

**СПЕЦИФИКАЦИЯ
опционного контракта**

Настоящая спецификация опционного контракта (далее - Спецификация) определяет стандартные условия внебиржевого опционного контракта (далее – опцион или контракт), заключаемого Акционерным обществом «Сургутнефтегазбанк» (далее – Банк) по поручению Клиента.

- 1. Наименование опциона:** внебиржевой опционный контракт.
- 2. Стиль опциона:** Европейский, т.е. опцион может быть исполнен по требованию держателя только в дату исполнения опционного контракта.
- 3. Вид исполнения опциона:** расчетный, т.е. не предусматривающий поставку базового актива.
- 4. Вид опциона:** опцион «колл»/ опцион «пут».
- 5. Держатель опциона:** АО БАНК «СНГБ» по поручению и за счет Клиента.
- 6. Организатор торговли:** _____
(указывается полное наименование организатора торговли)
- 7. Базовый актив:**

Наименование	Обозначение	Цена исполнения указывается
ценная бумага российского эмитента	по коду организатора торговли	рубли РФ
индекс, рассчитываемый организатором торговли на основании фондовых индексов	по коду организатора торговли	пункты
одна тройская унция аффинированного золота в слитках	GOLD	доллары США
иностранная валюта	по коду Банка России	соответствующая иностранная валюта
индекс S&P500, рассчитываемый Standard & Poor's Financial Services LLC	S&P500	пункты
индекс FTSE, рассчитываемый FTSE International Limited	FTSE100	пункты
индекс EuroStoxx50, рассчитываемый Stoxx Limited	Stoxx50	пункты
индекс DAX, рассчитываемый Deutsche Borse AG	DAX	пункты
индекс SSE Composite, рассчитываемый Shanghai Stock Exchange	SSE Composite	пункты
Индекс Dow Jones Industrial Average, рассчитываемый S&P Dow Jones indices	DJIA	пункты
Индекс NASDAQ Composite, рассчитываемый NASDAQ	NASDAQ	пункты

8. Количество единиц базового актива в 1 (одном) опционе: указывается Клиентом в поручении только в отношении базового актива в виде ценных бумаг, иностранной валюты или одной тройской унции аффинированного золота в слитках. Банк вправе установить требование в отношении минимального количества единиц базового актива в одном опционе, которое может быть указано Клиентом в поручении.

9. Количество опционов: указывается Клиентом в поручении. Банк вправе установить требование в отношении минимального количества опционов, которое может быть указано Клиентом в поручении.

10. Опционная премия: устанавливается Клиентом в поручении в рублях Российской Федерации. Оплачивается держателем не позднее рабочего дня, следующего за датой заключения контракта, за счет Клиента и не подлежит возврату.

11. Окончательная расчетная цена опциона (разница в цене базового актива): разница между рыночной ценой базового актива на дату исполнения опционного контракта и его ценой по условиям поручения. Определяется держателем по следующей формуле:

$P = P_{ц} - C_{и}$ (для опциона «колл»)

$P = C_{и} - P_{ц}$ (для опциона «пут»), где:

P – разница в цене базового актива;

$C_{и}$ – цена исполнения опциона, указанная в поручении Клиента;

$P_{ц}$ – рыночная цена базового актива, указанная в поручении Клиента и рассчитываемая на дату исполнения опциона.

При расчете окончательной расчетной цены базового актива в виде индекса 1 пункт = 1 рублю РФ.

12. Условия выплаты окончательной расчетной цены держателю/Клиенту:

12.1. уведомление держателем контрагента о намерении требовать выплату разницы в цене базового актива: по условиям соглашения между Банком и контрагентом заключенный опционный контракт является надлежащим уведомлением о намерении требовать выплаты, если Банк не уведомит контрагента об ином;

12.2. положительная разница между:

- рыночной ценой базового актива на дату исполнения опциона и ценой исполнения опциона (для опциона «колл»);

- ценой исполнения опциона и рыночной ценой базового актива на дату исполнения опциона (для опциона «пут»).

Если значение рыночной цены базового актива на дату исполнения опциона будет:

– меньше или равно цене исполнения опциона (для опциона «колл»);

– больше или равно цене исполнения опциона (для опциона «пут»),

обязательство контрагента по оплате держателю/Клиенту окончательной расчетной цены не возникает.

13. Порядок выплаты окончательной расчетной цены опциона Клиенту: зачисляется на счет Клиента не позднее 2 (двух) рабочих дней, следующих за датой получения Банком окончательной расчетной цены опциона от Контрагента. Выплата осуществляется только в рублях РФ. В случае, если базовым активом опциона является одна тройская унция аффинированного золота в слитках, то выплата осуществляется в рублях по курсу доллара США к рублю, установленному Банком России на дату исполнения опциона.

14. Определение рыночной цены базового актива:

14.1. для ценной бумаги: средневзвешенная цена ценной бумаги, рассчитываемая организатором торговли по результатам торгового дня на основании данных основных торгов организатора торговли на день определения рыночной цены.

В случае, если организатор торговли не осуществлял расчет средневзвешенной цены на основании данных основных торгов по результатам дня, на который определяется значение рыночной цены, то значение рыночной цены ценной бумаги определяется на основании средневзвешенной цены, рассчитанной организатором торговли по результатам предшествующего торгового дня на основании данных основных торгов организатора торговли.

В случае, если организатор торговли не осуществлял расчет средневзвешенной цены ценной бумаги на основании данных основных торгов по результатам предшествующего торгового дня, то значение рыночной цены ценной бумаги определяется на основании средневзвешенной цены, рассчитанной организатором торговли на основании данных основных торгов организатора торговли по результатам ближайшего предыдущего торгового дня по отношению ко дню, на который определяется значение рыночной цены ценной бумаги.

14.2. для индекса, рассчитываемого организатором торговли на основании совокупности цен на ценные бумаги (фондовых индексов): значение, рассчитываемое по формуле:

$$P = \frac{(X_{max} + X_{min})}{2}$$

P - значение рыночной цены индекса;

X_{max} – максимальное значение индекса, рассчитываемого организатором торговли по результатам торгового дня, на который определяется значение рыночной цены;

X_{min} - минимальное значение индекса, рассчитываемого организатором торговли по результатам торгового дня, на который определяется значение рыночной цены.

В случае если организатор торговли не осуществлял расчет максимального и/или минимального значений индекса по результатам дня, на который определяется значение рыночной цены индекса, то значение рыночной цены индекса определяется на основании максимального и минимального значений индекса, рассчитанных организатором торговли по результатам предшествующего дня.

В случае если организатор торговли не осуществлял расчет максимального и/или минимального значений индекса по результатам предшествующего дня, то значение рыночной цены индекса определяется на основании максимального и минимального значений индекса, рассчитанных организатором торговли по результатам ближайшего предыдущего дня по отношению ко дню, на который определяется значение рыночной цены индекса.

14.3. для одной тройской унции аффинированного золота в слитках: значение утреннего фиксинга на базовый актив на лондонском рынке наличного металла на дату определения значения рыночной цены (опубликованное по официальным данным «The London Gold Market Fixing Limited»), выраженное в долларах США за одну тройскую унцию.

Если на дату определения значения рыночной цены значение утреннего фиксинга на базовый актив не было установлено в вышеуказанном порядке, то значение рыночной цены базового актива определяется как ближайшее предыдущее значение фиксинга на базовый актив на лондонском рынке наличного металла (опубликованное по официальным данным «The London Gold Market Fixing Limited»), выраженное в долларах США за одну тройскую унцию.

14.4. для иностранной валюты: объявленный Центральным Банком Российской Федерации на день определения значения рыночной цены иностранной валюты официальный курс указанной иностранной валюты по отношению к рублю Российской Федерации, опубликованный на сайте Центрального Банка Российской Федерации www.cbr.ru.

14.5. для индекса S&P500, рассчитываемым Standard & Poor's Financial Services LLC: значение индекса S&P500, рассчитанное Standard & Poor's Financial Services LLC по результатам торгового дня, на который определяется значение рыночной цены индекса, опубликованное в информационной системе Reuters или на сайте Standard & Poor's Financial Services LLC (www.standardandpoors.com), выраженное в пунктах.

В случае, если Standard & Poor's Financial Services LLC не осуществляло расчет значения рыночной цены индекса S&P500 по результатам дня, на который определяется значение рыночной цены, то рыночная цена индекса определяется как значение индекса S&P500, рассчитанное Standard & Poor's Financial Services LLC по результатам ближайшего предшествующего дня, опубликованное в информационной системе Reuters или на сайте Standard & Poor's Financial Services LLC (www.standardandpoors.com), выраженное в пунктах. Дата определения значения рыночной цены индекса определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).

14.6. для индекса FTSE, рассчитываемого FTSE International Limited: значение индекса FTSE, рассчитанное FTSE International Limited по результатам торгового дня, на который определяется рыночная цена индекса, опубликованное в информационной системе Bloomberg (на странице UKX Index) или на сайте FTSE International Limited (www.ftse.com), выраженное в пунктах.

В случае, если FTSE International Limited не осуществляло расчет значения индекса FTSE по результатам дня, на который определяется рыночная цена индекса, то значение индекса определяется как значение индекса FTSE, рассчитанное FTSE International Limited по результатам ближайшего предшествующего дня, опубликованное в информационной системе Bloomberg на странице UKX Index) или на сайте FTSE International Limited (www.ftse.com), выраженное в пунктах. Дата определения значения рыночной цены индекса определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).

14.7. для индекса EuroStoxx50, рассчитываемого Stoxx Limited: значение индекса EuroStoxx50 рассчитанное Stoxx Limited по результатам торгового дня, на который определяется рыночная цена индекса, опубликованное в информационной системе Bloomberg (на странице SX5E Index) или на сайте Stoxx Limited (www.stoxx.com), выраженное в пунктах.

В случае если Stoxx Limited не осуществляло расчет значения индекса EuroStoxx50 по результатам дня, на который определяется рыночная цена индекса, то значение индекса определяется как значение индекса EuroStoxx50, рассчитанное Stoxx Limited по результатам ближайшего предшествующего дня, опубликованное в информационной системе Bloomberg на странице (на странице SX5E Index) или на сайте Stoxx Limited (www.stoxx.com), выраженное в пунктах. Дата определения значения рыночной цены индекса определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).

14.8. для индекса DAX, рассчитываемого Deutsche Borse AG: значение индекса DAX рассчитанное Deutsche Borse AG по результатам торгового дня, на который определяется рыночная цена индекса, опубликованное в информационной системе Bloomberg (на странице DAX Index) или на сайте Deutsche Borse AG (www.dax-indices.com), выраженное в пунктах.

В случае если Deutsche Borse AG не осуществляло расчет значения индекса DAX по результатам дня, на который определяется рыночная цена индекса, то значение индекса определяется как значение индекса DAX, рассчитанное Deutsche Borse AG по результатам ближайшего предшествующего дня, опубликованное в информационной системе Bloomberg на странице (на странице DAX Index) или на сайте Deutsche Borse AG (www.dax-indices.com), выраженное в пунктах. Дата определения значения рыночной цены индекса определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).

14.9. для индекса SSE Composite: значение индекса SSE Composite рассчитанное Shanghai Stock Exchange по результатам торгового дня, на который определяется значение рыночной цены индекса,

опубликованное в информационной системе Reuters или на сайте Shanghai Stock Exchange (www.sse.com.cn), выраженное в пунктах.

В случае, если Shanghai Stock Exchange не осуществляло расчет значения рыночной цены индекса SSE Composite по результатам дня, на который определяется значение рыночной цены, то рыночная цена индекса определяется как значение индекса SSE Composite, рассчитанное Shanghai Stock Exchange по результатам ближайшего предшествующего дня, опубликованное в информационной системе Reuters или на сайте Shanghai Stock Exchange (www.sse.com.cn), выраженное в пунктах. Дата определения значения рыночной цены индекса определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).

14.10. для индекса Dow Jones Industrial Average: значение индекса Dow Jones Industrial Average рассчитанное S&P Dow Jones indices по результатам торгового дня, на который определяется значение рыночной цены индекса, опубликованное в информационной системе Reuters или на сайте S&P Dow Jones indices (www.djindexes.com), выраженное в пунктах.

В случае, если S&P Dow Jones indices не осуществляло расчет значения рыночной цены индекса SSE Composite по результатам дня, на который определяется значение рыночной цены, то рыночная цена индекса определяется как значение индекса Dow Jones Industrial Average, рассчитанное S&P Dow Jones indices по результатам ближайшего предшествующего дня, опубликованное в информационной системе Reuters или на сайте S&P Dow Jones indices (www.djindexes.com), выраженное в пунктах. Дата определения значения рыночной цены индекса определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).

14.11. для индекса NASDAQ Composite: значение индекса NASDAQ Composite рассчитанное NASDAQ по результатам торгового дня, на который определяется значение рыночной цены индекса, опубликованное в информационной системе Reuters или на сайте NASDAQ (www.nasdaq.com), выраженное в пунктах.

В случае, если NASDAQ не осуществляло расчет значения рыночной цены индекса NASDAQ Composite по результатам дня, на который определяется значение рыночной цены, то рыночная цена индекса определяется как значение индекса NASDAQ Composite, рассчитанное NASDAQ по результатам ближайшего предшествующего дня, опубликованное в информационной системе Reuters или на сайте NASDAQ (www.nasdaq.com), выраженное в пунктах. Дата определения значения рыночной цены индекса определяется по среднему Гринвичскому времени (Greenwich Mean Time (GMT)).

Среднее Гринвичское время (Greenwich Mean Time (GMT)) рассчитывается следующим образом, с учетом установленного законодательством Российской Федерации порядком исчисления времени на территории Российской Федерации:

- московское время минус четыре часа - с даты, приходящейся на дату ежегодно осуществляемого перевода часовой стрелки на 1 час вперед (последнее воскресенье марта соответствующего года), до даты, приходящейся на дату, предшествующую дате ежегодно осуществляемого перевода часовой стрелки на 1 час назад (последнее воскресенье октября соответствующего года), включительно;

- московское время минус три часа - с даты, приходящейся на дату ежегодно осуществляемого перевода часовой стрелки на 1 час назад (последнее воскресенье октября соответствующего года), до даты, приходящейся на дату, предшествующую дате ежегодно осуществляемого перевода часовой стрелки на 1 час вперед (последнее воскресенье марта соответствующего года), включительно;

- московское время минус три часа - в случае если в соответствии с законодательством Российской Федерации перевод времени (часовой стрелки) не осуществляется.

Предупреждение:

Банк не несет ответственность за недостоверность, неполноту и/или несвоевременное отражение и/или обновление информации о значениях индексов, курсах валют, значений утреннего фиксинга на 1 (одну) тройскую унцию аффинированного золота в слитках, необходимой для определения значения рыночной цены базового актива в порядке, предусмотренном настоящей Спецификацией и опубликованной на сайтах организатора торговли, иных сайтах, указанных в настоящей Спецификации, и/или в информационной системе Reuters, а также за сбои в работе указанных сайтов и/или системы.

15. Ответственность держателя и контрагента (Сторон):

15.1. Каждая Сторона несет ответственность за убытки, причиненные ею другой Стороне в результате неисполнения или ненадлежащего исполнения обязанностей, предусмотренных контрактом.

15.2. Стороны несут ответственность за соблюдение конфиденциальности информации, ставшей известной в процессе исполнения контракта, в течение всего срока действия контракта, а также после его прекращения (расторжения), в соответствии с действующим законодательством Российской Федерации.

15.3. Сторона, виновная в разглашении конфиденциальной информации, возмещает другой Стороне понесенный в связи с этим разглашением ущерб в полном объеме.

15.4. Обязательства по контракту полностью прекращаются надлежащим исполнением контракта.

15.5. Контракт может быть расторгнут контрагентом в одностороннем порядке, в случае неисполнения либо ненадлежащего исполнения держателем/Клиентом обязательства по уплате опционной премии.

15.6. Контракт не может быть расторгнут держателем (в т.ч. по инициативе Клиента) в одностороннем порядке.

15.7. Ко всем правоотношениям, возникающим из контракта, в том числе в связи с его изменением, расторжением, неисполнением или ненадлежащим исполнением, или возникающим в связи с незаключенностью контракта, недействительностью контракта, подлежит применению законодательство Российской Федерации, иные нормативные правовые акты Российской Федерации.

Настоящая Спецификация является приложением к Поручению Клиента

№ _____ от « ____ » _____ 20 ____ г.

Клиент:

«.....».....20....г. ____ ч. ____ мин.

.....
Фамилия, инициалы и подпись Клиента /представителя Клиента