

ПАСПОРТ ВНЕБИРЖЕВОГО ФОРВАРДНОГО ДОГОВОРА «ФЕНИКС С ЗАЩИТОЙ И АВТОКОЛЛОМ УЛЬТИМА ПОРОГОВЫЙ»¹

Этот документ предназначен для информирования Вас как инвестора (клиента брокера)² об основных характеристиках такого финансового инструмента, как внебиржевой форвардный договор «Феникс с защитой и автоколлом Ультима Пороговый» (далее – **Форвардный договор**), а также 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 Форвардного договора следует ознакомиться с указанной ниже информацией.

2. Что представляет собой финансовый инструмент:

1. Краткая информация о Форвардном договоре	
Вид финансового инструмента	Расчетный внебиржевой форвардный договор. Базисным активом является российская ценная бумага.
Категория инвестора, которой предназначен финансовый инструмент	Юридическое лицо, Квалифицированный инвестор – физическое лицо
2. Информация о разработчике Форвардного 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 Форвардного договора	
Дата разработки паспорта финансового инструмента	16.05.2024 г.
Дата последней актуализации паспорта финансового инструмента	16.05.2024 г.
4. Информация о разработчике паспорта Форвардного договора	
Полное или краткое наименование	ООО «Компания БКС»
Контакты	Аналогичны контактам разработчика Форвардного договора

Форвардный договор – это договор, по условиям которого возможность 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.

¹ Далее по тексту – **Паспорт**.

² Далее по тексту – **инвестор**.

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

Механизм действия Форвардного договора:

- поставка Базисного актива по Форвардному договору не предусмотрена;
- для расчетов по Форвардному договору используются в том числе Номинал контракта в Валюте контракта и коэффициенты (добавочный коэффициент, досрочный коэффициент, ценовой коэффициент, корректирующий коэффициент, коэффициент защиты, коэффициент риска, коэффициент ожидаемой доходности), значения которых фиксируются в поручении брокеру на заключение Форвардного договора.

Условия для автоматического досрочного прекращения Форвардного договора:

- если на любую из Дат промежуточной фиксации все определенные на такую дату Промежуточные значения Базисных активов больше или равны 100 % от соответствующих Первоначальных значений Базисных активов, Форвардный договор досрочно автоматически прекращается с возвратом инвестору всего номинала Контракта в валюте Контракта а также на эту дату определяется наступление условия для Промежуточной выплаты по Форвардному договору.

Условия для промежуточной выплаты по Форвардному договору:

- на Дату промежуточной фиксации, на Дату исполнения контракта (далее любая из этих дат – **Дата определения Промежуточной выплаты**) определяется наступило ли условие для промежуточной выплаты инвестору и при его наступлении рассчитывается сумма промежуточной выплаты (далее – **Промежуточная выплата**).

Условие для Промежуточной выплаты считается наступившим, если все определенные на Дату определения промежуточной выплаты Промежуточные значения Базисных активов больше или равны 100 % от соответствующих Первоначальных значений Базисных активов.

Размер Промежуточной выплаты определяется как 30.5 % годовых от Номинала контракта в Валюте контракта.

При наступлении условия для Промежуточной выплаты инвестору уплачиваются также ранее невыплаченные суммы Промежуточных выплат за период с даты заключения Форвардного договора до Даты определения промежуточной выплаты, на которую наступило условие для Промежуточной выплаты.

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

- на Дату исполнения контракта рассчитывается денежная сумма и подлежит выплате инвестору в связи с завершением срока действия Форвардного договора. Выплачиваемая инвестору в связи с завершением срока действия Форвардного договора сумма денежных средств может быть существенно меньше суммы инвестированных средств;

➤ определение денежной суммы подлежащей выплате инвестору в связи с завершением срока действия Форвардного договора зависит от соотношения Итогового значения Базисного актива с Первоначальным значением Базисного актива:

Если все определенные на Дату исполнения контракта Итоговые значения Базисных активов будут больше или равны 100 % от соответствующих Первоначальных значений Базисных активов, то инвестору выплачивается в валюте расчетов денежная сумма, эквивалентная 100 % Номинала контракта в Валюте контракта	Если хотя бы одно Итоговое значение Базисного актива будет меньше 100 % от соответствующего первоначального значения Базисного актива, то инвестору возвращается номинал контракта в валюте контракта без выплаты дохода .
--	--

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

Ключевые характеристики Форвардного договора	
Минимальная сумма инвестиций	Срок действия контракта (в календарных днях)
1000000 российских рублей	153
Номинал контракта	Валюта контракта
	Российский рубль
	Валюта расчетов
Не уплачивается инвестором и используется исключительно в целях определения размера обязательств по Форвардному договору. Размер Номинала контракта устанавливается по согласованию с инвестором.	Российский рубль
	Добавочный коэффициент
	1
	Досрочный коэффициент
	1
Даты промежуточной фиксации	Коэффициент защиты, % годовых
	0
	Коэффициент риска, % годовых
	0
	Корректирующий коэффициент
	1
	Ценовой коэффициент
	1
Базисный актив	Валюта Базисного актива и Биржа для определения значения Базисного актива
1 (одна) обыкновенная акция ПАО "Новатэк", RU000A0DKVS5	Российский рубль ПАО Московская Биржа
1 (одна) обыкновенная акция ПАО "Северсталь", RU0009046510	Российский рубль ПАО Московская Биржа
Первоначальное, Промежуточное и Итоговое значение Базисного актива	Дата определения параметров
Первоначальное значение Базисного актива устанавливается на Дату определения параметров.	23.05.2024
	Дата исполнения контракта
	23.10.2024

Неблагоприятный сценарий	Что инвестор может получить обратно за вычетом затрат:	RUB 100000.00
	Средний доход каждый год:	0.00%
Умеренный сценарий	Что инвестор может получить обратно за вычетом затрат:	RUB 100000.00
	Средний доход каждый год:	0.00%
Благоприятный сценарий	Что инвестор может получить обратно за вычетом затрат:	RUB 112780.00
	Средний доход каждый год:	33.34%

В этой таблице показаны деньги, которые инвестор мог бы получить обратно в течение рекомендуемого периода владения при различных сценариях, предполагая, что инвестирует в Форвардный 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 Форвардному договору не сможет исполнить свои обязательства

В случае частичного или полного дефолта (банкротства) контрагента по Форвардному договору инвестор может частично или полностью потерять вложенные инвестиции. Брокер не отвечает перед инвестором, во исполнение поручения которого заключен Форвардный договор с контрагентом, за неисполнение таким контрагентом Форвардного договора за исключением

наличия ручательства брокера за исполнение Форвардного договора в объеме этого ручательства или случаев, предусмотренных законом.

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

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

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

Досрочное расторжение Форвардного договора возможно при согласии контрагента по Форвардному договору. При досрочном расторжении Форвардного 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 Форвардный договор связано в том числе со следующими рисками:

➤ Рыночный риск.

Риск неблагоприятного изменения значений Базисных активов Форвардного 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 Форвардного 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 Форвардный 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 Форвардного договора инвестор уплачивает брокеру вознаграждение⁴.

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

Инвестор также может нести расходы в связи с исполнением обязанности по уплате налоговых платежей в соответствии с применимым законом. Обязанность по несению иных расходов может вытекать из особенностей применимого к инвестору законодательства.

7. Кому жаловаться

Жалобы и обращения необходимо направлять на почтовый адрес разработчика паспорта Форвардного 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 Форвардного договора с другими финансовыми инструментами и не содержит в себе исчерпывающей информации о Форвардном договоре и связанных с ним рисках;
- Форвардный договор не является ценной бумагой. Инвестирование не осуществляется напрямую в ценные бумаги, составляющие Базисный актив Форвардного договора. Форвардный договор невозможно перевести на другой брокерский счет или индивидуальный инвестиционный счет⁵;
- при заключении Форвардного договора посредством использования брокерских услуг стороной Форвардного договора вместо инвестора, по общему правилу, является брокер, действующий от имени и за счет этого инвестора;
- инвестору перед подачей брокеру поручения на заключения Форвардного 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, инвестиционных целей, уровня сбережений, допустимого риска и ожидаемой доходности. Инвестор не должен инвестировать в Форвардный договор, если он не понимает и не готов принять на себя риски, связанные с этим.

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 bcs.ru/regulatory/additional-archive.

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