

## Условия и порядок совершения сделок репо на внебиржевом рынке

### СТАТЬЯ 1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1.1. Настоящее Приложение определяет условия и порядок совершения ООО «ИК «Гелиус Капитал» от своего имени и за счет клиента внебиржевых сделок репо (далее по тексту настоящего Приложения именуемых «Сделки», «Сделки Репо»), а также условия таких Сделок Репо. Совершение в интересах клиента сделок Репо на организованном рынке осуществляется в соответствии с иными положениями Регламента.

1.2. Если принятым ООО «ИК «Гелиус Капитал» Поручением на совершение Сделки Репо не предусмотрено иное, Поручение на совершение Сделки Репо исполняется путем совершения сделки на условиях настоящего Приложения. ООО «ИК «Гелиус Капитал» не гарантирует исполнение Поручений на совершение Сделок Репо.

1.3. В части, неурегулированной настоящим Приложением и Поручением на заключение Сделки Репо, ООО «ИК «Гелиус Капитал», вправе определять условия сделок по своему усмотрению.

1.4. ООО «ИК «Гелиус Капитал» вправе в соответствии со статьями 996 и 359 Гражданского кодекса Российской Федерации удерживать средства клиента в обеспечение требований по резервированию клиентом средств, предназначенных для исполнения Второй части Репо в течение всего Срока Репо.

1.5. Услуги ООО «ИК «Гелиус Капитал» в связи с заключением Сделок на основании настоящего Приложения оплачиваются в соответствии с Приложением 23 к Регламенту.

### СТАТЬЯ 2. ТЕРМИНЫ И ОПРЕДЕЛЕНИЯ

2.1. Если иное не оговорено специально, применительно к заключаемым за счет клиента Сделкам Репо, а также отношениям между клиентом и ООО «ИК «Гелиус Капитал» в связи с заключением и исполнением таких Сделок, применяются следующие определения основных терминов:

**База начисления процентов** - для сделок в российских рублях - фактическое количество дней в году (365 или 366); для сделок в иностранных валютах - 360 дней.

**Валюта расчетов** - валюта, в которой исполняются платежные обязательства по Сделке.

**Валюта Сделки** - валюта, в которой заключена Первая часть Репо и рассчитываются суммы обязательств по Сделке.

**Верхняя переоценка** - установленный настоящим Приложением и Условиями Сделки порядок, в соответствии с которым Контрагент имеет право одним из приведенных в данном Приложении способов произвести переоценку обязательств по Второй части Репо.

Верхняя переоценка производится в целях снижения риска неисполнения Первоначальным покупателем обязательства по продаже Ценных бумаг по Второй части Репо.

Случай Верхней переоценки наступает, если в течение Срока Репо Текущий уровень премии достигает значения или становится меньше Уровня минимально допустимой премии.

**Дата выкупа** - дата, в которую Первоначальный продавец обязуется перечислить Сумму выкупа за Ценные бумаги по Второй части Репо Первоначальному покупателю.

Если Дата выкупа не является Рабочим днем, то Датой выкупа будет считаться следующий Рабочий день.

**Дата исполнения Второй части Репо** - дата, в которую фактически исполняется наиболее позднее по времени исполнения обязательство (по поставке или по оплате) по Второй части Репо.

**Дата исполнения Открытого Репо** - дата, в которую должны быть исполнены обязательства по второй части Открытого Репо в случае, если требование об исполнении обязательств по второй части Открытого Репо (далее - «Требование об исполнении Открытого Репо») не было ранее предъявлено.

Дата исполнения Открытого Репо отстоит от Даты исполнения Первой части Репо на 364 дня.

**Дата исполнения Первой части Репо** - дата, в которую фактически исполняется наиболее позднее по времени исполнения обязательство (по поставке или по оплате) по Первой части Репо.

**Дата покупки** - дата, в которую Первоначальный покупатель обязуется перечислить Сумму покупки Первоначальному продавцу.

Если Дата покупки, о которой договорились Стороны, не является Рабочим днем, то Датой покупки будет считаться следующий Рабочий день.

**Дата поставки по Второй части Репо** - дата, когда Первоначальный покупатель обязуется перевести Первоначальному продавцу Ценные бумаги по Второй части Репо.

Если Дата поставки, не является Рабочим днем, то Датой поставки будет являться следующий Рабочий день.

**Дата поставки по Первой части Репо** - дата, когда Первоначальный продавец обязуется перевести Первоначальному покупателю Ценные бумаги по Первой части Репо.

Если Дата поставки не является Рабочим днем, то Датой поставки будет являться следующий Рабочий день.

**Дисконт/Премия** - Разница между Текущей рыночной ценой Ценных бумаг и ценой Ценных бумаг по Первой части Репо, выраженная в процентах.

**Количество Ценных бумаг** - количество Ценных бумаг, передаваемых по каждой из частей Репо. Количество Ценных бумаг по Сделке может исчисляться в штуках или определяться как их общая номинальная стоимость, если количество Ценных бумаг конкретного вида, и/или выпуска, и/или серии в соответствии с условиями выпуска или обычаями делового оборота при их обращении определяется как сумма их номиналов.

**Контрагент** - выбранное ООО «ИК «Гелиус Капитал» по своему усмотрению третье лицо, с которым ООО «ИК «Гелиус Капитал» заключило Сделку Репо от своего имени и за счет клиента. Клиент соглашается с тем, что в качестве Контрагента может выступать ООО «ИК «Гелиус Капитал», действующее за счет другого клиента.

**НКД** - накопленный на конкретную дату процентный (купонный) доход на одну Ценную бумагу.

НКД рассчитывается в Валюте Сделки или процентах от номинала в соответствии с условиями выпуска Ценных бумаг или с условиями, удостоверенными самой Ценной бумагой.

В случае если на Ценные бумаги, являющиеся объектом сделки, не начисляется НКД, в формулы, приведенные в настоящем Приложении для расчета сумм денежных обязательств Сторон и других показателей по таким Сделкам, вместо НКД и/или сумм НКД подставляется ноль.

**Нижняя переоценка** - установленный настоящим Приложением и Условиями Сделки порядок, в соответствии с которым Контрагент имеет право одним из приведенных в данном Приложении способов произвести переоценку обязательств по Второй части Репо.

Нижняя переоценка производится в целях снижения риска неисполнения Первоначальным продавцом обязательства по выкупу Ценных бумаг. Случай Нижней переоценки наступает, если в течение Срока Репо Текущий уровень дисконта достигает значения или становится меньше Уровня минимально допустимого дисконта.

**Открытое Репо** - Сделка Репо, при совершении которой Стороны согласовали, что обязательства по Второй части Репо могут быть исполнены в любой день до Даты исполнения Открытого Репо при условии предъявления Требования об исполнении Открытого Репо.

**Первоначальный Покупатель** - покупатель по Первой части Репо.

**Первоначальный Продавец** - продавец по Первой части Репо.

**Поручение на совершение Сделки Репо** - документ, направляемый клиентом одним из способов, предусмотренных Регламентом, содержащий все существенные условия заключаемой Сделки. Под Поручениями на совершение Сделок Репо в тексте настоящего Приложения понимаются исключительно поручения на совершение Сделки Репо, которые должны исполняться на внебиржевом рынке.

**Рабочий день** -

а) для целей заключения Сделок, обмена информацией - календарный день, кроме официально установленных выходных и праздничных дней в Российской Федерации, а также выходных дней, перенесенных на рабочие дни в соответствии с Действующим законодательством;

б) для целей расчетов по Сделкам - день и время, в которые организации (юридические лица), уполномоченные осуществлять платежи и переводы Ценных Бумаг по соответствующей Сделке Репо, открыты для проведения указанных операций, и одновременно удовлетворяющие условиям пункта «а».

**Срок Репо** - в отношении каждой конкретной Сделки Репо означает период времени в календарных днях между Датой исполнения Первой части Репо и Датой исполнения по Второй части Репо.

Срок Репо исчисляется со дня, следующего за Датой исполнения Первой части Репо (включительно), по Дату исполнения Второй части Репо включительно. Для Сделки Репо, Первая и Вторая части которой исполняются в один день, Срок Репо принимается равным одному дню.

Срок Репо, в том числе Открытого Репо, не может превышать 1 год.

**Ставка Репо** - величина, выраженная в процентах годовых, и используемая для расчета взаимных обязательств Первоначального продавца и Первоначального покупателя по Второй части Репо.

**Стороны Сделки** - действующее за счет и в интересах клиента ООО «ИК «Гелиус Капитал» и Контрагент, с которым ООО «ИК «Гелиус Капитал» заключило Сделку Репо. Каждая из Сторон Сделки может выступать как в качестве Первоначального покупателя, так и в качестве Первоначального продавца.

**Сумма выкупа** - сумма денежных средств, подлежащая уплате Первоначальным продавцом Первоначальному покупателю при исполнении обязательств по Второй части Репо, рассчитываемая по формуле [I] Дополнения 1 к настоящему Приложению.

**Сумма покупки** - сумма денежных средств, подлежащая уплате Первоначальным покупателем Первоначальному продавцу при исполнении обязательств по Первой части Репо.

**Текущая сумма выкупа** - Сумма выкупа, которая может быть рассчитана Контрагентом по формуле [III] Дополнения 1 к настоящему Приложению в любой день в течение Срока Репо.

**Текущая рыночная цена** - стоимость Ценных бумаг, принимаемая для расчетов в случаях, предусмотренных настоящим Приложением определяемая в соответствии с пунктом 4.3 настоящего Приложения.

**Уровень минимально допустимого дисконта или минимально допустимой премии** - определяемая условиями Сделки величина для целей определения наступления случая Верхней или Нижней переоценки. Случай Верхней/Нижней переоценки наступает, если в течение Срока Репо рассчитанный в соответствии с дополнением 1 к настоящему Приложению Текущий уровень дисконта/Текущий уровень премии достигает значения или становится меньше Уровня минимально допустимого дисконта.

**Уровень расторжения** - определяемая на основании условий Сделки величина для целей определения наступления условий, при которых Контрагент вправе расторгнуть Сделку в одностороннем порядке. Если иное не установлено Поручением на совершение Сделки Репо, Уровень расторжения равен Уровню минимально допустимого дисконта или Уровню минимально допустимой премии, уменьшенному на 5 (пять) процентов.

**Условия Сделки** - условия договора Репо, заключенного за счет клиента между ООО «ИК «Гелиус Капитал» и Контрагентом на основании Поручения клиента. Если иное не согласовано между ООО «ИК «Гелиус Капитал» и клиентом, Условия Сделки не должны противоречить условиям настоящего Приложения.

**Цена по Первой части Репо** - цена одной Ценной бумаги или иной единицы исчисления Количества Ценных бумаг по Первой части Репо (без учета НКД).

**Цена по Второй части Репо** - цена одной Ценной бумаги или иной единицы исчисления Количества Ценных бумаг по Второй части Репо (без учета НКД), рассчитываемая по формуле [II] Дополнения 1 к настоящему Приложению.

**Ценные бумаги** - ценные бумаги, являющиеся предметом купли-продажи по Первой и Второй частям одной Сделки Репо.

### **СТАТЬЯ 3. ПОРЯДОК ЗАКЛЮЧЕНИЯ СДЕЛКИ И РЕЗЕРВИРОВАНИЕ**

3.1. ООО «ИК «Гелиус Капитал» принимает от клиента Поручение на совершение Сделки Репо, в котором клиент указывает все существенные условия Сделки.

3.2. ООО «ИК «Гелиус Капитал» подбирает Контрагента для заключения Сделки в соответствии с условиями Поручения на совершение Сделки и настоящего Приложения, после чего заключает с Контрагентом Сделку от своего имени и за счет клиента. ООО «ИК «Гелиус Капитал» выбирает Контрагента по своему усмотрению в соответствии с принятыми ООО «ИК «Гелиус Капитал» критериями надежности.

3.3. В случае если ООО «ИК «Гелиус Капитал» не находит Контрагента в течение срока действия Поручения на совершение Сделки Репо, данное Поручение считается отменным по причине невозможности его исполнения, при этом ООО «ИК «Гелиус Капитал» не несет ответственности за неисполнение Поручения на совершение Сделки Репо.

3.4. ООО «ИК «Гелиус Капитал» в соответствии со своими внутренними процедурами обязано убедиться в надежности Контрагента, в частности, ООО «ИК «Гелиус Капитал» обязано на основе письменных документов удостовериться в том, что потенциальный Контрагент имеет существенный опыт работы на рынке ценных бумаг при отсутствии известных фактов неисполнения каких-либо сделок.

3.5. К существенным условиям Сделки относятся:

3.5.1. В качестве кого (Первоначального продавца или Первоначального покупателя) по Сделке должно выступать действующее за счет клиента ООО «ИК «Гелиус Капитал» (направление Сделки);

3.5.2. Наименование Ценных бумаг, являющихся объектом Сделки;

3.5.3. государственный регистрационный номер выпуска, а также иные реквизиты (наименование эмитента, тип, форма и др.), однозначно идентифицирующие соответствующую Ценную бумагу;

3.5.4. Количество Ценных бумаг;

3.5.5. Текущая рыночная цена Ценных бумаг на дату Первой части Репо в Валюте Сделки;

3.5.6. НКД на Дату поставки по Первой части Репо (при наличии);

3.5.7. Цена по Первой части Репо;

3.5.8. Сумма покупки;

3.5.9. Валюта Сделки;

3.5.10. Валюта расчетов и применимый курс конверсии (в случае если Валюта Сделки отличается от Валюты расчетов);

3.5.11. Дата покупки;

3.5.12. Дата поставки Ценных бумаг по Первой части Репо;

3.5.13. Ставка Репо;

3.5.14. Дисконт/Премия;

3.5.15. Дата выкупа;

3.5.16. Дата поставки Ценных бумаг по Второй части Репо;  
3.5.17. Уровень минимально допустимого дисконта/премии;  
Стороны совершают Открытое Репо в случае, если Дата выкупа, предусмотренная п.3.5.15, и Дата поставки Ценных бумаг по Второй части РЕПО, предусмотренная п.3.5.16, определяются моментом востребования.

3.6. Помимо существенных условий в Поручении на совершение Сделки Репо указываются:

3.6.1. Срок действия Поручения;

3.6.2. Уникальный код клиента/номер брокерского счета.

3.7. Форма Поручения на совершение Сделки Репо содержится в Дополнении 2 к настоящему Приложению.

3.8. Расходы, связанные с перерегистрацией Ценных бумаг, несет Сторона, со счета которой списываются Ценные бумаги.

3.9. Клиент обязуется обеспечить со своей стороны возможность проведения расчетов по каждой совершенной в его интересах Сделке Репо, в том числе обеспечить наличие свободного от обременений соответствующего актива (т.е. денежных средств или Ценных бумаг), доступного для проведения расчетов в день исполнения каждой из частей Репо. В случае невыполнения обязанности, предусмотренной настоящим пунктом, клиент обязуется выплатить все убытки и неустойки, связанные с неисполнением заключенной в его интересах Сделки.

3.10. Если на начало Рабочего дня, в который за счет клиента должна быть исполнена Вторая часть Репо на брокерском счете клиента отсутствуют необходимые для исполнения Второй части Репо активы (денежные средства или соответствующие ценные бумаги), ООО «ИК «Гелиус Капитал» вправе предложить Контрагенту расторгнуть Вторую часть Репо.

3.11. Если Первоначальным продавцом является действующее за счет клиента ООО «ИК «Гелиус Капитал», а планируемый день выплаты купонного дохода эмитентом Ценных бумаг наступает после Даты выкупа, то, в целях обеспечения исполнения предусмотренных пунктом 4.1.9.4 обязательств Первоначального продавца по возврату суммы купонного дохода (в случае невыплаты купонного дохода эмитентом), ООО «ИК «Гелиус Капитал» блокирует на брокерском счете клиента денежные средства. Денежные средства блокируются в размере, равном размеру купонного дохода, на который была уменьшена Сумма выкупа. Блокирование денежных средств на счете клиента устанавливается в момент поступления Суммы выкупа Контрагенту и снимается при исполнении эмитентом своих обязательств по выплате купонного дохода за соответствующий купонный период. В случае частичного исполнения обязательств Эмитентом, происходит разблокирование части удерживаемых денежных средств, пропорционально объему частично исполненных эмитентом обязательств по выплате НКД соответствующего купонного периода. В случае неисполнения эмитентом своих обязательств по выплате купонного дохода в установленный эмиссионными документами срок, заблокированная сумма подлежит списанию с брокерского счета клиента в пользу Контрагента. Клиент не вправе каким-либо образом распоряжаться заблокированными в соответствии с настоящим подпунктом денежными средствами.

#### **СТАТЬЯ 4. УСЛОВИЯ СДЕЛКИ РЕПО**

4.1. Если иное не оговорено согласованным с ООО «ИК «Гелиус Капитал» Поручением на совершение сделки Репо, данное Поручение предполагает совершение за счет клиента сделки, содержащей, в том числе, следующие условия:

4.1.1. В случае неисполнения (полного или частичного) эмитентом Ценных бумаг (далее - «Эмитентом») своих обязательств по каким-либо размещенным Эмитентом ценным бумагам, Контрагент, являющийся Первоначальным покупателем, вправе, направив Первоначальному продавцу уведомление, в одностороннем порядке изменить Дату выкупа и Дату поставки по Второй части Репо. При этом Сумма выкупа определяется в соответствии с пунктами [IIIa]/[IIIb] Дополнения 1 к настоящему Приложению, а Дата выкупа и Дата поставки по Второй части Репо переносятся на даты, указанные в направленном Контрагентом уведомлении.

4.1.2. Контрагент вправе без объяснения причин потребовать в одностороннем порядке досрочного исполнения Второй части Репо, при этом Сумма выкупа определяется в соответствии с пунктами IIIa/IIIb Дополнения 1 к настоящему Приложению, а Дата выкупа и Дата поставки по Второй части Репо переносятся на даты, указанные в уведомлении.

4.1.3. Для целей снижения риска неисполнения обязательства по оплате Ценных бумаг по Второй части Репо или обязательства по поставке Ценных Бумаг по Второй части Репо, Контрагент, в случае наступления условий, предусмотренных п.4.1.4.1. и п.4.1.5.1. настоящего Приложения, в одностороннем порядке может провести Нижнюю или Верхнюю переоценку обязательств по соответствующей Сделке. О проведении Верхней/Нижней переоценки, а также об изменении Условий Сделки в связи с проведением Верхней/Нижней переоценки ООО «ИК «Гелиус Капитал» уведомляет клиента посредством системы Электронного документооборота по факту проведения Верхней/Нижней переоценки Контрагентом.

4.1.4. Нижняя переоценка.

4.1.4.1. Случай Нижней переоценки наступает, если в течение Срока Репо Текущий уровень дисконта достигает значения или становится меньше Уровня минимально допустимого дисконта. Текущий уровень дисконта рассчитывается по формуле [IVa] Дополнения 1.

4.1.4.2. При наступлении случая Нижней переоценки Контрагент вправе в одностороннем порядке потребовать досрочного исполнения Второй части Репо, направив в адрес ООО «ИК «Гелиус Капитал» (Первоначальному продавцу) уведомление о проведении Нижней переоценки. При этом определенные Условиями Сделки Дата выкупа и Дата поставки по Второй части Репо переносятся на даты, указанные в направляемом в адрес ООО «ИК «Гелиус Капитал» уведомлении, а Сумма выкупа считается равной Текущей сумме выкупа, определенной по формуле [IIIa] Дополнения 1 к настоящему Приложению на измененную в соответствии с уведомлением Дату выкупа.

4.1.4.3. При наступлении случая Нижней переоценки Контрагент помимо указанного в пункте 4.1.4.2 уведомления вправе направить в адрес ООО «ИК «Гелиус Капитал» также оферту о заключении новой Сделки Репо. Оферта должна содержать предложение о заключении новой Сделки на тех же существенных условиях, что и Сделка, обязательства по которой должны быть досрочно исполнены в связи с наступлением случая Нижней переоценки, за исключением:

- Даты покупки и Даты поставки по Первой части Репо, которые принимаются равными Дате выкупа и Дате поставки, указанным в уведомлении о проведении Нижней переоценки, а также
- Суммы покупки, которая принимается равной Сумме новой сделки Репо, рассчитанной на измененную Дату выкупа по формуле [Va] Дополнения 1 к настоящему Приложению.

При получении оферты о заключении новой Сделки Репо в соответствии с настоящим подпунктом, ООО «ИК «Гелиус Капитал» передает содержание данной оферты клиенту. В случае согласия клиента на заключение новой Сделки Репо, выраженного в подаче поручения на заключение новой Сделки Репо на предложенных Контрагентом условиях, ООО «ИК «Гелиус Капитал» акцептует оферту Контрагента и заключает новую Сделку Репо, Офертой Контрагента может быть установлен срок для ее акцепта.

4.1.4.4. В случае если к 17.00 указанной в уведомлении о проведении Нижней переоценки Даты выкупа по Второй части Репо денежных средств на брокерском счете клиента недостаточно для исполнения второй части Репо, ООО «ИК «Гелиус Капитал», в целях недопущения возникновения обязанности по возмещению за счет клиента убытков Контрагенту и уплаты за счет клиента неустоек, обязано предложить Контрагенту расторгнуть Вторую часть Сделки Репо.

#### 4.1.5. Верхняя переоценка.

4.1.5.1. Случай Верхней переоценки наступает, если в течение Срока Репо Текущий уровень премии достигает значения или становится меньше Уровня минимально допустимой премии. Текущий уровень премии рассчитывается по формуле [IVb] Дополнения 1.

4.1.5.2. При наступлении случая Верхней переоценки Контрагент вправе в одностороннем порядке потребовать досрочного исполнения Второй части Репо, направив в адрес ООО «ИК «Гелиус Капитал» (Первоначальному покупателю) уведомление о проведении Верхней переоценки. При этом определенные Условиями Сделки Дата выкупа и Дата поставки по Второй части Репо переносятся на даты, указанные в направляемом в адрес ООО «ИК «Гелиус Капитал» уведомлении, а Сумма выкупа считается равной Текущей сумме выкупа, определенной по формуле [IIIb] Дополнения 1 к настоящему Приложению на измененную в соответствии с уведомлением Дату выкупа.

4.1.5.3. При наступлении случая Верхней переоценки Контрагент помимо указанного в пункте 4.1.5.2 уведомления вправе направить в адрес ООО «ИК «Гелиус Капитал» также оферту о заключении новой Сделки Репо. Оферта должна содержать предложение о заключении новой Сделки на тех же существенных условиях, что и Сделка, обязательства по которой должны быть досрочно исполнены в связи с наступлением случая Верхней переоценки, за исключением:

- Даты покупки и Даты поставки по Первой части Репо, которые принимаются равными Дате выкупа и Дате поставке, указанными в уведомлении о проведении Верхней переоценки, а также
- Суммы покупки, которая принимается равной Сумме новой сделки Репо, рассчитанной на измененную Дату выкупа по формуле [Vb] Дополнения 1 к настоящему Приложению.

При получении Оферты о заключении новой Сделки Репо в соответствии с настоящим подпунктом, ООО «ИК «Гелиус Капитал» передает содержание данной оферты клиенту. В случае согласия клиента на заключение новой Сделки Репо, выраженного в подаче поручения на заключение новой Сделки Репо на предложенных Контрагентом условиях, ООО «ИК «Гелиус Капитал» акцептует оферту Контрагента и заключает новую Сделку Репо, Офертой Контрагента может быть установлен срок для ее акцепта.

4.1.5.4. В случае если к 17.00 указанной в уведомлении о проведении Верхней переоценки Даты поставки по Второй части Репо на брокерском счете клиента отсутствует необходимое для исполнения Второй части Репо количество соответствующих ценных бумаг, ООО «ИК «Гелиус Капитал», в целях недопущения возникновения обязанности по возмещению за счет клиента убытков Контрагенту и уплаты за счет клиента неустоек, обязано предложить Контрагенту расторгнуть Вторую часть Репо.

4.1.6. В случае если в течение срока Сделки Репо Текущий уровень дисконта/премии достигает значения или становится меньше Уровня расторжения, указанного в Поручении на совершение сделки Репо, Контрагент вправе в одностороннем порядке расторгнуть Сделку Репо, при этом действующее за счет клиента ООО «ИК «Гелиус Капитал» не вправе требовать возврата

фактически исполненного по Первой части Репо. ООО «ИК «Гелиус Капитал» вправе по своему усмотрению определять способ уведомления клиента в соответствии с Разделом 6 Регламента.

4.1.7. Условиями Сделки могут быть предусмотрены неустойки за несвоевременное или ненадлежащее исполнение Сторонами своих обязательств по Сделке. В случае неисполнения клиентом обязанности по своевременному резервированию Ценных бумаг или денежных средств в объеме, необходимом для исполнения заключенных в его интересах Сделок, ООО «ИК «Гелиус Капитал» выплачивает соответствующие неустойки за счет средств клиента по письменному требованию Контрагента,

4.1.8. При принятии Эмитентом решения о конвертации, новации, дроблении, консолидации, объединении или совершении иных действий Эмитента в отношении ценных бумаг, вследствие которых торги по данным ценным бумагам будут прекращены, Дата поставки и Дата выкупа по Второй части Репо переносятся на даты, определенные соответствующим уведомлением Контрагента.

4.1.9. В случае если список лиц, имеющих право на получение от Эмитента либо денежных средств, либо иного имущества по Ценным бумагам, переданным по Первой части Репо, определяется в период после Даты поставки по Первой части Репо до Даты поставки по Второй части Репо, Первоначальный покупатель компенсирует Первоначальному продавцу распределенные Эмитентом, но неполученные Первоначальным продавцом доходы по Ценным бумагам в следующем порядке:

4.1.9.1. Размер неполученных Первоначальным продавцом дивидендов компенсируется Первоначальным покупателем в сумме дивидендов, распределенных Эмитентом по переданным по первой части Репо Ценным бумагам. При этом:

- Если Первоначальным продавцом является Контрагент и размер подлежащих выплате дивидендов на каждую акцию определен Эмитентом, Сумма дивидендов, приходящихся на количество переданных по первой части Репо Ценных бумаг, подлежит перечислению Контрагенту после определения уполномоченным органом Эмитента размера подлежащих выплате дивидендов. При этом, сумма дивидендов, передаваемая Контрагенту, передается в полном объеме, определенном исходя из решения о выплате дивидендов, и не подлежит уменьшению на сумму каких бы то ни было налогов и сборов.

- Если Первоначальным продавцом является действующее за счет клиента ООО «ИК «Гелиус Капитал», Первоначальный покупатель перечисляет Первоначальному продавцу сумму дивидендов после истечения предельного срока, в который должны быть выплачены дивиденды по Ценным бумагам, при условии, что дивиденды по Ценным бумагам были фактически выплачены всем владельцам соответствующих Ценных бумаг. При этом, сумма дивидендов подлежит уменьшению на сумму налогов и сборов, которые были фактически удержаны с Контрагента (лица, за счет которого действует Контрагент) или должны были бы быть удержаны с Контрагента (лица, за счет которого действует Контрагент) с учетом налогового статуса Контрагента (лица, за счет которого действует Контрагент), если бы получателем соответствующей суммы дивидендов от Эмитента был бы Контрагент (лицо, за счет которого действует Контрагент).

4.1.9.2. Размер неполученных Первоначальным продавцом сумм купонного дохода компенсируется Первоначальным покупателем, посредством уменьшения рассчитанной в соответствии с Дополнением 1 к настоящему Приложению Суммы выкупа, на предусмотренную настоящим пунктом сумму, в зависимости от того, кто является Первоначальным продавцом:

- если Первоначальным продавцом является Контрагент - на сумму подлежащего распределению в соответствии с эмиссионными документами купонного дохода.

- если Первоначальным продавцом является действующее за счет клиента ООО «ИК «Гелиус Капитал» - на сумму подлежащего распределению в соответствии с эмиссионными документами купонного дохода, уменьшенную на сумму налогов и сборов, которые были фактически удержаны с Контрагента (лица, за счет которого действует Контрагент) или должны были бы быть удержаны с Контрагента (лица, за счет которого действует Контрагент) с учетом налогового статуса Контрагента (лица, за счет которого действует Контрагент), если бы получателем соответствующей суммы купонного дохода от Эмитента был бы Контрагент (лицо, за счет которого действует Контрагент).

4.1.9.3. В случае если до Даты исполнения Второй части Репо Эмитент должен был исполнить свои обязательства по выплате сумм купонного дохода, однако фактически данные обязательства Эмитентом к Дате исполнения Второй части Репо исполнены не были, Сумма выкупа в соответствии с пунктом 4.1.9.2 на суммы НКД не уменьшается, а суммы купонного дохода, компенсируются Первоначальным покупателем посредством перечисления Первоначальному продавцу не позднее 3 рабочих дней со дня фактической выплаты Эмитентом предусмотренной настоящим пунктом суммы, в зависимости от того, кто является Первоначальным продавцом:

- если Первоначальным продавцом является Контрагент - сумма подлежащего распределению в соответствии с эмиссионными документами купонного дохода.

- если Первоначальным продавцом является действующее за счет клиента ООО «ИК «Гелиус Капитал» - сумма подлежащего распределению в соответствии с эмиссионными документами купонного дохода, уменьшенная на сумму налогов и сборов, которые были фактически удержаны с Контрагента (лица, за счет которого действует Контрагент) или должны были бы быть удержаны с Контрагента (лица, за счет которого действует Контрагент) с учетом налогового статуса Контрагента

(лица, за счет которого действует Контрагент), если бы получателем соответствующей суммы купонного дохода от Эмитента был бы Контрагент (лицо, за счет которого действует Контрагент).

4.1.9.4. В случае если в Дату исполнения Второй части Репо или после даты исполнения Второй части Репо Эмитент не исполнил свои обязательства по выплате купонного дохода в установленные эмиссионными документами сроки, Первоначальный покупатель вправе потребовать возврата купонного дохода, на который была уменьшена Сумма выкупа, в размере, пропорциональном объему неисполненных к моменту заявления такого требования обязательств Эмитента по выплате купонного дохода соответствующего купонного периода.

4.1.9.5. Если после осуществления, предусмотренного предыдущим пунктом возврата купонного дохода Эмитент исполнит свои обязательства по выплате купонного дохода за тот же купонный период, Первоначальный покупатель обязуется вернуть сумму ранее возвращенного ему Первоначальным продавцом купонного дохода, в размере, пропорциональном объему исполненных Эмитентом обязательств по выплате соответствующего купонного дохода не позднее 10 рабочих дней со дня выплаты этого дохода Эмитентом.

4.1.9.6. Требование о возврате купонного дохода в соответствии с пунктом 4.1.9.4 может быть предъявлено клиентом не ранее ликвидации Эмитента и должно быть исполнено не позднее 10 (десяти) рабочих дней с момента предъявления. Возврат доходов Контрагенту происходит в соответствии с пунктом 3.11.

4.1.9.7. В случае если список лиц, имеющих право на получение от Эмитента по Ценным бумагам имущественных ценностей, не являющихся денежными средствами, определяется в период после Даты поставки по Первой части Репо до Даты поставки по Второй части Репо, Первоначальный покупатель компенсирует Первоначальному продавцу стоимость неполученных от Эмитента имущественных ценностей в течение 10 рабочих дней с момента распределения имущественных ценностей Эмитентом. Стоимость распределенных имущественных ценностей определяется исходя из их Текущей рыночной цены.

4.1.10. Условия Сделки могут включать положения об освобождении Сторон от ответственности в связи с действием обстоятельств непреодолимой силы.

4.2. Если Сделка Репо совершается с целью переноса срока исполнения обязательства клиента с плановой даты исполнения на следующий рабочий день после плановой даты исполнения либо последующего использования вырученных денежных средств для исполнения обязательств клиента в полном объеме, условия такой Сделки Репо определяются в соответствии с постоянно действующим поручением клиента, содержащимся в регламенте, и имеют следующие особенности:

4.2.1. ООО «ИК «Гелиус Капитал» выступает от своего имени и за счет клиента:

- в качестве Первоначального покупателя, Контрагент - в качестве Первоначального продавца, в том случае, если Сделка Репо совершается с целью переноса срока исполнения обязательства клиента по поставке Ценных бумаг; или
- в качестве Первоначального продавца, Контрагент - в качестве Первоначального покупателя, в том случае, если Сделка Репо совершается с целью переноса срока исполнения обязательства клиента по оплате Ценных бумаг либо использования вырученных денежных средств для исполнения обязательств клиента в полном объеме.

4.2.2. Дисконт, Премия, Уровень минимально допустимого дисконта, Уровень минимально допустимой премии и Уровень расторжения применительно к указанным в пункте 4.2. Сделкам Репо не устанавливаются.

4.3. Текущая рыночная цена определяется Контрагентом в любой момент Рабочего дня в соответствии с настоящим пунктом любым из предусмотренных настоящим пунктом способов по усмотрению Контрагента.

4.3.1. Текущая рыночная цена акций российских эмитентов определяется:

- либо на основании действующих котировок на покупку/продажу (если Контрагент является Первоначальным продавцом - на основании котировок на продажу "ask", если Контрагент является Первоначальным покупателем - на основании котировок на покупку "bid") выставленных на Ценные бумаги через Организатора торговли ЗАО «ФБ ММВБ»;
- либо, если в течение торгового дня на дату расчета Текущей рыночной цены, с данными Ценными бумагами были совершены сделки с через организатора торговли, то в качестве Текущей рыночной цены принимается цена последней сделки, совершенной с данными Ценными бумагами в течение торгового дня через организатора торговли по выбору Контрагента;
- либо по средней котировке на Количество Ценных бумаг по сделке (если Контрагент является Первоначальным продавцом - по средней котировке на продажу "ask", если Контрагент является Первоначальным покупателем - по средней котировке на покупку "bid") из котировок, предлагаемых на внебиржевом рынке любыми тремя по выбору Контрагента участниками рынка, вошедшими по итогам предыдущего календарного месяца в список «Ведущие операторы рынка — акции: режим основных торгов» или в список «Ведущие операторы рынка — акции: режим переговорных сделок». Указанные списки ежемесячно публикуются на официальном сайте ЗАО «ФБ ММВБ».

- либо по рыночной цене, публикуемой организатором торгов (публикуется как «рыночная цена (2)» на сайте ЗАО «ФБ ММВБ» по результатам предыдущего торгового дня и рассчитываемой в соответствии с:

- Порядком расчета рыночной стоимости активов и стоимости чистых активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений (утв. приказом Федеральной службы по финансовым рынкам от 26 декабря 2006 г. № 06-155/пз-н)
  - Порядком расчета рыночной стоимости активов и стоимости чистых активов, в которые инвестированы накопления для жилищного обеспечения военнослужащих (утв. приказом Федеральной службы по финансовым рынкам от 27 марта 2007 г. № 07-29/пз-н).
- либо по признаваемой котировке, публикуемой организатором торгов по результатам предыдущего торгового дня и рассчитанной в соответствии с:
- Положением о порядке и сроках определения стоимости чистых активов акционерных инвестиционных фондов, стоимости чистых активов паевых инвестиционных фондов, расчетной стоимости инвестиционных паев паевых инвестиционных фондов, а также стоимости чистых активов акционерных инвестиционных фондов в расчете на одну акцию, утвержденного приказом ФСФР от 15 июня 2005 г. № 05-21/пз-н.

4.3.2. Текущая рыночная цена облигаций российских эмитентов определяется:

- либо на основании действующих котировок на покупку/продажу (если Контрагент является Первоначальным продавцом - на основании котировок на продажу "ask", если Контрагент является Первоначальным покупателем - на основании котировок на покупку "bid") выставленных на Ценные бумаги через организатора торговли ЗАО «ФБ ММВБ»;
- либо, если в течение торгового дня на дату расчета Текущей рыночной цены, с данными Ценными бумагами были совершены сделки с через организатора торговли, то в качестве Текущей рыночной цены принимается цена последней сделки, совершенной с данными Ценными бумагами в течение торгового дня через организатора торговли ЗАО «ФБ ММВБ»;
- либо по средней котировке на Количество Ценных бумаг по сделке (если Контрагент является Первоначальным продавцом - по средней котировке на продажу "ask", если Контрагент является Первоначальным покупателем - по средней котировке на покупку "bid") из котировок, предлагаемых на внебиржевом рынке любыми тремя по выбору Контрагента участниками рынка, вошедшими по итогам предыдущего календарного месяца в список «Ведущие операторы рынка — облигации: режим основных торгов» или в список «Ведущие операторы рынка — облигации: режим переговорных сделок». Указанные списки ежемесячно публикуются на официальном сайте ЗАО «ФБ ММВБ».
- либо по рыночной цене, публикуемой организатором торгов (публикуется как «рыночная цена (2)» на сайте ЗАО «ФБ ММВБ» по результатам предыдущего торгового дня и рассчитываемой в соответствии с:

- Порядком расчета рыночной стоимости активов и стоимости чистых активов, в которые инвестированы средства пенсионных накоплений (утв. приказом Федеральной службы по финансовым рынкам от 26 декабря 2006 г. № 06-155/пз-н)
  - Порядком расчета рыночной стоимости активов и стоимости чистых активов, в которые инвестированы накопления для жилищного обеспечения военнослужащих (утв. приказом Федеральной службы по финансовым рынкам от 27 марта 2007 г. № 07-29/пз-н).
- либо по признаваемой котировке, публикуемой организатором торгов по результатам предыдущего торгового дня и рассчитанной в соответствии с:
- Положением о порядке и сроках определения стоимости чистых активов акционерных инвестиционных фондов, стоимости чистых активов паевых инвестиционных фондов, расчетной стоимости инвестиционных паев паевых инвестиционных фондов, а также стоимости чистых активов акционерных инвестиционных фондов в расчете на одну акцию, утвержденного приказом ФСФР от 15 июня 2005 г. № 05-21/пз-н.
- либо по индикативной рыночной цене соответствующей облигации, рассчитываемой саморегулируемой организацией «Национальная фондовая ассоциация»

4.3.3. Текущая рыночная цена еврооблигаций и выпущенных иностранными эмитентами облигаций определяется Контрагентом в любой момент Рабочего дня по среднему арифметическому котировок на Количество Ценных бумаг на покупку/продажу (если Контрагент является Первоначальным продавцом - на основании среднего арифметического котировок на продажу "ask", если Контрагент является Первоначальным покупателем - на основании среднего арифметического котировок на покупку "bid") предлагаемых любыми тремя участниками рынка из следующего списка: UBS AG, ING Group NV, Deutsche Bank AG, Citigroup Global Markets Ltd, JP Morgan Securities Ltd, Raiffeisen Bank International AG, STANDARD BANK LONDON LTD, Royal Bank of Scotland, TD Investments Limited, Государственная корпорация «Банк развития и внешнеэкономической деятельности (Внешэкономбанк). Если котировка на покупку/продажу на Количество Ценных бумаг предлагается только двумя из перечисленных участников рынка, средняя котировка определяется на основании двух предлагаемых ими котировок. Если котировка на покупку/продажу на Количество Ценных бумаг предлагается только одним из перечисленных участников рынка, средняя котировка определяется на основании предлагаемой им котировки на Количество Ценных бумаг.



4.3.4. В случае невозможности определения Текущей рыночной цены любых ценных бумаг в соответствии с указанными в пунктах 4.3.1. - 4.3.3 критериями, исходя из котировок и цен, существующих в день определения Текущей рыночной цены, Контрагент вправе определить Текущую рыночную цену на основании вышеуказанных критериев в любой из 10 (десяти) предшествующих дню определения Текущей рыночной цены торговых дней.

4.3.5. В случае невозможности определения Текущей рыночной цены согласно предыдущему абзацу, Текущая рыночная цена признается равной нулю или используется экспертная оценка Контрагента.

4.3.6. В случае если Валюта Сделки отличается от валюты, использованной при определении Текущей рыночной цены котировки, то для определения Текущей рыночной цены Контрагент осуществляет пересчет указанной котировки в Валюту Сделки по официальному курсу Банка России на дату определения Текущей рыночной цены.

4.4. В случае заключения Открытого Репо любая Сторона имеет право предъявить другой Стороне Требование об исполнении Открытого Репо в любой Рабочий день до Даты исполнения Открытого Репо с указанием Даты исполнения Второй части Репо.

Если иное не согласовано Сторонами Требование об исполнении Открытого Репо должно быть направлено не позднее 2 (Двух) Рабочих дней до наиболее ранней из дат: Даты выкупа либо Даты поставки Ценных бумаг по Второй части Репо, - но в любом случае не позднее срока, достаточного для своевременного осуществления поставки Ценных бумаг по Второй части Репо. При этом:

- порядок расчетов по Второй части Репо устанавливается аналогично порядку расчетов по Первой части Репо;
- Сумма выкупа рассчитывается по формуле [III] Дополнения 1 к настоящему Приложению для определения Текущей суммы выкупа на Дату выкупа с учетом переоценок, если таковые производились по данной Сделке Репо.

Требование об исполнении Открытого Репо может быть направлено при помощи средств почтовой, факсимильной и телефонной связи, а также по электронной почте.

ООО «ИК «Гелиус Капитал» направляет Контрагенту Требование об исполнении Открытого Репо в день получения соответствующего требования от клиента.

**Дополнение 1 к приложению 9 к Регламенту оказания ООО «ИК «Гелиус Капитал»  
брокерских услуг на рынках ценных бумаг**

Расчетные формулы.

Ia. **Сумма выкупа** рассчитывается по формуле (в случае если существенными условиями сделки установлен Дисконт):

$$S_2 = S_1 + (S_1 * r * T) / Y$$

где:

S<sub>2</sub> - Сумма выкупа;  
S<sub>1</sub> - Сумма покупки;  
r - Ставка Репо;  
T - Срок Репо;  
Y - База начисления процентов.

Ib. **Сумма выкупа** рассчитывается по формуле (в случае если существенными условиями сделки установлена Премия):

$$S_2 = S_1 - (S_1 * r * T) / Y$$

где:

S<sub>2</sub> - Сумма выкупа;  
S<sub>1</sub> - Сумма покупки;  
r - Ставка Репо;  
T - Срок Репо;  
Y - База начисления процентов.

II. **Цена по Второй части Репо** рассчитывается по формуле:

$$P_2 = S_2 / Q - C_2$$

где:

P<sub>2</sub> - Цена по Второй части Репо;  
S<sub>2</sub> - Сумма выкупа;  
Q - Количество Ценных Бумаг по Сделке;  
C<sub>2</sub> - НКД (в расчете на 1 бумагу) на Дату выкупа.

IIIa. **Текущая сумма выкупа** рассчитывается по формуле (в случае если существенными условиями сделки установлен дисконт):

$$S_0 = S_1 + (S_1 * r\% * T_0) / Y$$

где:

S<sub>0</sub> - Текущая сумма выкупа;  
S<sub>1</sub> - Сумма покупки;  
r - Ставка Репо;  
T<sub>0</sub> - часть Срока Репо начиная со дня, следующего за днем исполнения Первой части Репо, до дня, в который производится расчет Текущей суммы выкупа включительно;  
Y - База начисления процентов.

IIIb. **Текущая сумма выкупа** рассчитывается по формуле (в случае если в существенных условиях по сделке прописана премия):

$$S_0 = S_1 - (S_1 * r\% * T_0) / Y$$

где:

S<sub>0</sub> - Текущая сумма выкупа;  
S<sub>1</sub> - Сумма покупки;  
r - Ставка Репо;  
T<sub>0</sub> - часть Срока Репо начиная со дня, следующего за днем исполнения Первой части Репо, до дня, в который производится расчет Текущей суммы выкупа включительно;  
Y - База начисления процентов.

IVa. **Текущий уровень Дисконта** рассчитывается по формуле:

$$MD = (1 - S_0 / ((MP_0 + C_0) * Q)) * 100\%$$

где:

MD - Текущий уровень Дисконта;

C<sub>0</sub> - НКД (в расчете на одну бумагу) на дату определения Текущего уровня Дисконта;

MP<sub>0</sub> - Текущая рыночная цена Ценной бумаги, являющейся предметом Сделки, на дату определения Текущего уровня Дисконта;

Q - Количество Ценных бумаг по Сделке;

S<sub>0</sub> - Текущая Сумма выкупа на дату определения Текущего уровня Дисконта.

IVb. **Текущий уровень премии** рассчитывается по формуле:

$$MP_r = (S_0 / ((MP_0 + C_0) * Q) - 1) * 100\%$$

где:

MP<sub>r</sub> - Текущий уровень премии;

C<sub>0</sub> - НКД (в расчете на одну бумагу) на дату определения Текущего уровня премии.

MP<sub>0</sub> - Текущая рыночная цена одной Ценной бумаги, на дату определения Текущего уровня премии;

Q - Количество Ценных бумаг по Сделке;

S<sub>0</sub> - Текущая сумма выкупа на дату определения Текущего уровня премии.

Va. **Сумма новой сделки Репо** рассчитывается по формуле (в случае если существенными условиями сделки установлен дисконт):

$$S_{new} = (MP_0 + C_0) * Q * (1 - D),$$

где:

S<sub>new</sub> - Сумма новой сделки Репо;

MP<sub>0</sub> - Текущая рыночная цена Ценной бумаги, являющейся предметом Сделки, на дату определения Суммы новой сделки Репо;

Q - Количество Ценных бумаг по Сделке;

D - Дисконт, %;

C<sub>0</sub> - НКД (в расчете на одну бумагу) на дату определения Суммы новой сделки Репо.

Vb. **Сумма новой сделки Репо** рассчитывается по формуле (в случае если в существенных условиях по сделке прописана премия):

$$CP = (MP_0 + C_0) * Q * (1 + Pr),$$

где:

S<sub>new</sub> - Сумма новой сделки Репо;

MP<sub>0</sub> - Текущая рыночная цена Ценной бумаги, являющейся предметом Сделки, на дату определения Суммы новой сделки Репо;

Q - Количество Ценных бумаг по Сделке;

Pr - Премия, %;

C<sub>0</sub> - НКД (в расчете на одну бумагу) на дату определения Суммы новой сделки Репо.

**Дополнение 2 к приложению 9 к Регламенту оказания ООО «ИК «Гелиус Капитал»  
брокерских услуг на рынках ценных бумаг**

**ПОРУЧЕНИЕ  
на совершение сделки РЕПО**

Клиент  
(Ф.И.О. / наименование) \_\_\_\_\_

№ договора (брокерского счета) \_\_\_\_\_

Вид сделки (РЕПО - покупка, РЕПО - продажа)	
Эмитент ценной бумаги / лицо, выдавшее ЦБ / акцептант	
Вид / категория / тип / форма выпуска / серия ценной бумаги	
Номер гос. регистрации / ISIN	
Количество ценных бумаг (или однозначные условия его определения)	
Цена одной ценной бумаги (или однозначные условия ее определения) для 1 части сделки	
Цена одной ценной бумаги (или однозначные условия ее определения) для 2 части сделки	
Общая сумма сделки для 1 части сделки, валюта суммы сделки	
Общая сумма сделки для 2 части сделки, валюта суммы сделки	
Дата расчетов по 1 части сделки	
Дата расчетов по 2 части сделки	
Место совершения	

Срок действия поручения \_\_\_\_\_

Дополнительная информация \_\_\_\_\_

Клиент (уполномоченное лицо) \_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_/

МП

<b>ЗАПОЛНЯЕТСЯ ООО «ИК «Гелиус Капитал»</b>	Входящий №
ФИО / код / подпись сотрудника	Дата и время получения