Особенности обслуживания на Срочном рынке каждой ТС (включая порядок совершения сделок на срочном рынке) определяются в соответствии с соответствующими Правилами ТС, опубликованными в информационно-телекоммуникационной сети Интернет на сайтах Бирж:

— ПАО Московская Биржа: <http://moex.com>

1.5. Акцептуя настоящие Условия, Клиент подтверждает факт ознакомления с Правилами ТС (в том числе с внутренними документами Биржи, клиринговой организации и решениями уполномоченных органов Биржи и клиринговой организации, касающихся организации торгов на Срочном рынке), спецификациями срочных контрактов.

1.6. Настоящим Компания уведомляет Клиента о возможном внесении изменений в Правила соответствующей ТС. С целью обеспечения гарантированного ознакомления Клиентов до вступления в силу изменений в Правила ТС, настоящими Условиями установлена обязанность Клиента не реже одного раза в неделю самостоятельно или через уполномоченных лиц обращаться по ссылкам, предусмотренным п.1.4 настоящих Условий, за сведениями об изменениях, произведенных в Правилах ТС соответствующей ТС (Биржи или Клиринговой организации).

2. Термины и определения

2.1. Для целей настоящих Условий применяются следующие термины и определения:

Биржа – ПАО Московская Биржа, осуществляющее свою деятельность по организации торговли на рынке ценных бумаг и финансовых инструментов на основании соответствующей лицензии.

Биржевые правила совершения срочных сделок (Биржевые правила) – Правила совершения срочных сделок на Срочном рынке или Правила проведения торгов на срочном рынке публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС».

Клиринговый центр (Клиринговая организация) - Банк НКЦ (АО).

Минимальная маржа (M_x) – расчетная величина, определяемая по формуле:

$$M_x = \frac{1}{2} M_0$$

Организованный рынок ценных бумаг (ОРЦБ) - совокупность отношений, связанных с заключением и исполнением сделок с Ценными бумагами по установленным процедурам.

Расчетная фирма (Участник торгов) – лицо, в соответствии с действующим на Бирже порядком, допущенное к совершению срочных сделок и являющееся участником клиринга по совершенным на Бирже срочным сделкам. В контексте настоящих условий – ООО «СПЭК ИНВЕСТМЕНТ».

Уполномоченные участники ОРЦБ - организации и учреждения (ПАО Московская Биржа, депозитарии, регистраторы, эмитенты, расчетно-клиринговые организации, органы государственной и местной власти и т.д.), уполномоченные на основании нормативных документов в сфере финансовых рынков, а также договоров и соглашений с Биржей и/или Расчетной фирмой, осуществлять регистрацию, учет, контроль или регулирование операций с ценными бумагами.

Регистр учета позиций Клиента (Позиционный счет клиентский) – клиринговый регистр (позиционный счет), открываемый Клиринговым центром для учета открытых позиций Клиента, отображающий совокупность прав и обязательств этого клиента по заключенным им срочным сделкам. Регистр учета позиций состоит из разделов, каждый из которых имеет отдельный код Клиента.

Торговый денежный регистр - клиринговый регистр, открываемый Банком НКЦ (АО) для учета свободных от обязательств денежных средств, принадлежащих Клиенту и предназначенных для совершения Компанией срочных сделок.

Спецификация срочного инструмента (спецификация) – документ, совместно с Биржевыми правилами совершения срочных сделок, определяющий все существенные условия срочного инструмента, его обращения и исполнения.

Срочные инструменты – фьючерсы/опционы, допущенные в установленном Биржевыми правилами совершения срочных сделок порядке к обращению на срочном рынке Биржи.

Поставочный контракт - срочный контракт, условия исполнения обязательств по которому предусматривают поставку/оплату базисного актива в порядке, установленном в спецификации, Правилах и Условиях клиринга.

Расчетный контракт - срочный контракт, условия исполнения обязательств по которому предусматривают проведение расчетов в порядке, установленном в спецификации, Правилах и Условиях клиринга.

Начальная маржа (Гарантийное обеспечение, Депозитная маржа, M_0) – сумма средств, подлежащих в соответствии с Биржевыми правилами совершения срочных сделок внесению Клиентом в качестве обеспечения исполнения обязательств по открытым позициям.

Вариационная маржа – денежные средства, обязанность уплаты которых возникает у одной из сторон фьючерсного контракта в результате изменения текущей рыночной цены базисного актива или цены фьючерсного контракта (опциона).

Поддерживающая маржа – расчетная величина, равная превышению требований Биржи по гарантийному обеспечению открытых позиций Клиента (M_0) над стоимостью активов по счету Клиента, принятых в обеспечение открытых позиций Клиента. Максимальный размер поддерживающей маржи не может превышать разность между размером Начальной маржи M_0 и размером Минимальной маржи M_x

Предоставление Поддерживающей маржи – мероприятия, осуществляемые Расчетной фирмой в соответствии с Биржевыми правилами и (или) иными Правилами ТС, следствием которых является использование денежных средств и (или) ценных бумаг Расчетной фирмы (иных клиентов Расчетной фирмы) в размере Поддерживающей маржи для обеспечения открытых позиций Клиента гарантийным обеспечением в соответствии с требованиями Биржи.

2.2. Термины, не определенные настоящими Условиями, используются в значениях, установленных Регламентом, Правилами ТС, нормативными документами в сфере финансовых

рынков и иными нормативными правовыми актами РФ.

2.3. Требования по осуществлению действий при наличии непокрытых позиций определяются Регламентом и настоящим Приложением.

3. Взаимоотношения Сторон

3.1. Обслуживание Клиента Расчетной фирмой строится на основе строгой добровольности и осуществляется исходя из финансовых и иных возможностей Расчетной фирмы и Клиента, а также обязательств, принимаемых Сторонами по настоящим Условиям.

3.2. Во взаимоотношениях друг с другом в ходе выполнения положений настоящих Условий Стороны руководствуются Биржевыми правилами совершения срочных сделок, Спецификациями срочных контрактов, иными документами, регламентирующими обращение срочных инструментов на Бирже.

3.3. Клиент поручает Расчетной фирме в течение срока действий настоящих Условий:

3.3.1. В соответствии с действующими Биржевыми правилами совершения срочных сделок, заключать на Бирже в интересах Клиента сделки купли/продажи фьючерсных и опционных контрактов;

3.3.2. По Приказу Клиента своевременно перечислить на счет Расчетной фирмы предоставленные Клиентом Расчетной фирме денежные средства в целях обеспечения совершения в интересах Клиента сделок на срочном рынке Биржи.

3.3.3. По Приказу Клиента своевременно возвращать свободные денежные средства, учитываемые на счете Клиента.

3.4. Стороны подтверждают, что осведомлены о риске, с которым связана их деятельность на рынке фьючерсных контрактов и опционов, и не будут иметь претензий друг к другу по поводу своих возможных убытков при добросовестном выполнении каждой из Сторон обязательств, определенных настоящими Условиями, и при отсутствии доказательств, изобличающих какую-либо из Сторон в сознательном искажении информации или других злонамеренных действиях.

3.5. Стороны подтверждают, что не будут нести ответственности друг перед другом в случае невыполнения обязательств в соответствии с настоящими Условиями по причине невыполнения Биржей и/или Клиринговым центром своих обязательств перед Расчетной фирмой.

4. Права и обязанности Сторон

4.1. Стороны *обязаны*:

4.1.1. При осуществлении операций в секции срочного рынка Биржи вести свою деятельность в соответствии с требованиями настоящих Условий.

4.1.2. В случае несоответствия позиций Клиента требуемому уровню гарантийного обеспечения и с учетом возможности Расчетной фирмы по поддержанию не полностью обеспеченных позиций Клиента, Клиент вправе получить от Расчетной фирмы поддерживающую маржу.

4.1.3. Информировать друг друга о своем финансовом положении и возможных его изменениях, способных поставить под угрозу финансовое положение другой Стороны.

4.2. Расчетная фирма *обязуется*:

4.2.1. Для учета денежных средств Клиента, а также для проведения денежных расчетов по операциям со Срочными инструментами, по Поручению Клиента открыть ему в ТС Торговый денежный регистр (Позиционный счет клиентский) и Регистр учета позиций Клиента (далее по тексту – Разделы Клиента).

4.2.2. Принимать к исполнению (кроме случаев, особо оговоренных в настоящих Условиях) оформленные и поданные в порядке, установленном Регламентом и приложениями к нему, приказы и Поручения Клиента, предусмотренные Регламентом и приложениями к нему.

4.2.3. По распоряжению Клиента оформлять документы, необходимые для исполнения на срочном рынке Биржи фьючерсных и опционных контрактов, заключенных по Поручению Клиента.

4.2.4. Уведомлять Клиента о прекращении совершения сделок по его распоряжениям вследствие снижения средств Клиента ниже величины, предусмотренной разделом 6 настоящих Условий.

4.2.5. Информировать Клиента о необходимости внесения дополнительных денежных средств, либо закрытия позиций, открытых ранее по его распоряжениям. Информирование осуществляется путем указания необходимой к донесению суммы денежных средств в отчетах Расчетной фирмы, или иным доступным способом взаимодействия Расчетной фирмы и Клиента.

4.2.6. Информировать Клиента либо обеспечивать доступ Клиента к информации о требованиях и ограничениях при проведении операций со срочными инструментами, устанавливаемых для Расчетной фирмы и/или Клиента уполномоченными участниками ОРЦБ и влияющих на порядок оформления и подачи Клиентом заявок, поручений и распоряжений, предусмотренных Регламентом и приложениями к нему.

4.3. Расчетная фирма *вправе*:

4.3.1. Не осуществлять регистрацию Клиента на срочном рынке, в соответствии с Биржевыми правилами и не осуществлять брокерское обслуживание Клиента на срочном рынке до исполнения Клиентом требований п.4.4.2 настоящих Условий.

4.3.2. Не принимать к исполнению либо корректировать по количественным параметрам приказы и Поручения Клиента, предусмотренные Регламентом и приложениями к нему, в случае недостаточности для обеспечения их исполнения (в том числе уплаты предусмотренных настоящим Договором об обслуживании на финансовых рынках (договором присоединения), неотъемлемой частью которого являются настоящие Условия вознаграждений Расчетной фирмы, Биржи, Клирингового центра) суммы денежных средств Клиента, предназначенных для приобретения срочных инструментов.

4.3.3. Не принимать к исполнению приказы и Поручения Клиента, предусмотренные Регламентом и приложениями к нему, в случае нарушения Клиентом порядка их оформления и подачи, установленного Регламентом и приложениями к нему.

4.3.4. Не принимать к исполнению приказы и Поручения Клиента, предусмотренные Регламентом и приложениями к нему, в случае их несоответствия требованиям, установленным для Расчетной фирмы уполномоченными участниками ОРЦБ, в том числе по ценовым условиям.

4.3.5. Дополнительно к гарантийному обеспечению открытых позиций, устанавливаемому Биржей, устанавливать гарантийное обеспечение открытых позиций, устанавливаемое Расчетной фирмой (ГО Брокера), в случае изменения оценки рисков как по финансовым инструментам, так и по обязательствам Клиента. Оценка рисков и размер ГО Брокера определяются Расчетной фирмой самостоятельно, применительно к каждому срочному инструменту (фьючерсному контракту, опциону), каждому Клиенту.

4.3.6. В безакцептном порядке с соответствующих счетов Клиента списывать предусмотренные Тарифным классификатором Компании, размещенным на официальном WEB-сайте Компании и положениями настоящих Условий, вознаграждения и удерживать суммы налогов и сборов по операциям с ценными бумагами (в т.ч. со срочными инструментами) в соответствии с действующим законодательством РФ и в соответствующих случаях.

4.3.7. Предоставлять необходимую информацию о Клиенте и совершаемых им операциях со срочными инструментами Бирже и иным уполномоченным участникам ОРЦБ с целью осуществления ими контрольных и учетных функций в соответствии с нормативными документами в сфере финансовых рынков.

4.3.8. Принудительно закрыть позиции Клиента по поставочным фьючерсным контрактам без его уведомления по текущей биржевой цене в случае неисполнения Клиентом своих обязательств по поставочным фьючерсным контрактам до 16ч.00м. Торгового дня, предшествующего дню исполнения поставочного фьючерсного контракта.

4.4. Клиент *обязуется*:

4.4.1. При акцепте настоящих Условий предоставить Расчетной фирме необходимые учредительные и иные документы в соответствии с *Перечнем документов, предоставляемых в ООО «СПЭК ИНВЕСТМЕНТ» для получения услуг на финансовых рынках* (Приложение №2 к Регламенту).

4.4.2. Перечислять Расчетной фирме денежные средства, предназначенные для приобретения срочных контрактов и поддержания открытых позиций, в порядке, предусмотренном Регламентом.

4.4.3. Оформлять и подавать Расчетной фирме приказы и Поручения Клиента, предусмотренные Регламентом и приложениями к нему, в порядке, установленном Регламентом и приложениями к нему.

4.4.4. Оплачивать затраты и услуги Расчетной фирмы в размерах и порядке, установленных Тарифным классификатором Компании и положениями настоящих Условий.

4.4.5. В случае вынужденного или принудительного закрытия Расчетной фирмой позиций Клиента на срочном рынке Биржи - возместить Расчетной фирме вызванные этим убытки в течение 3 (трех) рабочих дней.

4.4.6. В случае намерения Клиента исполнить поставочные фьючерсные контракты на акции Клиент обязуется заранее, не позднее дня, предшествующего последнему дню обращения поставочных фьючерсных контрактов на акции, подать Заявление на комплексное обслуживание на финансовых рынках (Приложение № 3 к Регламенту) с акцептом регистрации Клиента на Фондовом рынке ПАО Московская Биржа. Исполнение Клиентом обязательств по настоящему пункту означает безусловное согласие Клиента исполнять поставочные фьючерсные контракты на акции, если к моменту окончания срока обращения таких контрактов они не будут закрыты Клиентом в соответствии с Регламентом, Правилами ТС.

4.4.7. В случае неисполнения Клиентом своих обязательств по поставочным фьючерсным контрактам до 16 ч.00 м. торгового дня, предшествующего дню исполнения поставочного фьючерсного контракта, Расчетная фирма вправе принудительно закрыть позиции Клиента по поставочным фьючерсным контрактам в безакцептном порядке без его уведомления по текущей биржевой цене. При этом все последствия указанных действий Расчетной фирмы, включая возможные убытки, Клиент принимает на себя.

5. Порядок проведения операций по распоряжениям Клиента

5.1. Расчетная фирма совершает срочные сделки в срочной секции Биржи на основании получаемых от Клиента приказов и поручений следующих типов:

- купить (продать) фьючерсный контракт/опцион по рыночной цене;
- купить (продать) фьючерсный контракт/опцион по фиксированной цене;
- купить (продать) фьючерсный контракт/опцион по цене не выше (не ниже) указанной;
- исполнить опционный контракт.

5.2. Поручение Клиента (Приложение № 16-5 к Регламенту), переданное одним из определенных в разделе 4 Регламента способов, должно содержать:

- наименование и Код Клиента;
- вид срочной сделки (фьючерсный контракт/опцион);
- вид сделки;
- наименование (обозначение) фьючерсного контракта/опциона, принятое у организатора торговли на рынке ценных бумаг;
- количество фьючерсных контрактов/опционов;
- цена одного фьючерсного контракта/цена исполнения по опциону;
- размер премии по опциону;
- срок действия Поручения Клиента;
- подпись Клиента или индекс (условное наименование), установленное договором с Клиентом;
- дату составления Поручения.

При получении Поручения Клиента Расчетная фирма регистрирует Поручение, отражая при этом дату и время получения Поручения.

5.3. Срок окончания действия Поручения Клиента определяется как конец торговой сессии дня принятия Поручения Клиента к исполнению.

5.4. Клиент вправе получить от Расчетной фирмы, а Расчетная фирма вправе установить торговые лимиты, превышающие остатки собственных денежных средств по счету Клиента.

5.5. Клиент признает право Расчетной фирмы ограничивать без уведомления Клиента количество открытых позиций, которое Клиент может поддерживать через Расчетную фирму.

6. Средства Клиента

6.1. Средства гарантийного обеспечения обязательств по совершаемым по распоряжению Клиента срочным сделкам могут быть внесены денежными средствами и ликвидными ценными бумагами (по согласованию с Расчетной фирмой).

6.1.1. Денежные средства могут быть перечислены Клиентом на специальный брокерский счет Расчетной фирмы

6.2. Расчетная фирма ведет учет полученных от Клиента средств гарантийного обеспечения, необходимых для проведения в интересах Клиента операций на срочном рынке в форме отдельного счета (регистра) Расчетной фирмы.

6.3. На счете Клиента должен поддерживаться уровень собственных средств в объеме, достаточном для поддержания открытых позиций Клиента и осуществления расчетов.

6.4. В случае несоответствия позиций Клиента требуемому уровню гарантийного обеспечения Расчетная фирма информирует Клиента о необходимости пополнения денежных средств на счете Клиента.

6.5. В случае неисполнения Клиентом обязательств по восстановлению начальной маржи до требуемого уровня Расчетная фирма осуществляет без Поручения Клиента принудительное закрытие необеспеченных гарантийным обеспечением позиций Клиента. В случае открытия Клиенту более одного торгового денежного регистра (раздела клирингового регистра) расчет уровней/объемов начальной маржи, поддерживающей маржи осуществляется Расчетной фирмой по каждому торговому денежному регистру отдельно.

6.6. В последний день обращения срочного инструмента Расчетная фирма вправе без Поручения Клиента осуществить принудительное закрытие позиций, необеспеченных активами Клиента, необходимыми для надлежащего исполнения срочного инструмента (активы должны находиться на счетах для расчетов по срочным инструментам при экспирации контрактов, определенных спецификацией срочного инструмента). Достаточность активов определяется с учетом параметров исполнения срочного инструмента, специфики рынка исполнения срочного инструмента и особенностей обслуживания Клиента на соответствующем рынке, определенных Регламентом и Договором, заключенным с Клиентом.

6.7. Компания вправе без Поручения Клиента закрыть часть позиций Клиента, если Клиент нарушает установленные Биржей ограничения по числу открытых позиций.

6.8. При принудительном закрытии позиций Клиента в случаях, предусмотренных настоящими Условиями, Компания не несет ответственности за любые убытки, причиненные Клиенту данными действиями.

7. Вознаграждение Компании и порядок взаиморасчетов

7.1 Вознаграждение Компании по фактически совершенным сделкам со срочными инструментами начисляется в соответствии с Тарифами ООО «СПЭК ИНВЕСТМЕНТ»

7.2. Вознаграждение Расчетной фирмы, предусмотренное настоящими Условиями, начисляется после каждой проведенной операции и списывается в безакцептном порядке по итогам месяца из денежных средств Клиента, предназначенных для приобретения срочных инструментов или находящихся в распоряжении Компании по Договору об обслуживании на финансовых рынках (договору присоединения), неотъемлемой частью которого являются настоящие Условия.

7.1. Суммы налогов и сборов по операциям с инструментами срочных сделок удерживаются с Клиента Расчетной фирмой в порядке, предусмотренном законодательством РФ и нормативными документами в сфере финансовых рынков.

7.2. Расчетная фирма без предварительного уведомления Клиента производит все необходимые перечисления, связанные с оплатой услуг Расчетной фирмы по Договору об оказании услуг на финансовых рынках.

7.3. Клиент обязан, получив отчет Расчетной фирмы Клиенту, пополнить свой счет средствами в требуемом размере и в любом разрешенном виде, если сальдо счета меньше допустимого минимума, в соответствии с требованиями п. 6.3 настоящих Условий.

7.4. Клиент обязан предпринять все разумные и необходимые меры к тому, чтобы денежные средства поступили на счет Расчетной фирмы в течение 1 (одних) суток после отправления

Расчетной фирмой Клиенту отчета о результатах торгов рабочего дня.

7.5. Расчетная фирма по требованию Клиента обязана вернуть его средства (или их часть), учитываемые на Регистре учета позиций Клиента. Средства Клиента должны быть возвращены в течение срока, определенного Регламентом после получения Расчетной фирмой соответствующего поручения.

При этом в распоряжении Расчетной фирмы должны оставаться средства в размере, обеспечивающем выполнение условий п. 6.3 настоящих Условий.

8. Порядок предоставления отчетности

8.1. Компания предоставляет Клиенту отчет по срочным сделкам и операциям, с ними связанным, совершенным в интересах Клиента за отчетный период (месяц, квартал) в соответствии со стандартами отчетности, установленными Банком России сроки, с периодичностью и в порядке, установленными разделом 7 Регламента.

8.2. Принятие Клиентом отчета Расчетной фирмы полностью подтверждает все параметры совершенных Расчетной фирмой Сделок, и в случае обнаружения любой из Сторон в дальнейшем ошибок в отчете Расчетной фирмы, в том числе при расхождении данных отчета с параметрами поданных Клиентом Поручений, риск изменения рыночной стоимости фьючерсных и опционных контрактов и иных негативных последствий ошибки Расчетной фирмы принимается Клиентом на себя.

9. Способы сообщения

9.1. Расчетная фирма и Клиент обмениваются информацией, касающейся торговли по Поручениям Клиента и взаиморасчетов Расчетной фирмы, Клиента и Биржи, любым из способов, установленных в разделе 3 Регламента и акцептованных Клиентом в Заявлении на комплексное обслуживание на финансовых рынках (Приложение №3 к Регламенту): по телефону, по электронной почте, иными способами, предусмотренными договором Сторон.