

УТВЕРЖДАЮ
Генеральный директор
АО «Москва Сити Секьюритиз»
Красноярцев Е.А.

Приказ № 200524/1п
от 20 мая 2024г

**СОГЛАШЕНИЕ
ОБ ОБЩИХ УСЛОВИЯХ ИСПОЛНЕНИЯ ДОГОВОРОВ РЕПО, ЗАКЛЮЧАЕМЫХ
БРОКЕРОМ НА ОСНОВАНИИ ПОРУЧЕНИЙ КЛИЕНТОВ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ
БУМАГ**

г. Москва

«_20_» мая 2024г.

Акционерное общество «Москва Сити Секьюритиз», действующее на основании брокерской лицензии № 045-13962-100000 от 30 декабря 2015г, именуемое в дальнейшем «**Брокер**», с одной стороны, и

Клиент – физическое или юридическое лицо, заключившее брокерский договор с Брокером, с другой стороны, заключили настоящее Соглашение о нижеследующем.

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1.1. Настоящее Соглашение об общих условиях исполнения договоров РЕПО, заключаемых Брокером на основании Поручений клиентов на рынке ценных бумаг, устанавливает условия и порядок заключения и исполнения Брокером договоров РЕПО, в том числе через Организаторов торговли, а также исполнения или прекращения обязательств по договорам РЕПО без полного или частичного исполнения, ответственность Сторон сделки РЕПО за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по договорам РЕПО и иных обязательств, принятых на себя Сторонами сделок РЕПО.

По настоящему Соглашению Брокер совершает сделки РЕПО на основании Поручений Клиентов за счет Клиента, но от собственного имени, либо от имени и за счет Клиента, а Клиент соглашается с условиями заключения и исполнения данных сделок.

1.2. Договором РЕПО признается договор, по которому одна сторона – продавец по договору РЕПО (далее – Первоначальный продавец по договору РЕПО) обязуется в срок, установленный этим договором, передать в собственность другой стороне – покупателю по договору РЕПО (далее – Первоначальный покупатель по договору РЕПО) ценные бумаги, а Первоначальный покупатель обязуется принять ценные бумаги и уплатить за них определенную денежную сумму (первая часть РЕПО), и по которому Первоначальный покупатель обязуется в срок, установленный этим договором, передать ценные бумаги в собственность Первоначального продавца, а Первоначальный продавец обязуется принять ценные бумаги и уплатить за них определенную денежную сумму (вторая часть РЕПО). При этом по договору РЕПО обязательства по второй части РЕПО возникают у Сторон при условии исполнения обязательств по первой части РЕПО либо их прекращения без исполнения в натуре зачетом, а если указанные обязательства допущены к клирингу – иными способами, предусмотренными Правилами клиринговой организации (далее – Договор РЕПО).

Для целей настоящего Соглашения Брокер в дальнейшем именуется также «Сторона А», вторая сторона по заключаемым сделкам РЕПО именуется «Сторона Б», а совместно – «Стороны».

1.3. Отношения между Сторонами сделки РЕПО регулируются в соответствии с Примерными условиями договоров РЕПО на российском финансовом рынке (редакция № 2), утвержденными советом Саморегулируемой организации «Национальная фондовая ассоциация» (протокол от 23.11.2012 № 12) и согласованными ФСФР России (решение от 09.04.2013) с учетом Изменений № 1 (далее – Изменения) в Примерные условия договоров РЕПО на российском финансовом рынке (редакция № 2), согласованные на заочном заседании

Российского Совета РЕПО (протокол от 21.10.2021 № 4), утвержденные на заочном заседании Совета директоров СРО НФА (протокол от 28.10.2021 № 19/21-СД) (далее совместно – Примерные условия). Положения Примерных условий применяются ко всем договорам РЕПО, заключаемым на основании настоящего Соглашения.

1.4. В случае несоответствия каких-либо положений настоящего Соглашения Примерным условиям приоритет будут иметь положения настоящего Соглашения. В случае несоответствия условий договора РЕПО каким-либо положениям настоящего Соглашения приоритет будут иметь условия соответствующего договора РЕПО.

1.5. В случае если Сторона выступает за счет, в интересах и по поручению Клиента, в документах, оформляющих факт заключения Договора РЕПО, должна быть сделана пометка, что такая Сторона действует по брокерскому договору, с указанием номера и даты договора.

В случае если Сторона выступает в качестве доверительного управляющего, в документах, оформляющих факт заключения Договора РЕПО, после наименования такой Стороны должна быть сделана пометка «Д.У.».

2. ТЕРМИНЫ И ОПРЕДЕЛЕНИЯ

2.1. Если иное не оговорено специально в тексте настоящего Соглашения, то применяются следующие основные понятия и условные обозначения:

Базовая валюта – российский рубль;

Дефицит маржи / Избыток маржи – отрицательная / положительная величина, возникающая в случае изменения цены Ценных бумаг, используемая при проведении Верхней или Нижней переоценки и рассчитываемая Сторонами по формуле, приведенной в приложении 1 к настоящему Соглашению;

Договор об оказании репозитарных услуг – основное соглашение, заключаемое Репозитарием с одной / либо с каждой из Сторон сделки РЕПО и определяющее общий порядок предоставления репозитарных услуг, права и обязанности соответствующей Стороны и Репозитария, а также порядок разрешения спорных ситуаций;

Информирующее лицо – Сторона или юридическое лицо, заключившее с Репозитарием договор об обмене электронными документами, которому Сторона предоставляет полномочия для осуществления действий, предусмотренных Договором об оказании репозитарных услуг, и определенное Стороной в качестве лица, осуществляющего от имени Стороны информационное и операционное взаимодействие с Репозитарием;

МСФО – Международные стандарты финансовой отчетности;

Организатор торговли – профессиональный участник рынка Ценных бумаг, осуществляющий деятельность по организации торговли на рынке Ценных бумаг, в том числе по оказанию услуг, непосредственно способствующих заключению Договоров РЕПО;

Подтверждение – документ, направляемый Сторонами друг другу одним из способов, согласованных Сторонами в разделе 12 настоящего Соглашения, содержащий все существенные условия заключаемого Договора РЕПО или условия, касающиеся изменения, исполнения или прекращения иным образом обязательств или осуществления прав по Договору РЕПО. Примерная форма Подтверждения приведена в приложении 2 к настоящему Соглашению;

Процентный период – часть Срока РЕПО, которая имеет (i) порядковый номер, (ii) дату начала периода (или порядок ее определения), (iii) дату окончания периода (или порядок ее определения). Сведения о Процентных периодах, если их более одного, являются существенными условиями Договора РЕПО. Суммарная продолжительность всех Процентных периодов равна Сроку РЕПО.

Во избежание сомнений Ставка РЕПО начисляется с даты начала Процентного периода (исключая эту дату) по дату окончания Процентного периода (включая эту дату);

Рабочий день:

а) для целей заключения Договоров РЕПО, 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, с 9 ч. 30 мин. до 18 ч. 00 мин. по московскому времени (в пятницу и предпраздничные дни – с 9 ч. 30 мин. до 17 ч. 00 мин. по московскому времени);

б) для целей расчетов по Договорам РЕПО – день и время, в которые организации (юридические лица), уполномоченные осуществлять платежи и переводы Ценных бумаг по

соответствующему Договору РЕПО, в том числе иностранные (при наличии договоренности Сторон об осуществлении расчетов через организации, являющиеся иностранными юридическими лицами), открыты для проведения указанных операций;

Репозитарий – Небанковская кредитная организация акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий» (НКО АО НРД);

Референс Договора РЕПО – уникальная совокупность символов, используемых Сторонами для идентификации документов, относящихся к Договору РЕПО;

Срок РЕПО – период в календарных днях, исчисляемый со дня, следующего за Датой исполнения первой части Договора РЕПО, до Даты исполнения второй части Договора РЕПО включительно. Для Договора РЕПО, первая и вторая части которого исполняются в один день, Срок РЕПО принимается равным одному дню;

Ставка РЕПО – величина, выраженная в процентах годовых и используемая Сторонами для расчета Суммы выкупа. Может быть (i) фиксированной и/или (ii) расчетной и/или (iii) определяемой по соглашению Сторон, если Срок РЕПО состоит из нескольких Процентных периодов и как минимум по одному из таких Процентных периодов Ставка РЕПО не определена на дату заключения Договора РЕПО.

Ставка РЕПО, определяемая по соглашению Сторон, может быть фиксированной и/или расчетной.

Ставка РЕПО должна позволять определить Текущую сумму выкупа на любой день в течение Срока РЕПО, а если Срок РЕПО разделен на несколько Процентных периодов – на любой день до даты начала Процентного периода, Ставка РЕПО по которому не определена;

Текущая сумма выкупа – Сумма выкупа, которая может быть рассчитана Сторонами в любой день в течение Срока РЕПО в соответствии с формулой, приведенной в приложении 1 к настоящему Соглашению;

Уровень переоценки – величина допустимого колебания Дефицита / Избытка маржи, согласованная Сторонами при заключении Договора РЕПО, при превышении которого возникает основание для проведения Верхней или Нижней переоценки. Уровень переоценки для проведения Верхней и Нижней переоценки может быть разным;

Уровень прекращения – величина допустимого колебания Дефицита маржи, согласованная Сторонами при заключении Договора РЕПО, при превышении которого возникает основание для досрочного исполнения Договора РЕПО;

Ценные бумаги – ценные бумаги, являющиеся предметом Договора РЕПО: эмиссионные ценные бумаги российского эмитента, инвестиционные паи паевого инвестиционного фонда, доверительное управление которым осуществляет российская управляющая компания, клиринговые сертификаты участия, акции или облигации иностранного эмитента, инвестиционные паи или акции иностранного инвестиционного фонда, ценные бумаги иностранного эмитента, удостоверяющие права в отношении ценных бумаг российского и/или иностранного эмитента;

Электронная подпись – информация в электронной форме, которая присоединена к другой информации в электронной форме (подписываемой информации) или иным образом связана с такой информацией, и которая используется для определения лица, подписывающего информацию. В рамках настоящего Соглашения под Электронной подписью понимается усиленная неквалифицированная электронная подпись / усиленная квалифицированная электронная подпись;

электронные средства связи (ЭСС)¹ – используемые Сторонами для проведения переговоров и с целью заключения сделок системы Reuters, Bloomberg, MOEX Dealing, а также электронная почта.

2.2. Иные термины, специально не определенные в настоящем Соглашении, используются в значениях, установленных в Примерных условиях.

2.3. Заголовки разделов настоящего Соглашения даны исключительно для облегчения ссылок на них и не должны приниматься во внимание при толковании настоящего Соглашения.

¹ Список подлежит корректировке в зависимости от наличия / отсутствия у Сторон соответствующих каналов связи.

3. ЗАВЕРЕНИЯ ОБ ОБСТОЯТЕЛЬСТВАХ

3.1. Стороны сделок РЕПО предоставляют друг другу в дату заключения каждого Договора РЕПО следующие заверения об обстоятельствах, имеющих для них существенное значение:

а) они являются юридическими лицами, созданными и зарегистрированными в соответствии с законодательством страны их места государственной регистрации;

б) они обладают законными полномочиями на заключение Договоров РЕПО и выполнение принятых на себя обязательств по каждому Договору РЕПО;

в) они имеют все действующие лицензии, необходимые для заключения и исполнения Договоров РЕПО;

г) на момент заключения каждого Договора РЕПО они выполнили все требования по одобрению, уведомлению, получению разрешения, согласия органа управления Стороны или любые иные требования и согласования, необходимые для заключения каждого Договора РЕПО в соответствии с Действующим законодательством и внутренними документами Стороны;

д) заключение каждого Договора РЕПО не является для Стороны основанием для проведения конкурса, торгов или иных аналогичных процедур в соответствии с внутренними положениями документации Стороны и законодательства Российской Федерации;

е) условия и требования, которые позволяют им заключать Договоры РЕПО, использовать свои права и исполнять свои обязанности по заключенным Договорам РЕПО, должным образом каждой из них соблюдены;

ж) заключение Договоров РЕПО, а также исполнение обязательств по ним, насколько им известно, не будет нарушать Действующее законодательство, законодательство страны государственной регистрации Стороны и внутренние нормативные документы Стороны;

з) выполнение условий настоящего Соглашения не повлечет за собой нарушение какого-либо иного соглашения, договора или договоренности, которые имеются у каждой из Сторон друг с другом и у каждой из Сторон в отдельности с третьими лицами;

и) они согласны с предоставлением каждой из Сторон права на запись телефонных переговоров по Договорам РЕПО, причем такая запись может быть использована Сторонами в качестве доказательства при решении спорных вопросов, в том числе в ходе судебного разбирательства;

к) они будут незамедлительно извещать друг друга о любых изменениях в их заявлениях, изложенных в настоящем разделе;

л) на дату заключения любого Договора РЕПО лица, заключающие сделки, а также имеющие доступ к электронной почте и ЭСС, надлежащим образом уполномочены на это.

Стороны отвечают за действия своих сотрудников и любых других лиц, которые хотя и не уполномочены надлежащим образом, однако действуют так, что из их действий и обстановки следует наличие у таких лиц необходимых полномочий. К числу обстоятельств, свидетельствующих о наличии у лица необходимых полномочий, относится отправление сообщений, заявлений или подтверждений по каналам связи, обычно используемым Сторонами при проведении переговоров и заключении сделок. Стороны принимают на себя всю ответственность за наличие полномочий у лиц, имеющих доступ к ЭСС, электронной почте;

м) заключая каждую сделку, Стороны тем самым признают, что в полной мере понимают характер соответствующей сделки, все потенциальные последствия этой сделки и риски, связанные с ними (включая среди прочего возможную прибыль или убытки, возникающие вследствие колебаний цен, ставок, валютных курсов и иных рыночных показателей, а также юридические и иные риски в связи со сделкой);

н) каждый документ, представленный (на бумажном носителе в оригинале или в копии либо в электронной форме) такой Стороной или от ее имени другой Стороне в связи с настоящим Соглашением, является верным, полным и действующим в полном объеме на дату его предоставления;

о) каждая Сторона получила все необходимые согласия на раскрытие персональных данных.

3.2. В дату поставки (передачи) Ценных бумаг Сторона, передающая Ценные бумаги, предоставляет другой Стороне следующие заверения об обстоятельствах, имеющих для последней существенное значение:

а) поставляемые (передаваемые) ими Ценные бумаги не обременены залогом, свободны от иных прав третьих лиц, за исключением случаев, указанных в подп. в) ниже, а также не

находятся под арестом и являются подлинными;

б) они имеют право и возможность продать и передать Ценные бумаги другой Стороне;

в) Ценные бумаги, являющиеся объектом Договоров РЕПО, или Ценные бумаги, которые будут являться объектом Договоров РЕПО, находятся в собственности или в доверительном управлении (в указанном случае, Сторона, осуществляющая доверительное управление, обязана предоставить другой Стороне засвидетельствованную в нотариальном порядке копию договора доверительного управления) у Стороны, отчуждающей Ценные бумаги, и условия договора доверительного управления позволяют такой Стороне отчуждать (передавать в собственность) третьим лицам Ценные бумаги, за исключением случаев, когда такая Сторона действует в интересах и по поручению клиента в рамках брокерского договора.

3.3². Стороны подтверждают, что заключаемые в рамках настоящего Соглашения Договоры РЕПО не совершаются в прямом или косвенном интересе:

– лиц, включенных в перечни физических и юридических лиц постановления Правительства Российской Федерации от 01.11.2018 № 1300 «О мерах по реализации Указа Президента Российской Федерации от 22.10.2018 № 592», а также лиц, контролируемых физическими или юридическими лицами из указанных перечней;

– лиц, в отношении которых применяются специальные экономические меры в соответствии с любыми актами Президента Российской Федерации или Правительства Российской Федерации.

3.4. Стороны в рамках заключения и исполнения Договоров РЕПО будут полагаться на заверения об обстоятельствах, предоставленные в рамках пунктов 3.1, 3.2 и 3.3 настоящего Соглашения. Во избежание сомнений все заверения, сделанные / предоставленные Сторонами в соответствии с настоящим разделом, являются заверениями об обстоятельствах по смыслу ст. 431.2 Гражданского кодекса Российской Федерации.

4. СУЩЕСТВЕННЫЕ УСЛОВИЯ ДОГОВОРОВ РЕПО. ПОРЯДОК ЗАКЛЮЧЕНИЯ ДОГОВОРОВ РЕПО

4.1. Стороны признают, что существенными условиями Договоров РЕПО являются следующие условия:

4.1.1. Первоначальный продавец и Первоначальный покупатель.

4.1.2. Ценные бумаги, являющиеся предметом Договора РЕПО. Условие считается согласованным, если однозначно определены:

– наименование лица (лиц), выпустившего (их) / выдавшего (их) Ценные бумаги, вид Ценных бумаг, форма, для акций также – категория (тип), для паев паевых инвестиционных фондов также – наименование паевого инвестиционного фонда;

– государственный регистрационный номер, а также иные реквизиты, предусмотренные Действующим законодательством для данного вида (категории, типа) Ценной бумаги. Для иностранных Ценных бумаг – коды ISIN и CFI, если иное не предусмотрено нормативными правовыми актами Российской Федерации.

4.1.3. Количество Ценных бумаг или порядок его определения (количество в штуках или общая номинальная стоимость (применимо к количеству конкретного вида), и/или выпуск, и/или серия и т. д.) в соответствии с условиями выпуска или обычаями делового оборота определяется как сумма их номиналов.

При заключении Договора РЕПО на торгах Организатора торговли определение требований к Ценным бумагам (пункт 4.1.2 настоящего Соглашения) и порядок определения их количества (пункт 4.1.3 настоящего Соглашения) могут устанавливаться Правилами Организатора торговли. Идентификация Ценных бумаг и их количества осуществляется при подаче заявки. Включение кода Ценной бумаги или иного идентификатора Ценной бумаги признается достаточной идентификацией при наличии в Правилах Организатора торговли указаний о Ценных бумагах, с которыми могут совершаться Договоры РЕПО.

² Пункт включается и может быть дополнен / изменен в зависимости от действующих на момент подписания настоящего Соглашения применимых актов.

4.1.4. Валюта Договора РЕПО.

4.1.5. Цена первой части РЕПО. Не является существенным условием Договора РЕПО, если Стороны согласовали Текущую стоимость на дату заключения Договора РЕПО и Начальный коэффициент обеспечения.

4.1.6. Сумма покупки или порядок ее определения.

4.1.7. Валюта расчетов и применимый курс пересчета по первой части РЕПО. Не является существенным условием Договора РЕПО, если Валюта расчетов совпадает с Валютой Договора РЕПО.

4.1.8. Дата покупки.

4.1.9. Дата поставки по первой части Договора РЕПО.

4.1.10. Порядок расчетов по первой части Договора РЕПО.

4.1.11. Ставка РЕПО. Не является существенным условием Договора РЕПО, если Стороны согласовали Сумму покупки, Сумму выкупа и Срок РЕПО (либо даты расчетов по первой и второй частям РЕПО, предусмотренные пунктами 4.1.8, 4.1.9, 4.1.15, 4.1.16 настоящего Соглашения).

4.1.12. Срок РЕПО. Не является существенным условием Договора РЕПО, если Стороны согласовали даты расчетов по первой и второй частям РЕПО (пункты 4.1.8, 4.1.9, 4.1.15, 4.1.16 настоящего Соглашения).

4.1.13. Сумма выкупа или порядок ее определения.

4.1.14. Валюта расчетов и применимый курс пересчета по второй части Договора РЕПО. Не является существенным условием Договора РЕПО, если Валюта расчетов совпадает с Валютой Договора РЕПО.

4.1.15. Дата выкупа. Не является существенным условием для РЕПО с открытой датой.

4.1.16. Дата поставки Ценных бумаг по второй части Договора РЕПО. Не является существенным условием для РЕПО с открытой датой.

4.1.17. Порядок расчетов по второй части Договора РЕПО.

4.1.18. Возможность проведения Верхней / Нижней переоценки.

4.1.19. В случае если согласована возможность проведения Верхней и/или Нижней переоценки – Уровень переоценки и Начальный коэффициент обеспечения.

4.1.20. В случае выплаты эмитентом Ценных бумаг в течение Срока РЕПО дивидендов / купонного дохода / сумм частичного погашения – осуществляет ли Первоначальный покупатель перечисление соответствующих сумм Первоначальному продавцу или такие суммы учитываются в качестве предоплаты по второй части Договора РЕПО.

4.1.21. В случае если Стороны совершают РЕПО с открытой датой – указание на то, что заключаемый Договор является РЕПО с открытой датой. В этом случае вместо Даты выкупа, предусмотренной пунктом 4.1.15 настоящего Соглашения, и Даты поставки Ценных бумаг по второй части Договора РЕПО, предусмотренной пунктом 4.1.16 настоящего Соглашения, существенным условием такого Договора РЕПО будут:

– Дата требования об исполнении РЕПО с открытой датой;

– указание на то, какая из Сторон (Первоначальный покупатель и/или Первоначальный продавец) будет иметь право направления другой Стороне требования об исполнении обязательств по второй части Договора РЕПО.

4.1.22. В случае если Срок РЕПО разделен на два и более Процентных периода – дата начала и окончания (или порядок их определения) каждого Процентного периода. При несогласовании данного условия считается, что Срок РЕПО не разделен на Процентные периоды.

4.2. При заключении Договора РЕПО на торгах Организатора торговли Стороны согласовывают условия, определенные в Правилах Организатора торговли.

4.3. В случае если Дата покупки, Дата выкупа, Дата поставки по первой или второй части Договора РЕПО, определенные условиями Договора РЕПО, приходится на день, не являющийся Рабочим днем, для целей расчетов по Договорам РЕПО Датой покупки, Датой выкупа, Датой поставки по первой или второй части Договора РЕПО соответственно признается следующий за ним Рабочий день. При этом применяется фактическая цена реализации (приобретения) Ценной бумаги как по первой части Договора РЕПО, так и по второй части Договора РЕПО независимо от рыночной (расчетной) стоимости таких Ценных бумаг. Такая цена реализации (приобретения) рассчитывается с учетом накопленного процентного (купонного) дохода на дату перехода прав собственности на Ценные бумаги.

4.4. Условие о замене Ценных бумаг является изменением условий Договора РЕПО по требованию Первоначального покупателя и может повлечь также изменение цены, в том числе если Сторонами установлен порядок ее определения. Условие о замене не влияет на срок исполнения обязательств по второй части Договора РЕПО. Замена Ценных бумаг осуществляется также при совершении эмитентом Ценных бумаг корпоративных действий по консолидации, конвертации, дроблению Ценных бумаг.

Условие о замене Ценных бумаг может устанавливаться в Правилах Организатора торговли.

Внесение изменений в Договор РЕПО в связи с заменой Ценных бумаг осуществляется способами, предусмотренными пунктом 4.10 настоящего Соглашения.

Первоначальный покупатель имеет право требовать замены Ценных бумаг по Договору РЕПО в случае:

- исключения Ценных бумаг российских эмитентов из числа допущенных к организованным торгам на площадках ПАО Московская Биржа для заключения договоров купли-продажи, в том числе исключение Ценных бумаг из котировального списка ПАО Московская Биржа;

- неисполнения эмитентом обязательств по Ценным бумагам;

- введения Санкций³ в отношении эмитента Ценных бумаг, вследствие чего, по обоснованному мнению Первоначального покупателя бумаг, (данное условие применяется к Договорам РЕПО, в которых Первоначальным покупателем является Сторона А), существует риск:

- неисполнения / ненадлежащего исполнения третьими лицами, участие которых необходимо для целей исполнения обязательств эмитента по Ценным бумагам (в том числе, но не ограничиваясь, банками-корреспондентами, банками, в которых открыты счета, используемые для расчетов по Ценным бумагам, агентами, доверительными управляющими), всех или отдельных видов сделок / операций, необходимых для исполнения эмитентом обязательств по Ценным бумагам, а также блокировки платежа по Ценным бумагам со стороны таких третьих лиц;

- неисполнения / ненадлежащего исполнения третьими лицами, участие которых необходимо для целей исполнения обязательств по поставке Ценных бумаг в рамках Договора РЕПО (в том числе, но не ограничиваясь, депозитариями, клиринговыми центрами, агентами, доверительными управляющими), всех или отдельных видов сделок / операций, необходимых для исполнения обязательств по поставке Ценных бумаг в рамках Договора РЕПО, а также блокировки Ценных бумаг со стороны таких третьих лиц;

- исключения Ценных бумаг иностранных эмитентов из числа допущенных к организованным торгам для заключения договоров купли-продажи.

Количество заменяющих Ценных бумаг определяется исходя из Текущей суммы выкупа и Текущей стоимости заменяющих Ценных бумаг на дату направления требования о замене.

Замена Ценных бумаг не может осуществляться по требованию Первоначального продавца.

4.5. Все суммы обязательств по Договорам РЕПО рассчитываются в Валюте Договора РЕПО.

4.6. Для Договоров РЕПО, заключаемых на торгах Организатора торговли, суммы обязательств рассчитываются в соответствии с порядком, определенным в Правилах Организатора торговли.

4.7. В случае если какая-либо из Сторон оговорила при заключении Договора РЕПО использование стандартных реквизитов для расчетов, а также в случае достаточности таких реквизитов для осуществления расчетов, расчеты по Договору РЕПО осуществляются с использованием реквизитов этой Стороны, указанных в разделе 17 настоящего Соглашения.

4.8. Стороны вправе дополнительно при заключении Договора РЕПО согласовать порядок распределения расходов, которые могут возникать при осуществлении перевода Ценных бумаг.

Стороны договорились, что при заключении Договора РЕПО в отношении депозитарных

³ Под Санкциями понимаются любые экономические, финансовые или торговые ограничения либо ограничительные меры, введенные на основании законов, нормативных правовых или индивидуальных актов государственных или иных уполномоченных органов в соответствии с применимым правом в отношении юридических или физических лиц.

расписок Первоначальный продавец в срок не позднее 5 (Пяти) рабочих дней с момента получения соответствующего уведомления обязуется компенсировать Первоначальному покупателю все расходы, связанные с уплатой ежегодной комиссии за хранение депозитарных расписок, выплачиваемой соответствующему депозитарию, если Стороны в соответствующем Подтверждении не согласовали иное.

4.9. Стороны проводят переговоры по согласованию условий Договора РЕПО. В ходе переговоров должны быть согласованы параметры Договора РЕПО, позволяющие однозначно определить (рассчитать) все существенные условия Договора РЕПО, указанные в настоящем разделе.

Цена второй части Договора РЕПО, Сумма выкупа рассчитываются по формулам, приведенным в приложении 1 к настоящему Соглашению.

4.10. Стороны заключают Договоры РЕПО любым из следующих способов:

а) путем использования ЭСС в порядке, предусмотренном п. 4.11 настоящего Соглашения; или

б) без использования ЭСС путем обмена Подтверждениями в порядке, предусмотренном разделом 12 настоящего Соглашения. В этом случае соответствующий Договор РЕПО считается заключенным с момента обмена обеими Сторонами Подтверждениями, составленными по форме согласно приложению 2 к настоящему Соглашению либо иной форме, содержащими все согласованные Сторонами существенные условия Договора РЕПО, изложенные идентично во встречных Подтверждениях.

4.11. Договор РЕПО (в том числе внесение изменений) между Сторонами, за исключением договоров, заключаемых при посредничестве Организатора торговли, считается заключенным с момента достижения согласия по всем существенным условиям, указанным в разделе 4 настоящего Соглашения, по ЭСС либо с момента обмена Сторонами идентичными Подтверждениями в порядке, предусмотренном разделом 12 настоящего Соглашения – для сделок, существенные условия которых согласовывались Сторонами по телефону и/или электронной почте.

При этом Стороны признают распечатки переговоров о заключении Договора РЕПО (внесении в него изменений) по ЭСС, содержащие согласованные существенные условия Договора РЕПО, указанные в настоящем разделе, ясно и недвусмысленно свидетельствующие о факте заключения Договора РЕПО (внесении в него изменений), безусловным и окончательным документом, свидетельствующим о заключении Договора РЕПО (внесении в него изменений) в письменной форме.

Такой договор признается заключенным в письменной форме на условиях, изложенных в распечатках переговоров по ЭСС, если иное не будет доказано Стороной, оспаривающей факт заключения Договора РЕПО и его существенные условия.

5. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ДОГОВОРАМ РЕПО

5.1. По Договору РЕПО с открытой датой Сторона, имеющая право предъявления требования об исполнении Договора РЕПО, в любой Рабочий день до Даты требования об исполнении Договора РЕПО с открытой датой (включительно) вправе направить другой Стороне в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, требование об исполнении Договора РЕПО с открытой датой с указанием предполагаемой даты, в которую должны быть исполнены обязательства по второй части данного Договора РЕПО с открытой датой.

Такое требование должно быть доставлено другой Стороне не менее чем за 3 (Три) Рабочих дня до предполагаемой Даты исполнения второй части Договора РЕПО, но в любом случае не позднее срока, достаточного для своевременного осуществления перевода Ценных бумаг, являющихся предметом Договора РЕПО с открытой датой, и не позднее срока, необходимого для проведения расчетов в соответствии с Порядком расчетов, согласованным Сторонами в качестве одного из условий такого Договора РЕПО.

В этом случае:

– Датой выкупа и Датой поставки по второй части Договора РЕПО с открытой датой будут считаться соответственно даты, указанные в таком требовании;

– Сумма выкупа рассчитывается в порядке, установленном в приложении 1 к настоящему Соглашению для определения Текущей суммы выкупа, на Дату выкупа, указанную в письменном требовании об исполнении Договора РЕПО с открытой датой, с учетом переоценок,

если таковые производились по Договору РЕПО.

Другая Сторона безусловно соглашается с условиями исполнения РЕПО с открытой датой, если они соответствуют предъявляемым к ним в соответствии с настоящим Соглашением требованиям, и обязуется исполнить свои обязательства по второй части Договора РЕПО с открытой датой в срок, указанный в таком требовании.

5.2. В отношении Договора РЕПО, для которого согласован порядок расчетов «Предпоставка» / «Предоплата», при неисполнении в срок обязательства Стороной, которая должна в соответствии с достигнутой договоренностью осуществить передачу соответствующего актива первой, то есть осуществить предоплату / предпоставку, другая Сторона вправе исполнить соответствующее обязательство по перечислению денежных средств / поставке Ценных бумаг в Рабочий день, следующий за днем исполнения обязательств первой Стороной.

5.3. Каждая из Сторон обязуется обеспечить со своей стороны возможность проведения расчетов по каждому заключенному Договору РЕПО, в том числе обеспечить наличие соответствующего актива (то есть денежных средств или Ценных бумаг), доступного для проведения расчетов и соответствующего требованиям, предъявляемым настоящим Соглашением, а также предоставить в расчетные организации все документы, необходимые для проведения соответствующих расчетов.

5.4. Если Стороны не договорились об ином или Правилами Организатора торговли и/или Правилами клиринговой организации не предусмотрено иное, обязательство по оплате считается исполненным с момента зачисления денежных средств в сумме, достаточной для исполнения такого обязательства в полном объеме, на корреспондентский счет, указанный получателем денежных средств, либо на корреспондентский счет банка или небанковской кредитной организации, обслуживающей получателя, а в случаях, когда расчеты осуществляются в одной кредитной организации, – с момента зачисления денежных средств на счет, указанный получателем.

Обязательство по оплате считается прекращенным в случае зачета обязательств, оформленного в соответствии с настоящим Соглашением.

5.5. Обязательство по поставке Ценных бумаг считается исполненным:

– в случае нахождения Ценных бумаг у владельца – с момента фактической передачи их получателю, оформленной актом приема-передачи;

– в случае хранения Ценных бумаг, сертификатов предъявительских документарных Ценных бумаг и/или учета прав на Ценные бумаги в депозитарии – с момента осуществления приходной записи по счету депо, указанному получателем в соответствии с требованиями законодательства;

– в случае учета прав на Ценные бумаги в системе ведения реестра – с момента внесения приходной записи по лицевому счету, указанному получателем в соответствии с требованиями Действующего законодательства.

Обязательство по поставке считается прекращенным в случае зачета обязательств, оформленного в соответствии с настоящим Соглашением.

5.6. При замене Ценных бумаг путем внесения изменений в условия Договора РЕПО в отношении заменяющих Ценных бумаг должны быть указаны такие же данные, как и при заключении Договора РЕПО.

При замене Ценных бумаг по требованию Первоначального покупателя последний обязан вернуть Первоначальному продавцу Ценные бумаги, полученные им по первой части Договора РЕПО.

При замене Ценных бумаг, за исключением замены Ценных бумаг по Договорам РЕПО, заключенным через Организатора торговли, и в случае, если стороны Договора РЕПО не договорились об одновременном исполнении, исполнение обязательств по передаче Ценных бумаг осуществляется обеими Сторонами Договора РЕПО в течение одного Рабочего дня на условии предпоставки Ценных бумаг лицу, имеющему право требования замены Ценных бумаг.

Порядок передачи и возврата Ценных бумаг в результате замены по Договорам РЕПО, заключенным через Организатора торговли, и/или в отношении которых клиринговой организацией проводится клиринг обязательств, определяется Правилами Организатора торговли и/или Правилами клиринговой организации.

5.7. Стороны признают, что по Договору РЕПО, заключенному на торгах фондовой биржи или иного Организатора торговли лицом, которое определяет сумму денежных средств (количество Ценных бумаг), подлежащих передаче по Договору РЕПО, предъявляет Сторонам

связанные с этим требования, предусмотренные условиями Договора РЕПО, осуществляет действия, необходимые для совершения операций по счету депо, на котором учитываются Ценные бумаги, совершает иные действия, необходимые для осуществления прав и исполнения обязанностей каждой из Сторон по Договору РЕПО, является клиринговая организация, с которой у каждой из Сторон Договора РЕПО заключены договоры на клиринговое обслуживание. Указанное лицо определяется Правилами Организатора торговли.

5.8. Проведение зачета встречных однородных требований по Договорам РЕПО осуществляется, если в какую-либо дату (далее – Дата зачета) Стороны обязаны произвести друг другу два или более платежа в одной и той же валюте, требования по исполнению таких обязательств считаются однородными и могут подлежать зачету, который будет проводиться следующим образом:

- суммы платежей каждой Стороны в пользу другой Стороны складываются;
- если общая сумма обязательств по денежным средствам одной Стороны превышает общую сумму обязательств по денежным средствам другой Стороны, то выплату разницы осуществляет та Сторона, которая имеет большую сумму обязательств по денежным средствам;
- если суммы платежей, которые Стороны должны были произвести друг другу, равны, то платеж не осуществляется.

Если в Дату зачета Стороны обязаны осуществить друг другу две и более поставки Ценных бумаг одного выпуска, то требования по исполнению таких обязательств считаются однородными и могут подлежать зачету, который будет производиться следующим образом:

- количества Ценных бумаг, подлежащих поставке каждой из Сторон в пользу другой Стороны, складываются;
- если общий объем обязательств по Ценным бумагам одной Стороны превышает общий объем обязательств по Ценным бумагам другой Стороны, то перевод Ценных бумаг в количестве, равном разнице обязательств Сторон, осуществляет та Сторона, которая имеет больший объем обязательств по Ценным бумагам;
- если количества Ценных бумаг, поставку которых Стороны должны были произвести друг другу, равны, то поставка не осуществляется.

Проведение зачета встречных однородных требований оформляется письменными Подтверждениями в порядке и на условиях, предусмотренных разделом 12 настоящего Соглашения. Примерная форма Договора о взаиморасчетах приведена в приложении 3 к настоящему Соглашению.

Не допускается проведение зачета встречных однородных требований по заявлению одной из Сторон, если условиями настоящего Соглашения не предусмотрено иное.

Порядок зачета / неттинга обязательств при проведении клиринга клиринговой организации определяется Правилами клиринговой организации.

5.9. Первоначальный покупатель обязан передать Первоначальному продавцу во исполнение обязательств по второй части Договора РЕПО Ценные бумаги того же эмитента (лица, выдавшего Ценные бумаги), удостоверяющие тот же объем прав, в том же количестве (кроме случаев дробления и консолидации), что и Ценные бумаги, переданные Первоначальному покупателю по первой части Договора РЕПО, одного выпуска и/или дополнительных выпусков Ценных бумаг, если Стороны не договорились осуществить замену Ценных бумаг.

5.10. При неисполнении в срок одной из Сторон обязательств по первой части Договора РЕПО другая Сторона в любой Рабочий день начиная с первого Рабочего дня, следующего за днем, когда соответствующее обязательство должно было быть исполнено, вправе расторгнуть в одностороннем порядке Договор РЕПО при условии, что указанное обязательство на момент расторжения остается неисполненным, направив соответствующее уведомление, в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, не исполнившей обязательство Стороне, а также потребовать уплаты неустойки и/или возмещения убытков в соответствии с настоящим Соглашением. При этом обязательства Сторон прекращаются, за исключением обязанности Сторон вернуть другой Стороне по Договору РЕПО полученные по первой части Договора РЕПО денежные средства или Ценные бумаги, если Стороны не договорились об ином или иное не установлено Правилами Организатора торговли.

Если Стороной Б по настоящему Соглашению является юридическое лицо, учрежденное или зарегистрированное в иностранной юрисдикции, в настоящее Соглашение

включается пункт 5.11 следующего содержания⁴:

«5.11. Если одна из Сторон по Договору РЕПО является нерезидентом Российской Федерации, то каждая Сторона признается налоговым агентом в отношении выплачиваемых доходов в форме процентов по размещенным (привлеченным) средствам и удерживает налог из таких доходов.

Удержание налога Стороной А осуществляется в соответствии с Налоговым кодексом Российской Федерации, а также правилами и нормами международных договоров об избежании двойного налогообложения, если Сторона Б предоставила до даты выплаты дохода подтверждение того, что она имеет постоянное местонахождение (местопребывание) в государстве, с которым Российская Федерация имеет международный договор (соглашение), регулирующий (ее) вопросы налогообложения (апостилированный сертификат налогового резидентства), и письмо-подтверждение, что она действует от своего имени и является бенефициарным собственником (фактическим владельцем) такого дохода, по форме Стороны А.

В случае появления обстоятельств, при которых фактическое право на получение доходов получит другое лицо, Сторона Б обязуется незамедлительно проинформировать об этом Сторону А, а также предоставить Стороне А документы, необходимые для применения соответствующих ставок налога, включая заявление о лицах, имеющих фактическое право на доход по настоящему Соглашению, с приложением подтверждающих и надлежащим образом заверенных документов не позднее рабочего дня, предшествующего дню выплаты дохода.

В случае если Сторона Б выступает от своего имени, за счет, в интересах и по поручению третьей стороны, она обязана до заключения сделки РЕПО предоставить Стороне А апостилированный сертификат налогового резидентства третьей стороны и письмо-подтверждение от третьей стороны, что такая третья сторона является бенефициарным (фактическим) собственником дохода. Подтверждение постоянного местонахождения (местопребывания) должно быть заверено компетентным органом, определенным в международном договоре (соглашении), или уполномоченным им представителем соответствующего иностранного государства и представляется за каждый календарный год выплаты доходов.

В случае если Сторона Б не предоставит надлежащим образом оформленные документы, указанные выше в настоящем пункте, или, в случае если предоставленные документы не будут свидетельствовать о налоговом резидентстве получателя дохода, Сторона А при выплате доходов Стороне Б удержит налог в соответствии с Налоговым кодексом Российской Федерации.».

6. ОСНОВАНИЯ ДЛЯ ДОСРОЧНОГО ИСПОЛНЕНИЯ ДОГОВОРОВ РЕПО

6.1. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Стороной Б обязательств по проведению переоценки путем внесения Компенсационных или Маржинальных взносов, замене Ценных бумаг Сторона А, имеющая право требовать проведения переоценки, замены Ценных бумаг, имеет право потребовать от Стороны Б досрочного исполнения обязательств по второй части Договора РЕПО.

6.2. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Стороной Б обязательств, предусмотренных пунктом 12.10 настоящего Соглашения.

6.3. Сторона Б в течение более чем 1 (Одного) Рабочего дня не исполняет какое-либо обязательство по поставке денежных средств и/или Ценных бумаг, которое подлежит исполнению согласно настоящему Соглашению и/или какому-либо Договору РЕПО.

6.4. В случае превышения Уровня прекращения в любой день действия заключенного договора РЕПО (т. е. при превышении Дефицита маржи по модулю уровня, определяемого согласно приложению 1 к настоящему Соглашению).

6.5. Дополнительными основаниями прекращения в отношении Стороны А и Стороны Б является любое из событий (во избежание сомнений, за исключением событий, указанных в п. 11.2 настоящего Соглашения):

⁴ Если Сторона Б выступает в интересах третьего лица, Сторона Б также должна предоставить письмо-подтверждение от своего имени об отсутствии у нее бенефициарного (фактического) права собственности на доход (по форме Стороны А).

- a) Финансовое состояние Стороны отвечает признакам несостоятельности (банкротства) и/или основаниям для осуществления мер по предупреждению банкротства, установленным законодательством о банкротстве.
- b) Принятие судом к рассмотрению заявления в отношении Стороны о признании должника банкротом (в том числе заявления должника).
- c) Принятие в отношении Стороны мер по предупреждению банкротства, установленных законодательством о банкротстве, введение в отношении Стороны процедур банкротства, установленных законодательством о банкротстве, в том числе наблюдение, финансовое оздоровление, внешнее управление, назначение временной администрации или уполномоченного представителя Банка России в случае осуществления в отношении Стороны мер по предупреждению банкротства.
- d) Отзыв, аннулирование или приостановление действия любой лицензии, в том числе лицензии профессионального участника рынка Ценных бумаг, за исключением случаев аннулирования лицензии по инициативе Стороны, если такое аннулирование не влияет на способность соответствующей Стороны приобретать права и обязанности, а также надлежащим образом исполнять обязательства по настоящему Соглашению и/или какой-либо сделке.
- e) Принятие решения о ликвидации или назначении ликвидационной комиссии (ликвидатора) Стороны учредителями (участниками) Стороны, ее органом, уполномоченным на это учредительными документами, или судом.
- f) Предъявление уполномоченным государственным органом, Банком России или органом местного самоуправления в суд требования о ликвидации Стороны по основаниям, предусмотренным Действующим законодательством.
- g) Наличие принятых к рассмотрению исков к Стороне в объеме, превышающем 20 % от величины ее собственных средств / собственного капитала.
- h) Иные аналогичные меры, действия или процедуры, предусмотренные законодательством о несостоятельности (банкротстве), применимым к Стороне Б.

6.6. В случаях, указанных в пунктах 6.1–6.5 настоящего Соглашения, по выбору соответствующей Стороны, в отношении которой не наступили события, указанные в пунктах 6.1–6.5 настоящего Соглашения, обязательства Сторон подлежат досрочному исполнению по всем или отдельным Договорам РЕПО путем направления уведомления Стороне, в отношении которой наступили события, указанные в пунктах 6.1–6.5 настоящего Соглашения (с учетом применения условий пунктов 6.1–6.5 к соответствующей Стороне), в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, либо прекращаются по всем Договорам РЕПО в порядке, предусмотренном Примерными условиями и настоящим Соглашением.

При этом:

– Датами выкупа и Датами поставки по второй части Договора РЕПО по досрочно исполняемым Договорам РЕПО будут считаться даты, указанные в соответствующем уведомлении Стороны, которые не могут наступить ранее Рабочего дня, следующего за днем получения другой Стороной соответствующего уведомления, и соответствуют срокам, необходимым для своевременного осуществления поставки Ценных бумаг и проведения расчетов в соответствии с Порядком расчетов;

– Суммы выкупа по таким Договорам РЕПО будут изменены соответственно на Текущие суммы выкупа, рассчитанные в соответствии с формулой, приведенной в приложении 1 к настоящему Соглашению, на измененные Даты выкупа. В случае если Договоры РЕПО заключены при посредничестве Организатора торговли, Суммы выкупа по таким Договорам РЕПО будут рассчитываться в соответствии с Правилами Организатора торговли.

Сторона, потребовавшая досрочного исполнения обязательств, также должна исполнить свои обязательства по второй части Договоров РЕПО в указанный ею в требовании о досрочном исполнении срок.

При неисполнении требования о досрочном исполнении обязательств по второй части Договора РЕПО Сторона, потребовавшая досрочного исполнения Договоров РЕПО, имеет право начать Процедуру урегулирования в соответствии с разделом 10 настоящего Соглашения.

6.6. В случае если одновременно соблюдаются все нижеприведенные условия:

- i) Срок РЕПО разделен на несколько Процентных периодов;
- ii) в дату заключения Договора РЕПО как минимум по одному Процентному периоду Ставка РЕПО не была согласована;

iii) до 16:00 по московскому времени Рабочего дня, предшествующего дате начала Процентного периода, по которому Ставка РЕПО не согласована, Стороны не согласовали Ставку РЕПО на такой Процентный период. Согласование Ставки РЕПО осуществляется в порядке, предусмотренном для заключения Договоров РЕПО, такой Договор РЕПО подлежит досрочному исполнению без направления каких-либо требований в дату окончания Процентного периода, предшествующего Процентному периоду, на который Стороны не согласовали Ставку РЕПО. Если такая дата выпадает на выходной или праздничный день, то досрочное исполнение Договора РЕПО производится в ближайший следующий Рабочий день.

7. ПЕРЕОЦЕНКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ДОГОВОРУ РЕПО

7.1. Для целей снижения риска неисполнения Первоначальным продавцом обязательства по выкупу Ценных бумаг или Первоначальным покупателем обязательства по продаже Ценных бумаг по второй части Договора РЕПО Стороны в случае наступления условий, предусмотренных пунктами 7.3 и 7.4 настоящего Соглашения, вправе осуществить Нижнюю или Верхнюю переоценку обязательств по соответствующему Договору РЕПО, если такая возможность предусмотрена условиями Договора РЕПО. По соглашению Сторон, оформленному письменными Подтверждениями в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, допускается проведение общей переоценки по двум и более Договорам РЕПО, предусматривающей сальдирование сумм Дефицита / Избытка маржи.

7.2. Дефицит / Избыток маржи рассчитывается по формуле, приведенной в приложении 1 к настоящему Соглашению.

7.3. Нижняя переоценка

Случай Нижней переоценки определяется в соответствии с формулой, приведенной в приложении 1 к настоящему Соглашению.

Наступление случая Нижней переоценки определяется Первоначальным покупателем.

При наступлении случая Нижней переоценки Первоначальный покупатель вправе направить Первоначальному продавцу в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, уведомление, содержащее указание на наступление случая Нижней переоценки и величину Дефицита маржи.

Стороны согласуют в соответствующем Подтверждении при заключении Договора РЕПО способ проведения Нижней переоценки из числа способов, указанных в пунктах 7.3.1–7.3.4 настоящего Соглашения.

В случае если согласована возможность проведения Нижней переоценки и Сторонами не установлен в соответствующем Подтверждении при заключении Договора РЕПО один из способов проведения Нижней переоценки, указанных в пунктах 7.3.1–7.3.4 настоящего Соглашения, Стороны при проведении Нижней переоценки применяют перечисление Компенсационного взноса денежными средствами согласно пункту 7.3.2 настоящего Соглашения.

7.3.1. Досрочное исполнение обязательств по Договору РЕПО и заключение нового Договора РЕПО

При выборе данного способа Нижней переоценки Стороны согласуют измененные Дату выкупа и Дату поставки по второй части Договора РЕПО, а также существенные условия нового Договора РЕПО. При этом:

(а) измененные Дата выкупа и Дата поставки по второй части Договора РЕПО должны соответствовать срокам, необходимым для своевременного осуществления расчетов в соответствии с согласованным Сторонами Порядком расчетов;

(б) Сумма выкупа изменяется и принимается равной Текущей сумме выкупа, рассчитанной на измененную Дату выкупа по формуле, приведенной в приложении 1 к Соглашению.

Изменение условий Договора РЕПО, а также заключение нового Договора РЕПО оформляется в порядке, определенном настоящим Соглашением для заключения Договоров РЕПО. Новый Договор РЕПО может быть заключен на условиях, определенных в пунктах 7.3.1.1 или 7.3.1.2 настоящего Соглашения по соглашению Сторон.

7.3.1.1. Новый Договор РЕПО заключается на аналогичных досрочно исполняемому Договору РЕПО условиях, за исключением:

– Даты покупки и Даты поставки по первой части нового Договора РЕПО, которые

принимаются идентичными Дате выкупа и Дате поставки по второй части измененного Договора РЕПО в соответствии с подпунктом (а) пункта 7.3.1 настоящего Соглашения;

– Суммы покупки, которая принимается равной Текущей стоимости на дату заключения нового Договора РЕПО, скорректированной с учетом Начального коэффициента обеспечения.

7.3.1.2. Новый Договор РЕПО заключается на аналогичных досрочно исполняемому Договору РЕПО условиях, за исключением:

– Даты покупки и Даты поставки по первой части нового Договора РЕПО, которые принимаются идентичными Дате выкупа и Дате поставки по второй части измененного Договора РЕПО в соответствии с подпунктом (а) пункта 7.3.1 настоящего Соглашения;

– Суммы покупки, которая принимается равной Сумме выкупа по досрочно исполняемому Договору РЕПО;

– количества Ценных бумаг, которое определяется исходя из Суммы покупки нового Договора РЕПО и Текущей стоимости на дату заключения нового Договора РЕПО.

7.3.2. Перечисление Компенсационного взноса денежными средствами

При выборе данного варианта Нижней переоценки Первоначальный покупатель путем направления Первоначальному продавцу уведомления в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, определяет:

(а) сумму Компенсационного взноса, которая должна быть эквивалента размеру Дефицита маржи по модулю;

(б) дату, в которую указанная сумма Компенсационного взноса должна быть перечислена Первоначальным продавцом, при этом такая дата:

– не может наступать ранее Рабочего дня, следующего за днем получения Первоначальным продавцом уведомления Первоначального покупателя;

– должна соответствовать срокам, необходимым для своевременного осуществления платежа;

(с) реквизиты, по которым должна быть перечислена указанная сумма.

При внесении Компенсационного взноса в виде денежных средств Первоначальным продавцом Первоначальному покупателю Сумма выкупа по второй части Договора РЕПО уменьшается на сумму Компенсационного взноса, полученного Первоначальным покупателем.

7.3.3. Передача Компенсационного взноса в виде Ценных бумаг

При выборе данного варианта Нижней переоценки Первоначальный покупатель путем направления Первоначальному продавцу уведомления в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, определяет:

(а) количество Ценных бумаг, подлежащих передаче в качестве Компенсационного взноса, определяемое таким образом, чтобы их Текущая стоимость была эквивалентна размеру Дефицита маржи по модулю. Формула расчета количества Ценных бумаг, вносимых в качестве Компенсационного взноса, приведена в приложении 1 к настоящему Соглашению;

(б) дату, в которую указанные Ценные бумаги должны быть переданы Первоначальным продавцом, при этом такая дата:

– не может наступать ранее Рабочего дня, следующего за днем получения Первоначальным продавцом уведомления Первоначального покупателя;

– должна соответствовать срокам, необходимым для своевременного осуществления поставки таких Ценных бумаг;

(с) реквизиты, по которым должны быть поставлены Ценные бумаги.

При внесении Компенсационного взноса в виде Ценных бумаг Первоначальным продавцом Первоначальному покупателю текущее количество Ценных бумаг по Договору РЕПО (обязательство Первоначального покупателя по второй части Договора РЕПО) увеличивается на количество Ценных бумаг, полученных Первоначальным покупателем.

7.3.4. Маржинальный взнос в виде денежных средств

При выборе данного способа Нижней переоценки Первоначальный покупатель путем направления Первоначальному продавцу уведомления в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, определяет:

(а) сумму Маржинального взноса, которая должна быть эквивалентна размеру Дефицита маржи по модулю;

(б) дату, в которую указанная сумма должна быть перечислена Первоначальному покупателю, при этом такая дата:

– не может наступать ранее Рабочего дня, следующего за днем получения

Первоначальным продавцом уведомления Первоначального покупателя;

– должна соответствовать срокам, необходимым для своевременного осуществления платежа;

(с) реквизиты, по которым должна быть перечислена указанная сумма;

(d) процентную ставку, по которой будут начисляться проценты на сумму перечисленного Первоначальным продавцом Маржинального взноса. Стороны могут согласовать применение ставки 0 %.

Суммы Маржинальных взносов могут быть выражены как в Валюте Договора РЕПО, так и в иной валюте по договоренности Сторон. Если Стороны договорились о возможности перечисления Маржинальных взносов в валюте, отличной от Валюты Договора РЕПО, Сторонами должен быть согласован также курс пересчета. При этом, если иное не установлено соглашением Сторон, пересчет Маржинальных взносов осуществляется по курсу закрытия основной торговой сессии для расчетов следующим банковским днем (Tom), сложившемуся на валютном рынке ПАО Московская Биржа.

Денежные средства в виде Маржинального взноса передаются Первоначальным продавцом Первоначальному покупателю на срочной, возвратной и, если это согласовано Сторонами, платной основе. В случае если при заключении Договора РЕПО Стороны не согласовали процентную ставку, по которой должны начисляться проценты на суммы Маржинальных взносов, проценты на сумму Маржинального взноса начисляются по Ставке РЕПО. Если обязательства Первоначального продавца при исполнении второй части Договора РЕПО исполнены надлежащим образом в полном объеме, суммы перечисленных Маржинальных взносов, а также начисленные на них проценты, если таковые начислялись, подлежат перечислению Первоначальному продавцу не позднее Рабочего дня, следующего за днем, когда обязательства Первоначального продавца по второй части соответствующего Договора РЕПО исполнены в полном объеме. Любая из Сторон вправе путем направления уведомления другой Стороне зачесть обязательства Первоначального покупателя по возврату Маржинальных взносов и уплате начисленных на них процентов (в случае их начисления) с обязательствами Первоначального продавца по перечислению Суммы выкупа. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Первоначальным продавцом обязательств во второй части Договора РЕПО суммы Маржинальных взносов подлежат перечислению Первоначальному продавцу не позднее 2 (Второго) Рабочего дня с даты, когда обязательства Первоначального продавца по соответствующему Договору РЕПО исполнены в полном объеме, и/или могут учитываться при проведении Процедуры урегулирования в соответствии с разделом 10 настоящего Соглашения.

7.4. Верхняя переоценка

Случай Верхней переоценки определяется в соответствии с формулой, приведенной в приложении 1 к настоящему Соглашению.

Наступление случая Верхней переоценки определяется Первоначальным продавцом.

При наступлении случая Верхней переоценки Первоначальный продавец вправе направить Первоначальному покупателю в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, уведомление, содержащее указание на наступление случая Верхней переоценки и величину Дефицита / Избытка маржи.

Стороны согласуют в соответствующем Подтверждении при заключении Договора РЕПО способ проведения Верхней переоценки из числа способов, указанных в пунктах 7.4.1–7.4.4 настоящего Соглашения.

В случае если согласована возможность проведения Верхней переоценки и Сторонами не установлен в соответствующем Подтверждении при заключении Договора РЕПО один из способов проведения Верхней переоценки, указанных в пунктах 7.4.1–7.4.4 настоящего Соглашения, Стороны при проведении Верхней переоценки применяют передачу Компенсационного взноса в виде Ценных бумаг согласно пункту 7.4.2 настоящего Соглашения.

7.4.1. Досрочное исполнение обязательств по Договору РЕПО и заключение нового Договора РЕПО

При выборе данного способа Верхней переоценки Стороны согласуют измененные Дату выкупа и Дату поставки по второй части Договора РЕПО, а также существенные условия нового Договора РЕПО. При этом:

(а) измененные Дата выкупа и Дата поставки по второй части Договора РЕПО должны соответствовать срокам, необходимым для своевременного осуществления расчетов в соответствии с согласованным сторонами Порядком расчетов;

(б) Сумма выкупа изменяется и принимается равной Текущей сумме выкупа, рассчитанной на измененную Дату выкупа по формуле, приведенной в приложении 1 к настоящему Соглашению.

Изменение условий Договора РЕПО, а также заключение нового Договора РЕПО оформляется в порядке, определенном настоящим Соглашением для заключения Договоров РЕПО. Новый Договор РЕПО может быть заключен на условиях, определенных в пунктах 7.4.1.1 или 7.4.1.2 настоящего Соглашения, по соглашению Сторон.

7.4.1.1. Новый Договор РЕПО заключается на аналогичных досрочно исполняемому Договору РЕПО условиях, за исключением:

- Даты покупки и Даты поставки по первой части нового Договора РЕПО, которые принимаются идентичными Дате выкупа и Дате поставки по второй части измененного Договора РЕПО в соответствии с подпунктом (а) пункта 7.4.1 настоящего Соглашения;

- Суммы покупки, которая принимается равной Текущей стоимости на дату заключения нового Договора РЕПО, скорректированной с учетом Начального коэффициента обеспечения.

7.4.1.2. Новый Договор РЕПО заключается на аналогичных досрочно исполняемому Договору РЕПО условиях, за исключением:

- Даты покупки и Даты поставки по первой части нового Договора РЕПО, которые принимаются идентичными Дате выкупа и Дате поставки по второй части измененного Договора РЕПО в соответствии с подпунктом (а) пункта 7.4.1 настоящего Соглашения;

- Суммы покупки, которая принимается равной Сумме выкупа по досрочно исполняемому Договору РЕПО;

- количества Ценных бумаг, которое определяется исходя из Суммы покупки нового Договора РЕПО и Текущей стоимости на дату заключения нового Договора РЕПО.

7.4.2. Передача Компенсационного взноса в виде Ценных бумаг

При выборе данного варианта Верхней переоценки Первоначальный продавец путем направления Первоначальному покупателю уведомления в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, определяет:

(а) количество Ценных бумаг, подлежащих передаче в качестве Компенсационного взноса, определяемое таким образом, чтобы их Текущая стоимость была эквивалентна размеру Избытка маржи. Формула расчета количества Ценных бумаг, вносимых в качестве Компенсационного взноса, приведена в приложении 1 к настоящему Соглашению;

(б) дату, в которую указанные Ценные бумаги должны быть переданы Первоначальным покупателем, при этом такая дата:

- не может наступать ранее Рабочего дня, следующего за днем получения Первоначальным покупателем уведомления Первоначального продавца;

- должна соответствовать срокам, необходимым для своевременного осуществления поставки таких Ценных бумаг;

(с) реквизиты, по которым должны быть переданы Ценные бумаги.

При внесении Компенсационного взноса в виде Ценных бумаг Первоначальным покупателем Первоначальному продавцу текущее количество Ценных бумаг по Договору РЕПО (обязательство Первоначального покупателя по второй части Договора РЕПО) уменьшается на количество Ценных бумаг, полученных Первоначальным продавцом.

7.4.3. Перечисление Компенсационного взноса в денежных средствах

При выборе данного варианта Верхней переоценки Первоначальный продавец путем направления Первоначальному покупателю уведомления в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, определяет:

(а) сумму Компенсационного взноса эквивалентно размеру Избытка маржи;

(б) дату, в которую указанная сумма Компенсационного взноса должна быть перечислена Первоначальным покупателем, при этом такая дата:

- не может наступать ранее Рабочего дня, следующего за днем получения Первоначальным покупателем уведомления Первоначального продавца;

- должна соответствовать срокам, необходимым для своевременного осуществления платежа;

(с) реквизиты, по которым должна быть перечислена указанная сумма.

При внесении Компенсационного взноса в виде денежных средств Первоначальным покупателем Первоначальному продавцу Сумма выкупа по второй части Договора РЕПО увеличивается на сумму Компенсационного взноса, полученного Первоначальным продавцом.

7.4.4. Маржинальный взнос в виде денежных средств

При выборе данного способа Верхней переоценки Первоначальный продавец путем направления Первоначальному покупателю уведомления в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, определяет:

(а) сумму Маржинального вноса, которая должна быть эквивалентна размеру Избытка маржи;

(б) дату, в которую указанная сумма должна быть перечислена Первоначальному продавцу, при этом такая дата:

– не может наступать ранее Рабочего дня, следующего за днем получения Первоначальным покупателем уведомления Первоначального продавца;

– должна соответствовать срокам, необходимым для своевременного осуществления платежа;

(с) реквизиты, по которым должна быть перечислена указанная сумма;

(д) процентную ставку, по которой будут начисляться проценты на сумму перечисленного Первоначальным покупателем Маржинального вноса. Стороны могут согласовать применение ставки 0 %.

Суммы Маржинальных взносов могут быть выражены как в Валюте Договора РЕПО, так и в иной валюте по договоренности Сторон. Если Стороны договорились о возможности перечисления Маржинальных взносов в валюте, отличной от Валюты Договора РЕПО, Сторонами должен быть согласован также курс пересчета. При этом, если иное не установлено соглашением Сторон, пересчет Маржинальных взносов осуществляется по курсу закрытия основной торговой сессии для расчетов следующим банковским днем (Tom), сложившемуся на валютном рынке ПАО Московская Биржа.

Денежные средства в виде Маржинального вноса передаются Первоначальным покупателем Первоначальному продавцу на срочной, возвратной и, если это согласовано Сторонами, платной основе. В случае если при заключении Договора РЕПО Стороны не согласовали процентную ставку, по которой должны начисляться проценты на суммы Маржинальных взносов, проценты на сумму Маржинального вноса начисляются по Ставке РЕПО. Если обязательства Первоначального покупателя при исполнении второй части Договора РЕПО исполнены надлежащим образом в полном объеме, суммы перечисленных Маржинальных взносов, а также начисленные на них проценты, если таковые начислялись, подлежат перечислению Первоначальному покупателю не позднее Рабочего дня, следующего за днем, когда обязательства Первоначального покупателя по второй части соответствующего Договора РЕПО исполнены в полном объеме. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Первоначальным покупателем обязательств во второй части Договора РЕПО суммы Маржинальных взносов подлежат перечислению Первоначальному покупателю не позднее 2 (Второго) Рабочего дня с даты, когда обязательства Первоначального покупателя по соответствующему Договору РЕПО исполнены в полном объеме, и/или могут учитываться при проведении Процедуры урегулирования в соответствии с разделом 10 настоящего Соглашения.

7.5. Если уведомление, содержащее условия проведения переоценки, получено Стороной после окончания Рабочего дня, оно считается полученным на следующий Рабочий день.

7.6. Положения раздела 7 настоящего Соглашения применяются в том числе к Договорам РЕПО, заключенным при посредничестве Организатора торговли в случае отсутствия аналогичных процедур в Правилах Организатора торговли.

8. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ ТЕКУЩЕЙ СТОИМОСТИ

8.1. Текущая стоимость Ценных бумаг в любой момент Рабочего дня (дата определения Текущей стоимости) определяется в Валюте Договора РЕПО следующим образом:

8.1.1. Для Ценных бумаг, обращающихся на российском организованном рынке, на основании средневзвешенной цены, рассчитанной ПАО Московская Биржа на дату определения Текущей стоимости (далее – Оценка). При отсутствии Оценки по состоянию на дату определения Текущей стоимости Текущая стоимость принимается равной Оценке предыдущего дня, рассчитанной ПАО Московская Биржа.

8.1.2. Для Ценных бумаг, имеющих внебиржевое обращение / обращающихся на зарубежных рынках, а также в случае если Оценка предыдущего дня, рассчитанная ПАО Московская Биржа, отсутствует, Текущая стоимость Ценных бумаг определяется на основании

котировки Last Price предыдущего дня по данным информационных агентств, публикующих информацию (предоставляющих доступ к информации) о котировках внебиржевого рынка / зарубежных организаторов торгов.

8.1.3. При невозможности определения Текущей стоимости Ценных бумаг способом, приведенным в пунктах 8.1.1–8.1.2 настоящего Соглашения, Текущая стоимость Ценных бумаг определяется на основании сведений, публикуемых Саморегулируемой организацией «Национальная финансовая ассоциация» в сети Интернет по следующему адресу: <http://www.nfa.ru/?page=fixing>.

8.1.4. При невозможности определения Текущей стоимости Ценных бумаг способом, приведенным в пунктах 8.1.1–8.1.3 настоящего Соглашения, Текущая стоимость Ценных бумаг определяется как среднее арифметическое не менее 3 (Трех) котировок на покупку соответствующего объема Ценных бумаг, полученных в дату определения Текущей стоимости от различных участников рынка, не являющихся аффилированными лицами Стороны, определяющей Текущую стоимость (под участником рынка понимается профессиональный участник рынка Ценных бумаг, осуществляющий дилерскую деятельность в качестве основного (одного из основных) вида хозяйственной деятельности, выполняющий функцию маркет-мейкера в отношении любых Ценных бумаг).

8.2. При невозможности определения Текущей стоимости Ценных бумаг способами, приведенными в пунктах 8.1.1–8.1.4 настоящего Соглашения, Текущая стоимость Ценных бумаг определяется по соглашению Сторон.

8.3. В случае если Валюта Договора РЕПО отличается от валюты используемой котировки, при определении Текущей стоимости Ценных бумаг пересчет в Валюту Договора РЕПО осуществляется:

(а) при пересчете из иностранной валюты в российские рубли или из российских рублей в иностранную валюту – по курсу закрытия основной торговой сессии для расчетов следующим банковским днем (Tom), сложившемуся на валютном рынке ПАО Московская Биржа в ближайший предшествующий торговый день к дате определения Текущей стоимости;

(б) при невозможности определения курса в соответствии с подпунктами (а) пункта 8.3 настоящего Соглашения – по официальному курсу, установленному Банком России на дату определения Текущей стоимости.

8.4. Для целей определения Текущей стоимости Ценных бумаг при заключении Договора РЕПО и/или в Подтверждении Сторонами может быть согласован организатор торгов, в том числе иностранная фондовая биржа, по данным которой вместо указанных в пунктах 8.1, 8.2 настоящего Соглашения будет определяться Текущая стоимость Ценных бумаг по такому Договору РЕПО. Такое согласование может быть осуществлено как путем указания наименования организатора торгов или иностранной фондовой биржи, так и путем указания кода (SEDOL), присвоенного Ценной бумаге данным организатором торгов или иностранной фондовой биржей.

8.5. Текущая стоимость Ценных бумаг, определяемая в соответствии с положениями настоящего раздела, должна быть выражена в денежных единицах. Если цена, определенная по правилам настоящего раздела, выражена в процентах от номинальной стоимости или иных математических величинах, то она должна быть переведена в денежные единицы с учетом текущей номинальной стоимости Ценной бумаги.

9. ВЫПЛАТЫ ДОХОДОВ ПО ЦЕННЫМ БУМАГАМ И ИНЫЕ КОРПОРАТИВНЫЕ ДЕЙСТВИЯ

9.1. В целях исполнения договоров РЕПО Стороны договариваются о следующем порядке распределения доходов по Ценным бумагам:

9.1.1. Если Стороны не договорились об ином при заключении Договора РЕПО, при определении в период между датами перехода прав собственности на Ценные бумаги по первой и второй части Договора РЕПО перечня лиц, имеющих право на получение денежных средств или иного имущества, в том числе в виде дивидендов, процентного дохода, частичного погашения, от эмитента и/или лица, выдавшего Ценные бумаги, являющиеся предметом Договора РЕПО, суммы денежных средств, эквивалентные выплатам эмитента и/или лица, выдавшего Ценные бумаги, и/или иное имущество, полученные от эмитента и/или лица, выдавшего Ценные бумаги, или его эквивалент (далее – Доход по Ценным бумагам) должны

быть перечислены (переданы) Первоначальным покупателем Первоначальному продавцу как суммы, входящие в обязательства Первоначального покупателя по Договору РЕПО. Доход по Ценным бумагам перечисляется (передается) по реквизитам Первоначального продавца, указанным в разделе 17 настоящего Соглашения, если иные реквизиты не были согласованы в порядке, предусмотренном для заключения Договоров РЕПО (пункт 4.9 настоящего Соглашения) по соответствующему Договору РЕПО, либо по иным реквизитам, о которых Первоначальный продавец дополнительно заблаговременно информировал Первоначального покупателя в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения. В этом случае сумма полученных (переданных) денежных средств и/или количество Ценных бумаг во исполнение обязательств эмитента по Ценным бумагам не учитываются при определении обязательств по второй части Договора РЕПО.

Первоначальный покупатель обязан перечислить (передать) Первоначальному продавцу сумму Дохода по Ценным бумагам в течение 10 (Десяти) Рабочих дней с даты выплаты дохода в соответствии с условиями выпуска Ценных бумаг, но в любом случае не ранее даты фактического получения Дохода Первоначальным покупателем, в случае надлежащего исполнения эмитентом и/или лицом, выдавшим Ценные бумаги, обязательств по Ценным бумагам, и в течение 10 (Десяти) Рабочих дней с даты, с которой Первоначальный покупатель узнал или должен был узнать о фактической выплате дохода эмитентом и/или лицом, выдавшим Ценные бумаги, в случае ненадлежащего исполнения им обязательств по выплате доходов, в каждом случае при условии отсутствия ограничений распоряжения Первоначальным покупателем суммой Дохода на счете Первоначального покупателя со стороны платежных агентов, платежных систем или иных третьих лиц.

В случае нарушения указанного срока Первоначальный покупатель по Договору РЕПО должен дополнительно уплатить Первоначальному продавцу проценты на сумму, выплачиваемую Первоначальному продавцу в соответствии с настоящим подпунктом (проценты на Текущую стоимость Ценных бумаг, полученных в качестве дохода, на дату передачи таких Ценных бумаг Первоначальному продавцу) по ставке, равной Ставке РЕПО, за период просрочки.

9.1.2. Если в соответствии с условиями Договора РЕПО Доходы по Ценным бумагам не подлежат передаче Первоначальному продавцу, то они принимаются в уменьшение Суммы выкупа по второй части Договора РЕПО. Условие о Сумме выкупа согласуется при заключении Договора РЕПО с учетом суммы Дохода по Ценным бумагам.

При этом в случае невыполнения или ненадлежащего выполнения эмитентом и/или лицом, выдавшим Ценные бумаги, обязательств по выплате дохода перерасчет Суммы выкупа осуществляется при исполнении второй части Договора РЕПО с учетом фактической даты выплаты дохода эмитентом и/или лицом, выдавшим Ценные бумаги. Если фактическая выплата дохода осуществлена эмитентом и/или лицом, выдавшим Ценные бумаги, в течение Срока РЕПО, перерасчет Суммы выкупа осуществляется с учетом такой выплаты. При невыплате эмитентом и/или лицом, выдавшим Ценные бумаги, дохода до Даты исполнения второй части Договора РЕПО Сумма выкупа перерасчитывается исходя из условия, что в период между Датами поставки по первой и второй частям Договора РЕПО выплата дохода не осуществлялась. В этом случае при фактической выплате эмитентом и/или лицом, выдавшим Ценные бумаги, дохода после Даты исполнения второй части Договора РЕПО Первоначальный покупатель обязан перечислить (передать) Первоначальному продавцу сумму Дохода по Ценным бумагам в течение 10 (Десяти) Рабочих дней с даты, когда Первоначальный покупатель узнал или должен был узнать о фактической выплате дохода эмитентом и/или лицом, выдавшим Ценные бумаги, которая определяется в соответствии с пунктом 9.1.3 настоящего Соглашения.

Изменение Суммы выкупа оформляется письменными Подтверждениями в порядке, предусмотренном для заключения Договоров РЕПО (пункт 4.9 настоящего Соглашения).

9.1.3. Под надлежащим исполнением эмитентом и/или лицом, выдавшим Ценные бумаги, своих обязательств по выплате доходов понимается их исполнение в дату (не позднее последнего дня, определенного периодом времени) и в порядке, установленные в соответствии с решением о выпуске Ценных бумаг или иным документом в соответствии с Действующим законодательством, если Стороны не договорились об ином сроке.

При ненадлежащем исполнении эмитентом и/или лицом, выдавшим Ценные бумаги, своих обязательств датой выплаты доходов для целей настоящего раздела признается дата фактической выплаты дохода эмитентом и/или лицом, выдавшим Ценные бумаги.

Если информация о выплате эмитентом и/или лицом, выдавшим Ценные бумаги, дохода (в том числе фактической – при ненадлежащем исполнении эмитентом и/или иным лицом, выдавшим Ценные бумаги, обязательств) подлежала раскрытию, указанный срок перечисления (передачи) Первоначальному продавцу суммы Дохода по Ценным бумагам отсчитывается от даты раскрытия. Если информация о выплате дохода не подлежала раскрытию, указанный срок отсчитывается от даты, которая должна быть определена по согласованию Сторон с указанием источника информации о такой дате.

9.1.4. Первоначальный покупатель обязан перечислить (передать) Первоначальному продавцу Доходы по Ценным бумагам в соответствии с подпунктом 9.1.1 настоящего Соглашения или изменить условие о Сумме выкупа в соответствии с подпунктом 9.1.2 настоящего Соглашения, в том числе в случае открытия Первоначальным покупателем короткой позиции по Ценным бумагам или неполучения Первоначальным покупателем дохода от эмитента и/или лица, выдавшего Ценные бумаги, по любой причине, при условии надлежащего исполнения эмитентом и/или лицом, выдавшим Ценные бумаги, своих обязательств по выплате дохода в соответствии с решением о выпуске Ценных бумаг.

9.2. За исключением предусмотренных законодательством случаев, в том числе касающихся распределения выплат по Ценным бумагам, а также за исключением иных случаев, предусмотренных настоящим Соглашением, в случае составления списка владельцев в период между датами перехода прав собственности на Ценные бумаги по первой и второй частям Договора РЕПО (либо датами прекращения обязательств по первой и второй частям Договора РЕПО путем зачета в установленных в настоящем Соглашении случаях) Первоначальный покупатель осуществляет все права собственника в отношении полученных по первой части Договора РЕПО Ценных бумаг.

9.3. Стороны могут договориться в порядке, предусмотренном для заключения Договоров РЕПО (пункт 4.9 настоящего Соглашения), что в случае включения Первоначального покупателя в список владельцев Ценных бумаг, имеющих право на участие в общем собрании акционеров, в период между датами перехода прав собственности на Ценные бумаги по первой и второй частям Договора РЕПО (либо датами прекращения обязательств по первой и второй частям Договора РЕПО путем зачета в установленных в настоящем Соглашении случаях) Первоначальный продавец имеет право на получение права голоса по Ценным бумагам. С целью реализации Первоначальным продавцом права голоса по Ценным бумагам Первоначальный покупатель на основании соответствующего письменного запроса или указания Первоначального продавца, направленного в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, не позднее 2 Рабочих дней до даты окончания приема инструкций / бюллетеней для проведения соответствующего общего собрания акционеров обязан:

А) предоставить Первоначальному продавцу доверенность на участие в общем собрании акционеров, по форме и содержанию устраивающую Первоначального продавца, согласно запросу

либо

Б) принять участие в голосовании в соответствии с полученными письменными указаниями Первоначального продавца.

При этом Первоначальный покупатель не несет ответственности за невозможность осуществления Первоначальным продавцом права на участие в общем собрании акционеров, в том числе в случае предоставления Первоначальным покупателем доверенности на участие в данном собрании акционеров другим лицам (согласно указанию Первоначального продавца), за исключением случаев ненадлежащего оформления доверенности.

Указанное правило не применяется в случае заключения Договора РЕПО через Организатора торговли и/или в случае осуществления клиринга клиринговой организацией. В указанных случаях право на участие в общем собрании акционеров осуществляется Первоначальным покупателем, если иное не предусмотрено Правилами Организатора торговли и/или клиринговой организации.

9.4. В случае конвертации Ценных бумаг по основаниям, предусмотренным законом, в том числе при дроблении / консолидации акций, конвертации привилегированных акций, конвертации иных эмиссионных Ценных бумаг в акции общества, конвертации при реорганизации путем слияния, разделения, выделения и присоединения, объединения выпусков Ценных бумаг, если такая конвертация была проведена по счету депо (лицевому счету) Первоначального покупателя в период между датами перехода прав собственности на Ценные

бумаги по первой и второй частям Договора РЕПО (либо датами прекращения обязательств по первой и второй частям Договора РЕПО путем зачета в установленных в настоящем Соглашении случаях), Первоначальный покупатель обязан передать по второй части Договора РЕПО Ценные бумаги, полученные в результате конвертации / дробления / консолидации.

В случае составления списка владельцев Ценных бумаг для проведения конвертации по основаниям, предусмотренным законом, в период между датами перехода прав собственности на Ценные бумаги по первой и второй частям Договора РЕПО (либо датами прекращения обязательств по первой и второй частям Договора РЕПО путем зачета в установленных в настоящем Соглашении случаях) и включения в список владельцев Первоначального покупателя, но неосуществления конвертации по любой причине до указанной даты по счету депо (лицевому счету) приобретателя Ценных бумаг, передаче подлежат Ценные бумаги, предусмотренные условиями Договора РЕПО. В случае получения Первоначальным покупателем Ценных бумаг, в которые были конвертированы Ценные бумаги, переданные им во исполнение обязательств по второй части РЕПО, указанные Ценные бумаги подлежат передаче Первоначальному продавцу не позднее дня, следующего за днем поступления Ценных бумаг на счет, указанный Первоначальным покупателем.

Обязательства Сторон по Договору РЕПО в указанном случае сохраняются до наступления одного из обстоятельств, в зависимости от того, которое наступит ранее:

– зачисления Ценных бумаг в результате конвертации после Даты исполнения второй части Договора РЕПО на счет депо Первоначального покупателя и перевода таких Ценных бумаг на счет депо, указанный Первоначальным продавцом;

– зачисления Ценных бумаг в результате конвертации после Даты исполнения второй части Договора РЕПО на счет депо Первоначального продавца.

Сторона, на счет депо которой (счет депо третьей стороны которой) были зачислены Ценные бумаги в результате конвертации, обязана письменно известить другую Сторону об этом в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, не позднее дня, следующего за днем получения документа депозитария о совершении депозитарной операции по конвертации Ценных бумаг.

9.5. Если одна из Сторон по настоящему Соглашению выступает от своего имени, за счет, в интересах и по поручению третьей стороны – нерезидента Российской Федерации или в качестве доверительного управляющего в интересах выгодоприобретателя – нерезидента Российской Федерации, то такая Сторона признается налоговым агентом в отношении выплачиваемых в пользу третьей стороны – нерезидента Российской Федерации доходов, по которым у источника выплаты не был удержан налог или налог был удержан в сумме, меньшей, чем сумма налога, исчисленная с соответствующих видов доходов для нерезидента Российской Федерации, и удерживает налог с таких доходов.

Если Стороной Б по настоящему Соглашению является юридическое лицо, учрежденное или зарегистрированное в иностранной юрисдикции, в настоящее Соглашение включается пункт 9.6 следующего содержания:

«9.6. Если одна из Сторон является нерезидентом Российской Федерации, то каждая Сторона признается налоговым агентом в отношении выплачиваемых доходов, по которым у источника выплаты не был удержан налог или налог был удержан в сумме, меньшей, чем сумма налога, исчисленная с соответствующих видов доходов, и удерживает налог из таких доходов.

Удержание налога Стороной А осуществляется в соответствии с Налоговым кодексом Российской Федерации, а также правилами и нормами международных договоров об избежании двойного налогообложения, если Сторона Б предоставила до даты выплаты дохода подтверждение того, что она имеет постоянное местонахождение (местопребывание) в государстве, с которым Российская Федерация имеет международный договор (соглашение), регулирующий (ее) вопросы налогообложения (апостилированный сертификат резидентства), и письмо-подтверждение, что она действует от своего имени и является бенефициарным собственником (фактическим владельцем) такого дохода, по форме Стороны А⁵.

В случае появления обстоятельств, при которых фактическое право на получение доходов получит другое лицо, Сторона Б обязуется незамедлительно проинформировать об

⁵ В отношении лица, подписавшего письмо-подтверждение, необходимо предоставить документ, подтверждающий его полномочие на подписание данного документа (устав, доверенность, иной документ).

этом Сторону А, а также предоставить Стороне А документы, необходимые для применения соответствующих ставок налога, включая заявление о лицах, имеющих фактическое право на доход по настоящему Соглашению, с приложением подтверждающих и надлежащим образом заверенных документов не позднее рабочего дня, предшествующего дню выплаты дохода.

В случае если Сторона Б выступает от своего имени, за счет, в интересах и по поручению третьей стороны или в качестве доверительного управляющего в интересах выгодоприобретателя, Сторона Б обязуется до заключения сделки предоставить Стороне А апостилированный сертификат налогового резидентства третьей стороны и письмо-подтверждение от третьей стороны, что она является бенефициарным (фактическим) собственником дохода. Сертификат должен быть заверен компетентным органом, определенным в международном договоре (соглашении) и представляется за каждый календарный год выплаты доходов.

В случае если Сторона Б не предоставит надлежащим образом оформленные документы, указанные выше в настоящем пункте, или, в случае если предоставленные документы не будут свидетельствовать о налоговом резидентстве получателя дохода, Сторона А при выплате доходов Стороне Б удержит налог в соответствии с Налоговым кодексом Российской Федерации.

С учетом этого суммы, перечисляемые Первоначальному продавцу (пункт 9.1.1 настоящего Соглашения) или рассматриваемые в качестве предоплаты по второй части Договора РЕПО (пункт 9.1.2 настоящего Соглашения), а также суммы по второй части Договора РЕПО выплачиваются / учитываются за вычетом налога, удержанного в соответствии с первым абзацем настоящего пункта.»

10. ПРОЦЕДУРА УРЕГУЛИРОВАНИЯ

10.1. Процедура урегулирования в соответствии с настоящим Соглашением применяется в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения одной из Сторон (далее – Нарушившая Сторона) обязательств, предусмотренных настоящим Соглашением и/или Договором (ами) РЕПО, включая обязательства по досрочному исполнению Договора (ов) РЕПО, в том числе в связи с неисполнением обязательств по внесению Компенсационных (Маржинальных) взносов. Другая Сторона в целях настоящего раздела далее именуется «Ненарушившая Сторона». В случае если обе Стороны являются Нарушившими Сторонами, для целей проведения Процедуры урегулирования Ненарушившей Стороной является Сторона А.

10.2. Стороны обязуются провести Процедуру урегулирования в порядке, предусмотренном Примерными условиями, не позднее 30 (Тридцати) календарных дней с более поздней из двух дат: Даты выкупа или Даты поставки по второй части Договора РЕПО (далее – Дата урегулирования).

10.3. Суммы Неурегулированных обязательств Сторон для целей проведения Процедуры урегулирования определяются в порядке, предусмотренном Примерными условиями, и отражаются в уведомлении о проведении Процедуры урегулирования.

10.4. Определение стоимости Ценных бумаг для целей проведения Процедуры урегулирования может быть осуществлено одним из нижеприведенных способов по выбору Ненарушившей Стороны:

10.4.1. По состоянию на дату фактического приобретения / реализации Ценных бумаг на основании фактической цены приобретения либо фактической цены реализации Ценных бумаг:

а) в случае если Ненарушившая Сторона является Первоначальным продавцом или Стороной, передавшей Ценные бумаги в качестве Маржинального взноса, стоимость Ценных бумаг может быть определена по фактической цене приобретения соответствующих Ценных бумаг;

б) в случае если Ненарушившая Сторона является Первоначальным покупателем или Стороной, получившей Ценные бумаги в качестве Маржинального взноса, стоимость Ценных бумаг может быть определена по фактической цене реализации соответствующих Ценных бумаг.

10.4.2. По состоянию на дату направления уведомления о проведении Процедуры урегулирования в соответствии с порядком, согласованным Сторонами для определения Текущей стоимости по настоящему Соглашению.

10.5. Ненарушившая Сторона имеет право направить Нарушившей Стороне уведомление о проведении Процедуры урегулирования начиная со дня, следующего за датой, когда

обязательство по Договору РЕПО должно быть исполнено, но не позднее 25 (Двадцати пяти) календарных дней с более поздней из двух дат: Даты выкупа и Даты поставки по второй части Договора РЕПО.

10.6. В случае проведения процедуры урегулирования по двум или более Договорам РЕПО, суммы обязательств Сторон могут зачитываться по заявлению Ненарушившей Стороны. При этом взаиморасчеты осуществляются в Базовой валюте исходя из курсов Банка России на дату проведения взаиморасчетов между Сторонами, если Сторонами не согласован иной курс.

10.7. Исполнение в натуре обязательств по второй части Договора РЕПО, в отношении которых было допущено неисполнение или ненадлежащее исполнение, после направления уведомления о проведении Процедуры урегулирования допускается только с согласия Ненарушившей Стороны.

11. ПОРЯДОК ПРЕКРАЩЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПРИ БАНКРОТСТВЕ ОДНОЙ ИЗ СТОРОН

11.1. В случае если в отношении одной из Сторон введены процедуры банкротства (далее – Должник), Стороны соглашаются с тем, что:

11.1.1. Обязательства Сторон по всем Договорам РЕПО, заключенным в рамках настоящего Соглашения, прекращаются путем замены на нетто-обязательство, определяемое в порядке, установленном настоящим разделом.

11.1.2. Обязательства Сторон прекращаются, а нетто-обязательство возникает в дату, предшествующую дате наступления любого из обстоятельств, признаваемых в соответствии с пунктом 11.2 настоящего Соглашения процедурами банкротства для целей настоящего Соглашения (далее – Дата прекращения).

11.1.3. Сторона, в отношении которой не введены процедуры банкротства (далее – Добросовестный кредитор), осуществляет расчет размера нетто-обязательства в порядке, предусмотренном настоящим разделом, и направляет уведомление о размере нетто-обязательства Должника не позднее 30 (Тридцати) календарных дней после наступления Даты прекращения с указанием:

- Даты прекращения обязательств и возникновения нетто-обязательства;
- валюты, используемой для целей расчетов и перечисления суммы нетто-обязательства (Базовая валюта);
- величины нетто-обязательства;
- Стороны, обязанной осуществить перечисление суммы нетто-обязательства другой Стороне.

11.1.4. Нетто-обязательство рассчитывается в Базовой валюте путем сальдирования сумм обязательств Сторон по Договорам РЕПО, заключенным в рамках настоящего Соглашения. Нетто-обязательство возникает у Стороны, совокупный объем обязательств которой превышает совокупный объем обязательств другой Стороны.

11.1.5. При определении размера нетто-обязательства учитываются следующие обязательства по каждому Договору РЕПО:

- стоимость Ценных бумаг, не переданных во исполнение обязательств по второй части Договора РЕПО, и Сумма выкупа, не уплаченная во исполнение обязательств по второй части Договора РЕПО;
- подлежащие возврату Первоначальному продавцу / Первоначальному покупателю суммы денежных средств, полученные в результате проведения Нижней / Верхней переоценки (Маржинальных взносов), с процентами, если их начисление предусмотрено условиями Договора РЕПО;
- стоимость подлежащих возврату Первоначальному продавцу / Первоначальному покупателю Ценных бумаг, полученных в результате проведения Нижней переоценки / Верхней переоценки;
- Доход по Ценным бумагам, подлежащий передаче, но ранее не переданный;
- иные обязательства Сторон, кроме предусмотренных пунктом 11.4 настоящего Соглашения.

11.2. Под процедурами банкротства для целей настоящего раздела понимается любое из событий:

- в отношении некредитной организации – принятие арбитражным судом решения о

признании Должника банкротом и об открытии конкурсного производства,

в отношении кредитной организации – отзыв у Должника лицензии на осуществление банковских операций либо введение Банком России моратория на удовлетворение требований кредиторов кредитной организации.

11.3. Для целей расчета нетто-обязательства все прекращающиеся обязательства подлежат пересчету в Базовую валюту. При этом:

11.3.1. По обязательству по поставке Ценных бумаг в расчет принимается стоимость Ценных бумаг, определенная на Дату прекращения одним из способов, предусмотренных пунктом 11.5 настоящего Соглашения, по выбору Добросовестного кредитора.

11.3.2. По платежным обязательствам, выраженным в валюте, отличной от Базовой валюты, суммы обязательств подлежат конвертации по рыночному курсу, сформировавшемуся на межбанковском денежном рынке в Дату прекращения, по которому Добросовестный кредитор мог бы, действуя добросовестно и коммерчески обоснованно, конвертировать сумму соответствующих платежных обязательств в Базовую валюту.

11.4. При определении нетто-обязательства в расчет не включаются и, соответственно, не прекращаются обязательства по уплате неустойки (пени, штраф), предусмотренной настоящим Соглашением. Кроме того, при определении нетто-обязательства не учитываются требования о возмещении убытков в форме упущенной выгоды.

11.5. Стоимость Ценных бумаг для целей расчета нетто-обязательства при прекращении обязательств по Договорам РЕПО в связи с введением в отношении одной из Сторон процедур банкротства определяется одним из следующих способов по выбору Добросовестного кредитора:

11.5.1. На основании фактической цены приобретения либо фактической цены реализации Ценных бумаг:

(а) в случае если Добросовестный кредитор является продавцом по договору РЕПО или Стороной, передавшей Ценные бумаги в качестве Маржинального взноса, стоимость Ценных бумаг для целей расчета нетто-обязательства может быть определена по фактической цене приобретения соответствующих Ценных бумаг;

(б) в случае если Добросовестный кредитор является покупателем по договору РЕПО или Стороной, получившей Ценные бумаги в качестве Маржинального взноса, стоимость Ценных бумаг может быть определена по фактической цене реализации соответствующих Ценных бумаг.

При этом:

– фактическая цена приобретения не может превышать Текущую стоимость, порядок определения которой согласован Сторонами не позднее чем за 190 (Сто девяносто) календарных дней до Даты прекращения, увеличенной с учетом Начального коэффициента обеспечения;

– фактическая цена реализации не может быть ниже Текущей стоимости, порядок определения которой согласован Сторонами не позднее чем за 190 (Сто девяносто) календарных дней до Даты прекращения, уменьшенной с учетом Начального коэффициента обеспечения;

– фактическое приобретение или фактическая реализация осуществляются Добросовестным кредитором не ранее даты заключения соответствующего Договора РЕПО;

– фактическая цена приобретения или фактическая цена реализации могут быть документально подтверждены.

11.5.2. На основании котировки соответствующих Ценных бумаг. При этом:

(а) под котировкой Ценных бумаг, допущенных к обращению у Организатора торговли, то есть Ценных бумаг, сделки с которыми могут быть заключены на торгах соответствующего Организатора торговли, понимается среднее арифметическое цен всех сделок, заключенных в торговой системе соответствующего Организатора торговли в течение торгового дня, являющегося Датой прекращения. В случае если в Дату прекращения в торговой системе какого-либо Организатора торговли отсутствуют заявки на заключение сделок с такой Ценной бумагой, а равно и в случае, когда число таких заявок менее чем 3 (Три), котировка для таких Ценных бумаг определяется в порядке, установленном для определения котировок Ценных бумаг, не допущенных к торгам у Организатора торговли в соответствии с подпунктом (б) настоящего пункта;

(б) под котировкой Ценных бумаг, не допущенных к обращению у Организатора торговли, понимается среднее арифметическое не менее 3 (Трех) признаваемых котировок, то есть котировок на соответствующий объем Ценных бумаг, полученных Добросовестным кредитором от различных профессиональных участников рынка Ценных бумаг, осуществляющих дилерскую деятельность в качестве основного (одного из основных) вида

хозяйственной деятельности, выполняющих функции маркет-мейкера в отношении любых Ценных бумаг и не являющихся аффилированными лицами Добросовестного кредитора. Такие котировки должны быть получены по состоянию и с учетом оценки профессиональными участниками состояния финансового и фондового рынка на Дату прекращения.

11.5.3. В соответствии с порядком, согласованным Сторонами для определения Текущей стоимости, при условии, что порядок определения Текущей стоимости согласован Сторонами не позднее чем за 190 (Сто девяносто) календарных дней до Даты прекращения.

11.5.4. В соответствии с оценкой справедливой стоимости Ценных бумаг, произведенной независимым оценщиком по заказу Добросовестного кредитора.

12. ПОРЯДОК ОБМЕНА ПОДТВЕРЖДЕНИЯМИ И ИНОЙ ИНФОРМАЦИЕЙ. ПРЕДОСТАВЛЕНИЕ СВЕДЕНИЙ В РЕПОЗИТАРИЙ

12.1. При заключении Договоров РЕПО с использованием ЭСС каждая Сторона обязана предоставить другой Стороне Подтверждение по Договору РЕПО не позднее даты заключения Договора РЕПО (если Договор РЕПО заключен до 16:00 по московскому времени); не позднее окончания Рабочего дня, следующего за датой заключения Договора РЕПО (если Договор РЕПО заключен после 16:00 по московскому времени).

12.2. Помимо существенных условий Договора РЕПО, перечисленных в разделе 4 настоящего Соглашения, или информации, позволяющей однозначно их определить, Подтверждение должно содержать ссылку на настоящее Соглашение. Подтверждение может содержать также Референс Договора РЕПО, присвоенный данному Договору РЕПО Стороной, направившей Подтверждение. В дальнейшем другая Сторона, направляя какие-либо сообщения в отношении такого Договора РЕПО, может делать ссылку на данный Референс Договора РЕПО.

При необходимости указания Референса Договора РЕПО в расчетных документах, в соответствии с требованиями расчетной организации, для этих целей будет использоваться Референс Договора РЕПО, указанный Первоначальным продавцом (если каждая из Сторон указала Референс Договора РЕПО при обмене Подтверждениями), либо Референс Договора РЕПО той Стороны, которая указала его в своем Подтверждении по Договору РЕПО.

12.3. При наличии в Подтверждениях Сторон расхождений по условиям Договора РЕПО каждая из Сторон обязана незамедлительно сообщить об этом другой Стороне и принять меры к их устранению путем направления не позднее окончания Рабочего дня, следующего за днем обнаружения таких расхождений, исправленных Подтверждений (до достижения полной идентичности условий Договора РЕПО в Подтверждениях и их соответствия условиям Договора РЕПО, согласованным при его заключении в порядке, предусмотренном разделом 4 настоящего Соглашения).

12.4. Подтверждение, а также любое сообщение, запрос, уведомление, извещение или требование по настоящему Соглашению, требующее письменной формы, может быть доставлено по выбору отправителя:

12.4.1. По ЭСС.

12.4.2. С использованием электронной почты путем направления сканированной копии документа с последующим представлением оригинала в срок, установленный настоящим Соглашением.

12.4.3. В оригинале заказным почтовым отправлением с уведомлением о вручении.

12.4.4. В оригинале курьером.

Стороны обязаны обмениваться оригиналами документов в течение 10 (Десяти) Рабочих дней со дня направления документа согласно пунктам 12.4.2 и 12.4.3 настоящего Соглашения.

12.5. Подтверждение, а также любое сообщение, запрос, уведомление, извещение или требование по настоящему Соглашению считается доставленным надлежащим образом с момента его получения адресатом. В зависимости от используемых Сторонами способов доставки датой и временем получения сообщения, направляемого одной Стороной другой Стороне, считается:

12.5.2. При использовании электронной почты – дата и время сообщения отправляющей Стороны.

12.5.3. При использовании ЭСС – дата и время, указанные в этом качестве в данной системе.

12.5.4. При использовании почтовой связи – дата (и время – при указании времени)

уведомления о вручении почтового отправления получающей Стороне.

12.5.5. При использовании доставки курьером – дата и время проставления Стороной-получателем отметки о получении.

12.6. В соответствии со ст. 160 Гражданского кодекса Российской Федерации Стороны договорились о возможности посылать и принимать друг от друга Подтверждения, а также иные сообщения, запросы, уведомления, извещения и в виде сканированных копий документов с использованием электронной почты без потери их юридической силы, а также о возможности использования электронной подписи либо иного аналога собственноручной подписи и печати при подписании Подтверждений, а также иных сообщений, документов, запросов, уведомлений, извещений и требований без потери их юридической силы. Стороны не вправе ссылаться на использование аналога собственноручной подписи для признания документа не имеющим юридической силы. При возникновении споров, связанных или вытекающих из настоящего Соглашения или какого-либо Договора РЕПО, заинтересованная Сторона вправе предоставлять в суд в качестве доказательств сканированные копии документов, полученных с использованием электронной почты. Стороны признают, что при использовании указанных средств связи:

(а) документы, содержащие подпись уполномоченного представителя Стороны, имеют юридическую силу таких документов, составленных на бумажном носителе;

(б) документы принимаются другой Стороной только при условии, что простое визуальное сличение образца подписи уполномоченного представителя Стороны-отправителя, имеющегося у Стороны-получателя, с подписью на полученном Подтверждении позволяет установить их схожесть по внешним признакам с учетом искажений, возникающих при пересылке сообщения. О несовпадении подписи на Подтверждении, полученном по факсу или с использованием электронной почты, с образцом подписи уполномоченного представителя, имеющимся у Стороны-получателя, Сторона-получатель обязана незамедлительно уведомить Сторону-отправителя;

(в) оригинал документа, направленного с использованием средств электронной почты, должен быть предоставлен Стороной-отправителем Стороне-получателю не позднее 10 (Десяти) Рабочих дней с даты направления соответствующего документа (подтверждения, сообщения, запроса, уведомления, извещения или требования) с использованием средств электронной почты.

12.7. Каждая Сторона несет ответственность за достоверность содержащихся в настоящем Соглашении ее реквизитов для получения корреспонденции (включая адреса, номера телефонов, коды СПФС и др.).

12.8. Каждая из Сторон обязуется представлять другой Стороне документы, подтверждающие полномочия лиц, подписавших Подтверждения или иные документы (в случае если такие документы не были ранее предоставлены либо утратили силу в связи с истечением срока действия или по иной причине).

12.9. При достижении между Сторонами соглашения об изменении одного или нескольких ранее согласованных условий Договора РЕПО, такие изменения оформляются Подтверждениями, содержащими Референс Договора РЕПО, условия которого подлежат изменению, а также описание измененных условий и направляемыми каждой из Сторон другой Стороне в сроки и в порядке, предусмотренные пунктами 12.1–12.6 настоящего Соглашения. Вносимые изменения не могут относиться к обязательствам по Договорам РЕПО, исполненным до их внесения.

ПРЕДОСТАВЛЕНИЕ СВЕДЕНИЙ В РЕПОЗИТАРИЙ

12.10. Стороны обязуются предоставлять в Репозитарий информацию о заключении Договоров РЕПО в рамках настоящего Соглашения, в соответствии с требованиями и порядком, предусмотренными Действующим законодательством, а также Договором об оказании репозитарных услуг, для чего Стороны настоящего Соглашения договорились, что:

В случае если каждая Сторона самостоятельно предоставляет информацию в Репозитарий, в настоящее Соглашение включаются пункты следующего содержания:

«12.10.1. Информирующим лицом _____ является _____ (репозитарный код: _____, международный код идентификации юридического лица (LEI): _____).

Страна регистрации: Российская Федерация
_____ является _____ (репозитарный код: _____, международный код идентификации юридического лица (LEI): _____).

_____).

Страна регистрации _____.

12.10.2. Стороной, формирующей и присваивающей уникальный код идентификации договора (Unique Trade Identifier, UTI) в отношении настоящего Соглашения и Договоров РЕПО, по которым Стороны обязаны предоставлять информацию в Репозиторий, является Сторона А.

Сторона А не позднее второго Рабочего дня со дня заключения Договора РЕПО уведомляет Сторону Б о сформированном UTI любым доступным способом по согласованным каналам связи, позволяющим установить, что документ, содержащий UTI, исходит от Стороны А,

12.10.3. Стороны обязуются заключить с Репозитарием все договоры и соглашения, необходимые для реализации пункта 12.10 настоящего Соглашения, и обеспечить действительность и действие соответствующих договоров и соглашений в течение всего срока действия настоящего Соглашения.

12.10.4. Стороны обязуются своевременно оплачивать услуги Репозитария в порядке, предусмотренном Договором об оказании репозитарных услуг. При этом каждая Сторона уплачивает причитающиеся с нее платежи в пользу Репозитария самостоятельно.

12.10.5. Стороны договорились проводить сверку информации о договорах, заключенных в рамках настоящего Соглашения, зарегистрированного в Репозитарии, методом комбинированного подтверждения по обязательным (основным) полям.

12.10.6. Порядок, сроки и формы предоставления Репозитарию информации о настоящем Соглашении и Договорах РЕПО определяются законодательством Российской Федерации и Договором об оказании репозитарных услуг.».

В случае если Сторона Б не обязана предоставлять отчетность в Репозиторий и не является клиентом НКО АО НРД или предоставила отказ от предоставления отчетности, в настоящее Соглашение включаются пункты следующего содержания:

«12.10.1. Сторона А обязуется предоставлять информацию о заключении настоящего Соглашения и Договоров РЕПО в Репозиторий в соответствии с требованиями и порядком, предусмотренными законодательством Российской Федерации, а также Договором об оказании репозитарных услуг.

12.10.2. Сторона Б подтверждает, что, являясь лицом, необязанным представлять информацию в Репозиторий, настоящим выражает свое безотзывное и безусловное согласие Стороне А на передачу информации Репозитарию в объеме, установленном законодательством Российской Федерации (включая нормативно-правовые акты Банка России), а также Договором об оказании репозитарных услуг.

12.10.3. Информирующим лицом _____ является _____ (репозитарный код: _____, международный код идентификации юридического лица (LEI): _____).

Репозитарный код Стороны Б: _____ (при наличии),

международный код идентификации юридического лица (LEI) Стороны Б:

_____ (при наличии),

ИНН Стороны Б: _____ (в случае отсутствия LEI).

12.10.4. Стороной, формирующей и присваивающей уникальный код идентификации договора (Unique Trade Identifier, UTI) в отношении Соглашения и Договоров РЕПО, по которым Стороны обязаны предоставлять информацию в Репозиторий, является Сторона А.

Сторона А уведомляет Сторону Б о сформированном UTI любым доступным способом по согласованным каналам связи, позволяющим установить, что документ, содержащий UTI, исходит от Стороны А,

12.10.5. Каждая Сторона обязуется самостоятельно оплачивать свои издержки, связанные с оплатой услуг Репозитария (в случае если Сторона Б является клиентом НКО АО НРД и предоставила отказ от отчетности).

12.10.6. Порядок, сроки и формы предоставления Репозитарию информации о настоящем Соглашении и Договорах РЕПО определяются законодательством Российской Федерации и Договором об оказании репозитарных услуг.».

13. ОТВЕТСТВЕННОСТЬ СТОРОН

13.1. В случае несоблюдения или нарушения одной из Сторон гарантий,

предусмотренных настоящим Соглашением, другая Сторона вправе требовать возмещения убытков, причиненных таким нарушением или несоблюдением, в полном объеме. Сумма причиненного убытка должна быть документально подтверждена Стороной, требующей возмещения.

13.2. Сторона, допустившая неисполнение или несвоевременное исполнение обязательств, предусмотренных настоящим Соглашением и/или условиями Договора РЕПО (Нарушившая Сторона), уплачивает по требованию другой Стороны (Ненарушившей Стороны) пеню, предусмотренную настоящим Соглашением.

13.2.1. При неисполнении или несвоевременном исполнении платежных обязательств по настоящему Соглашению или какому-либо Договору РЕПО, в том числе при неисполнении или несвоевременном исполнении обязательств по внесению Компенсационных (Маржинальных) взносов или передаче Дохода по Ценным бумагам, Нарушившая Сторона уплачивает Ненарушившей Стороне пеню, размер которой рассчитывается исходя из суммы денежных средств, не уплаченных в установленный срок.

13.2.2. При неисполнении или несвоевременном исполнении обязательств по поставке Ценных бумаг по настоящему Соглашению или какому-либо Договору РЕПО, в том числе при неисполнении или несвоевременном исполнении обязательств по внесению Компенсационных (Маржинальных) взносов, Нарушившая Сторона уплачивает Ненарушившей Стороне пени исходя из стоимости не поставленных в срок Ценных бумаг, которая определяется как:

– Сумма покупки – если не исполнены или несвоевременно исполнены обязательства по первой части Договора РЕПО;

– Сумма выкупа – в остальных случаях.

13.2.3. Если Ненарушившая Сторона потребовала досрочного исполнения обязательств по второй части Договора РЕПО в соответствии с пунктом 6.1 настоящего Соглашения, размер пени за неисполнение или несвоевременное исполнение обязательств по внесению Компенсационных (Маржинальных) взносов рассчитывается исходя из количества дней с даты перечисления / передачи Компенсационного (Маржинального) взноса, определенной в соответствии с разделом 7 настоящего Соглашения в уведомлении о перечислении / передаче Компенсационного (Маржинального) взноса, по дату, когда Нарушившая Сторона должна исполнить обязательства по второй части досрочно исполняемого Договора РЕПО.

13.2.4. При расчете размера пени за неисполнение или несвоевременное исполнение обязательств Сторонами применяются следующие ставки:

если валютой обязательства являются рубли – ставка RUONIA Index, действовавшая на дату неисполнения обязательств, плюс 3 % (Три процента) годовых;

если валютой обязательства являются доллары США – ставка SOFR (Secured Overnight Financing Rate), действовавшая на дату неисполнения обязательств, плюс 3 % (Три процента) годовых;

если валютой обязательства является евро – ставка ESTR (Euro short-term rate), действовавшая на дату неисполнения обязательств, плюс 3 % (Три процента) годовых;

в остальных случаях – в размере ставки SONIA, TONAR, SARON в соответствующей валюте на дату неисполнения обязательств плюс 3 % (Три процента) годовых.

Пеня начисляется на сумму обязательств, просрочка исполнения которых допущена, за каждый календарный день просрочки. Если значение соответствующей ставки, указанной выше, меньше нуля, значение ставки принимается равным нулю.

13.3. Уплата Нарушившей Стороной суммы пени за неисполнение или несвоевременное исполнение обязательств по настоящему Соглашению не исключает право Ненарушившей Стороны:

– требовать исполнения в установленном порядке Нарушившей Стороной своих обязательств по первой / второй части Договора РЕПО, или обязательств по Компенсационным (Маржинальным) взносам, или обязательств по передаче Дохода по Ценным бумагам; либо

– если неисполнение или несвоевременное исполнение происходит в отношении обязательств Нарушившей Стороны по первой части Договора РЕПО, расторгнуть Договор РЕПО в одностороннем порядке, направив Нарушившей Стороне соответствующее уведомление;

– если неисполнение или несвоевременное исполнение происходит в отношении уплаты Компенсационных (Маржинальных) взносов, требовать досрочного исполнения обязательств по второй части Договора РЕПО;

– если неисполнение происходит в отношении обязательств Нарушившей Стороны по

второй части Договора РЕПО, требовать урегулирования обязательств по соответствующему Договору РЕПО.

13.4. При просрочке одной из Сторон исполнения обязательств по второй части Договора РЕПО другая Сторона вправе направить Нарушившей Стороне уведомление с предложением применить Процедуру урегулирования в соответствии разделом 10 настоящего Соглашения.

13.5. Уплата пени Стороной, допустившей несвоевременное исполнение обязательств, не освобождает ее от исполнения обязательств и возмещения убытков, причиненных другой Стороне.

13.6. Платеж любой суммы, поступившей от Нарушившей Стороны по настоящему Соглашению, направляется на погашение ее задолженности по денежному обязательству в следующем порядке:

а) в первую очередь погашается сумма обязательства;
б) во вторую очередь погашается сумма пени, подлежащая уплате в связи с неисполнением или ненадлежащим исполнением обязательств.

13.7. Уплата пени, неустоек и штрафов осуществляется в Валюте расчетов с учетом положений, определенных в пункте 10.6 настоящего Соглашения.

13.8. Сторона А имеет право:

В целях исполнения законодательства Российской Федерации о противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма, в том числе, но не ограничиваясь, требовать от Стороны Б предоставления любых документов, сведений (включая информацию о своих выгодоприобретателях, учредителях (участниках), представителях и бенефициарных владельцах), в том числе поясняющих экономическую суть проводимых Стороной Б операций.

13.9. Сторона Б обязана:

По требованию Стороны А в срок не более 7 (Семи) Рабочих дней с даты получения такого требования предоставить любые документы и сведения (включая информацию о своих выгодоприобретателях, учредителях (участниках), представителях и бенефициарных владельцах), в том числе подтверждающие актуальность информации, хранящейся у Стороны А, в целях исполнения законодательства Российской Федерации о противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма, а также поясняющие экономическую суть проводимых Стороной Б операций.

14. ОСНОВАНИЯ ДЛЯ ОСВОБОЖДЕНИЯ ОТ ОТВЕТСТВЕННОСТИ

14.1. Стороны не несут ответственности за неисполнение или ненадлежащее исполнение своих обязательств по Договорам РЕПО, если такое неисполнение или ненадлежащее исполнение было вызвано:

– принятием органами государственной власти Российской Федерации / других государств и центральными / национальными банками нормативных правовых актов, которые делают невозможным, в том числе и временно (мораторий), для одной из Сторон надлежащее исполнение своих обязательств по Договору РЕПО;

– приостановлением действия, включая несвоевременное исполнение обязательств по основаниям, установленным пунктом 10 статьи 7 Федерального закона от 07.08.2001 № 115-ФЗ «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма», а также принятием новых законов и иных нормативных правовых актов, регулирующих соответствующее правоотношение;

– наступлением обстоятельств непреодолимой силы, а именно: стихийных бедствий, военных действий, забастовок, террористических актов и иных чрезвычайных и непредотвратимых при данных условиях обстоятельств при условии, что данные обстоятельства непосредственно повлияли на исполнение обязательств по Договорам РЕПО.

14.2. Обязанность доказывания действия обстоятельств непреодолимой силы, а также иных обстоятельств, являющихся основанием освобождения от ответственности, лежит на Стороне, которая ссылается на их действие.

14.3. Сторона, затронутая действием обстоятельств, указанных в пункте 14.1 настоящего Соглашения, обязана незамедлительно, но в любом случае не позднее 3 (Трех) Рабочих дней с даты их возникновения / прекращения уведомить в письменной форме другую Сторону, соответственно, о наступлении таких обстоятельств, их характере и сроке действия (при

невозможности определить точный срок – о примерном сроке действия) / о прекращении действия таких обстоятельств, а также в течение 20 (Двадцати) Рабочих дней с даты получения запроса от другой Стороны предоставить другой Стороне документы, подтверждающие наступление соответствующих обстоятельств и срок их действия, в том числе подтверждающие документы, выданные компетентным государственным органом или торгово-промышленной палатой. При отсутствии таких уведомлений и подтверждающих документов (кроме случаев, когда информация о наступлении таких обстоятельств является общедоступной или когда наступление таких обстоятельств препятствует передаче уведомлений и подтверждающих документов) или нарушении сроков их предоставления Сторона, допустившая неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств, не вправе ссылаться на действие обстоятельств, являющихся основанием для освобождения от ответственности, и несет ответственность в соответствии с разделом 13 настоящего Соглашения.

14.4. В случае наличия надлежащего уведомления и подтверждающих документов в соответствии с пунктом 14.3. настоящего Соглашения срок исполнения обязательств по Договорам РЕПО отодвигается на время действия вышеуказанных обстоятельств. После прекращения действия обстоятельств, указанных в пункте 14.1 настоящего Соглашения, Стороны обязаны продолжить исполнение своих обязательств по заключенным Договорам РЕПО.

14.5. В случае если действие вышеуказанных обстоятельств продолжается более 30 (Тридцати) Рабочих дней, Стороны обязаны начать переговоры продолжительностью не более 10 (Десяти) Рабочих дней для определения альтернативных вариантов для исполнения обязательств, приостановленных в связи с действием обстоятельств, указанных в пункте 14.1 настоящего Соглашения.

В случае недостижения согласия в результате таких переговоров Сторона, не затронутая действием обстоятельств, указанных в пункте 14.1 настоящего Соглашения (либо любая из Сторон, если в результате действия таких обстоятельств происходит взаимное неисполнение обязательств по Договору РЕПО), может принять решение о расторжении таких Договоров РЕПО в одностороннем порядке с предварительным уведомлением об этом другой Стороны в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения, не позднее чем за 2 (Два) Рабочих дня до предполагаемой даты расторжения.

14.6. Стороны не несут ответственности за неисполнение или ненадлежащее исполнение своих обязательств по Договорам РЕПО, если такое неисполнение (ненадлежащее исполнение) было вызвано предоставлением Стороной-получателем денежных средств или Ценных бумаг Стороне-перевододателю ошибочных реквизитов для перечисления денежных средств / поставки Ценных бумаг.

В этом случае надлежащее исполнение обязательств осуществляется только после возврата, ранее исполненного по ошибочным реквизитам.

15. ДОПОЛНИТЕЛЬНЫЕ УСЛОВИЯ

15.1. Ограничение исполнения

Стороны согласовали, что Ограничение исполнения не является обстоятельством непреодолимой силы, не является основанием для освобождения Стороны от ответственности за неисполнение или ненадлежащее исполнение своих обязательств в соответствии с пунктом 14.1 настоящего Соглашения и исполнение обязательств по Договору РЕПО может быть произведено с учетом следующих положений:

(а) Исполнение по Договору РЕПО в рублях по Обменному курсу

Если какой-либо платеж по любому Договору РЕПО подлежит уплате в иностранной валюте и любая из Сторон в связи с наступлением Ограничения исполнения (как данный термин определен настоящим Соглашением) не может осуществить или принять (получить) такой платеж в иностранной валюте, такая Сторона не позднее Рабочего дня, предшествующего соответствующей дате платежа по Договору РЕПО, направляет письменное уведомление о невозможности исполнения со ссылкой на настоящий подпункт (а) в порядке, предусмотренном настоящим Соглашением для обмена Подтверждениями, другой Стороне. При этом Сторона, которая не может осуществить или принять (получить) платеж в иностранной валюте, вправе осуществить платеж или потребовать осуществления соответствующего платежа по Договору РЕПО в рублях по Обменному курсу (если Подтверждением по соответствующему Договору

РЕПО не предусмотрено иное или иной порядок не согласован Сторонами). В этом случае Сторона А определяет сумму соответствующего платежа по Договору РЕПО в рублях по Обменному курсу и уведомляет об этом вторую Сторону не позднее 14:00 по московскому времени в соответствующую дату платежа. Для целей осуществления расчетов по Договору РЕПО в рублях по Обменному курсу Стороны обязуются своевременно предоставить реквизиты счета для оплаты в рублях (если такие реквизиты не указаны в настоящем Соглашении или Подтверждении по Договору РЕПО). Если в соответствующую дату платежа по Договорам РЕПО с учетом положений настоящего подпункта (а) обе Стороны должны осуществить платежи в рублях, то к обязательствам Сторон применяются положения пункта 5.8 настоящего Соглашения. Во избежание сомнений замена Валюты платежа по Договору РЕПО в соответствии с настоящим подпунктом (а) на рубли не является новацией для целей ст. 414 Гражданского кодекса Российской Федерации.

Определения для целей настоящего пункта:

Ограничение исполнения означает любые экономические, финансовые или торговые ограничения или ограничительные меры, введенные на основании законов, нормативных правовых или индивидуальных актов государственных или иных уполномоченных органов в соответствии с применимым правом в отношении юридических или физических лиц, запрещающие Сторонам или третьим лицам, участие которых необходимо для целей исполнения обязательств по Договору РЕПО (в том числе, но не ограничиваясь, банкам-корреспондентам, банкам, в которых открыты счета, используемые для расчетов по Договору РЕПО), совершение или исполнение всех или отдельных видов сделок или операций, необходимых для исполнения платежных обязательств в иностранной валюте по Договору РЕПО, если одно или несколько вышеуказанных ограничений имеет или может иметь место на дату платежа по Договору РЕПО.

Обменный курс означает:

(А) если платежные обязательства по Договору РЕПО выражены в долларах США, то для целей осуществления платежа в рублях – курс рубля к доллару США, выраженный как количество рублей за один доллар, для расчетов на следующий Рабочий день, опубликованный ПАО «Московская Биржа ММВБ-РТС» (МОЕХ) на странице moex.com/en/fixing как МОЕХ USD/RUB FX Fixing примерно в 12 часов 35 минут по московскому времени в соответствующую дату платежа по Договору РЕПО с отклонением не более 1 %, размер отклонения определяется Стороной А. В случае невозможности определения Обменного курса в соответствии с настоящим подпунктом (А) Обменный курс устанавливается как официальный курс рубля к доллару США, выраженный как количество рублей за один доллар США, установленный Банком России в соответствующую дату платежа по Договору РЕПО для расчетов на следующий Рабочий день с отклонением не более 1 %, размер отклонения определяется Стороной А. Для целей определения суммы платежа в рублях сумма платежа в долларах США умножается на Обменный курс, определяемый в соответствии с настоящим подпунктом (А);

(Б) если платежные обязательства по Договору РЕПО выражены в иной иностранной валюте, кроме долларов США, то для целей осуществления платежа в рублях – курс рубля к соответствующей иностранной валюте, установленный Стороной А для данной операции. Для целей определения суммы платежа в рублях сумма платежа в соответствующей иностранной валюте умножается на Обменный курс, определяемый в соответствии с настоящим подпунктом (Б).

Все уведомления, сообщения, запросы, извещения или требования в рамках настоящего пункта направляются Сторонами в порядке, определенном разделом 12 настоящего Соглашения.

16. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

16.1. Договоры РЕПО, заключенные в соответствии с настоящим Соглашением, а также все вытекающие из них права и обязанности Сторон регулируются и толкуются в соответствии с действующим законодательством.

16.2. В случае если в результате изменения действующего законодательства отдельные положения настоящего Соглашения окажутся незаконными или недействительными, это не будет означать незаконность или недействительность других положений настоящего Соглашения и настоящего Соглашения в целом.

16.3⁶. Споры Сторон по заключенным в рамках Соглашения Договорам РЕПО, в том числе, касающиеся их исполнения, нарушения, прекращения или недействительности, подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражном суде г. Москвы.

Каждая из Сторон вправе обратиться в Арбитражный суд г. Москвы по истечении 7 (Семи) Рабочих дней со дня направления другой Стороне претензии в письменной форме.

Споры Клиента и Брокера по Соглашению и заключенным в рамках Соглашения Договорам РЕПО, в том числе, касающиеся их исполнения, нарушения, прекращения или недействительности, подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражном суде г. Москвы или в Суде общей юрисдикции по месту нахождения Брокера (если применимо). 16.4. Каждая из Сторон вправе фиксировать проводимые переговоры, в том числе с целью использования полученных материалов (к которым, в зависимости от способа фиксации переговоров, без ограничений относятся: аудиозапись, распечатка переговоров по ЭСС электронной почте и иные) в качестве подтверждения согласованных Сторонами условий Договора РЕПО в целях разрешения споров.

Стороны договорились о возможности использования зафиксированных переговоров в ходе судебного разрешения споров.

16.4. Стороны обязуются рассматривать условия заключенных Договоров РЕПО как конфиденциальную информацию и не будут раскрывать ее третьим лицам (за исключением аудиторов Сторон, уполномоченных государственных органов, а также случаев раскрытия информации в соответствии с требованиями Действующего законодательства), если иное не будет специально согласовано между Сторонами.

Любые документы, предоставленные и подготовленные любой из Сторон в связи с Договорами РЕПО, будут рассматриваться Сторонами как конфиденциальные.

Сторона, получившая конфиденциальную информацию, несет ответственность перед другой Стороной за действия любого из ее сотрудников и представителей, которые нарушают требования настоящего пункта, при этом любой иск (претензия или требование) в связи с таким нарушением может быть подан только против Стороны, получившей конфиденциальную информацию, и только другой Стороной.

Обязательства Сторон, предусмотренные настоящим разделом, не распространяются на информацию, которая является общедоступной.

16.5. Текст настоящего Соглашения подлежит публикации на официальном сайте Брокера

16.6. Брокер в одностороннем порядке вправе вносить изменения в текст данного Соглашения, которые вступают в силу через 10 дней с момента их опубликования на сайте. Клиент, не согласный с новой редакцией Соглашения, вправе отказаться от его использования, направив письменный отказ Брокеру любым из способов, предусмотренных Соглашением

16.7. Ни одна из Сторон, а также Клиент, не имеет права передать свои права и требования, вытекающие из настоящего Соглашения, полностью или частично третьей стороне.

16.8. Настоящее Соглашение вступает в силу для Клиента с момента его акцепта Клиентом любым доступным способом, позволяющим однозначно зафиксировать согласие Клиента на использование настоящего Соглашения.

17. РЕКВИЗИТЫ БРОКЕРА

Брокер (Сторона А): Акционерное общество «Москва Сити Секьюритиз»

Место нахождения: 127051, г.Москва, Б.Сухаревский пер, д.21, стр.2 ком.2-15, 17

ОГРН 1227700750320; ИНН 9702049204,

Электронная почта: broker@mcitys.ru

⁶ Пункт 16.3 подлежит корректировке в случае, если Стороной Б по настоящему Соглашению является юридическое лицо, учрежденное и/или зарегистрированное в иностранной юрисдикции, **не входящей в перечень стран СНГ**, в которых возможно признание и исполнение решения государственного суда.

Расчетные формулы

1. Сумма выкупа рассчитывается по формуле:

$$S_2 = S_1 + (S_1 \times r \times T) / Y, \quad (1)$$

где:

S_2 – Сумма выкупа;

S_1 – Сумма покупки;

r – Ставка РЕПО;

T – Срок РЕПО;

Y – База начисления процентов.

А. В случае если в качестве базы расчетов используется фактическое количество дней в году (365 или 366) и конец / начало високосного года приходится на период между Датой исполнения первой части Договора РЕПО и Датой исполнения второй части Договора РЕПО, Сумма выкупа рассчитывается по формуле:

$$S_2 = S_1 + (S_1 \times r \times T_{0 \rightarrow d}) / Y_1 + (S_1 \times r \times T_{d \rightarrow N}) / Y_2, \quad (1A)$$

где:

S_2 – Текущая сумма выкупа;

S_1 – Сумма покупки;

r – Ставка РЕПО;

$T_{0 \rightarrow d}$ – часть Срока РЕПО от дня, следующего за Датой исполнения первой части Договора РЕПО, до 31 декабря включительно;

$T_{d \rightarrow N}$ – часть Срока РЕПО с 01 января до Даты исполнения второй части Договора РЕПО включительно;

Y_1 – фактическое количество дней в году, на который приходится Дата исполнения первой части Договора РЕПО;

Y_2 – фактическое количество дней в году, на который приходится Дата исполнения второй части Договора РЕПО.

Б. В случае осуществления предоплаты, в т. ч. за счет Нижней переоценки либо за счет выплат эмитентом Доходов по Ценным бумагам, Сумма выкупа рассчитывается по формуле:

$$S_2 = (S_1 - \sum_{i=1..N} P_i) + (S_1 \times r \times t_{0 \rightarrow 1}) / Y + \\ + \sum_{k=1..N-1} [(S_1 - \sum_{i=1..k} P_i) \times r \times t_{k \rightarrow k+1}] / Y + (S_1 - \sum_{i=1..N} P_i) \times r \times T_N / Y, \quad (1B)$$

где:

S_2 – Сумма выкупа;

S_1 – Сумма покупки;

N – количество предоплат, осуществленных на момент расчета Суммы выкупа;

P_i – Сумма i -й предоплаты;

r – Ставка РЕПО;

$t_{0 \rightarrow 1}$ – часть Срока РЕПО со дня, следующего за Датой исполнения первой части Договора РЕПО, до дня первой предоплаты включительно;

$t_{k \rightarrow (k+1)}$ – часть Срока РЕПО со дня, следующего за днем k -й предоплаты, до дня $k+1$ -й предоплаты включительно;

T_N – часть Срока РЕПО со дня, следующего за днем N -й предоплаты, до Даты исполнения второй части Договора РЕПО включительно;

Y – База начисления процентов. В случае если в качестве базы расчетов используется фактическое количество дней в году (365 или 366) и конец / начало високосного

года приходится на период между Датой исполнения первой части Договора РЕПО и Датой исполнения второй части Договора РЕПО, проценты по РЕПО за период, на который приходится окончание / начало високосного года, рассчитываются аналогично формуле 1А.

В случае если Срок РЕПО разделен на несколько Процентных периодов, Сумма выкупа рассчитывается по формуле:

$$S_2 = S_1 + \sum_{i=1}^N S_1 \times r_i \times T_i / Y \quad (1B)$$

где:

S_2 – Сумма выкупа;
 S_1 – Сумма покупки;
 T_i – Количество дней в Процентном периоде по соответствующей ставке;
 Y – База начисления процентов.
 N – количество Процентных периодов (если Ставка РЕПО – фиксированная) / количество изменений Ставки РЕПО в течение Процентных периодов (если Ставка РЕПО – плавающая), осуществленных на момент расчета Суммы выкупа;
 r_i – Ставка РЕПО i -го Процентного периода, действующая в течение T_i .

2. Цена по второй части Договора РЕПО рассчитывается по формуле:

$$P_2 = S_2 / Q - C_2, \quad (2)$$

где:

P_2 – цена по второй части Договора РЕПО;
 S_2 – Сумма выкупа;
 Q – количество Ценных бумаг по Договору РЕПО;
 C_2 – накопленный купонный доход (НКД) (в расчете на одну Ценную бумагу) на Дату выкупа (для долговых Ценных бумаг).

3. Текущая сумма выкупа рассчитывается по формуле:

$$S_0 = S_1 + (S_1 \times r \times T_0) / Y, \quad (3)$$

где:

S_0 – Текущая сумма выкупа;
 S_1 – Сумма покупки;
 r – Ставка РЕПО;
 T_0 – часть Срока РЕПО от дня, следующего за Датой исполнения первой части Договора РЕПО, до дня, в который производится расчет Текущей суммы выкупа включительно;
 Y – База начисления процентов.

А. В случае, если в качестве базы расчетов используется фактическое количество дней в году (365 или 366) и конец / начало високосного года приходится на период между Датой исполнения первой части Договора РЕПО и датой расчета Текущей суммы выкупа, Текущая сумма выкупа рассчитывается по формуле:

$$S_0 = S_1 + (S_1 \times r \times T_{0 \rightarrow d}) / Y_1 + (S_1 \times r \times T_{d \rightarrow N}) / Y_2, \quad (3A)$$

где:

S_0 – Текущая сумма выкупа;
 S_1 – Сумма покупки;
 r – Ставка РЕПО;
 $T_{0 \rightarrow d}$ – часть Срока РЕПО от дня, следующего за Датой исполнения первой части Договора РЕПО, до 31 декабря включительно;
 $T_{d \rightarrow N}$ – часть Срока РЕПО с 01 января до даты расчета Текущей суммы выкупа включительно;
 Y_1 – фактическое количество дней в году, на который приходится Дата исполнения первой части Договора РЕПО;
 Y_2 – фактическое количество дней в году, на который приходится дата расчета Текущей суммы выкупа.

Б. В случае осуществления предоплаты, в том числе за счет Нижней переоценки либо за счет выплат эмитентом Доходов по Ценным бумагам, Текущая сумма выкупа рассчитывается по формуле:

$$S_0 = (S_1 - \sum_{i=1...N} P_i) + (S_1 \times r \times t_{0>1}) / Y + \\ + \sum_{k=1...N-1} [(S_1 - \sum_{i=1...k} P_i) \times r \times t_{k>k+1}] / Y + (S_1 - \sum_{i=1...N} P_i) \times r \times t_N / Y, \quad (3Б)$$

где:

S_0 – Текущая сумма выкупа;
 S_1 – Сумма покупки;
 N – количество предоплат, осуществленных на момент расчета Текущей суммы выкупа;
 P_i – сумма i -й предоплаты;
 r – Ставка РЕПО;
 $t_{0>1}$ – часть Срока РЕПО со дня, следующего за Датой исполнения первой части Договора РЕПО, до дня первой предоплаты включительно;
 $t_{k>(k+1)}$ – часть Срока РЕПО со дня, следующего за днем k -й предоплаты, до дня $k+1$ -й предоплаты включительно;
 t_N – часть Срока РЕПО со дня, следующего за днем N -й предоплаты, до дня, в который производится расчет Текущей суммы выкупа включительно;
 Y – База начисления процентов. В случае если в качестве базы расчетов используется фактическое количество дней в году (365 или 366) и конец / начало високосного года приходится на период между Датой исполнения первой части Договора РЕПО и датой расчета Текущей суммы выкупа, проценты по РЕПО за период, на который приходится окончание / начало високосного года, рассчитываются по формуле 3А.

4. Текущая стоимость обеспечения рассчитывается по формуле:

$$CP = (MP_0 + C_0) \times Q \times D, \quad (4)$$

где:

CP – Текущая стоимость обеспечения;
 MP_0 – текущая рыночная цена Ценной бумаги, являющейся предметом Договора РЕПО, на дату определения Текущей стоимости обеспечения;
 Q – количество Ценных бумаг по Договору РЕПО;
 D – Начальный коэффициент обеспечения;
 C_0 – НКД (в расчете на одну Ценную бумагу) на дату определения Текущей стоимости обеспечения (для долговых Ценных бумаг).

5. Дефицит / Избыток маржи рассчитывается по формуле:

$$MD / ME = CP - S_0 + Ps - Pb, \quad (5)$$

где:

MD – Дефицит маржи (если рассчитанное по формуле значение – величина отрицательная);
 ME – Избыток маржи (если рассчитанное по формуле значение – величина положительная);
 CP – Текущая стоимость обеспечения на дату определения Дефицита / Избытка маржи;
 S_0 – Текущая сумма выкупа на дату определения Дефицита / Избытка маржи;
 Ps – сумма Маржинальных взносов, включая накопленные проценты, внесенных Первоначальным продавцом до даты определения Дефицита / Избытка маржи;
 Pb – сумма Маржинальных взносов, включая накопленные проценты, внесенных Первоначальным покупателем до даты определения Дефицита / Избытка маржи.

6. Наступление случая Нижней переоценки определяется по формуле:

$$|MD| \geq (S_0 - Ps + Pb) \times Tr, \quad (6)$$

где:

MD – Дефицит маржи;
 S₀ – Текущая сумма выкупа на дату определения Дефицита маржи;
 P_s – сумма Маржинальных взносов, включая накопленные проценты, внесенных Первоначальным продавцом до даты определения Дефицита маржи;
 P_b – сумма Маржинальных взносов, включая накопленные проценты, внесенных Первоначальным покупателем до даты определения Дефицита маржи;
 Tr – Уровень переоценки, в процентах.

7. Наступление случая Верхней переоценки определяется по формуле:

$$ME \geq (S_0 - P_s + P_b) \times Tr, \quad (7)$$

где:

ME – Избыток маржи;
 S₀ – Текущая сумма выкупа на дату определения Избытка маржи;
 P_s – сумма Маржинальных взносов, включая накопленные проценты, внесенных Первоначальным продавцом до даты определения Избытка маржи;
 P_b – сумма Маржинальных взносов, включая накопленные проценты, внесенных Первоначальным покупателем до даты определения Избытка маржи;
 Tr – Уровень переоценки, в процентах.

8. Размер Компенсационного взноса в форме Ценных бумаг:

$$Mo = Q - \text{int} \left\{ \frac{S_0}{(1 - D) / 100\% \times (MP_0 + C)} \right\}, \quad (8)$$

где:

Mo – количество Ценных бумаг, подлежащее передаче в качестве Компенсационного взноса;
 Q – количество Ценных бумаг по Договору РЕПО;
 S₀ – Текущая сумма выкупа на дату переоценки;
 D – Начальный коэффициент обеспечения;
 MP₀ – текущая рыночная цена Ценной бумаги, являющейся предметом Договора РЕПО, на дату переоценки;
 C – НКД (в расчете на одну Ценную бумагу) на дату переоценки.

9. Наступление Уровня прекращения определяется по формуле:

$$|MD| \geq (S_0 - P_s + P_b) \times Tr, \quad (9)$$

где:

MD – Дефицит маржи;
 S₀ – Текущая сумма выкупа на дату определения Избытка маржи;
 P_s – сумма Маржинальных взносов, включая накопленные проценты, внесенных Первоначальным продавцом до даты определения Избытка маржи;
 P_b – сумма Маржинальных взносов, включая накопленные проценты, внесенных Первоначальным покупателем до даты определения Избытка маржи;
 Tr – Уровень прекращения, в процентах.

Приложение 2
к Соглашению об общих условиях
заключения и исполнения договоров
РЕПО, заключаемых Брокером на
основании поручений Клиентов на
рынке ценных бумаг

Подтверждение по Договору РЕПО № _____ от _____.20____

г. Москва

«_____» _____ 20__ г.

_____, именуем___ в дальнейшем «Первоначальный покупатель», в лице _____, действующего (й) на основании _____, с одной стороны, и _____, именуем___ в дальнейшем «Первоначальный продавец», в лице _____, действующего (й) на основании _____, с другой стороны, заключили настоящий Договор РЕПО о нижеследующем:

1. Настоящий Договор РЕПО заключен в соответствии с условиями Соглашения об общих условиях заключения и исполнения договоров РЕПО на рынке ценных бумаг № _____ от _____.20____ (далее – Соглашение).

2. Стороны пришли к соглашению заключить настоящий Договор РЕПО на следующих условиях:

Ценные бумаги (эмитент, вид, форма, для акций также – категория (тип), для паев паевых инвестиционных фондов также – наименование паевого инвестиционного фонда)	
Государственный регистрационный номер, а также иные реквизиты, предусмотренные Действующим законодательством / ISIN / CFI	
Количество Ценных бумаг или порядок его определения	
Валюта Договора РЕПО	
Цена по первой части Договора РЕПО	
Накопленный купонный доход (НКД) на Дату исполнения первой части Договора РЕПО (если применимо) (в Валюте Договора РЕПО)	
Сумма покупки или порядок ее определения (в Валюте Договора РЕПО)	
Валюта расчетов и применимый курс пересчета по первой части Договора РЕПО	
Сумма платежа по первой части Договора РЕПО (в Валюте расчетов)	
Дата покупки	
Дата поставки Ценных бумаг по первой части Договора РЕПО	
Порядок расчетов по первой части Договора РЕПО	
Ставка РЕПО, %	
Срок РЕПО	

Процентные периоды	
Цена по второй части Договора РЕПО	
НКД на Дату исполнения второй части Договора РЕПО (если применимо) (в Валюте Договора РЕПО)	
Сумма выкупа или порядок ее определения (в Валюте Договора РЕПО)	
Валюта расчетов и применимый курс пересчета по второй части Договора РЕПО	
Сумма платежа по второй части Договора РЕПО (в валюте расчетов, на Дату выкупа)	
Дата выкупа*	
Дата поставки Ценных бумаг по второй части Договора РЕПО*	
Порядок расчетов по второй части Договора РЕПО	
Возможность проведения Верхней переоценки	
Возможность проведения Нижней переоценки	
Уровень переоценки (<i>Дефицит маржи / Избыток маржи</i>)	
Начальный коэффициент обеспечения	
Способ проведения Верхней переоценки	
Способ проведения Нижней переоценки	
Порядок действий в случае выплаты эмитентом Ценных бумаг в течение Срока РЕПО дивидендов / купонного дохода / сумм частичного погашения	
Иные условия:	

* В случае если Стороны совершают РЕПО с открытой датой, существенным будет указание на то, что заключаемый Договор является РЕПО с открытой датой. В этом случае вместо Даты выкупа и Даты поставки Ценных бумаг по второй части Договора РЕПО указывается:

– «Дата требования об исполнении РЕПО с открытой датой»;

– какая из Сторон (Первоначальный покупатель и/или Первоначальный продавец) будет иметь право направления другой Стороне требования об исполнении обязательств по второй части Договора РЕПО.

3. Реквизиты для исполнения Договора РЕПО

Реквизиты Первоначального покупателя: _____

Адрес: _____

ИНН _____

Реквизиты банковского счета _____

Получатель: _____

Счет: _____

К/С: _____

БИК: _____

Банк получателя: _____

Реквизиты счета ДЕПО / лицевого Идентификатор: _____

счета в реестре владельцев Ценных Счет ДЕПО: _____

бумаг Депозитарий: _____

Тип счета: _____

Раздел счета: _____

Договор счета ДЕПО: _____

Реквизиты Первоначального продавца: _____

Адрес: _____

ИНН _____

Реквизиты банковского счета

Получатель: _____

Счет: _____

К/С: _____

БИК: _____

Банк получателя: _____

Реквизиты счета ДЕПО / лицевого
счета в реестре владельцев Ценных
бумаг

Идентификатор: _____

Счет ДЕПО: _____

Депозитарий: _____

Тип счета: _____

Раздел счета: _____

4. Настоящее Подтверждение является неотъемлемой частью Соглашения, составлено в двух экземплярах, по одному экземпляру для каждой из Сторон настоящего Договора РЕПО.

Первоначальный покупатель:

Первоначальный продавец:

МП

МП

Приложение 3
к Соглашению об общих условиях
заключения и исполнения договоров
РЕПО, заключаемых Брокером на
основании поручений Клиентов на
рынке ценных бумаг

Договор о взаиморасчетах № _____

г. Москва

«_____» _____ 20__ г.

_____, именуем___ в дальнейшем «Сторона-1», в лице _____, действующего (й) _____ на основании _____, и _____, именуем___ в дальнейшем «Сторона-2», в лице _____, действующего (й) на основании _____, совместно именуемые далее «Стороны», заключили настоящий Договор о взаиморасчетах (далее – Договор) о нижеследующем:

1. Сторона-1 обязана уплатить Стороне-2 сумму в размере:

Сумма в валюте сделки	Валюта сделки	Сумма в валюте расчетов	Валюта расчетов	Документ
				Итого

2. Сторона-2 обязана уплатить Стороне-1 сумму в размере:

Сумма в валюте сделки	Валюта сделки	Сумма в валюте расчетов	Валюта расчетов	Документ
				Итого

3. Обязательства Сторон по поставке Ценных бумаг:

Эмитент _____, ГРН/ISIN _____

Обязательства Стороны	Количество, шт.	Документ
Сторона-1		
Сторона-2		
[Сторона-1 / Сторона-2]		Итоговое обязательство

4. Стороны договорились, что с момента подписания Договора обязательства Стороны-1 по уплате суммы в размере _____ по договору, указанному в п. 1 Договора, полностью / частично прекращаются. Обязательства Стороны-2 по уплате суммы в размере _____ по договору, указанному в п. 2 Договора, полностью / частично прекращаются. Сторона-1 / Сторона-2 обязана уплатить _____.20__ сумму в размере _____ на счет Стороны-2 / Стороны-1, указанный в п. 7 Договора.

5. Стороны пришли к соглашению о проведении зачета встречных однородных требований по поставке Ценных бумаг, указанных в п. 3 Договора. Обязательства Стороны-1 прекращаются полностью зачетом _____.20__ / частично. Обязательства Стороны-2 прекращаются полностью зачетом _____.20__ / частично. Сторона-1 / Сторона-2 обязана поставить _____ Ценные бумаги, указанные в п. 3 Договора, в количестве _____ штук на счет Стороны-2 / Стороны-1, указанный в п. 7 Договора.

6. Договор составлен и подписан в двух экземплярах, имеющих равную юридическую силу, по одному для каждой из Сторон.

7. адреса и банковские реквизиты Сторон**7.1. Сторона-1:** _____

Место нахождения: _____

ИНН: _____

Банковские реквизиты:

Счет: _____

К/С: _____

БИК: _____

Банк получателя: _____

Реквизиты счета ДЕПО: (в случае движения по Ценным бумагам)

Счет ДЕПО:

Депозитарий:

Тип счета:

Раздел счета:

Договор:

7.2. Сторона-2: _____

Место нахождения: _____

ИНН: _____

Банковские реквизиты:

Счет: _____

К/С: _____

БИК: _____

Банк получателя: _____

Реквизиты счета ДЕПО: (в случае движения по Ценным бумагам)

Счет ДЕПО:

Депозитарий:

Тип счета:

Раздел счета:

Договор:

Сторона-1:

_____/ФИО/

МП

Сторона-2:

_____/ФИО/

МП