

СПЕЦИФИКАЦИЯ внебиржевого форвардного контракта, являющегося производным финансовым инструментом, «Внебиржевой форвард на еврооблигацию Минфина России 1»

Производный финансовый инструмент «Внебиржевой форвард на еврооблигацию Минфина России 1» предназначен только для квалифицированных инвесторов.

Для целей настоящей Спецификации используются термины и определения, в значении как это определено в действующем Регламенте брокерского обслуживания АО ИФК «Солид» (далее – Регламент), если иное прямо не установлено настоящей Спецификацией, Генеральным соглашением или условиями договора, являющегося производным финансовым инструментом - Поставочный форвард на облигации («Внебиржевой форвард на еврооблигацию Минфина России 1»).

Настоящая Спецификация является неотъемлемой частью поручения Клиента и определяет условия, на которых Клиент поручает, а Брокер принимает на себя обязательство заключить по поручению Клиента внебиржевой форвардный контракт «Внебиржевой форвард на еврооблигацию Минфина России 1».

1. Термины и определения

Базисный актив – еврооблигации Минфина России, параметры которых указаны в пункте 2 настоящей Спецификации.

Место хранения Базисного актива - вне централизованной финансовой инфраструктуры РФ, иностранный депозитарий.

Брокер – АО ИФК «Солид», действующее от своего имени, за счет, по поручению и в интересах Клиента.

Клиент – лицо, заключившее с АО ИФК «Солид» Договор на брокерское обслуживание, в порядке и на условиях предусмотренными вышеуказанным договором и приложениями к нему.

Стороны – АО ИФК «Солид» и Контрагент при совместном упоминании по тексту.

Контрагент – лицо, поименованное в Спецификации, с которым Брокер заключил контракт в рамках Генерального соглашения о срочных сделках на условиях, приведенных в настоящей спецификации.

Контракт (финансовый инструмент, договор, являющийся производным финансовым инструментом, Сделка) – внебиржевой форвард на Базисный актив.

Расчетный агент – лицо, осуществляющее расчет сумм, подлежащих выплате согласно п.2 данной Спецификации, а также определение наличия или отсутствия оснований для досрочного погашения или событий, препятствующих расчету согласно Спецификации.

Срок контракта – период между Датой заключения Контракта и Датой окончания действия Контракта согласно п.2 данной Спецификации.

2. Параметры Контракта

Вид финансового инструмента	Внебиржевой форвард	
Категория инвестора, которой предназначен финансовый инструмент	Квалифицированный инвестор	
Базисный актив контракта (БА)	Валюта Базисного актива	В зависимости от Ценной бумаги, указанной в Поручении Клиента [доллар США/Евро]
	Категория (тип)	Еврооблигации
	Наименование Эмитента	Министерство Финансов Российской Федерации
	Наименование базисного актива	Определяется Поручением Клиента
	ISIN	Определяется Поручением Клиента
	Место хранения	вне централизованной финансовой инфраструктуры РФ, иностранный депозитарий
	Номинальная стоимость Базисного актива	Определяется Поручением Клиента
Цена базисного актива	Цена Базисного актива, используемая для расчета Суммы начального платежа, включая накопленный купонный доход по базисному активу.	

	Дата погашения Базисного актива	В зависимости от Ценной бумаги, указанной в Поручении Клиента
Количество Базисного актива (шт.)		0,1
Валюта Сделки		Российский рубль
Начальный курс		Определяется Поручением Клиента
Дата заключения Контракта		Определяется Поручением Клиента на покупку
Дата поставки Базисного актива		14 (четырнадцатый) календарный день, предшествующий Дате погашения Базисного актива
Суммы начального платежа		Номинальная стоимость Базисного актива X Цена базисного актива X Количество Базисного актива X Начальный курс
Обязанности Брокера, действующего за счет Клиента, перед Контрагентом		Брокер за счет и по поручению Клиента уплачивает Контрагенту Сумму начального платежа в течение 1 (одного) рабочего дня с момента заключения Сделки.
Обязанности Контрагента перед Брокером		<p>Контрагент обязуется передавать Брокеру Выплаты в отношении Базисного актива в Даты Промежуточных выплат, за вычетом налогов и применимых расходов.</p> <p>Контрагент обязуется в Дату поставки Базисного актива передать Брокеру, Базисный актив, при условии оплаты всех издержек и затрат Контрагента, связанных с владением Базисным активом, за исключением случаев наступления в течение Срока Контракта:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Досрочного исполнения обязательств • Ограничивающих обстоятельств, препятствующих проведению расчетов • Альтернативного исполнения обязательств <p>При наличии Ограничивающих обстоятельств, препятствующих проведению расчетов, исполнение контракта осуществляется путем перечисления Контрагентом в пользу Клиента Брокера Замещающей суммы или Замещающих ценных бумаг.</p>
Выплаты в отношении Базисного актива (далее – Промежуточные выплаты) подлежащие уплате в пользу Клиента Брокера Контрагентом	Периоды начисления купонного дохода	Совпадают с периодами начисления купонного дохода, предусмотренного условиями Базисного актива и выпадающими на Срок Контракта
	Сумма Промежуточных выплат	<p>Сумма, равная купонному доходу, начисленному на Базисный актив и уменьшенная на налоги и применимые расходы, связанные с владением Базисным активом, Контрагентом, если применимо.</p> <p>В случае Досрочного исполнения обязательств по Сделке до завершения определенного Периода начисления купонного дохода Сумма Промежуточных выплат за такой Период начисления купонного дохода Контрагентом в пользу Клиента Брокера не уплачивается</p>
	Дата окончания купонного периода	Дата, в которую подлежит выплате начисленный купонный доход по Базисному активу в течение срока Контракта, вне зависимости от факта получения Контрагентом соответствующей выплаты.
	Дата Промежуточных выплат	Дата, наступающая не позднее чем на 120-й (сто двадцатый) календарный день, после наступления соответствующей Даты окончания купонного

		периода.
	Расчет суммы Промежуточных выплат	В случае, если купонный доход по Базисному активу выплачивается в рублях, то Промежуточные выплаты выплачиваются Контрагентом Брокеру в рублях РФ по курсу, определяемому в соответствии с Указом Президента Российской Федерации № 665 от 09.09.2023 или иным нормативным актом, действующим на момент проведения расчета.
	Дополнительные условия, регламентирующие даты выплаты Промежуточных выплат Контрагентом Брокеру и применимый курс	Указ Президента Российской Федерации № 665 от 09.09.2023, в частности п.9, в соответствии с которым выплаты производятся не ранее 91-ого дня с момента выплаты купонного дохода по Базисному активу в соответствии с проспектом эмиссии Базисного актива или иной нормативный акт, регламентирующий даты выплат купонного дохода и действующий на момент определения указанных дат.
Досрочное исполнение обязательств	<p>В случае наступления Основания досрочного исполнения любая из Сторон имеет право требовать досрочного исполнения обязательств по Сделке направив другой стороне требование о досрочном исполнении обязательств (далее – «Требование Стороны о досрочном исполнении»). Требование Стороны о досрочном исполнении должно содержать указание на такое Основание досрочного исполнения.</p> <p>Частичное исполнение обязательств по Сделке не предусмотрено.</p> <p>При наступлении Основания досрочного исполнения, предусмотренного условиями производного финансового инструмента, Контрагент обязуется в Дату досрочного исполнения передать Брокеру Базисный актив или, в случае наступления Невозможности поставки или Несообщения реквизитов для поставки, уплатить Брокеру Замещающую сумму.</p> <p>Стороны соглашаются, что все обязательства Контрагента в рамках Сделки после выплаты Брокеру Замещающей суммы в результате Досрочного исполнения обязательств считаются исполненными надлежащим образом.</p>	
Основания досрочного исполнения обязательств	<p>Любое из следующих обстоятельств:</p> <ol style="list-style-type: none"> i. Эмитент принимает решение о досрочном погашении Облигаций (полном или частичном); ii. возникают условия, обстоятельства или события, в силу которых владелец Облигаций может потребовать от Эмитента досрочного погашения Облигаций; iii. Эмитент принимает решение о приобретении Облигаций (полном или частичном); iv. наступление любого обстоятельства, предусмотренного пунктами 5.1, 5.2 и 5.3. Примерных условий договора, кроме обстоятельств, предусмотренных подпунктом (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора; v. наступление любого обстоятельства, предусмотренного пунктом 3.5 статьи 3 Генерального соглашения («Дополнительное основание прекращения»); vi. Невозможность выплаты купонов как это определено в Ограничивающих обстоятельствах настоящей спецификации vii. Эмитент принимает решение о проведение Замещения облигаций, являющихся Базисным Активом 	
Дата досрочного исполнения	30-й Рабочий день после дня получения Требования Стороны о досрочном исполнении	

Ограничивающие обстоятельства	Событием, препятствующим проведению расчетов, является: <ul style="list-style-type: none"> • Невозможность поставки Базисного актива и (или), • Невозможность получения Контрагентом Купонов и выплаты Номинальной стоимости Базисного актива и (или), • Несообщение соответствующих реквизитов Клиентом. В случае наступления События, препятствующего проведению расчетов, Контрагент выплачивает Брокеру Замещающую сумму.	
	Невозможность физической поставки	Обстоятельства, не зависящие от Контрагента, при наличии которых Контрагент не может, добросовестно предприняв все разумные усилия, передать в собственность Клиенту Брокера Базисный актив, кроме Несообщения реквизитов, в т.ч. невозможность поставки в случае, когда суммарное Количество Базисного актива, подлежащего поставке по всем Контрактам, выражается в дробном количестве лотов
	Невозможность выплаты купонов	Обстоятельства, не зависящие от Контрагента, при наличии которых Контрагент не может, добросовестно предприняв все разумные усилия, в срок установленный Указом Президента Российской Федерации № 665 от 09.09.2023 г. плюс 20 (двадцать) календарных дней получать купонный доход и (или) перечислять Промежуточные выплаты
	Несообщение реквизитов	Несообщение Клиентом Брокеру реквизитов или сообщение реквизитов, по которым невозможно осуществить и принять исполнение
	Прочие ограничения	Ограничения на основании законов и иных нормативных актов, в т.ч. ограничения со стороны Банка России и (или) иного регулирующего органа, препятствующие расчетам по Сделке.
Альтернативное исполнение Сделки	Контрагент имеет право в любой день на выбор Контрагента на протяжении срока действия Контракта до наступления Даты поставки Базисного актива и до момента выплаты Замещающей суммы без предварительного уведомления другой стороны по Сделке осуществить поставку Замещающих ценных бумаг. При этом Суммарный номинал поставляемых Контрагентом Замещающих ценных бумаг в рамках Альтернативного исполнения Сделки, рассчитываемый как произведение количества Замещающих ценных бумаг и номинала Замещающих ценных бумаг должен соответствовать Суммарному номиналу Базисного актива согласно условиям Контракта, определяемому как произведение Номинальной стоимости Базисного актива по условиям Спецификации и Количества Базисного актива по условиям Спецификации. Стороны соглашаются, что все обязательства Контрагента в рамках Сделки в случае поставки Брокеру Замещающих ценных бумаг в результате Альтернативного исполнения Сделки считаются исполненными надлежащим образом.	
Замещающие ценные бумаги	Тип Замещающих ценных бумаг	Структурная облигация
	Эмитент Замещающих ценных бумаг	ООО «СФО «Идефикс»
	Погашение и промежуточные платежи	Погашение и промежуточные платежи по Замещающим ценным бумагам обеспечены Базисным активом контракта.
	Даты погашения и промежуточных платежей	Могут быть позднее даты погашения и даты выплаты доходов по Базисному активу не более чем на 120 календарных дней.

<p>Замещающая сумма</p>	<p>Замещающая сумма рассчитывается Расчетным агентом. За исключением случаев, указанных в условиях договора, Замещающей суммой признается стоимость фактической продажи Базисного актива Контрагентом, определенная на следующих условиях: А.1. Контрагент должен, действуя добросовестно и разумно, предложить приобрести все количество Базисного актива: А.1.1. не менее чем трем профессиональным брокерам, дилерам или иным профессиональным контрагентам, осуществляющим сделки с Базисным активом с учетом места хранения Базисного актива, и ограничений, действующих в отношении Базисного актива на момент совершения предложения, как указано выше («Ограничивающие обстоятельства»); А.1.2. при отсутствии таких профессиональных контрагентов в указанном выше количестве – не менее чем трем любым контрагентам, осуществляющим сделки с Базисным активом с учетом Ограничивающих обстоятельств; А.1.3. при отсутствии указанных контрагентов в указанном выше количестве – всем доступным контрагентам с учетом Ограничивающих обстоятельств. А.2. Стоимость продажи Базисного актива, используемая для определения Замещающей суммы, должна быть не ниже наибольшей из стоимостей, предложенной контрагентами, указанными в пункте А.1. Замещающая сумма уплачивается в рублях РФ. В случае, если фактическая продажа Базисного актива осуществлена в иностранной валюте, выплата Замещающей суммы в рублях РФ производится по самому выгодному курсу, по которому Контрагент, действующий добросовестно и разумно, мог конвертировать стоимость фактической продажи Базисного актива в иностранной валюте в рубли РФ для целей такой выплаты. В случае, если присутствуют одновременно различные основания для уплаты Замещающей суммы, Замещающая сумма уплачивается однократно. Срок расчета (определение размера) Замещающей суммы составляет 5 (пять) рабочих дней для случаев, когда такой расчет осуществляется для целей выплаты Замещающей суммы в Дату Досрочного исполнения. Срок расчета (определение размера) Замещающей суммы составляет 30 (тридцать) календарных дней для случаев, когда такой расчет осуществляется для целей выплаты Замещающей суммы результате наступления Ограничивающих обстоятельств, препятствующих поставке Базисного актива в Дату поставки Базисного актива. А.3. В случае, если срок до момента погашения Базисного актива составляет менее 30 (тридцать) календарных дней, Замещающая сумма определяется как произведение Номинальной стоимости Базисного актива и Количества Базисного актива.</p>
<p>Дата поставки Замещающих ценных бумаг</p>	<p>Любой день на выбор Контрагента на протяжении срока действия Контракта до наступления Даты поставки Базисного актива и до момента выплаты Замещающей суммы.</p>
<p>Дата выплаты Замещающей суммы</p>	<p>В случае выплаты Замещающей суммы в результате Досрочного исполнения обязательств Контрагент выплачивает Брокеру Замещающую сумму в Дату Досрочного исполнения. В случае выплаты Замещающей суммы в результате наступления Ограничивающих обстоятельств, препятствующих поставке Базисного актива в Дату поставки Базисного актива, Дата выплаты Контрагентом Брокеру Замещающей суммы определяется как дата, наступающая не позднее 120 календарных дней после погашения Базисного актива.</p>
<p>Расходы, связанные с приобретением, владением и продажей Базисного актива</p>	<p>Клиент несет и оплачивает все расходы, связанные с владением Базисным активом Брокером, Контрагентом, включая, но не ограничиваясь депозитарными комиссиями и иными комиссиям третьих лиц. В расходы могут быть включены в т.ч. стоимость услуг организации, осуществляющей ведение бухгалтерского учета Контрагента, а также управляющей компании Контрагента. Оплата может производиться в порядке и на условиях Договора на брокерское обслуживание на фондовом, срочном и других финансовых рынках, заключенным между клиентом и Брокером, а также на условиях Спецификации и условий Сделки или иным способом, в том числе путем уменьшения Промежуточных выплат, транслируемых в пользу Клиента. В случае исполнения сделки путем поставки Замещающих ценных бумаг, документация выпусков Замещающих ценных бумаг также может содержать</p>

	описанный порядок оплаты Расходов, связанных с приобретением, владением и продажей Базисного актива.
Расчетный агент	АО ИФК «Солид»
Контрагент	ООО «СФО «Идефикс»
Дополнительные заверения Брокера	Содержащаяся в Спецификации информация не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией, а также не является рекламой ценных бумаг.

3. Обязанности Клиента перед Брокером

3.1. При подаче поручения на заключение Контракта Клиент производит оплату Контракта в размере Суммы начального платежа в течение 1 (одного) рабочего дня после Даты Заключения Контракта. Комиссия Брокера взимается дополнительно согласно тарифам Брокера.

3.2. Все налоги и расходы, связанные с обслуживанием Базисного актива, в течение срока действия внебиржевого форвардного контракта (комиссии за депозитарное обслуживание, иные расходы и комиссии третьих лиц), несет Клиент. Данные расходы возмещаются Клиентом в порядке, предусмотренным Регламентом.

3.3. Клиент обязан сообщить Брокеру актуальные реквизиты, необходимые для исполнения Контракта. Несообщение указанных реквизитов Клиентом Брокеру влечет наступление такого События, препятствующего проведению расчетов, как Несообщение реквизитов, что может повлечь выплату Замещающей суммы вместо поставки Базисного актива.