

УТВЕРЖДЕНА
Приказом Генерального директора
ОАО «Брокерский дом «ОТКРЫТИЕ»
от 01.04.2014 № 14.04/01.1-ОД

СПЕЦИФИКАЦИЯ
внебиржевого опционного контракта (Опцион)
для «Структурного продукта «Фиксированный купон»

Термины и определения

1. Тип Опциона – направление изменения цены Базового актива. Опцион Call – на рост, Опцион Put – на снижение.
2. Стилль Опциона – Европейский, когда Опцион может быть исполнен по требованию покупателя только в дату окончания срока действия Опциона.
3. Тип исполнения – Поставочный, когда в результате исполнения Опциона покупателю или продавцу может быть поставлен базовый актив.
4. Премия – стоимость Опциона, уплачиваемая Покупателем Опциона Продавцу Опциона.
5. Сумма инвестирования ($S_{инв}$) – сумма денежных средств, которую Продавец инвестирует в Структурный продукт
6. Цена исполнения Опциона (Strike) – цена базового актива, выбираемая Продавцом Опциона в момент подачи поручения на продажу.
7. Ставка купона - ставка, в процентах готовых, определяющая величину Премии.
8. Гарантийный перевод - сумма денежных средств, передаваемая Продавцом Опциона Покупателю Опциона в целях обеспечения исполнения обязательств по опционному Договору, заключенному на условиях настоящей Спецификации. Покупатель Опциона вправе распоряжаться денежными средствами, переданными ему в качестве Гарантийного перевода, по своему усмотрению с обязанностью возвратить Гарантийный перевод Продавцу Опциона в дату исполнения обязательств по настоящему Опциону. Гарантийный перевод не является средством коммерческого кредита, проценты за пользование Покупателем Опциона средствами Гарантийного перевода не начисляются и не уплачиваются Продавцу Опциона.
9. Иные термины и определения, не описанные в данной спецификации, применяются в значениях, установленных законодательством Российской Федерации и Правилами организованных торгов на Срочном рынке ОАО Московская Биржа.

Параметры опционного контракта

| Название параметра | Значение параметра |
|---------------------------------------|---|
| Наименование Опциона | Опцион на Базовый актив |
| Базовый актив | Определяется в поручении клиента на структурный продукт |
| Количество базового актива | Равно количеству ценных бумаг, определяется в поручении клиента на структурный продукт |
| Тип Опциона | PUT |
| Тип исполнения | Поставочный |
| Стилль Опциона | Европейский |
| Дата окончания срока действия Опциона | Дата погашения структурного продукта, определяется в поручении клиента на структурный продукт |
| Сумма инвестирования | Определяется в поручении клиента на структурный продукт |

| | |
|----------------------------------|---|
| Цена исполнения опциона (Strike) | Определяется в поручении клиента на структурный продукт |
| Стоимость Опциона (Премия) | Определяется в поручении клиента на структурный продукт |
| Гарантийный перевод | Равен Сумме инвестирования |
| Ставка купона (в % годовых) | Определяется в поручении клиента на структурный продукт |

Иные существенные условия опционного контракта:

1. Поставка Базового актива осуществляется в случае, если Цена исполнения опциона (Strike) больше или равна цене закрытия (Расчетной цене) Базового актива в секторе Основной рынок ЗАО "Фондовая биржа ММВБ" в режиме основных торгов на день, предшествующий Дате окончания срока действия Опциона.
2. Поставка Базового актива осуществляется по цене исполнения опциона (Strike) в количестве, установленном в поручении клиента на структурный продукт.
3. В случае поставки Базового актива Продавец Опциона перечисляет Покупателю Опциона Сумму инвестирования в Дату окончания срока действия Опциона.
4. Покупатель Опциона перечисляет Премию по Опциону Продавцу Опциона в Дату окончания срока действия Опциона.
5. Продавец Опциона уплачивает Покупателю Опциона Гарантийный перевод в размере, установленном в поручении клиента на структурный продукт не позднее 1 (одного) рабочего дня с даты продажи Опциона.
6. В Дату окончания срока действия Опциона Покупатель Опциона возвращает Гарантийный перевод Продавцу Опциона.