

ПАСПОРТ ВНЕБИРЖЕВОГО ОПЦИОННОГО ДОГОВОРА «УЧАСТИЕ ПОЛЁТ УЧАСТИЕ»¹

Этот документ предназначен для информирования Вас как инвестора (клиента брокера)² об основных характеристиках данного финансового инструмента (далее – **Опционный договор**), связанной с ним структуре расходов, наличии ограничений на досрочный выход из инвестиций и о существенных рисках.

1. Это важно:

- 1.1. Представленная информация не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией, а также не является рекламой.
- 1.2. Финансовый инструмент не является банковским депозитом, связанные с ним риски не подлежат страхованию в соответствии с Федеральным законом от 23 декабря 2003 года № 177-ФЗ «О страховании вкладов в банках Российской Федерации». Возврат инвестиций и доходность вложений в данный финансовый инструмент не гарантированы государством.
- 1.3. Данный финансовый инструмент может быть труден для понимания.
- 1.4. Перед подачей поручения брокеру на заключение Опционного договора следует ознакомиться с указанной ниже информацией.

2. Что представляет собой финансовый инструмент:

1. Краткая информация об Опционном договоре	
Вид финансового инструмента	Расчетный внебиржевой опционный договор. Базисным активом является российская ценная бумага.
Категория инвестора, которой предназначен финансовый инструмент	Юридическое лицо, Квалифицированный инвестор – физическое лицо.
2. Информация о разработчике Опционного договора	
Полное или краткое наименование	ООО «Компания БКС» ³
Контакты	630099, г. Новосибирск, ул. Советская, д. 37 / 129110, г. Москва, пр. Мира, д.69 стр.1
3. Информация о паспорте Опционного договора	
Дата разработки паспорта финансового инструмента	14.09.2023 г.
Дата последней актуализации паспорта финансового инструмента	14.09.2023 г.
4. Информация о разработчике паспорта Опционного договора	
Полное или краткое наименование	ООО «Компания БКС»
Контакты	Аналогичны контактам разработчика Опционного договора

Описание Опционного договора

Опционный договор – это договор, по условиям которого право требовать получения дохода и его величина, а также сумма возврата вложенных инвестиций зависит от наступления определенных условий, а именно от достижения определенных значений базисных активов в определенные даты. Выплачиваемая инвестору в связи с завершением срока действия Опционного договора сумма денежных средств может быть существенно меньше суммы инвестированных средств.

Все платежи по Опционному договору производятся только в валюте расчетов в безналичном порядке.

Механизм действия Опционного договора:

Для расчетов по Опционному договору используются в том числе Номинал контракта в Валюте контракта и коэффициенты, значения которых фиксируются в поручении брокеру на заключение Опционного договора.

Для целей Паспорта под **Динамикой корзины БА** понимается сумма изменений значения каждого Базисного актива, определенного на Дату наблюдения, Дату эффективного роста, относительно Первоначального значения этого Базисного актива с учетом порогового и весового коэффициентов или коэффициента участия в зависимости от условий Опционного договора.

¹ Далее по тексту – **Паспорт**.

² Далее по тексту – **инвестор**.

³ Общество с ограниченной ответственностью «Компания Брокеркредитсервис» (ОГРН: 1025402459334).

У Инвестора возникает право требования получения Промежуточной выплаты по Опционному договору при наступлении следующих условий и в следующем размере:

если на любую из Дат наблюдения до автоматического досрочного прекращения Опционного договора, на Дату исполнения контракта Динамика корзины БА больше или равна 0.0, то в эту дату у инвестора возникает право требования Промежуточной выплаты, которая рассчитывается на эту дату (далее – **Промежуточная выплата**). При возникновении у инвестора права требования Промежуточной выплаты такое право требования считается предъявленным инвестором автоматически в дату возникновения у инвестора такого права требования. Сумма Промежуточной выплаты в Валюте контракта рассчитывается так:

- как произведение ограничительного коэффициента на Номинал контракта в Валюте контракта и на сумму всех коэффициентов участия среди всех Базисных активов, если на эту дату возникновения права требования Динамика корзины БА выше ограничительного коэффициента 999.0 или равна ему;
- в ином случае, как произведение Динамики корзины БА на Номинал контракта в Валюте контракта на сумму всех коэффициентов участия среди всех Базисных активов.

Условия для основной выплаты по Опционному договору в связи с отсутствием наступления условия для автоматического досрочного прекращения Опционного договора:

- при не наступлении предыдущих условий и, если на Дату исполнения контракта Динамика корзины БА выше или равно - 0, то инвестору выплачивается в валюте расчетов денежная сумма, эквивалентная 100 % от Номинала контракта в Валюте контракта.
- при не наступлении предыдущих условий инвестору выплачивается в валюте расчетов денежная сумма, эквивалентная % от Номинала контракта в Валюте контракта, который рассчитывается как сумма между 100% и значением Динамики корзины БА на Дату исполнения контракта в %.

Ключевые характеристики Опционного договора

Ограничительный коэффициент	Коэффициент защиты
999.0	1

Пороговый купонный коэффициент	Пороговый коэффициент
0.0	0.8

Дата исполнения
21.09.2028

Номинал контракта	Валюта контракта
Не уплачивается инвестором и используется исключительно в целях определения размера обязательств по Опционному договору. Размер Номинала контракта устанавливается по согласованию с инвестором.	Российский рубль
	Валюта расчетов
	Российский рубль

Первоначальное значение Базисного актива.	Дата определения параметров
Первоначальное значение Базисного актива устанавливается на Дату определения параметров. Значения Базисных активов определяются в порядке, установленном поручением Инвестора, а также в разделе 8 Приложения № 6 к Регламенту (https://broker.ru/f/reg/bcs_futures.pdf), с учетом установленной Биржи для определения значения этого Базисного актива и поручением на заключение Опционного договора.	21.09.2023 г.
	Срок для уплаты Промежуточной выплаты по Опционному договору
	не позднее двух рабочих дней, следующих за датой, на которую возникла обязанность по ее уплате с учетом реализации инвестором права требования её выплаты
	Срок для уплаты основной выплаты по Опционному договору
	не позднее двух рабочих дней, следующих за Датой исполнения контракта

Базисные активы	Валюта Базисного актива	Биржа для определения значения Базисного актива
1 (одна) обыкновенная акция ПАО "Газпром", RU0007661625	Российский рубль	ПАО Московская Биржа
1 (одна) обыкновенная акция ПАО "Совкомфлот", RU000A0JXNU8	Российский рубль	ПАО Московская Биржа
1 (одна) обыкновенная акция ПАО "ЛУКОЙЛ", RU0009024277	Российский рубль	ПАО Московская Биржа
1 (одна) обыкновенная акция ПАО "Северсталь", RU0009046510	Российский рубль	ПАО Московская Биржа
1 (одна) обыкновенная акция ПАО Сбербанк, RU0009029540	Российский рубль	ПАО Московская Биржа
1 (одна) обыкновенная акция ПАО "Газпром нефть", RU0009062467	Российский рубль	ПАО Московская Биржа

Базисные активы. Худший результат определяется на соответствующую Дату наблюдения, Дату фиксации эффективного роста в соответствии с условиями Опционного договора	Коэффициенты участия	Весовые коэффициенты
С худшим результатом	2.1	1
Со вторым худшим результатом	0	0
С третьим худшим результатом	0	0
С четвертым худшим результатом	0	0
С пятым худшим результатом	0	0
С шестым худшим результатом	0	0

Индикатор риска Опционного договора и возможные сценарии выплат.

Сводный индикатор риска

1	2	3	4	5	6	7
←						→
Низкий риск					Высокий риск	

Сводный индикатор риска показывает уровень риска этого финансового инструмента по сравнению с другими инструментами. Он показывает, насколько велика вероятность, что инвестор потеряет деньги, инвестированные в Опционный договор, из-за изменений на рынках или из-за того, что ему не смогут заплатить. Данный Опционный договор классифицирован ООО «Компания БКС» как 6 из 7, что составляет второй по величине класс риска. Это означает оценку уровня потенциальных убытков от результатов инвестирования в Опционный договор как высоких. Плохие рыночные условия очень вероятно повлияют на возможности другой стороны произвести купонные выплаты или их размер, возврата начальных инвестиций по Опционному договору или размер такого возврата. Валютный риск не учитывается в показанном выше сводном индикаторе риска. Этот инструмент не предусматривает никакой защиты капитала, поэтому инвестор может потерять часть или все свои инвестиции в Опционный договор. Период инвестирования в Опционный договор равен сроку действия Опционного договора, зависит от потребностей инвестора и определяется им самостоятельно. Рекомендуемый период инвестирования – до даты исполнения Опционного договора

Сценарии выплат.

Инвестиции RUB 100 000				
Сценарии		12 месяцев	30 месяцев	5 лет (Рекомендованный период владения)

Стрессовый сценарий	Что инвестор может получить обратно за вычетом затрат:	RUB 29057.08	RUB 12314.19	RUB 1136.56
	Средний доход каждый год:	-70.92%	-50.25%	-59.15%
Неблагоприятный сценарий	Что инвестор может получить обратно за вычетом затрат:	RUB 105995.46	RUB 91209.25	RUB 56524.98
	Средний доход каждый год:	5.99%	-3.02%	-10.78%
Умеренный сценарий	Что инвестор может получить обратно за вычетом затрат:	RUB 118698.04	RUB 182019.14	RUB 224955.33
	Средний доход каждый год:	18.68%	22.10%	17.60%
Благоприятный сценарий	Что инвестор может получить обратно за вычетом затрат:	RUB 130563.97	RUB 286538.78	RUB 760738.81
	Средний доход каждый год:	30.54%	42.03%	50.04%

В этой таблице показаны деньги, которые инвестор мог бы получить обратно в течение рекомендуемого периода владения при различных сценариях, предполагая, что инвестирует в Опционный договор 100 000 рублей. Расчеты производятся исходя из рекомендуемого периода владения.

Представленный расчет доходности в данных сценариях носит информационный характер, представляет собой прогноз (оценку) будущих результатов инвестиций, основанный на ценах/значениях прошлых периодов, не является точным показателем, а также не является точным указанием того, что инвестор может получить обратно и не является гарантией получения дохода от инвестиций в Опционный договор. То, что получит инвестор, будет зависеть от того, как движется рынок, как будет изменяться цена/значение базового актива и периода действия финансового инструмента до его прекращения или продажи. Можно сравнить их со сценариями других финансовых инструментов или продуктов. Инвестор должен помнить, что результаты инвестиций в финансовые инструменты, а также значения/цены базисных активов в прошлом не определяют результаты инвестиций, а также значения/цены базисных активов в будущем. Стрессовый сценарий показывает, что инвестор может получить обратно в экстремальных рыночных условиях, и не принимает во внимание ситуацию, когда сторона по Опционному контракту не сможет осуществить выплату, а ручательство по Опционному договору будет отсутствовать.

Приведенные цифры включают все затраты на сам финансовый инструмент, но не включают брокерскую и депозитарную комиссию, а также не включают расходы, которые инвестор несет за оказание ему иных услуг. Цифры не учитывают личную налоговую ситуацию Инвестора, которая также может повлиять на размер дохода.

Инвестирование в Опционный договор означает предположение Инвестора, что по его мнению цена/значение базового актива увеличится.

Максимальный убыток инвестора будет заключаться в том, что инвестор потеряет все свои инвестиции в Опционный договор, а также понесет расходы, связанные с таким инвестированием.

3. Что произойдет, если сторона по Опционному договору не сможет исполнить свои обязательства

В случае частичного или полного дефолта (банкротства) контрагента по Опционному договору инвестор может частично или полностью потерять вложенные инвестиции. Брокер не отвечает перед инвестором, во исполнение поручения которого заключен Опционный договор с контрагентом, за неисполнение таким контрагентом Опционного договора за исключением наличия ручательства брокера за исполнение Опционного договора в объеме этого ручательства или случаев, предусмотренных законом.

4. Как долго рекомендуется владеть финансовым инструментом, возможен ли досрочный возврат инвестиций

Период инвестирования в Опционный договор зависит от потребностей инвестора и определяется им самостоятельно.

Опционный договор может быть автоматически досрочно прекращен при наступлении условия для его автоматического досрочного прекращения. В таком случае, срок действия Опционного договора окажется меньше того, на который инвестор рассчитывал.

Возможность одностороннего отказа от Опционного договора по инициативе брокера или инвестора не предусмотрена.

Досрочное расторжение Опционного договора возможно при согласии контрагента по Опционному договору. При досрочном расторжении Опционного договора возврат вложенных инвестиций осуществляется не в полном объеме в соответствии со сложившейся на момент досрочного расторжения рыночной конъюнктурой, что влечет финансовые потери для инвестора.

5. Какие риски несет финансовый инструмент

Инвестирование в Опционный договор связано в том числе со следующими рисками:

➤ Рыночный риск.

Риск неблагоприятного изменения значений базисных активов Опционного договора, в результате чего инвестор может не только не получить доход в ожидаемом размере, но и лишиться части или всех вложенных инвестиций.

➤ Риск ликвидности.

Проявляется в возможности возникновения у инвестора финансовых потерь в связи с досрочным расторжением Опционного договора либо наоборот, в связи с невозможностью его досрочного расторжения;

➤ Валютный риск.

Проявляется в возможности возникновения у инвестора финансовых потерь в связи с неблагоприятным изменением курсов валюты расчетов и валюты контракта.

➤ Инфраструктурный риск, включая кастодиальный риск.

Риск связанный с фактическим отсутствием у владельцев или держателей финансовых инструментов возможности распоряжаться ими (например, переводить их, когда такой перевод подлежит отражению по счетам в вышестоящих иностранных учетных институтах или распоряжаться ими иным образом) или получать доходы по ним (в том числе, например, в связи с участием иностранных платежных агентов, иностранных учетных институтов, иных организаций), или участвовать в корпоративных действиях, или связанный с иными действиями/бездействием организаций финансового рынка, расположенных на территории России или за ее пределами, например, организаторов торгов, клиринговых организаций, репозитариев, рейтинговых агентств, профессиональных участников рынка ценных бумаг, иностранных брокеров, иностранных учетных институтов, банков, платежных агентов, кастодианов, иных организаций, включая инфраструктурные, способствующих функционированию рынка ценных бумаг.

6. Какова структура расходов

Сумма инвестиций в Опционный договор определяется инвестором по своему усмотрению, но не может быть менее Минимальной суммы инвестирования и осуществляется в валюте расчетов. За исполнение брокером поручения инвестора на заключение Опционного договора инвестор уплачивает брокеру вознаграждение⁴. Инвестор также может нести расходы в связи с исполнением обязанности по уплате налоговых платежей. Размер налоговой ставки и порядок уплаты налогов в отношении доходов по Опционному договору зависит от применимого к инвестору налогового законодательства, международных договоров об избежании двойного налогообложения. Обязанность по несению иных расходов может вытекать из особенностей применимого к инвестору законодательства, соглашений.

При неблагоприятном для инвестора изменении значений базисных активов на определенные в Опционном договоре даты инвестор может лишиться части или всех вложенных инвестиций. При досрочном расторжении Опционного договора возврат вложенных инвестиций осуществляется не в полном объеме в соответствии со сложившейся на момент досрочного расторжения рыночной конъюнктурой.

7. Кому жаловаться

Жалобы и обращения необходимо направлять на почтовый адрес разработчика паспорта Опционного договора: 630099, г. Новосибирск, ул. Советская, д. 37 / 129110, г. Москва, пр. Мира, д.69 стр.1.

8. Иная важная информация

➤ Паспорт не является офертой, в том числе публичной, а также не является приглашением делать оферты. Паспорт носит исключительно информационный характер для сравнения основных характеристик Опционного договора с другими финансовыми инструментами и не содержит в себе исчерпывающей информации об Опционном договоре и связанных с ним

⁴ С информацией о расходах, возмещаемых инвестором в связи с исполнением поручения, включая сведения о видах расходов, о сумме расходов, и/или о порядке определения суммы расходов, информацией о размере вознаграждения ООО «Компания БКС», включая сведения о сумме вознаграждения и/или о порядке определения размера вознаграждения, можно ознакомиться в Регламенте оказания услуг на рынке ценных бумаг ООО «Компания БКС» и приложении 11 к Регламенту на broker.ru/regulations.

рисках. Итоговые условия Опционного договора определяются в поручении инвестора брокеру на заключение Опционного договора, с которыми инвестору необходимо внимательно ознакомиться перед подачей такого поручения;

- Опционный договор не является ценной бумагой. Инвестирование не осуществляется напрямую в ценные бумаги, составляющие базисный актив Опционного договора. Опционный договор невозможно перевести на другой брокерский счет или индивидуальный инвестиционный счет⁵;
- Коэффициенты дополнительной выплаты и ожидаемой доходности используются исключительно для расчетов и не должны восприниматься в качестве заверения/гарантии выплаты инвестору дополнительной выплаты или доходности;
- инвестору перед подачей брокеру поручения на заключение Опционного договора необходимо получить все необходимые ему консультации от независимых лиц по юридическим, налоговым, бухгалтерским и иным вопросам, а также оценить риски наступления возможных неблагоприятных финансовых последствий и принять решение об их приемлемости для инвестора в свете его опыта работы на финансовом рынке, уровня соответствующих знаний инвестора, инвестиционных целей, уровня финансовых возможностей и сбережений, допустимого риска и ожидаемой доходности. Инвестор не должен инвестировать в Опционный договор, если он не понимает и не готов принять на себя риски, связанные с этим.

5 Индивидуальный инвестиционный счет в соответствии со ст. 10.2-1 Федерального закона от 22.04.1996 №39-ФЗ «О рынке ценных бумаг».