

ОСОБЕННОСТИ ИСПОЛНЕНИЯ ПОРУЧЕНИЙ НА СОВЕРШЕНИЕ СДЕЛКИ РЕПО

1. Настоящее Приложение устанавливает особенности исполнения Банком Поручений на совершение Сделок РЕПО.
2. Если иное не оговорено в тексте настоящего Приложения, термины, используемые в настоящем Приложении с заглавной буквы, применяются в значениях, установленных в Регламенте.

Взнос – Маржинальный взнос или Компенсационный взнос в соответствии с условиями Сделки РЕПО.

Компенсационный взнос - сумма денежных средств или ценных бумаг, рассчитываемая Банком, подлежащая уплате Стороной по Сделке РЕПО в пользу другой Стороны Сделки РЕПО для целей снижения риска неисполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО и представляющая собой частичное предварительное исполнение обязательств по второй части Сделки РЕПО.

Ликвидационный уровень – Уровень обеспеченности, при котором у Банка появляется право требовать досрочного исполнения Сделки РЕПО в соответствии с п. 9.1. Приложения.

Маржинальный взнос – сумма денежных средств или ценных бумаг, рассчитываемая Банком, подлежащая уплате Стороной по Сделке РЕПО в пользу другой Стороны Сделки РЕПО для целей снижения риска неисполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО и не являющаяся предоплатой или предпоставкой по второй части Сделки РЕПО.

Текущая стоимость Ценных бумаг - стоимость Ценных бумаг, являющихся предметом Сделки РЕПО, которая может быть рассчитана в любое время между первой и второй частью Сделки РЕПО на основании данных, полученных в ТС, или иным образом, предусмотренным двусторонним соглашением между Банком и Контрагентом.

Уровень обеспеченности – показатель, отражающий уровень обеспеченности обязательств по Сделке РЕПО в зависимости от изменения Текущей стоимости Ценных бумаг

Уровень переоценки - Уровень обеспеченности, при котором у одной из Сторон Сделки РЕПО возникает обязанность по передаче Взноса в соответствии с условиями Сделки РЕПО;

3. Банк вправе самостоятельно определить Контрагента по Сделке РЕПО, заключаемой по Поручению Клиента, а также условия Сделки РЕПО, которые дополняют условия, включенные Клиентом в Поручение на совершение Сделки РЕПО.

При заключении Банком Сделки РЕПО с Контрагентом по поручению Клиента, Банк обязуется в течении 5 (пяти) рабочих дней в письменной форме уведомить Клиента об условиях (включая, но не ограничиваясь, Уровень обеспеченности и Уровень переоценки), которые дополняют условия Сделки РЕПО, включенные Клиентом в Поручение на совершение Сделки РЕПО.

4. Поручение на совершение Сделки РЕПО не может быть отозвано Клиентом после исполнения Банком обязательств по первой части Сделки РЕПО.

5. Клиент имеет право направить Банку предложение об изменении условий заключенной, но не исполненной в полном объеме Сделки РЕПО путем подачи нового Поручения на совершение Сделки РЕПО с указанием того, что Поручение направляется для изменения условий уже заключенной Сделки, в графе «Дополнительные условия». Банк, при условии достижения договоренности об изменении условий Сделки РЕПО с Контрагентом, исполняет данное Поручение путем заключения дополнительного соглашения с Контрагентом или иными способами, предусмотренными российским законодательством. Банк вправе отказать Клиенту в приеме Поручения, направленного для изменения условий уже заключенной Сделки РЕПО, без указания причин.
6. При наличии взаимных встречных требований между Банком и Контрагентом по сделкам, заключенным по Поручениям на совершение сделки РЕПО Клиента, Банк имеет право провести зачет этих требований в установленном законодательством порядке без получения дополнительного согласия Клиента с последующим уведомлением Клиента о произведенном зачете в письменной форме.
7. Стороны устанавливают следующий порядок взаимодействия при выплате эмитентом ценных бумаг, являющихся предметом Сделки РЕПО, дивидендов, процентов и иного дохода по ценным бумагам (далее – Доход по ценным бумагам). Если дата формирования списка лиц, имеющих право на получение Дохода по ценным бумагам, приходится на период между первой и второй частью Сделки РЕПО, Доход по ценным бумагам подлежит зачислению на счет Клиента-продавца по первой части Сделки РЕПО не позднее 20 рабочих дней с даты получения информации о том, что эмитент ценных бумаг произвел выплату дохода по ценным бумагам.

Невзирая на вышеизложенное, Банк без предварительного согласия Клиента имеет право договориться с Контрагентом о том, что суммы Дохода по ценным бумагам не будут перечисляться Контрагентом-покупателем по первой части Сделки РЕПО Клиенту-продавцу по первой части Сделки РЕПО, а уменьшат сумму денежных обязательств Клиента-продавца по Сделке РЕПО по второй части Сделки РЕПО в соответствующей части. Банк обязуется своевременно уведомить Клиента о достижении такой договоренности с Контрагентом.

8. Переоценка обязательств по Сделке РЕПО.
 - 8.1. Условия Сделок РЕПО, заключаемых Банком по Поручению Клиента, могут предусматривать проведение переоценки обязательств Сторон по Сделке РЕПО в виде передачи Взносов при изменении Уровня обеспеченности ниже или выше Уровня переоценки.
 - 8.2. Банк обязуется письменно информировать Клиента о каждом случае изменения Уровня обеспеченности, при котором возникает обязательство Банка по передаче Взноса в соответствии с условиями Сделки РЕПО. Клиент обязуется обеспечить наличие достаточного количества денежных средств или Ценных бумаг для передачи Взноса по Сделке РЕПО не позднее окончания дня, в течение которого Клиент получил уведомление об этом.
9. Досрочное исполнение Сделок РЕПО.
 - 9.1. В случае снижения Уровня обеспеченности ниже Ликвидационного уровня (если Банк выступает в роли продавца по первой части Сделки РЕПО) Банк имеет право, без предварительного согласия Клиента, требовать досрочного исполнения Контрагентом Сделки РЕПО, заключенной по Поручению Клиента. Банк вправе самостоятельно определить дату, в которую должны быть проведены расчеты по Сделке РЕПО при досрочном исполнении, и направить Клиенту письменное

уведомление о досрочном исполнении Сделки РЕПО, с указанием сумм обязательств Банка и Контрагента, скорректированных в связи с переносом даты второй части Сделки РЕПО.

- 9.2. Дата проведения расчетов по второй части Сделки РЕПО не может наступать ранее дня, следующего за получением Клиентом уведомления о досрочном исполнении Сделки РЕПО.
- 9.3. Клиент обязуется обеспечить наличие необходимых денежных средств или ценных бумаг для досрочного исполнения Сделки РЕПО в срок не позднее 12.00 по московскому времени в Дату расчетов по второй части Сделки РЕПО.
- 9.4. Банк и / или Клиент также имеют право, при достижении договоренности о досрочном исполнении с Контрагентом в письменном виде, требовать досрочного исполнения Сделки РЕПО, вне зависимости от наступления обстоятельства, указанного в п 9.1.
10. Особенности урегулирования обязательств Сторон при досрочном исполнении Сделки РЕПО.

В случае отсутствия на счетах Клиента необходимого количества денежных средств или ценных бумаг для исполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО (в том числе, при досрочном исполнении обязательств по сделке РЕПО в соответствии с п. 9.1 Приложения) или обязательств по уплате соответствующего Взноса в требуемом размере Банк, помимо прочих прав, установленных в Регламенте, имеет право совершить за счет Клиента Сделки по покупке или продаже ценных бумаг, для чего Клиент настоящим поручает Банку совершить соответствующие Сделки по рыночным ценам в объеме, достаточном для надления Банка денежными средствами или ценными бумагами для исполнения обязательств по второй части Сделки РЕПО.

Сделки по покупке или продаже ценных бумаг при наступлении условий, указанных в абзацах выше, могут проводиться в ТС или на внебиржевом рынке. Акцепт настоящего пункта 10 Приложения считается надлежащим образом оформленным Поручением Клиента Банку на совершение Сделок, необходимых для обеспечения исполнения Банком обязательств по Сделке РЕПО.