



УТВЕРЖДЕНА
Приказом Генерального директора
ОАО «Брокерский дом «ОТКРЫТИЕ»
от 17.01.2014 № 14.01/17.2-ОД

СПЕЦИФИКАЦИЯ
внебиржевого опционного контракта (Опцион)
для «Структурного продукта «Умный депозит»

Термины и определения

1. Тип Опциона – определяемое Покупателем попадание («в интервале CALL»)/непопадание («вне интервала PUT») цены базового актива в интервал между значениями предельного изменения цены базового актива Пороговая Цена 1 и Пороговая цена 2.
2. Стилль Опциона – Европейский, когда Опцион может быть исполнен по требованию покупателя только в дату окончания срока действия Опциона
3. Тип исполнения – расчетный, когда в результате исполнения Опциона продавец уплачивает покупателю денежный эквивалент разницы между ценой базового актива на дату окончания срока действия Опциона и ценой исполнения Опциона.
4. Премия – цена опционного контракта, уплачиваемая Покупателем опционного контракта Продавцу опционного контракта.
5. Сумма инвестирования ($S_{инв}$) – сумма денежных средств, которую Покупатель инвестирует в Структурный продукт
6. Коэффициент защиты капитала (КЗК) – доля Суммы инвестирования, которая будет гарантированно возвращена Покупателю в момент погашения структурного продукта.
7. Пороговая цена 1 – (Strike1) цена базового актива, используемая при расчете Суммы выплаты (S).
8. Пороговая цена 2 – (Strike2) цена базового актива, используемая при расчете Суммы выплаты (S).
9. Ставка купона - ставка, в процентах готовых, выплачиваемая Покупателю в момент погашения Структурного продукта (внебиржевого опционного контракта).
10. 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 Опциона	Опцион на Базовый актив*
Тип Опциона	в интервале Call / вне интервала Put
Тип исполнения	Расчетный
Стиль Опциона	Европейский
Дата окончания срока действия Опциона	Дата погашения структурного продукта* или дата заключения оффсетного договора, в зависимости от того, какая из дат наступит раньше
Сумма выплаты (S)	<p>Для Опциона в интервале Call:</p> <p>Если значение (цена) Базового актива (R) больше либо равно Пороговой цене 1 (Strike1) и меньше либо равно Пороговой цене 2 (Strike2), то</p> $(S_{инв} \cdot C \cdot N_D / 365) \cdot 2$ <p>Если значение (цена) Базового актива (R) менее Пороговой цены 1 (Strike1) или больше Пороговой цены 2 (Strike2), то</p> $S_{инв} \cdot C \cdot N_D / 365 - S_{инв} \cdot (100\% - K3K)$ <p>Для Опциона вне интервала Put:</p> <p>Если значение (цена) Базового актива (R) меньше либо равно Пороговой цене 1 (Strike1) или больше либо равно Пороговой цене 2 (Strike2), то</p> $(S_{инв} \cdot C \cdot N_D / 365) \cdot 2$ <p>Если значение (цена) Базового актива (R) больше Пороговой цены 1 (Strike1) и меньше Пороговой цены 2 (Strike2), то</p> $S_{инв} \cdot C \cdot N_D / 365 - S_{инв} \cdot (100\% - K3K)$ <p>где $S_{инв}$ - Сумма инвестирования*</p> <p>$Strike_1$ - Пороговая цена1 (цена исполнения Опциона) *</p> <p>$Strike_2$ - Пороговая цена2 (цена исполнения Опциона) *</p> <p>C - Ставка купона (в % годовых)*</p> <p>R - Значение (цена) Базового актива для исполнения Опциона*</p> <p>K3K - Коэффициент Защиты Капитала*</p> <p>N_D - Разница между датой окончания срока действия Опциона и датой покупки Опциона (в календарных днях)</p>
Иные существенные условия опционного контракта	<p>Покупатель Опциона перечисляет Продавцу Опциона Премию по Опциону в дату окончания срока действия Опциона.</p> <p>Продавец Опциона уплачивает Покупателю опциона сумму выплаты в размере, установленном в спецификации, в дату окончания срока действия Опциона.</p> <p>В случае заключения Сторонами оффсетного опционного договора, Датой окончания срока действия Опциона будет дата заключения оффсетного договора</p>

* параметры, отмеченные звездочкой, определяются в поручении клиента на структурный продукт.