

## УСЛОВИЯ ОБСЛУЖИВАНИЯ НА РЫНКЕ СТАНДАРТИЗИРОВАННЫХ ПРОИЗВОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ (СПФИ)

1. Настоящее Приложение к Регламенту брокерского обслуживания и оказания сопутствующих услуг Акционерного общества Финансовое ателье ГроттБьерн (далее – «Регламент») содержит существенные условия обслуживания Клиента на рынке стандартизированных производных финансовых инструментов (СПФИ) ПАО Московская Биржа, и вступает в силу с момента выбора Клиентом в Заявлении на обслуживание (Приложение №7 к Регламенту) соответствующих пунктов об открытии счёта и/или выборе тарифного плана.

2. Акцептуя настоящие Условия, Клиент подтверждает факт ознакомления с Правилами Торгов и Правилами клиринга (в том числе с внутренними документами ПАО Московская Биржа, клиринговой организации и решениями уполномоченных органов Биржи и клиринговой организации), касающихся организации торгов, подачи заявок и (или) Предложений на сделки, заключение сделок и расчёт по ним на Рынке СПФИ.

3. Настоящим Брокер уведомляет Клиента о возможном внесении изменений в Правила торгов и клиринга на рынке СПФИ (Далее – «Правила»). С целью обеспечения гарантированного ознакомления Клиентов до вступления в силу изменений в Правил, настоящими Условиями установлена обязанность Клиента не реже одного раза в неделю самостоятельно или через уполномоченных лиц обращаться на официальный WEB-сайт Биржи ([www.moex.com](http://www.moex.com)) и клиринговой организации ([www.nationalclearingcentre.ru](http://www.nationalclearingcentre.ru)), за сведениями об изменениях, произведенных в Правилах (Биржи и (или) Клиринговой организации).

4. Клиент соглашается, что может использовать полученную от Биржи и/или Брокера и/или Клиринговой организации информацию о ценах только для целей совершения сделок на рынке СПФИ.

5. Клиент и Брокер соглашаются с тем, что обслуживание Клиента на рынке СПФИ содержит дополнительные права и обязательства, применимые к Клиенту и Брокеру в том числе, но не ограничиваясь:

**5.1.** Если у Клиента к моменту окончания основной Торговой или клиринговой сессии дня Т (определяется Правилами) существует нетто-позиция на покупку/продажу (поставку) соответствующих инструментов или Активов, и/или Клиент не обеспечил за три часа до начала расчётов по соответствующим инструментам наличие Активов в количестве достаточном для исполнения обязательств, в соответствии с настоящими Условиями, Брокер вправе без предварительного уведомления Клиента предпринять по своему усмотрению за счёт и в интересах Клиента одно или несколько из следующих действий, исходя из сложившейся рыночной ситуации:

**5.1.1.** Перенести позицию Клиента, осуществив одно или несколько действий по усмотрению Брокера путем заключения сделки (сделок) на любом рынке, на котором Брокер осуществляет обслуживание Клиентов:

**5.1.1.1.** на продажу/покупку соответствующих инструментов, в объёме соответствующем нетто-позиции;

**5.1.1.2.** типа СВОП;

**5.1.1.3.** иного типа для переноса позиции Клиента.

**5.1.2.** Исполнить обязательства Клиента осуществив одно или несколько действий по усмотрению Брокера путем заключения сделки (сделок):

**5.1.2.1.** типа РЕПО с имеющимися Активами Клиента;

**5.1.2.2.** продажи принадлежащих Клиенту Активов (и/или закрытия открытых позиций) на валютном рынке и рынке ДМ, фондовом, срочном и/или иных финансовых рынках;

**5.1.2.3.** иного типа для исполнения обязательств Клиента.

**5.2.** Брокер имеет право:

**5.2.1.** Не принимать поручения Клиента на сделки по инструментам с датой расчёта в текущий день, если соответствующие поручения были поданы менее чем за 30 минут до окончания торговой сессии и/или начала клиринговой сессии;

**5.2.2.** Отозвать поручения Клиента на сделки по инструментам с датой расчёта в текущий день, если на Брокерском счёте Клиента будет недостаточно денежных средств в соответствующей валюте для полного исполнения обязательств, которые могут возникнуть по указанным поручениям.

**6.** Брокер заключает соответствующие сделки, предусмотренные п.5 настоящих Условий, с активами Клиента в безакцептном порядке, без предварительного уведомления Клиента. Брокер по своему усмотрению определяет инструмент, направление сделки (покупка, продажа), объем активов, контрагента, цены сделок, место и момент реализации активов Клиента, если иное не определено настоящими Условиями.

**7.** Брокер контролирует размер свободных денежных средств (СДС) Клиента как рублёвую оценку денежных средств (ДС), учитываемых по счёту Клиента на рынке СПФИ с учётом имеющихся у Клиента требований/обязательств по исполнению ранее заключённых сделок, комиссий, подлежащих уплате и/или иных планируемых выбытий Активов, а также открытых позиций по производным финансовым инструментам (ПФИ). Стороны договорились, что переоценка иностранной валюты и требований/обязательств по получению/поставке иностранной валюты производится Брокером с учётом применяемых последним риск-параметров: дисконтирующих/премиальных коэффициентов, устанавливаемых Брокером, центральных курсов валют, определяемых Клиринговой организацией, гарантийных переводов и иных параметров, предусмотренных Биржей и Клиринговой организацией и/или внутренними документами Брокера.

**8.** Брокер обязан исполнять Поручения Клиента на совершение сделки с иностранной валютой и ДМ при условии, что СДС Клиента больше нуля и/или исполнение поручения Клиента не приведет к снижению уровня СДС Клиента ниже нуля.

**9.** Стороны договорились, что СДС Клиента, а также требуемое по Правилам гарантийное обеспечение рассчитываются:

**9.1.** По методикам, предусмотренным Правилами;

**9.2.** С учётом дополнительного обеспечения, устанавливаемого решением Брокера;

**9.3.** Брокер рекомендует Клиенту поддерживать на брокерском счете остаток денежных средств в размере не менее 20% от объема Открытых позиций Клиента за вычетом денежных средств, предназначенных для расчетов по сделкам с финансовыми инструментами.

**10.** Брокер обеспечивает Клиенту в торговые часы доступ к информации о текущем значении СДС Клиента в электронном виде с использованием специальных программно-технических средств.

**11.** В случае если в результате исполнения Поручений Клиента, либо изменения рыночной ситуации, либо иных причин уровень СДС Клиента станет меньше нуля (требуемое Клиринговой организацией гарантийное обеспечение с учётом дисконтирующих/премиальных коэффициентов, установленных Брокером, превысит оценочную стоимость Активов Клиента), Брокер вправе требовать увеличения уровня СДС, а Клиент обязан исполнить требование в срок до 17.00 по московскому времени, либо до окончания торговой сессии, в ходе которой уровень СДС стал ниже нуля, если событие наступило после 17.00. Брокер вправе по своему усмотрению требовать от Клиента увеличить уровень СДС как в более длительный, так и более короткий срок. При этом Брокер и Клиент соглашаются, что Клиент, в случае снижения СДС Клиента ниже нуля, не дожидаясь увеличения уровня СДС за счёт действий Клиента, условно поручил Брокеру выполнить, по усмотрению последнего, одно или несколько действий:

**11.1.** Предоставить Клиенту возможность использования пониженных требований к уровню СДС, уплатив при этом плату, предусмотренную Тарифами (Приложение №3), которая исчисляется, исходя из суммы отрицательного значения СДС, которые

образовались по итогу операционного дня на брокерском счёте Клиента в секции Валютного рынка и рынка драгоценных металлов, требуемого ТС, и/или

**11.2.** Совершить на любом рынке, на котором Брокер обслуживает клиентов, одну или несколько сделок любого типа по усмотрению Брокера, исходя из рыночной ситуации, направленных на повышение уровня СДС Клиента до положительного значения (уменьшить размер требуемого гарантийного обеспечения), в том числе, но не ограничиваясь, совершив закрывающие и (или) балансирующие сделки и/или

**11.3.** Совершить действия, направленные на аннулирование/отмену, полностью или частично, одного или нескольких ранее заключённых Клиентом договоров на рынке СПФИ, согласовав от имени Клиента размер неустойки, подлежащей уплате за счёт Клиента второй стороне по аннулируемым/отменяемым договорам.

**12.** В случае выхода Клиента на расчёт (промежуточный расчёт) по сделкам при отсутствии достаточного количества соответствующей валюты для исполнения своих обязательств (далее – «Дефолт»), Клиент:

**12.1.** Условно поручает Брокеру совершить любые действия, направленные на вывод Клиента из состояния дефолта, при этом Клиент соглашается с тем, что в действия Брокера могут сопровождаться дополнительными затратами, которые Клиент обязуется компенсировать в полном объеме, и выполняться на условиях, отличающихся от рыночных;

**12.2.** Обязуется уплатить штраф в размере десяти ключевых ставок Банка России, исходя из суммы, недостаточной для исполнения обязательств.

**13.** Брокер заключает соответствующие сделки, предусмотренные пунктами 11-12 настоящих Условий, с Активами Клиента, учитываемых в секторе Рынка СПФИ, так и в других секторах финансовых рынков, в безакцептном порядке, без предварительного уведомления Клиента. Брокер по своему усмотрению определяет инструмент, направление сделки (покупка, продажа), объем активов, контрагента, цены сделок, место и момент реализации активов Клиента, если иное не определено настоящими Условиями.

**14.** Риски возникновения возможных убытков, недополучения прибыли или любые иные риски в случае заключения Компанией сделок, предусмотренных пунктами 5, 11 и 12 настоящих Условий, Клиент принимает на себя. За совершение действий (и сопряженных с ними действий), указанных в настоящем пункте, Клиент уплачивает вознаграждение, предусмотренное в Тарифах.

**15.** Клиент и Брокер соглашаются с тем, что действия, предусмотренные пунктами 5, 11, 12 настоящих Условий, являются правом, а не обязанностью Брокера. В случае невыполнения указанных действий Клиринговая организация самостоятельно осуществляет действия, направленные на понижение требуемого уровня гарантийного обеспечения, закрытия позиций Клиента и т.д., что предусмотрено соответствующими Правилами клиринга. При этом в случае, если совершение Брокером и (или) Клиринговой организацией указанных действий, приведет к дополнительным затратам, которые Брокер будет вынужден покрыть за свой счёт, то Клиент обязуется компенсировать: понесённые Брокером затраты, компенсировать полученные убытки (прямые и косвенные), выплатить штраф в размере десяти ключевых ставок Банка России, а также неустойку в размере 0,1% годовых на сумму полученных брокером убытков (понесённых затрат, которые невозможно компенсировать за счёт Клиента в безакцептном порядке).

**16.** Клиент и Брокер соглашаются с тем, что действия, предусмотренные пунктом 11.3 Настоящих Условий, с учётом пунктов 12-15, Брокер вправе применить в ситуации, когда последнему стало известно о совершении (или намерении совершить) Клиентом действия гражданско-правового характера, совершение которых сделает невозможным исполнение Клиентом обязательств по заключённым договорам.

**17.** Особенности учёта позиций и Активов Клиента на Рынке СПФИ:

**17.1.** При регистрации на Рынке СПФИ Брокер открывает Клиенту один или несколько клиринговых регистров, предусмотренных Правилами, для учёта открытых контрактов, денежных средств, требований и обязательств;

**17.2.** Открытие и закрытие Брокером клиринговых регистров Клиента на Рынке СПФИ производится без специальных поручений Клиента;

- 17.3.** Брокер вправе заключать сделки с типом OIS на отдельном клиринговом регистре, отдельно от остальных контрактов;
- 17.4.** Учет гарантийного обеспечения, позиций, требований и обязательств, расчёты, начисление и списание вариационной и (или) депозитной маржи, начисление и удержание процентов, производится в разрезе каждого клирингового регистра;
- 17.5.** Брокер вправе переводить денежные средства Клиента между клиринговыми регистрами Клиента на Рынке СПФИ без предварительного согласования с последним и без специального поручения на перевод Активов
- 18.** Клиент и Брокер соглашаются с тем, что Отчёт Брокера об операциях является подтверждением совершения Брокером соответствующих сделок, предусмотренных настоящими Условиями, на основании соответствующих Поручений / Предложений Клиента. Клиент подтверждает подачу указанных поручений / предложений в порядке, установленном Регламентом.
- 19.** Соглашаясь с настоящими Условиями, Клиент подтверждает, что:
  - 19.1.** Ему разъяснены и понятны риски совершения операция на Рынке СПФИ, включая, но, не ограничиваясь рисками, указанными в Приложении №1 к Регламенту, в том числе риски, возникающие в связи с заключением договоров, являющихся ПФИ, с центральным контрагентом на внебиржевом рынке, а также дополнительные риски, связанные с ограничениями работы на Рынке СПФИ, и Клиент принимает такие риски на себя;
  - 19.2.** Клиент ознакомлен с паспортами финансовых инструментов, с которыми производятся операции на Рынке СПФИ, размещенными Брокером на сайте в сети Интернет [www.grottbjorn.com](http://www.grottbjorn.com);
  - 19.3.** Клиент ознакомлен с тем, что риски, связанные с финансовыми инструментами на Рынке СПФИ, не подлежат страхованию в соответствии с Федеральным законом от 23 декабря 2003 года № 177-ФЗ «О страховании вкладов физических лиц в банках Российской Федерации», а доход по операциях с ПФИ на Рынке СПФИ не является гарантированным.