

ГЕНЕРАЛЬНОЕ СОГЛАШЕНИЕ О СРОЧНЫХ СДЕЛКАХ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ

НАСТОЯЩЕЕ ГЕНЕРАЛЬНОЕ СОГЛАШЕНИЕ О СРОЧНЫХ СДЕЛКАХ НА ФИНАНСОВЫХ РЫНКАХ № _____ (далее - "*Генеральное соглашение*") заключено "___" _____ 20__ года

между

- (1) АКЦИОНЕРНЫМ ОБЩЕСТВОМ "АЛЬФА-БАНК" (далее - "*Сторона А*"), созданным и действующим в соответствии с законодательством Российской Федерации, ОГРН 1027700067328, с местонахождением по адресу: Российская Федерация, 107078, г. Москва, ул. Каланчевская, д. 27, в лице _____, действующего на основании _____, с одной стороны, и
- (2) [•] (далее - "*Сторона Б*"), созданным и действующим в соответствии с законодательством Российской Федерации, ОГРН [•], с местонахождением по адресу: [•], Российская Федерация, в лице [президента/председателя правления/генерального директора] [•], действующего на основании [Устава], с другой стороны,

далее совместно именуемыми "*Стороны*", а по отдельности - "*Сторона*".

Принимая во внимание, что

Стороны намереваются заключать сделки, перечисленные в подпунктах (а), (б) и (в) пункта 2.2 статьи 2 Примерных условий договора (определенных ниже), которые будут регулироваться настоящим Генеральным соглашением,

Стороны договорились о следующем:

1. **ПРИМЕНЕНИЕ ПОЛОЖЕНИЙ ПРИМЕРНЫХ УСЛОВИЙ ДОГОВОРА И СТАНДАРТНЫХ УСЛОВИЙ. ОПРЕДЕЛЕНИЕ ТЕРМИНОВ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ В ГЕНЕРАЛЬНОМ СОГЛАШЕНИИ**
- 1.1 Стороны договариваются о том, что отдельные условия настоящего Генерального соглашения определяются Примерными условиями договора о срочных сделках на финансовых рынках 2011 г., разработанными и утвержденными Саморегулируемой (некоммерческой) организацией "Национальная ассоциация участников фондового рынка" (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, и опубликованными в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации "Национальная ассоциация участников фондового рынка" (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее - "*Примерные условия договора*"), с

учетом изменений и дополнений, установленных в Генеральном соглашении. При этом для целей применения Примерных условий договора как части настоящего Генерального соглашения ссылки на Сделки в Примерных условиях договора считаются исключительно ссылками на Сделки, заключенные в соответствии с настоящим Генеральным соглашением.

- 1.2 Термины, используемые с заглавной буквы в Генеральном соглашении, имеют значение, указанное в статье 12 Примерных условий договора, если Генеральным соглашением не предусмотрено иное.
- 1.3 Стандартные условия применяются к отношениям Сторон по Сделке (а) в случае ссылки на эти Стандартные условия в Подтверждении, или (б) в отсутствие такой ссылки, если применение Стандартных условий к отношениям Сторон по Сделке следует из условий Сделки, или (в) в соответствии с пунктом 1.3 статьи 1 Примерных условий договора.
- 1.4 Настоящим Стороны договариваются о том, что каждая и любая Сделка, которая в соответствии с законодательством Российской Федерации может быть признана производным финансовым инструментом на основании соглашения Сторон, является производным финансовым инструментом, если Стороны прямо не предусмотрели иное применительно к соответствующей Сделке в Подтверждении.

2. ЗАКЛЮЧЕНИЕ И ПОДТВЕРЖДЕНИЕ СДЕЛОК

Заключение Сделок

- 2.1 Для целей пункта 2.3 статьи 2 Примерных условий договора Стороны устанавливают следующий порядок заключения Сделок.
- 2.2 Для заключения Сделки Стороны согласовывают существенные условия этой Сделки по телефону, Reuters-Dealing или Bloomberg.
- 2.3 В пункте 2.4 статьи 2 Примерных условий договора слова "Электронным средствам связи" в первой, второй и третьей строках дополнить словами "и телефону".

Подтверждение Сделок

- 2.4 Для целей пункта 2.7 статьи 2 Примерных условий договора Стороны устанавливают следующий порядок составления и обмена Подтверждениями.
- 2.5 Не позднее следующего Рабочего дня после Даты Сделки Сторона А размещает в системе «Альфа-Подтверждение» (далее - «Система Альфа-подтверждение») Подтверждение, содержащее все существенные и иные условия Сделки в виде электронного документа. Порядок работы и взаимодействия Сторон в Системе Альфа-подтверждение регулируются Договором на обслуживание по системе «Альфа-Подтверждение», заключенным между Сторонами, в том числе Правилами взаимодействия участников системы «Альфа-Подтверждение», утвержденными Стороной А, подтверждение о присоединении, к которому подписано уполномоченными

лицами Стороны Б (далее для целей настоящей статьи 2 - «Уполномоченное лицо Стороны Б»).

По своему выбору или в случае невозможности размещения Подтверждения в Системе Альфа-подтверждение Сторона А не позднее следующего Рабочего дня после Даты Сделки направляет Стороне Б Подтверждение, содержащее все существенные и иные условия Сделки посредством факсимильной связи или системы SWIFT.

Сторона Б не позднее 14:00 часов по московскому времени Рабочего дня после Даты сделки подтверждает свое согласие с правильность изложения в Подтверждении согласованных условий Сделки и другими условиями Сделки при их наличии посредством проставления электронной подписи Уполномоченного лица Стороны Б на соответствующем Подтверждении в Системе Альфа-подтверждение, либо соответственно, при обмене Подтверждениями по факсимильной связи, Сторона Б подписывает Подтверждение в указанном месте и возвращает подписанное Подтверждение Стороне А также по факсимильной связи, или соответственно, направляет Подтверждение со своей стороны по системе SWIFT.

- 2.6 Подтверждение, направленное Стороной А, считается принятым Стороной Б при отсутствии очевидной ошибки, если не позднее 13:00 часов по московскому времени следующего Рабочего дня после Даты сделки Сторона Б не направит Стороне А возражения относительно условий Сделки, содержащихся в Подтверждении, посредством Системы Альфа-подтверждение, факсимильной связи или системы SWIFT или исправленный вариант Подтверждения посредством факсимильной связи или системы SWIFT.
- 2.7 Если Сторона Б направляет возражения или исправленный вариант Подтверждения посредством Системы Альфа-подтверждение, факсимильной связи или системы SWIFT в срок, указанный в пункте 2.6 настоящей статьи 2, Сторона А, получив исправленный вариант Подтверждения или возражения Стороны Б по Подтверждению, вправе не позднее 14:00 часов по московскому времени следующего Рабочего дня после Даты сделки направить посредством Системы Альфа-подтверждение, факсимильной связи или системы SWIFT возражения относительно содержания исправленного варианта Подтверждения (в том числе, в виде исправленного ею варианта такого Подтверждения) или возражений Стороны Б по Подтверждению.
- 2.8 Если Сторона Б не принимает возражений Стороны А относительно своих возражений или исправленного Стороной Б варианта Подтверждения Сделка считается заключенной в соответствии с пунктом 2.6 статьи 2 Примерных условий договора.
- 2.9 Если Подтверждение, его исправленный вариант или возражения Стороны Б по Подтверждению не были направлены Стороной Б в соответствии с пунктом **Ошибка! Источник ссылки не найден.** или **Ошибка! Источник ссылки не найден.** настоящей статьи 2, по требованию Стороны А Сторона Б обязана проставить в Системе Альфа-

подтверждение электронную подпись Уполномоченного лица Стороны Б на Подтверждении либо, если Подтверждение было получено Стороной Б по факсимильной связи или по системе SWIFT направить Стороне А не позднее 14:30 часов по московскому времени следующего Рабочего дня после Даты сделки подписанное Стороной Б Подтверждение посредством факсимильной связи или Подтверждение по системе SWIFT.

- 2.10 По требованию любой из Сторон в последний Рабочий день месяца, но в любом случае не позднее чем в течение двух Рабочих дней после предъявления требования Стороной А, Стороны обязаны обменяться (с курьером или по почте) оригиналами Подтверждений, подписанными уполномоченными представителями Сторон.
- 2.11 В пункте 2.7 статьи 2 Примерных условий договора слова "или иной согласованной Сторонами форме" дополнить ", или иной форме, приемлемой для Стороны А".
- 2.12 В пункте 2.8 статьи 2 Примерных условий договора после слов "в Дату сделки" дополнить ", а также указание на Дату сделки".

3. ПОЛОЖЕНИЯ О ПРЕКРАЩЕНИИ

3.1 *Связанное лицо* означает:

- (а) применительно к Стороне А для целей:
- (А) подпункта (д) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора: не применяется;
 - (Б) подпункта (е) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора: не применяется;
 - (В) подпункта (ж) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора: не применяется;
 - (Г) подпункта (з) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора: не применяется;
 - (Д) подпункта (и) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора: не применяется;
 - (Е) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора: не применяется;
 - (Ж) подпункта (в) пункта 5.3 статьи 5 Примерных условий договора: не применяется;
- (б) применительно к Стороне Б для целей:
- (А) подпункта (д) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора: любое Аффилированное лицо;

- (Б) подпункта (е) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора: любое Аффилированное лицо;
- (В) подпункта (ж) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора: любое Аффилированное лицо;
- (Г) подпункта (з) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора: любое Аффилированное лицо;
- (Д) подпункта (и) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора: любое Аффилированное лицо;
- (Е) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора: любое Аффилированное лицо;
- (Ж) подпункта (в) пункта 5.3 статьи 5 Примерных условий договора: любое Аффилированное лицо.

3.2 **Иная срочная сделка** имеет значение, указанное в статье 12 Примерных условий договора. Для целей подпункта (в) определения "Иная срочная сделка" и применительно только к Стороне Б, Иная срочная сделка также означает любой иной договор (а также любое генеральное соглашение, которое к нему относится, и любое обязательство по обеспечению исполнения обязательств по нему), заключенный по законодательству Российской Федерации или иностранному праву в настоящем или будущем между (i) Стороной Б, ее Связанным лицом или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, и (ii)(А) Стороной А, ее Связанным лицом или Лицом, предоставляющим обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, который не является Сделкой по Генеральному соглашению; или (Б) третьим лицом.

3.3 Подпункт (ж) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора (**Нарушение долговых обязательств (кросс-дефолт)**):

Не применяется к Стороне А,

Применяется к Стороне Б

Задолженность по долгovým обязательствам означает любое обязательство (как существующее на дату заключения настоящего Генерального соглашения или Сделки, так и возникшее после такой даты, условное или без условия, основное или акцессорное, включая обязательства по уплате сумм за третье лицо на основании гарантии или договора поручительства или ином аналогичном основании) по возврату заемных денежных средств или уплате купонных, процентных или иных платежей в связи с заимствованием денежных средств по договору займа, облигационного займа (в том числе при выпуске еврооблигаций), кредитному договору, договору о выставлении аккредитива или иному аналогичному договору.

Пороговая сумма означает:

Для Стороны А - не применимо,

для Стороны Б – 10 000 (Десять тысяч) долларов США или эквивалент этой суммы в любой иной валюте после пересчета данной суммы Стороной А с использованием курса, добросовестно и разумно выбранного Стороной А.

3.4 Подпункт (в) пункта 5.3 статьи 5 Примерных условий договора (***Снижение платежеспособности вследствие реорганизации***):

не применяется к Стороне А, и

применяется к Стороне Б,

с учетом следующего изменения: слова "означает, что" дополнить словами "(А) происходит реорганизация Стороны или Лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, или передача всего или существенной части ее/его/их имущества третьему лицу и правопреемник Стороны по обязательствам по Генеральному соглашению, в том числе любой из Сделок, или Лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, по обязательствам по Документу об обеспечении не принимает на себя такие обязательства Стороны или Лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, в силу закона или на основании договора, удовлетворяющего другую Сторону; или (Б)".

3.5 ***Валюта прекращения*** имеет значение, указанное в статье 12 Примерных условий договора.

3.6 ***Дополнительное основание прекращения*** применяется.

(а) Дополнительное основание прекращения применительно к Стороне Б (которая будет являться Затронутой стороной для целей такого Дополнительного основания прекращения) составляет вступление Стороны Б в переговоры с кредиторами с целью приостановления исполнения обязательств, списания задолженности или иной реструктуризации (либо прекращения) задолженности Стороны Б по любым своим обязательствам (в том числе созыв Стороной Б собрания или комитета кредиторов).

(б) Дополнительное основание прекращения применительно к Стороне Б (которая будет являться Затронутой стороной для целей такого Дополнительного основания прекращения) составляет наступление любого события или совершение любого действия, в результате которого [указать контролирующего акционера или группу] перестает осуществлять контроль, прямо либо косвенно, в отношении Стороны Б. При этом для целей настоящего подпункта (а) под "***осуществлением контроля***" понимается:

(А) владение, прямо либо косвенно, более чем 50 процентов голосующих акций или долей участия; или

(Б) возможность (в силу владения акциями или долями участия, в соответствии с соглашением, в качестве агента или поверенного либо иным образом):

- (aa) голосовать либо определять результаты голосования более чем 50 процентов голосующих акций или долей участия; или
- (bb) назначать и досрочно прекращать полномочия единоличного исполнительного органа либо определять состав более чем половины коллегиального исполнительного органа; или
- (vv) давать обязательные для исполнения Стороной Б указания либо определять направления финансово-хозяйственной деятельности.

3.7 Подпункт (а) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора изложить в следующей редакции:

"(а) *Просрочка платежа или поставки.*

(А) Просрочка Стороной какого-либо платежа или поставки по Сделке (за исключением Сделки, образованной заключенным Сторонами Договором о порядке уплаты плавающих маржевых сумм (далее - "**Договор о маржевых суммах**") согласно пункту 1.3 такого договора), если указанное нарушение продолжается после истечения следующего Рабочего дня после получения Стороной-должником уведомления о такой просрочке.

(Б)

(aa) Просрочка Стороной Б как Плательщиком плавающих маржевых сумм по Договору о маржевых суммах уплаты Плавающей маржевой суммы или Дополнительной маржевой суммы Стороне А как Получателю плавающих маржевых сумм по Договору о маржевых суммах.

(bb) Просрочка Стороной А как Получателем плавающих маржевых сумм по Договору о маржевых суммах уплаты Плавающей маржевой суммы или Дополнительной маржевой суммы Стороне Б как Плательщику плавающих маржевых сумм по Договору о маржевых суммах, если указанное нарушение продолжается после истечения третьего Рабочего дня после получения Стороной А уведомления о такой просрочке.

Для целей настоящего подпункта (Б), термины, использованные с заглавной буквы и не определенные в Генеральном соглашении, имеют значение, определенное в Договоре о маржевых суммах."

3.8 В подпункте (А) подпункта (б) пункта 5.1 статьи 5 Примерных условий договора:

- (а) слова "по Сделке" дополнить словами "или иного обязательства по Сделке, образованной Договором о маржевых суммах согласно пункту 1.3 такого договора,";
- (б) слово "тридцати" заменить словом "пятнадцати".

3.9 Пункт 5.1 статьи 5 Примерных условий договора дополнить следующими положениями:

- "(к) **Требование уплаты Плавающих маржевых сумм в отсутствие достаточных оснований.** Сторона Б как Плательщик плавающих маржевых сумм по Договору о маржевых суммах в отсутствие оснований, предусмотренных пунктом 2.3 статьи 2 Стандартных условий договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм 2011 г., требует уплаты Плавающей маржевой суммы или Дополнительной маржевой суммы Стороной А как Получателем плавающих маржевых сумм по Договору о маржевых суммах. Для целей настоящего подпункта (к), Нарушившей стороной является Сторона Б.

Для целей настоящего подпункта (к), термины, использованные с заглавной буквы и не определенные в Генеральном соглашении, имеют значение, определенное в Договоре о маржевых суммах.

- (л) **Достижение Уровня прекращения по портфелю.** Плавающая маржевая сумма, рассчитанная в соответствии с пунктом 2.1 статьи 2 Стандартных условий договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм 2011 г., (с учетом изменений, внесенных Договором о маржевых суммах), составляет положительное число, равное Минимальной сумме платежа, установленной для Стороны Б как Плательщика плавающих маржевых сумм, или превышающее такую Минимальную сумму платежа, и такая Плавающая маржевая сумма, выраженная в процентах от Нетто-обязательства по портфелю, превышает Уровень прекращения по портфелю. При этом, несмотря на любые положения Договора о маржевых суммах об ином, при расчете Плавающей маржевой суммы для целей настоящего подпункта (л) из Накопленных маржевых сумм исключаются Плавающие маржевые суммы, требование об уплате которых Получатель плавающих маржевых сумм предъявил ранее, и в Накопленные маржевые суммы включаются Плавающие маржевые суммы, требование об уплате которых Плательщик плавающих маржевых сумм предъявил ранее, если какая-либо из этих сумм не была уплачена и Дата платежа по обязательству об уплате такой суммы наступает в Дату оценки или после нее. Для целей настоящего подпункта (л), Нарушившей стороной является Сторона Б.

Для целей настоящего подпункта (л), термины, использованные с заглавной буквы и не определенные в Генеральном соглашении, имеют значение, определенное в Договоре о маржевых суммах."

3.10 Подпункт (з) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора изложить в следующей редакции:

"(з) вмешательство или аналогичные действия со стороны органов государственной власти или местного самоуправления, контрольных или надзорных органов в операции, дела или хозяйственную деятельность Стороны, ее Связанного лица или Лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, при условии, что такие действия могут, по мнению Стороны А, негативно повлиять на способность соответствующей Стороны, ее Связанного лица или Лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, исполнять свои обязательства по Генеральному соглашению, в том числе любой из Сделок, или Документу об обеспечении;"

3.11 Пункт 5.2 статьи 5 Примерных условий договора дополнить следующими положениями:

"(и) наступление любого иного события в отношении Стороны, ее Связанного лица или Лица, предоставляющего обеспечение исполнения обязательств этой Стороны, которое в соответствии с применимым законодательством будет иметь последствия, аналогичные описанным в настоящем пункте 5.2."

3.12. Дополнить пункт 6.2 Примерных условий договора вторым абзацем следующего содержания:

"Независимо от направления уведомления о досрочном прекращении обязательств по всем Сделкам, Ненарушившая сторона должна незамедлительно, после того как ей стало известно о Нарушении обязательства или Банкротстве (кроме случаев, предусмотренных подпунктом (е) пункта 5.2 и подпунктом (В) подпункта (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора) информировать об этом Нарушившую сторону по каналам связи, предусмотренными Генеральным соглашением. Если случай Нарушения обязательств или Банкротство (кроме случаев, предусмотренных подпунктом (е) пункта 5.2 и подпунктом (В) подпункта (ж) пункта 5.2 статьи 5 Примерных условий договора) наступил и продолжается и Ненарушившая сторона не направляет уведомление о досрочном прекращении обязательств по всем Сделкам, Нарушившая сторона имеет право на обращение к Ненарушившей стороне с просьбой о досрочном прекращении обязательств по всем Сделкам, и в таком случае Ненарушившая сторона будет обязана направить уведомление о досрочном прекращении обязательств по всем Сделкам в порядке, предусмотренном настоящим пунктом 6.2."

3.13 Первый абзац пункта 6.8 статьи 6 Примерных условий договора изложить в следующей редакции:

"Уведомление о сумме денежного обязательства при прекращении. В Дату досрочного прекращения либо в возможно короткий срок после ее наступления Ненарушившая сторона или, в случае Иного основания досрочного прекращения, Сторона А:"

3.14 В подпункте (б) пункта 6.8 статьи 6 Примерных условий договора слова "Нарушившей или Затронутой стороне" заменить словами "Нарушившей стороне или Стороне Б посредством почты, телекса, системы SWIFT или

курьером"; после слов "(на основании которых произведен расчет)" дополнить "с разбивкой в отношении каждой Сделки".

- 3.15 Исключить последний абзац пункта 6.8 статьи 6 Примерных условий договора.
- 3.16 В подпункте (д) пункта 6.9 статьи 6 Примерных условий договора:
- (а) перед словами "издержки или расходы"; и
 - (б) после слов "вправе учесть (i)" и "сделке, (ii)"
- дополнить "документально подтвержденные".
- 3.17 Подпункт (б) пункта 6.10 статьи 6 Примерных условий договора изложить в следующей редакции:
- "(б) **Иные основания досрочного прекращения.** В случае досрочного прекращения обязательств по Затронутым сделкам вследствие Иного основания досрочного прекращения Сумма денежного обязательства при прекращении рассчитывается Стороной А. Сумма денежного обязательства при прекращении определяется в соответствии с подпунктом (а) настоящего пункта 6.10. При этом ссылки на Нарушившую и Ненарушившую стороны означают ссылки на Сторону Б и Сторону А соответственно."
- 3.18 В подпункте (а) пункта 6.12 статьи 6 Примерных условий договора слова "в день получения" дополнить словами "посредством почты, телекса, системы SWIFT или курьером".
- 3.19 Подпункт (б) пункта 6.12 статьи 6 Примерных условий договора изложить в следующей редакции:
- "(б) при досрочном прекращении обязательств по Затронутым сделкам вследствие наступления Иного основания досрочного прекращения в течение одного Рабочего дня после получения посредством почты, телекса, системы SWIFT или курьером Стороной Б Уведомления о сумме денежного обязательства при прекращении."
- 3.20 В подпункте (а) пункта 6.14 статьи 6 Примерных условий договора слова "неисполненные Сделки" заменить словами "неисполненные и/или непрекращенные Сделки".

4. ПРЕДСТАВЛЕНИЕ ДОКУМЕНТОВ

- 4.1 Стороны обязуются представить следующие документы:

Сторона, представляющая документ	Вид документа	Срок представления	Отметка о применении пункта 4.9 статьи 4 Примерных условий договора
Сторона А и Сторона Б	Учредительные документы	До или при заключении Генерального соглашения	Да
Сторона А и Сторона Б	Свидетельство о государственной регистрации	До или при заключении Генерального соглашения	Да
Сторона А и Сторона Б	Лицензия на осуществление банковских операций, иная лицензия, имеющая существенное значение для деятельности Стороны А/Б	До или при заключении Генерального соглашения	Да
Сторона А и Сторона Б	Карточка (или альбом) с образцами подписей уполномоченных представителей Стороны А/Б	При заключении Генерального соглашения	Да
Сторона А и Сторона Б	Документы, подтверждающие полномочия представителей Стороны А/Б на заключение Генерального соглашения, если Генеральное соглашение подписывается лицом, не являющимся единоличным исполнительным органом Стороны А/Б	До или при заключении Генерального соглашения	Да
Сторона А и Сторона Б	Документы, подтверждающие полномочия представителей Стороны А/Б на заключение и подтверждение Сделок, составленные существенным образом по форме, приведенной в приложении 1/2 к Генеральному соглашению	До или при заключении Генерального соглашения	Да
Сторона А и Сторона Б	Разрешения, согласия и одобрения государственных органов, которые Сторона Б обязана получить в отношении Генерального соглашения, в том числе любой из Сделок, или любого из Документов об обеспечении, подписанного этой Стороной	При заключении Генерального соглашения или соответствующей Сделки или Документа об обеспечении, как применимо	Да
Сторона А и	Бухгалтерский баланс по счетам	В разумно короткий срок по	Да

Сторона Б	второго порядка	требованию другой Стороны	
¹ Сторона А и Сторона Б	Расчет обязательных нормативов	В разумно короткий срок по требованию другой Стороны	Да
Сторона Б	Иные документы и сведения, определенные Стороной А, в том числе связанные с исполнением требований законодательства, направленного на противодействие легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма	В разумно короткий срок по требованию Стороны А, а при необходимости, до или при заключении Генерального соглашения	Да

4.2 В случае внесения изменений или дополнений в документы, представленные Стороной в соответствии с настоящей статьей 4, либо их отмены или признания утратившими силу эта Сторона обязана незамедлительно уведомить об этом другую Сторону и в разумный срок представить измененные или дополненные документы либо новые документы, принятые или оформленные взамен отмененных или утративших силу.

5. РАЗНОЕ

5.1 **Адреса и иные реквизиты Сторон.** Для целей пункта 10.1 статьи 10 Примерных условий договора:

(а) Реквизиты Стороны А для направления Подтверждений, уведомлений или иных сообщений:

Почтовый адрес:	107078, г. Москва, ул. Каланчевская, д. 27
Вниманию:	Управления оформления операций на финансовых рынках
Телефон:	+7(495)6209191; +7(495)7953646; +7(495)7864885; +7(495)788 6704
Телекс:	412 089 ALFA RU
Факс:	+7(495)7953684; +7(495)7457158; +7(495)7953699

¹ Включить, если соответствующая Сторона является кредитной организацией.

Адрес электронной почты: ConfirmationsTeam@alfabank.ru;

CollateralTeam@alfabank.ru

SWIFT: ALFARUMM

Reuters: ALFM

Bloomberg: ALFM

- (б) Реквизиты Стороны Б для направления Подтверждений, уведомлений или иных сообщений:

Почтовый адрес: [•]

Вниманию: [•]

Телефон: [•]

Телекс: [•]

Факс: [•]

Адрес электронной почты: [•]

SWIFT: [•]

Reuters: [•]

Bloomberg: [•]

Каждый документ, отправляемый посредством факсимильной связи (по факсу) должен быть подписан лицами, надлежащим образом уполномоченными для их подписания от имени отправляющей Стороны, а также заверен печатью отправляющей Стороны, если заверение печатью предполагается формой направляемого документа.

Каждая Сторона несет ответственность за достоверность своих реквизитов для получения корреспонденции (в том числе адреса, номера телефонов и факсов, адреса электронной почты и др.), содержащихся в настоящем пункте 5.1.

Каждая Сторона вправе изменить реквизиты для получения корреспонденции (в том числе адреса, номера телефонов и факсов, адреса электронной почты и др.), уведомив другую Сторону в порядке, установленном статьей 10 Примерных условий договора, не позднее, чем за один Рабочий день до даты, когда новые реквизиты должны быть применены для целей Генерального соглашения.

- 5.2 **Реквизиты Сторон для осуществления платежа и поставки.** Если иное не указано в Подтверждении, обязательства Стороны по осуществлению платежа или поставки по Генеральному соглашению, в том числе каждой из Сделок, должно исполняться с использованием следующих реквизитов:

- (а) Реквизиты Стороны А для осуществления платежа и поставки:

Счет в российских рублях: АО "Альфа-Банк" ИНН 7728168971 ОГРН 1027700067328
к/с 30101810200000000593 БИК 044525593

Счет в долларах США: Beneficiary: AO ALFA-BANK, Moscow,
SWIFT: ALFARUMM,
Beneficiary's acc.: 36310481
Beneficiary's bank: CITIBANK N.A., NEW YORK, SWIFT CITIUS33

Счет в евро: Beneficiary: Alfa Bank, Moscow
Beneficiary's Account: 1-50.092.584
Beneficiary's Bank: RAIFFEISEN ZENTRALBANK OESTERREICH AG, Vienna,
SWIFT: RZBAATWW

Счет депо: Счет в НКО ЗАО НРД HS1212170852 раздел 36MC0000500000F00 код депонента MC0000500000

Счет в Euroclear Operation Centre, Brussels: 92344

(б) Реквизиты Стороны Б для осуществления платежа и поставки:

Счет в российских рублях: [•]
Счет в долларах США: [•]
Счет в евро: [•]
Счет депо: [•]

Каждая Сторона вправе изменить реквизиты для осуществления платежа или поставки по Генеральному соглашению, уведомив другую Сторону в порядке, установленном статьей 10 Примерных условий договора, не позднее чем за один Рабочий день до даты, когда должен быть осуществлен соответствующий платеж или поставка по Генеральному соглашению.

Сторона, осуществляющая платеж или поставку по Генеральному соглашению, в том числе по какой-либо Сделке, не несет ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение своего обязательства, если такое неисполнение или ненадлежащее исполнение вызваны предоставлением другой Стороной неточных или неправильных реквизитов (в том числе отсутствием у первой Стороны информации об измененных реквизитах), при этом:

(а) Сторона, осуществляющая платеж или поставку, будет обязана произвести повторный платеж или поставку (как применимо) по уточненным реквизитам лишь после того, как ей будет возвращен первоначально произведенный платеж или поставка (как применимо); и

- (б) Сторона, осуществляющая платеж или поставку, будет нести ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение своего обязательства со дня, непосредственно следующего за днем, в который первоначально произведенный платеж или поставка (как применимо) возвращен такой Стороне.
- 5.3 **Расчетный агент.** Расчетным агентом является Сторона А, если применительно к Сделке иное не установлено ее условиями.
- 5.4 **Документ об обеспечении.** Данные о Документе об обеспечении:
применительно к Стороне А отсутствует;
применительно к Стороне Б отсутствует.
- 5.5 **Лицо, предоставляющее обеспечение,**
применительно к Стороне А отсутствует;
применительно к Стороне Б отсутствует.
- 5.6 **Комплексный платежный неттинг.** Для целей пункта 3.7 статьи 3 Примерных условий договора Стороны договариваются о том, что если иное не предусмотрено соответствующим Подтверждением или иным образом не согласовано Сторонами в отношении такой Сделки, обязательства Сторон совершить в пользу друг друга платежи в одной и той же валюте в одну и ту же дату, возникшие из разных Сделок, прекращаются автоматически. Если при этом общая сумма обязательства одной Стороны превышает общую сумму обязательства другой Стороны, обязательство первой Стороны прекращается в части, равной сумме обязательства другой Стороны, а обязательство последней прекращается полностью. По инициативе любой из Сторон Стороны сверяют подлежащую уплате разницу между суммами обязательств Сторон до совершения соответствующего платежа.
- 5.7 Пункт 3.7 статьи 3, пункт 6.15 статьи 6 или иные положения Примерных условий договора не могут быть истолкованы как ограничивающие или исключаяющие возможность прекращения зачетом обязательства по уплате Суммы денежного обязательства при прекращении, определяемой в случаях досрочного прекращения вследствие Нарушения обязательства или вследствие возникновения Иного основания досрочного прекращения. Любая из Сторон вправе зачесть полностью или частично данную Сумму денежного обязательства при прекращении против иного встречного однородного денежного требования в порядке, предусмотренном законодательством Российской Федерации.
- 5.8 **Аффилированное лицо** имеет значение, указанное в статье 12 Примерных условий договора.
- 5.9 **Отсутствие судебных и иных разбирательств.** Для целей пункта 4.8 статьи 4 Примерных условий договора **Связанное лицо** означает:
применительно к Стороне А: отсутствует;

применительно к Стороне Б: любое Аффилированное лицо

5.10 *Дополнительное заявление или заверение* применяется.

- (а) Для целей статьи 4 Примерных условий договора Дополнительные заявления Стороны А и Стороны Б составляют:
 - (А) Сторона надлежащим образом подписала Генеральное соглашение, каждое Подтверждение и каждый Документ об обеспечении, стороной которого она является.
 - (Б) Генеральное соглашение, в том числе каждая из Сделок, и каждый Документ об обеспечении, стороной которого она является, имеют для Стороны обязательную силу и подлежат судебной защите в соответствии с условиями Генерального соглашения, в том числе соответствующей Сделки, и Документа об обеспечении, соответственно.
 - (В) Сторона не отвечает признакам неплатежеспособности или недостаточности имущества (в каждом случае, как это определено в Федеральном законе от 26 октября 2002 г. № 127-ФЗ "О несостоятельности (банкротстве)").
- (б) Для целей статьи 4 Примерных условий договора Дополнительные заявления Стороны Б составляют:
 - (А) Сторона Б заключает каждую Сделку с хозяйственной целью, заключающейся в управлении рисками, возникающими в процессе ее предпринимательской деятельности.
 - (Б) Стороне Б понятно содержание всех условий Генерального соглашения, в том числе каждой из Сделок, и Документа об обеспечении.
 - (В) Сторона Б приняла собственное независимое решение о заключении Генерального соглашения, в том числе каждой из Сделок, и о его приемлемости или целесообразности на основании собственного суждения и в соответствии с рекомендациями тех консультантов, привлечение которых она сочла необходимым, понимает риски, связанные с возможностью возникновения у нее убытков вследствие изменения рыночной стоимости базового актива Сделок.
 - (Г) Сторона Б не полагается на какую-либо информацию (в письменной или устной форме), полученную от Стороны А в отношении заключения Генерального соглашения, в том числе каждой из Сделок, и Сторона А не выполняет в отношении Стороны Б функций финансового консультанта, консультанта по инвестициям либо поверенного в отношении Генерального соглашения, в том числе каждой из Сделок.

- (в) Для целей статьи 4 Примерных условий договора Дополнительные заверения Стороны А и Стороны Б составляют:
- (А) Сторона обязуется незамедлительно уведомлять другую Сторону о своем Нарушении обязательства, Техническом дефолте, Банкротстве, Потенциальном банкротстве или известном ей Ином основании досрочного прекращения.
 - (Б) Сторона обязуется воздержаться от заключения Сделки, если это повлечет за собой нарушение законодательства, учредительных документов этой Стороны, актов судебного или иного государственного органа либо органа местного самоуправления, применимых к этой Стороне, обязательных для этой Стороны положений договоров и односторонних сделок либо если это приведет к наступлению Нарушения обязательства, Технического дефолта, Банкротства, Потенциального банкротства или Иного основания досрочного прекращения.
- (г) Для целей статьи 4 Примерных условий договора Дополнительные заверения Стороны Б составляют:
- (А) Сторона Б обязуется незамедлительно письменно информировать Сторону А о любых изменениях сведений, полученных Стороной А в рамках проведения процедуры идентификации в отношении Стороны Б, и представить документы, подтверждающие внесенные изменения, если такие документы не подлежат представлению в соответствии с пунктом 4.2 статьи 4 Генерального соглашения.
- (д) (А) Условия пунктов 4.7 и 4.8 Примерных условий договора применяются только в отношении Стороны Б.

5.11 **Рабочий день** имеет значение, указанное в статье 12 Примерных условий договора.

5.12 **Репозитарий** а также порядок взаимодействия с Репозитарием определены в приложении 3 к Генеральному соглашению.

5.13 **Электронные средства связи** означает Reuters-Dealing, Bloomberg,.

5.14 **Запись телефонных переговоров.** Стороны соглашаются с тем, что каждая из них может вести запись всех и любых телефонных переговоров между ними (в том числе при заключении Сделки в соответствии с пунктом 2.2 статьи 2 Генерального соглашения) и что любая пленка (либо любой иной материальный носитель записи) с такой записью может служить доказательством при любом рассмотрении споров в любом государственном или третейском суде в целях установления любых вопросов, относящихся к Генеральному соглашению, в том числе любой из Сделок. В случае возникновения между Сторонами любого

спора в отношении условий какой-либо Сделки, Стороны могут использовать запись телефонных переговоров для целей подтверждения ее условий.

6. ПРОЧИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Изменения и дополнения, вносимые в Стандартную документацию

Встречное исполнение обязательств

- 6.1 Без ущерба для действия пунктов 3.3 и 3.4 статьи 3 Примерных условий договора, в отношении любой Сделки, по условиям которой обязательства Сторон по платежу (платежам) и (или) поставке (поставкам) подлежат исполнению в одну дату, если иное не предусмотрено соответствующим Подтверждением исполнение Стороной А своего обязательства по платежу или поставке обусловлено исполнением Стороной Б своего обязательства по платежу или поставке. Сторона А обязана исполнить свое обязательство не позднее окончания Рабочего дня, следующего за датой, в которую Сторона Б исполнила свое обязательство.

Комплексный неттинг по поставочным обязательствам

- 6.2 Для целей статьи 3 Примерных условий договора Стороны договариваются о том, что, если иное не предусмотрено соответствующим Подтверждением или иным образом не согласовано Сторонами в отношении такой Сделки, обязательства Сторон осуществить в пользу друг друга поставку актива одного и того же вида в одну и ту же дату, возникшие из одной и той же или разных Сделок, прекращаются автоматически. Если при этом общее количество актива, подлежащего поставке одной Стороной, превышает общее количество актива, подлежащего поставке другой Стороной, обязательство первой Стороны по поставке такого актива прекращается в части, равной количеству актива, подлежащего поставке другой Стороной, а обязательство последней прекращается полностью.

Валюта платежа

- 6.3 Пункт 8.1 статьи 8 Примерных условий договора изложить в следующей редакции:

"(а) Платежи по каждой из Сделок, должны осуществляться в валюте, согласованной Сторонами для соответствующего платежа (далее - "**Валюта платежа**"). Денежное обязательство по любой Сделке в Валюте платежа не может быть прекращено платежом в иной валюте без предварительного письменного согласия другой Стороны, за исключением случаев, когда Сторона не вправе в соответствии с законодательством или актом какого-либо государственного органа или органа местного самоуправления или государственного или третейского суда исполнить свое обязательство по платежу в Валюте платежа. В таком случае эта Сторона обязана исполнить такое обязательство в российских рублях либо любой иной согласованной между Сторонами валюте.

(б) Исполнение Стороной ("*первая сторона*" для целей настоящего пункта 8.1) своего обязательства по платежу в валюте, отличной от Валюты платежа, прекращает такое обязательство только в той части суммы в Валюте платежа, которую другая Сторона ("*вторая сторона*" для целей настоящего пункта 8.1), действуя добросовестно и разумно, могла бы приобрести в Рабочий день, следующий за днем получения от первой стороны суммы такой иной валюты, за такую сумму в иной валюте (с учетом расходов на конверсию). Первая сторона обязана возместить второй стороне:

(А) положительную разницу между суммой указанного обязательства и суммой, которую вторая сторона может приобрести; и

(Б) все расходы, понесенные второй стороной при покупке суммы в валюте указанного обязательства (если такая сумма была фактически приобретена).".

Уступка прав

6.4 Пункт 8.3 статьи 8 Примерных условий договора изложить в следующей редакции:

"Сторона не вправе уступать, передавать, отчуждать или иным образом распоряжаться правами (требованиями), принадлежащими ей на основании Генерального соглашения, без предварительного письменного согласия другой Стороны, за исключением уступки Стороной А как Ненарушившей стороной требований в отношении Суммы денежного обязательства при прекращении в случае досрочного прекращения обязательств по Сделкам или уступки Стороной А требований из Генерального соглашения, в том числе всех или части Сделок".

Получение уведомлений

6.5 В подпункте (а) пункта 10.1 статьи 10 Примерных условий договора слово "день" заменить словом "момент".

6.6 Подпункт (б) пункта 10.1 статьи 10 Примерных условий договора изложить в следующей редакции:

"(б) если составлено на бумажном носителе и отправлено посредством факсимильной связи - в момент получения на аппарате отправителя подтверждения передачи сообщения;".

6.7 В подпункте (в) пункта 10.1 статьи 10 Примерных условий договора слово "день" заменить словом "момент".

6.8 Подпункты (г) и (д) пункта 10.1 статьи 10 Примерных условий договора исключить и заменить следующими подпунктами:

"(г) если отправлено по Электронным средствам связи:

- (А) при направлении посредством Reuters-Dealing - с момента доставки;
- (Б) при направлении посредством Bloomberg - с момента доставки.
- (д) если отправлено по телексу - с момента получения автоответа получателя;
- (е) если отправлено посредством системы SWIFT - с момента присвоения сообщению системой статуса "получено" ("received");
- (ж) если отправлено по электронной почте – в момент доставки;
- (з) если отправлено по Системе Альфа-подтверждение – в момент размещения документа в Системе Альфа-подтверждение."

6.9 Пункт 10.1 статьи 10 Примерных условий договора дополнить следующими положениями:

"Стороны признают и соглашаются, что уведомления и иные сообщения по Генеральному соглашению, направленные посредством Электронных средств связи, телекса, системы SWIFT, Системы Альфа-подтверждение, факсу равнозначны документам на бумажном носителе, подписанным собственноручной подписью.

Стороны обязуются обеспечить доступ к своим Электронным средствам связи, телексу, системе SWIFT, факсу, Системе Альфа-подтверждение, телефону только тех лиц, которые уполномочены заключать Сделки, подтверждать их условия, а также изменять условия заключенных Сделок и направлять любые уведомления и иные сообщения по Генеральному соглашению от имени этой Стороны (как применимо), и предпринимать все меры, необходимые для обеспечения невозможности доступа неуполномоченных лиц к своим Электронным средствам связи, телексу, системе SWIFT, факсу, Системе Альфа-подтверждение, телефону (в том числе, соблюдать конфиденциальность информации, необходимой для создания и направления таких сообщений).

Несмотря на иные положения Генерального соглашения, Стороны настоящим соглашаются с тем, что факт:

- (а) доступа какого-либо лица к Электронным средствам связи, телексу, системе SWIFT, факсу, Системе Альфа-подтверждение или телефону Стороны; и
- (б) проведения переговоров с использованием Электронных средств связи или телефона и отправления таким лицом сообщения с использованием Электронных средств связи, телекса, системы SWIFT, Системы Альфа-подтверждение или факса этой Стороны,

является неоспоримым свидетельством полномочий такого лица по заключению Сделок или подтверждению их условий от имени этой Стороны (как применимо), вне зависимости от того получена ли другой Стороной в соответствии со статьей 4 Генерального соглашения доверенность и иные документы, подтверждающие полномочия такого лица.

Распечатки переговоров по Электронным средствам связи, факсу, Системе Альфа-подтверждение безусловно принимаются Сторонами в качестве свидетельства заключения и/или подтверждения условий Сделок, в том числе признание таковых в ходе разбирательств в соответствии с пунктом 6.17 статьи 6 Генерального соглашения. В случае возникновения спора, Стороны имеют право воспользоваться иными доказательствами заключения и/или подтверждения условий Сделок.

В случае возникновения любого спора относительно существования и/или действительности любых распечаток переговоров по Электронным средствам связи, Системе Альфа-подтверждения или факсу любого уведомления или иного сообщения и/или записи телефонных переговоров, сделанных Стороной согласно Генеральному соглашению, такой спор должен быть рассмотрен в соответствии с пунктом 6.17 статьи 6 Генерального соглашения, причем бремя доказывания отсутствия и/или недействительности соответствующих распечаток переговоров, соответствующего уведомления или иного сообщения и/или записи телефонных переговоров лежит на Стороне, оспаривающей существование и/или действительность таковых.

Если соглашением Сторон установлена обязанность обмена уведомлениями или иными сообщениями по Генеральному соглашению (в том числе, если какая-либо Сторона действует в качестве Расчетного агента по Сделке), неисполнение Стороной ("*первая сторона*" для целей настоящего абзаца), получившей соответствующее сообщение от другой Стороны ("*вторая сторона*" для целей настоящего абзаца), обязанности по подписанию полученного сообщения и/или по направлению второй стороне такого сообщения, подписанного первой стороной, и/или неполучение второй стороной такого сообщения, подписанного первой стороной, не отменяет и не изменяет обязательства Сторон действовать согласно направленному второй стороной сообщению. Положения настоящего абзаца не подлежат применению к обмену Сторонами Подтверждениями.

Проценты

- 6.10 В пункте 12.1 статьи 12 Примерных условий договора определение "Проценты" изложить в следующей редакции:

"*Проценты* означает проценты, уплачиваемые:

- (а) применительно к пункту 6.11 статьи 6 Примерных условий договора в целях определения Просроченной суммы;
- (б) применительно к пункту 6.13 статьи 6 Примерных условий договора в целях определения Суммы денежного обязательства при прекращении;
- (в) применительно к пунктам 7.1-7.4 статьи 7 Примерных условий договора,

в размере стоимости кредитных ресурсов для соответствующего получателя платежа плюс 1% годовых.

При этом стоимость кредитных ресурсов определяется в следующем порядке:

для обязательств, выраженных рублями – ставка по депозитам в рублях на срок "overnight", публикуемая на странице MOSPRIME1 в системе Reuters действовавшая на дату, когда соответствующее обязательство должно было быть исполнено, но не было исполнено;

для обязательств, выраженных в долларах США – ставка по депозитам в долларах США на срок "overnight", публикуемая на странице LIBOR01 в системе Reuters, действовавшая на дату, когда соответствующее обязательство должно было быть исполнено, но не было исполнено;

для обязательств, выраженных в евро – средневзвешенная ставка по однодневным межбанковским кредитам, предоставляемым в евро, публикуемая на странице EONIA в системе Reuters действовавшая на дату, когда соответствующее обязательство должно было быть исполнено, но не было исполнено."

6.11 В каждом из пунктов 6.11 и 6.13 статьи 6 и пунктов 7.1-7.4 статьи 7 Примерных условий договора слова между словами "за период" и "по" исключить и заменить словами: "с (исключая этот день) даты, когда другой Стороной было выставлено соответствующее требование об уплате Процентов,". Проценты рассчитываются исходя из фактического количества дней в году.

6.12 Дополнить статью 7 Примерных условий договора пунктом 7.5 в следующей редакции:

"7.5. Проценты, указанные в пункте 6.11 статьи 6 и пунктах 7.1-7.2 статьи 7 Примерных условий договора признаются Сторонами неустойкой за неисполнение (ненадлежащее исполнение) обязательств. Сторона, в отношении которой не было исполнено (было ненадлежащим образом исполнено) соответствующее обязательство вправе, но не обязана, требовать от другой Стороны уплаты таких неустоек."

6.13 В пункте 7.1. статьи 7 Примерных условий договора исключить последнее предложение.

Прочие требования

6.14 В пункте 12.1 статьи 12 Примерных условий договора в определении "Прочие требования" слово "Соглашения" заменить словами "Генерального соглашения".

Изменение Генерального соглашения

6.15 Изменение Генерального соглашения, кроме случаев заключения Сделок, действительно, если совершено в письменной форме и собственноручно подписано Сторонами.

Расторжение Генерального соглашения

6.16 Каждая из Сторон вправе расторгнуть Генеральное соглашение в любое время, письменно уведомив об этом другую Сторону не менее чем за 15 (пятнадцать) Рабочих дней до предполагаемой даты расторжения при условии отсутствия на дату расторжения (i) обязательств по Генеральному соглашению (в том числе по какой-либо Сделке), не прекращенных исполнением или иным способом, в том

числе обязательств, срок исполнения которых не наступил, и (ii) Сделок, срок действия которых не истек.

Разрешение споров

- 6.17 Все споры, разногласия и требования, возникающие из Генерального соглашения или в связи с ним, в том числе в связи с заключением, изменением, прекращением, исполнением, неисполнением либо ненадлежащим исполнением Генерального соглашения, по поводу его недействительности, признания его незаключенным, признания его не подлежащим судебной защите, а также заключенных в соответствии с ним (на его основе) Сделок, разрешаются в Арбитражном суде г. Москвы.

Заранее данный акцепт

- 6.18 Сторона Б предоставляет Стороне А право без дополнительных распоряжений (заранее дает акцепт) списывать с банковских счетов Стороны Б в валюте Российской Федерации и иностранной валюте, открытых, а также открываемых Стороной Б в будущем у Стороны А, денежные средства в размере любого неисполненного обязательства Стороны Б по Генеральному соглашению и процентов, начисленных в соответствии с Примерными условиями договора, начиная с Рабочего дня, следующего за днем, когда денежное обязательство должно было быть исполнено. Частичное исполнение требований Стороны А допускается. Суммы, подлежащие списанию с банковских счетов Стороны Б в иностранной валюте, пересчитываются по курсу Стороны А на момент осуществления списания.

7. СДЕЛКИ ОТКРЫТЫЙ ФОРВАРД

- 7.1 Если иное не предусмотрено в настоящей статье 0, положения настоящей статьи 0 подлежат применению исключительно к Сделкам открытый форвард (как определено в пункте 7.2 настоящей статьи 0).
- 7.2 *Сделка открытый форвард* означает Сделку открытый валютный форвард (как определено в Стандартных условиях конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г., с учетом изменений и дополнений, согласованных Сторонами), Сделку открытый форвард на облигации, Сделку открытый форвард на векселя (в каждом случае как определено в Стандартных условиях срочных сделок с облигациями 2011 г., с учетом изменений и дополнений, согласованных Сторонами), Сделку открытый форвард на акции, Сделку открытый форвард на паи (в каждом случае как определено в Стандартных условиях срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г., с учетом изменений и дополнений, согласованных Сторонами).
- 7.3 Сделки открытый форвард подлежат исполнению с учетом особенностей, установленных Генеральным соглашением и соответствующими Стандартными условиями. Все термины, использованные в настоящей статье 0 с заглавной буквы и не определенные в Генеральном соглашении, имеют значение, определенное в соответствующих Стандартных условиях.

7.4 Применительно к Сделкам открытый форвард следующие термины имеют следующие значения:

(а) **База начисления процентов** имеет одно из следующих значений, как может быть согласовано Сторонами:

(А) "**фактический**" означает фактическое количество дней в соответствующем году. Если какая-либо часть соответствующего периода приходится на високосный год, "фактический" означает 366 применительно к такой части и 365 применительно к части, приходящейся на год, не являющийся високосным.

(Б) "**365**" означает 365;

(В) "**360**" означает 360;

Стороны вправе применительно к Сделке согласовать иную Базу начисления процентов. Если применительно к Сделке иное не предусмотрено Подтверждением или иным образом не согласовано Сторонами, Базой начисления процентов по такой Сделке является База начисления процентов "фактический".

(б) **Дата исполнения** означает дату, определяемую в качестве таковой в соответствии с пунктом 7.6 настоящей статьи 0.

(в) **Дата отсчета** означает дату, указанную в таком качестве в Подтверждении или иным образом согласованную Сторонами применительно к Сделке. Если применительно к Сделке иное не предусмотрено Подтверждением или иным образом не согласовано Сторонами, Датой отсчета по такой Сделке является день, наступающий через один Расчетный цикл после Даты сделки.

(г) **Дата пересмотра процентной ставки** означает дату, определенную в соответствии с подпунктом (б) пункта 7.5 настоящей статьи 7.

(д) **Потенциальная дата исполнения** означает, применительно к Стороне:

(А) если для такой Стороны в качестве Потенциальной даты исполнения Стороны согласовали "любой день", – любой Рабочий день;

(Б) если для такой Стороны в качестве Потенциальной даты исполнения Стороны согласовали определенные дни, – любой из таких определенных дней;

(В) если для такой Стороны в качестве Потенциальной даты исполнения Стороны согласовали определенный период или периоды, – любой Рабочий день в пределах такого периода или периодов.

(е) **Потенциальная дата пересмотра процентной ставки** означает:

- (А) если в качестве Потенциальной даты пересмотра процентной ставки Стороны согласовали "любой день", – любой Рабочий день;
 - (Б) если в качестве Потенциальной даты пересмотра процентной ставки Стороны согласовали определенные дни, – любой из таких определенных дней;
 - (В) если в качестве Потенциальной даты пересмотра процентной ставки Стороны согласовали определенный период или периоды, – любой Рабочий день в пределах такого периода или периодов.
- (ж) **Процентная ставка** применительно к Процентному периоду означает каждую процентную ставку, применимую в течение такого Процентного периода к какой-либо валюте по Сделке, выраженную в виде числового значения либо формулы и применяемую для целей расчета:
- (А) суммы валюты, подлежащей уплате по Сделке открытый поставочный валютный форвард Плательщиком;
 - (Б) Суммы платежа по Сделке открытый расчетный валютный форвард / Сделке открытый беспоставочный форвард на облигации / Сделке открытый беспоставочный форвард на векселя / Сделке открытый беспоставочный форвард на акции / Сделке открытый беспоставочный форвард на паи; или
 - (В) суммы, подлежащей уплате Покупателем по Сделке открытый поставочный форвард на облигации / Сделке открытый поставочный форвард на векселя / Сделке открытый поставочный форвард на акции / Сделке открытый поставочный форвард на паи;

при этом Процентная ставка, применяемая к первому Процентному периоду в отношении каждой валюты по Сделке, указывается в соответствующем Подтверждении или иным образом согласовывается Сторонами и может быть изменена Стороной А в соответствии с пунктом 7.5 настоящей статьи 7.

- (з) **Процентный период** означает каждый период времени, начинающийся с Даты пересмотра процентной ставки (исключая такую дату) и заканчивающийся в ближайшую следующую Дату пересмотра процентной ставки (включая такую дату); при этом первый Процентный период начинается с Даты отсчета (исключая эту дату), а последний Процентный период заканчивается в Дату платежа (включительно) (в случае Сделки открытый беспоставочный валютный форвард), в Дату платежа, в которую в соответствии с условиями Сделки должна быть выплачена сумма валюты, подлежащая уплате Плательщиком (включительно) (в случае Сделки открытый поставочный валютный форвард), в Дату расчетов (включительно) (в случае Сделки открытый беспоставочный форвард на облигации, Сделки открытый беспоставочный форвард на векселя, Сделки открытый беспоставочный форвард на акции или Сделки открытый беспоставочный форвард на паи) или в Дату расчетов, в которую должна быть уплачена сумма,

подлежащая уплате по Сделке Покупателем (включительно) (в случае Сделки открытый поставочный форвард на облигации, Сделки открытый поставочный форвард на векселя, Сделки открытый поставочный форвард на акции или Сделки открытый поставочный форвард на паи).

- (и) **Расчетный цикл** означает в отношении любой Сделки (но не только Сделки открытый форвард) количество Рабочих дней, указанное для этой цели в соответствующем Подтверждении либо иным образом согласованное Сторонами применительно к Сделке. Если иное не предусмотрено Подтверждением или иным образом не согласовано Сторонами, Расчетный цикл означает количество Рабочих дней, в течение которого обычно осуществляются расчеты по аналогичным сделкам. Во избежание сомнений, настоящее определение заменяет определения "Расчетного цикла" согласно Стандартным условиям.
- (к) **Уведомление о дате исполнения** означает уведомление о предложении Стороной Даты исполнения, составленное по форме, согласованной Сторонами, или иной форме, приемлемой для Стороны А.
- (л) **Уведомление о пересмотре процентной ставки** означает уведомление о пересмотре Процентной ставки, составленное Стороной А по форме, согласованной Сторонами, или иной форме, приемлемой для Стороны А.
- (м) **Уведомление о расчете** означает уведомление о расчете по Сделке, составленное по форме, согласованной сторонами, или иной форме, приемлемой для Стороны А.

7.5 Пересмотр Процентной ставки

- (а) Сторона А вправе время от времени в одностороннем порядке изменять Процентную ставку, применимую к:
 - (А) валюте, определенной к уплате Плательщиком, и/или валюте, определенной к уплате Получателем платежа, по Сделке открытый поставочный валютный форвард;
 - (Б) Базовой валюте и/или Расчетной валюте по Сделке открытый расчетный валютный форвард;
 - (В) Сделке открытый форвард на облигации;
 - (Г) Сделке открытый форвард на векселя;
 - (Д) Сделке открытый форвард на акции;
 - (Е) Сделке открытый форвард на паи;

и устанавливать какие-либо из своих Потенциальных дат пересмотра процентной ставки в качестве Дат пересмотра процентной ставки. Каждая новая Процентная ставка применяется к Процентному периоду, который начинается с соответствующей Даты пересмотра процентной ставки, установленной Стороной А.

- (б) Изменение Стороной А Процентной ставки осуществляется посредством направления этой Стороной другой Стороне Уведомления о пересмотре процентной ставки не позднее планируемой Даты пересмотра процентной ставки в соответствии с нижеследующим:
- (А) Если Сторона А уведомляет Сторону Б о новой Процентной ставке не позднее 18:00 указанной в Уведомлении о пересмотре процентной ставки Потенциальной даты пересмотра процентной ставки, Датой пересмотра процентной ставки является такая Потенциальная дата пересмотра процентной ставки;
- (Б) Если Сторона А уведомляет Сторону Б о новой Процентной ставке после 18:00 в указанную в Уведомлении о пересмотре процентной ставки Потенциальную дату пересмотра процентной ставки, Датой пересмотра процентной ставки является ближайшая следующая Потенциальная дата пересмотра процентной ставки.

Расчет подлежащей уплате суммы будет осуществляться с применением новой Процентной ставки с соответствующей Датой пересмотра процентной ставки, установленной Стороной А.

- (в) Сторона Б обязуется подписать направленное Стороной А Уведомление о пересмотре процентной ставки и вернуть его Стороне А.
- (г) Если в течение одного Рабочего дня с даты направления Уведомления о пересмотре процентной ставки в соответствии с подпунктом (б) настоящего пункта 7.5 Стороной А не будет получено Уведомление о пересмотре процентной ставки, подписанное Стороной Б, либо будут получены возражения Стороны Б в отношении новой Процентной ставки, то, независимо от условий Сделки, Сторона А имеет право (но не обязанность) определить любую дату в качестве Даты исполнения (независимо от того, является ли Сторона А стороной, имеющей право определить Дату исполнения, и от того, какие даты согласованы Сторонами в качестве Потенциальных дат исполнения для Стороны А). В этом случае расчет подлежащей уплате суммы будет осуществляться с применением новой Процентной ставки с соответствующей Датой пересмотра процентной ставки, установленной Стороной А.

7.6 **Определение Даты исполнения**

- (а) Датой исполнения по сделке является дата, в которую предложение Стороны, которая в соответствии с условиями Сделки имеет право определить Дату исполнения, будет принято другой Стороной в соответствии с положениями подпункта (б) пункта 7.6 ниже. Во избежание сомнений, право определить Дату исполнения по Сделке может быть предоставлено любой из Сторон или обоим Сторонам.

Сторона, имеющая право определить Дату исполнения, вправе предложить в качестве Даты исполнения любую из согласованных для нее Потенциальных дат исполнения, при условии, что такая дата следует после Даты сделки.

- (б) Предложение Стороной, имеющей право определить Дату исполнения, Даты исполнения осуществляется посредством направления этой Стороной другой Стороне Уведомления о дате исполнения не позднее планируемой Даты исполнения. Дата принятия такого предложения определяется в соответствии с нижеследующим:
- (А) Если Сторона (далее для целей настоящего пункта 7.6 – "**Определяющая сторона**") уведомляет другую Сторону о своем предложении определить указанную в Уведомлении о дате исполнения Потенциальную дату исполнения в качестве Даты исполнения не позднее 18:00 такой Потенциальной даты исполнения, датой принятия такого предложения другой Стороной является такая Потенциальная дата исполнения;
- (Б) Если Определяющая сторона уведомляет другую Сторону о своем предложении определить указанную в Уведомлении о дате исполнения Потенциальную дату исполнения в качестве Даты исполнения после 18:00 в такую Потенциальную дату исполнения, датой принятия такого предложения является ближайшая следующая Потенциальная дата исполнения,
- в каждом случае при условии, что другая Сторона, которая в соответствии с условиями соответствующей Сделки имеет право определить Дату исполнения, в срок до даты принятия предложения первой Стороны, не уведомила первую Сторону о своем предложении определить в качестве Даты исполнения любую из согласованных для нее Потенциальных дат исполнения, наступающих до Даты исполнения, предложенной первой Стороной. Если вторая Сторона уведомила первую Сторону о своем предложении определить более раннюю Дату исполнения в соответствии с предыдущим положением настоящего подпункта (б), Датой исполнения является дата принятия такого предложения второй Стороны в соответствии с подпунктами (А) и (Б) выше.
- (в) Не позднее Рабочего дня, следующего за датой получения от Стороны, осуществившей свое право определять Дату исполнения, Уведомления о дате исполнения, другая Сторона обязана подтвердить получение ею такого Уведомления о дате исполнения посредством подписания такого Уведомления о дате исполнения и направить его первой Стороне.
- (г) Если Определяющей стороной и Расчетным агентом по соответствующей Сделке является Сторона А, Уведомление о дате исполнения может включать информацию о сумме валюты, подлежащей уплате Плательщиком (по Сделке открытый поставочный валютный форвард); Сумме платежа (по Сделке открытый расчетный валютный форвард, Сделке открытый беспоставочный форвард на облигации, Сделке открытый беспоставочный форвард на векселя, Сделке открытый беспоставочный форвард на акции или Сделке открытый беспоставочный форвард на паи); или сумме, подлежащей уплате Покупателем (по Сделке открытый поставочный форвард на облигации,

Сделке открытый поставочный форвард на векселя, Сделке открытый поставочный форвард на акции или Сделке открытый поставочный форвард на паи) (как применимо). При этом если Сторона Б уведомит Сторону А о своем предложении определить более раннюю Дату исполнения в соответствии с подпунктом (б) пункта 7.6 выше, Сторона А направит Стороне Б Уведомлении о расчете, содержащее в числе прочего указанную в настоящем подпункте (г) информацию. В этом случае такая информация будет отменять и заменять собой аналогичную информацию, содержащуюся в Уведомлении о дате исполнения.

7.7 Особенности определения Ликвидационной суммы

- (а) Несмотря на любые положения Сделки об ином, если:
- (А) Сторона допускает Нарушение обязательства, наступает Технический дефолт, Банкротство или Потенциальное банкротство Стороны и такое обстоятельство продолжает иметь место; или
 - (Б) применительно к Стороне наступает Иное основание досрочного прекращения;

такая Сторона не вправе предлагать Дату исполнения.

- (б) Ликвидационная сумма применительно к Прекращаемым сделкам, являющимся Сделками открытый форвард, определяется в порядке, предусмотренном настоящим Генеральным соглашением. При этом для целей определения Ликвидационной суммы Датой исполнения по каждой такой Сделке является:
- (А) в отношении Сделок, применительно к которым Стороны согласовали в качестве Потенциальной даты исполнения для Ненарушившей стороны "любой день", – Дата досрочного прекращения;
 - (Б) в отношении Сделок, применительно к которым Стороны согласовали в качестве Потенциальной даты исполнения для Ненарушившей стороны определенные дни, – ближайший из таких определенных дней, но не ранее Даты досрочного прекращения;
 - (В) в отношении Сделок, применительно к которым Стороны согласовали в качестве Потенциальной даты исполнения для Ненарушившей Стороны определенный период или определенные периоды, – ближайший из Рабочих дней в пределах ближайшего периода, но не ранее Даты досрочного прекращения.

Если в отношении каких-либо Сделок Ненарушившая сторона не является Стороной, имеющей право определить Дату исполнения, Датой исполнения по таким сделкам для целей определения Ликвидационной суммы является Дата досрочного прекращения.

8. ИЗМЕНЕНИЯ В СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ КОНВЕРСИОННЫХ СДЕЛОК, СДЕЛОК ВАЛЮТНЫЙ ФОРВАРД, ВАЛЮТНЫЙ ОПЦИОН И ВАЛЮТНЫЙ СВОП

8.1 В пункте 1.2 Стандартных условий конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г. (далее – "**Условия валютных сделок**") слова "пунктами 2.4(в) и 3.8(в)" заменить словами "пунктами 2.4(в), 2.5(ж) и 3.8(в)".

8.2 В подпункте (а) пункта 1.6 Условий валютных сделок слова "за два Рабочих дня до Даты платежа" заменить словами "в Рабочий день, предшествующий Дате платежа".

8.3 Первый абзац пункта 1.7 Условий валютных сделок изложить в следующей редакции:

"Дата платежа означает применительно к Сделке день, в который стороны обязаны исполнить свои обязательства по Сделке, предусмотренные пунктами 2.4, 2.5, 3.8 или 5.1 Стандартных условий, указанный в качестве Даты платежа или иным образом определяемый в соответствии с Подтверждением либо иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке. Стороны вправе согласовать как общую Дату платежа для обеих Сторон, так и различные Даты платежа для каждой Стороны (и в этом случае каждая Сторона обязана исполнить соответствующее обязательство в Дату платежа, установленную для такой Стороны). Если применительно к Сделке открытый валютный форвард иное не предусмотрено Подтверждением или иным образом не согласовано сторонами, Датой платежа по такой Сделке будет день, наступающий через один Расчетный цикл после Даты исполнения."

8.4 В пункте 1.14 Условий валютных сделок слова "или иной форме, согласованной Сторонами" дополнить словами ", или иной форме, приемлемой для Стороны А".

8.5 Пункт 1.17 Условий валютных сделок дополнить словами ", с учетом изменений и дополнений, согласованных сторонами".

8.6 Пункт 1.24 Условий валютных сделок изложить в следующей редакции:

"Сумма платежа означает применительно к Расчетной сделке сумму, определяемую в Дату оценки по формулам, указанным в пунктах 2.4(б), 2.5(е) и 3.8(б) Стандартных условий, и подлежащую уплате в Дату платежа в порядке, установленном пунктами 2.4(в), 2.5(ж) и 3.8(в) Стандартных условий соответственно."

8.7 Пункт 2.2 Условий валютных сделок дополнить следующими положениями:

"Сделка поставочный валютный форвард, которая содержит указание на то, что она является Сделкой открытый поставочный валютный форвард (далее – "**Сделка открытый поставочный валютный форвард**"), подлежит исполнению с учетом особенностей, установленных пунктом 2.5 Стандартных условий.

Сделка расчетный валютный форвард, которая содержит указание на то, что она является Сделкой открытый расчетный валютный форвард (далее – "**Сделка открытый расчетный валютный форвард**"), подлежит исполнению с учетом особенностей, установленных пунктом 2.5 Стандартных условий.

Сделка открытый валютный форвард означает Сделку открытый поставочный валютный форвард или Сделку открытый расчетный валютный форвард."

8.8 Пункт 2.3(б) Стандартных условий дополнить словами "(за исключением Сделки открытый поставочный валютный форвард)" после слов "Сделки поставочный валютный форвард".

8.9 Пункт 2.3(в) Стандартных условий дополнить словами "(за исключением Сделки открытый расчетный валютный форвард)" после слов "Сделки расчетный валютный форвард".

8.10 Пункт 2.3(г) Условий валютных сделок изложить в следующей редакции:

"(г) Существенными условиями Сделки открытый поставочный валютный форвард, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:

(А) Валютная пара;

(Б) первоначальная сумма валюты для Плательщика;

(В) сумма валюты, подлежащая уплате Получателем платежа, или Форвардный курс (в этом случае валюта, указанная в подпункте (Б) выше признается Расчетной валютой);

(Г) Плательщик;

(Д) применительно к валюте, указанной в подпункте (Б) выше:

(аа) Процентная ставка первого Процентного периода;

(бб) Потенциальная дата пересмотра процентной ставки;

(Е) применительно к валюте, указанной в подпункте (В) выше:

(аа) Процентная ставка первого Процентного периода;

(бб) Потенциальная дата пересмотра процентной ставки;

(Ж) сторона, имеющая право определить Дату исполнения, и Потенциальная дата исполнения для каждой такой стороны.

8.11 Пункт 2.3 Условий валютных сделок дополнить следующими положениями:

"(д) Существенными условиями Сделки открытый расчетный валютный форвард, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:

(А) Расчетная валюта;

(Б) Базовая валюта;

(В) Продавец расчетной валюты;

(Г) Покупатель расчетной валюты;

(Д) Номинальная сумма в базовой валюте и Номинальная сумма в расчетной валюте или Форвардный курс и либо Номинальная сумма в базовой валюте, либо Номинальная сумма в расчетной валюте;

(Е) применительно к Базовой валюте:

(аа) Процентная ставка первого Процентного периода;

(бб) Потенциальная дата пересмотра процентной ставки;

(Ж) применительно к Расчетной валюте:

(аа) Процентная ставка первого Процентного периода;

(бб) Потенциальная дата пересмотра процентной ставки;

(З) сторона, имеющая право определить Дату исполнения, и Потенциальная дата исполнения для каждой такой стороны.

(И) Способ определения курса спот.

(е) Другие условия подлежат согласованию в качестве существенных условий Конверсионной сделки или Сделки валютный форвард по требованию одной из сторон."

8.12 Пункт 2.4 Условий валютных сделок не подлежит применению к Сделкам открытый валютный форвард.

8.13 Подпункт (бб) подпункта (А) и подпункт (бб) подпункта (Б) пункта 2.4(в) Условий валютных сделок изложить в следующей редакции:

"(бб) эквивалент этой суммы в Валюте платежа по обменному курсу, способ определения которого указан для этих целей в Подтверждении (если Валютой платежа является валюта, не входящая в Валютную пару)".

8.14 Пункт 2 Условий валютных сделок дополнить следующим пунктом 2.5:

"2.5 Сделки открытый валютный форвард

Определения

(а) Применительно к Сделке открытый валютный форвард следующие термины имеют следующее значение:

(А) **Плательщик** означает сторону Сделки открытый поставочный валютный форвард, указанную в таком качестве в соответствующем Подтверждении или иным образом согласованную сторонами.

(Б) **Получатель платежа** означает сторону Сделки открытый поставочный валютный форвард, не являющуюся Плательщиком.

(В) **Процентный фактор** применительно к Процентному периоду означает значение, рассчитываемое по следующей формуле:

$$ПФ_i = \frac{1 + ПС_{P_i} \times \frac{ДО_i - ДН_i}{БНП_P}}{1 + ПС_{B_i} \times \frac{ДО_i - ДН_i}{БНП_B}}$$

где

$ПФ_i$ – Процентный фактор i -го Процентного периода;

$ПС_{P_i}$ – (аа) применительно к Сделке открытый поставочный валютный форвард - Процентная ставка i -го Процентного периода применительно к валюте, определенной к уплате Плательщиком;

(бб) применительно к Сделке открытый расчетный валютный форвард - Процентная ставка i -го Процентного периода применительно к Расчетной валюте;

$ДН_i$ – дата начала i -го Процентного периода;

$ДО_i$ – дата окончания i -го Процентного периода;

$БНП_P$ – (аа) применительно к Сделке открытый поставочный валютный форвард – База начисления процентов применительно к валюте, определенной к уплате Плательщиком;

(бб) применительно к Сделке открытый расчетный валютный форвард - База начисления процентов применительно к Расчетной валюте;

i – порядковый номер Процентного периода;

$ПС_{B_i}$ – (аа) применительно к Сделке открытый поставочный валютный форвард - Процентная

ставка i -го Процентного периода применительно к валюте, определенной к уплате Получателем платежа;

(бб) применительно к Сделке открытый расчетный валютный форвард - Процентная ставка i -го Процентного периода применительно к Базовой валюте;

БНП_Б – (аа) применительно к Сделке открытый поставочный валютный форвард – База начисления процентов применительно к валюте, определенной к уплате Получателем платежа;

(бб) применительно к Сделке открытый расчетный валютный форвард - База начисления процентов применительно к Базовой валюте.

(Г) Термины "База начисления процентов", "Дата исполнения", "Дата отсчета", "Дата пересмотра процентной ставки", "Процентная ставка", "Процентный период", "Расчетный цикл", "Уведомление о дате исполнения" и "Уведомление о расчете" имеют значение, указанное в пункте 7.4 статьи 7 Генерального соглашения.

Порядок осуществления расчетов по Сделке открытый поставочный валютный форвард

(б) В Дату платежа по Сделке открытый поставочный валютный форвард Получатель платежа обязан уплатить сумму валюты, указанную для него в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а Плательщик обязан уплатить сумму валюты, рассчитанную следующим образом:

$$СВ = ПСВ \times \prod_{i=1}^N ПФ_i$$

где

СВ – сумма валюты, подлежащая уплате по Сделке Плательщиком;

ПСВ – первоначальная сумма валюты для Плательщика;

ПФ _{i} – Процентный фактор i -го Процентного периода;

i – порядковый номер Процентного периода;

N – количество Процентных периодов по Сделке.

(в) Сумма валюты, подлежащая уплате по Сделке Плательщиком, рассчитывается Расчетным агентом на Дату исполнения и указывается (А) в Уведомлении о дате исполнения, если Дата исполнения определена Стороной А и Сторона А является

Расчетным агентом; или (Б) в Уведомлении о расчете, если Дата исполнения определена Стороной Б (или Стороной А, если Сторона А не является Расчетным агентом) или если на дату направления Уведомления о дате исполнения расчет указанной суммы не может быть произведен Стороной А, являющейся Расчетным агентом.

- (г) Расчетный агент обязан осуществить расчет суммы валюты, подлежащей уплате по Сделке Плательщиком, и направить Сторонам (либо другой Стороне, если Расчетным агентом является одна из Сторон) соответствующее уведомление не позднее Даты платежа.
- (д) Не позднее Рабочего дня, следующего за датой получения Стороной Б Уведомления о расчете, Сторона Б обязана подписать полученное Уведомление о расчете и направить его Расчетному агенту.

Порядок осуществления расчетов по Сделке открытый расчетный валютный форвард

- (е) Сумма платежа применительно к Сделке открытый расчетный валютный форвард, если в отношении Сделки сторонами не согласовано иное, рассчитывается по следующей формуле:

$$СП = \left(\text{НСБВ} \times \text{ФК} \times \prod_{i=1}^N \text{ПФ}_i \right) - (\text{НСБВ} \times \text{КС})$$

где

СП – Сумма платежа;

НСБВ – Номинальная сумма в базовой валюте;

ФК – Форвардный курс;

ПФ_{*i*} – Процентный фактор *i*-го Процентного периода;

КС – Курс спот;

i – порядковый номер Процентного периода;

N – количество Процентных периодов по Сделке.

- (ж) В Дату платежа по Сделке открытый расчетный валютный форвард:

(А) если Сумма платежа имеет положительное значение, Покупатель расчетной валюты обязан уплатить Продавцу расчетной валюты:

- (аа) эту сумму в Расчетной валюте (если Расчетная валюта является Валютой платежа); или

- (бб) эквивалент этой суммы в Валюте платежа по обменному курсу, способ определения которого указан для этих целей в Подтверждении;
- (Б) если Сумма платежа имеет отрицательное значение, Продавец расчетной валюты обязан уплатить Покупателю расчетной валюты абсолютную величину:
 - (аа) этой суммы в Расчетной валюте (если Расчетная валюта является Валютой платежа); или
 - (бб) эквивалент этой суммы в Валюте платежа по обменному курсу, способ определения которого указан для этих целей в Подтверждении.
- (з) Сумма платежа применительно к Сделке открытой расчетный валютный форвард рассчитывается Расчетным агентом в Дату оценки и указывается в Уведомлении о расчете.
- (и) Уведомление о расчете должно также содержать информацию о значении Курса спот, использованного при расчете Суммы платежа.
- (к) Расчетный агент обязан осуществить расчет Суммы платежа и направить Сторонам (либо другой Стороне, если Расчетным агентом является одна из Сторон) Уведомление о расчете не позднее Рабочего дня, следующего за Датой оценки, или Датой платежа (в зависимости от того, какая дата наступила ранее).
- (л) Не позднее Рабочего дня, следующего за датой получения Стороной Б Уведомления о расчете, Сторона Б обязана подписать полученное Уведомление о расчете и направить его Стороне А."

8.15 Для целей статьи 7 Условий валютных сделок, если применительно к Сделке валютный форвард иное не предусмотрено Подтверждением или иным образом не согласовано сторонами,

- (а) к такой Сделке подлежат применению События, препятствующие исполнению, указанные в пунктах 7.1(а)-(в) Условий валютных сделок;
- (б) считается, что в Подтверждении, которое относится к такой Сделке, стороны предусмотрели "Определение События, препятствующего исполнению, Расчетным агентом"; и
- (в) считается, что в Подтверждении, которое относится к такой Сделке, стороны предусмотрели в качестве Альтернативы на случай, препятствующий исполнению, (А) применительно к Событию, препятствующему исполнению, указанному в пункте 7.1(а) Условий валютных сделок, применение положений подпункта (а) пункта 8.1 статьи 8 Примерных условий договора и (Б) применительно к Событиям, препятствующим исполнению, указанным в пунктах 7.1(б)-(в) Условий валютных сделок, Определение курса спот расчетным агентом.

8.16 Приложения 2-3 Условий валютных сделок не подлежат применению к Сделкам открытый валютный форвард.

9. ИЗМЕНЕНИЯ В СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ СРОЧНЫХ СДЕЛОК С ОБЛИГАЦИЯМИ

9.1 Для целей Стандартных условий срочных сделок с облигациями 2011 г. (далее – "**Условия сделок с облигациями**") (в том числе пункта 1.11 Условий сделок с облигациями) количество Облигаций или Векселей определяется и указывается в Подтверждениях и иных документах касательно Сделок как общая номинальная стоимость соответствующих Облигаций или Векселей, и, соответственно, ссылки на передачу (в том числе, в собственность) Облигаций или Векселей и аналогичные положения Условий сделок с облигациями означают такую передачу Облигаций или Векселей согласованной общей номинальной стоимости. Без ущерба для положений выше, предметом Срочной сделки на векселя может быть лишь один (но не более) Вексель.

9.2 Для целей Условий сделок с облигациями (в том числе пунктов 1.4, 4.1 и 7.2 Условий сделок с облигациями) цена Облигации определяется и указывается в Подтверждениях и иных документах касательно Сделок как процент от номинальной стоимости соответствующей Облигации. Для целей Условий сделок с облигациями (в том числе пунктов 4.1. и 7.2. Условий сделок с облигациями) цена Векселя определяется и указывается в Подтверждениях и иных документах касательно Сделок как процент от номинальной стоимости соответствующего Векселя.

9.3 В пункте 1.1 Условий сделок с облигациями слова "в пункте 1.13 Стандартных условий" дополнить словами "и Вексель, как он определен в пункте 1.35 Стандартных условий".

9.4 В пункте 1.14 Условий сделок с облигациями слова "в значении, определенном законодательством Российской Федерации о рынке ценных бумаг" дополнить словами ", или аналогичные финансовые инструменты в соответствии с иностранным правом".

9.5 Пункт 1.15 Условий сделок с облигациями изложить в следующей редакции:

"Плановый торговый день означает применительно к Срочной сделке на облигации или Срочной сделке на корзину облигаций любой день, в который Биржа, указанная в Подтверждении по Сделке или иным образом согласованная сторонами применительно к Сделке (или каждая Биржа, если в Подтверждении указано или сторонами иным образом согласовано более одной Биржи) должна быть открыта в соответствии с графиком работы для проведения торгов в режиме основных торгов, или в случае отсутствия указания Биржи в условиях Подтверждения или иного соглашения сторон касательно Биржи – любой день, в который могут быть осуществлены расчеты по сделкам с Облигациями на соответствующем рынке, и применительно к Срочной сделке на векселя любой Рабочий день."

- 9.6 В пункте 1.16 Условий сделок с облигациями слова "или иной форме, согласованной сторонами" дополнить словами ", или иной форме, приемлемой для Стороны А".
- 9.7 Пункт 1.19 Условий сделок с облигациями дополнить словами ", с учетом изменений и дополнений, согласованных сторонами".
- 9.8 Подпункт (Б) подпункта (в) пункта 1.21 Условий сделок с облигациями дополнить словами ", с учетом изменений и дополнений, согласованных сторонами".
- 9.9 Пункт 1.22 Условий сделок с облигациями дополнить следующими положениями после первого предложения:
"Расчетным агентом по Сделкам открытый форвард на облигации и Сделкам открытый форвард на векселя является Сторона А."
- 9.10 Подпункт (а) пункта 1.22 Условий сделок с облигациями дополнить следующими положениями:
", а также сумму, подлежащую уплате Покупателем по Сделке открытый поставочный форвард".
- 9.11 В подпункте (г) пункта 1.22 Условий сделок с облигациями слова "уведомление сторонам Сделки" дополнить словами "(в том числе Уведомление о расчете)".
- 9.12 В подпункте (В) подпункта (г) пункта 1.22 Условий сделок с облигациями удалить слова ", и/или количество Базового актива, подлежащего поставке".
- 9.13 Подпункт (Г) подпункта (г) пункта 1.22 Условий сделок с облигациями изложить в следующей редакции:
"(Г) Расчетной цены, использованной при расчете соответствующих сумм по Сделке;"
- 9.14 Подпункт (а) пункта 1.25 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (В):
"(В) Векселю, являющемуся предметом Сделки (такая Сделка далее именуется "**Сделка беспоставочный опцион на векселя**");"
- 9.15 В подпункте (в) пункта 1.25 Условий сделок с облигациями удалить слова ", а вместе со Сделкой поставочный опцион на облигации – "**Сделка поставочный опцион**"".
- 9.16 Пункт 1.25 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (г):
"(г) в Дату расчетов по Опциону колл получить от Продавца в собственность Вексель, являющийся предметом Сделки, или по Опциону пут передать Продавцу в собственность Вексель, являющийся предметом Сделки, по Цене исполнения, а Продавец обязуется соответственно передать

Покупателю в собственность Вексель, являющийся предметом Сделки, или получить от Покупателя в собственность Вексель, являющийся предметом Сделки, по Цене исполнения (далее – "**Сделка поставочный опцион на векселя**"), а вместе со Сделкой поставочный опцион на облигации и Сделкой поставочный опцион на корзину облигаций – "**Сделка поставочный опцион**").".

9.17 В подпункте (а) пункта 1.28 Условий сделок с облигациями слова «Сумму платежа» в первой строке заменить на «абсолютное значение Суммы платежа», слово "положительном" в первой строке заменить словом "отрицательном", слова «абсолютное значение Суммы платежа» во второй строке заменить на «Сумму платежа», а слово "отрицательном" в третьей строке заменить словом "положительном".

9.18 Подпункт (а) пункта 1.28 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (В):

"(В) Векселю, являющемуся предметом Сделки (такая Сделка далее именуется "**Сделка беспоставочный форвард на векселя**");".

9.19 В подпункте (б) пункта 1.28 Условий сделок с облигациями слова "Форвардной цены" заменить словами "Полной цены".

9.20 В подпункте (в) пункта 1.28 Условий сделок с облигациями удалить слова ", а вместе со Сделкой поставочный форвард на облигации – "**Сделка поставочный форвард**)".

9.21 Пункт 1.28 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (г):

"(г) в Дату расчетов Продавец обязуется передать Покупателю в собственность Вексель, являющийся предметом Сделки, а Покупатель обязуется оплатить его в сумме, рассчитанной на основе Полной цены (далее - "**Сделка поставочный форвард на векселя**"), а вместе со Сделкой поставочный форвард на облигации и Сделкой поставочный форвард на корзину облигаций – "**Сделка поставочный форвард**").".

9.22 Пункт 1.28 Условий сделок с облигациями дополнить следующими положениями:

"Сделка беспоставочный форвард на облигации, которая содержит указание на то, что она является Сделкой открытый беспоставочный форвард на облигации (далее – "**Сделка открытый беспоставочный форвард на облигации**"), подлежит исполнению с учетом особенностей, установленных пунктом 8.5 Стандартных условий.

Сделка поставочный форвард на облигации, которая содержит указание на то, что она является Сделкой открытый поставочный форвард на облигации (далее – "**Сделка открытый поставочный форвард на облигации**"), подлежит исполнению с учетом особенностей, установленных пунктом 9.8 Стандартных условий.

Сделка открытый форвард на облигации означает Сделку открытый беспоставочный форвард на облигации или Сделку открытый поставочный форвард на облигации.

Сделка беспоставочный форвард на векселя, которая содержит указание на то, что она является Сделкой открытый беспоставочный форвард на векселя (далее – "**Сделка открытый беспоставочный форвард на векселя**"), подлежит исполнению с учетом особенностей, установленных пунктом 8.5 Стандартных условий.

Сделка поставочный форвард на векселя, которая содержит указание на то, что она является Сделкой открытый поставочный форвард на векселя (далее – "**Сделка открытый поставочный форвард на векселя**"), подлежит исполнению с учетом особенностей, установленных пунктом 9.8 Стандартных условий.

Сделка открытый форвард на векселя означает Сделку открытый беспоставочный форвард на векселя или Сделку открытый поставочный форвард на векселя.

Сделка открытый беспоставочный форвард означает Сделку открытый беспоставочный форвард на облигации или Сделку открытый беспоставочный форвард на векселя.

Сделка открытый поставочный форвард означает Сделку открытый поставочный форвард на облигации или Сделку открытый поставочный форвард на векселя."

9.23 Пункт 1 Условий сделок с облигациями дополнить следующими определениями:

"1.35. **Вексель** означает применительно к Срочной сделке на векселя вексель в значении, определенном законодательством Российской Федерации, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.

1.36. **Дата выплаты дохода** означает применительно к Доходу дату, по состоянию на которую определяются лица, имеющие право на получение Дохода.

1.37. **Доход** означает применительно к Облигациям любые поступления (включая купонный доход и суммы амортизационных выплат) в отношении Количества облигаций от Эмитента держателям таких Облигаций.

1.38. **Количество векселей** означает применительно к Срочной сделке на векселя количество Векселей, выраженное как номинальная стоимость Векселя, являющегося предметом Сделки, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке.

1.39. **Обменный курс полной стоимости** означает применительно к Сделке, предметом которой являются Облигации или Вексель, номинальная

стоимость которых выражена в валюте, отличной от Валюты платежа, обменный курс для конвертации суммы Полной стоимости в Валюту платежа, указанный в качестве такового в соответствующем Подтверждении или иным образом согласованный сторонами.

- 1.40. **Обменный курс расчетной стоимости** означает применительно к Сделке, предметом которой являются Облигации или Вексель, номинальная стоимость которых выражена в валюте, отличной от Валюты платежа, обменный курс для конвертации суммы Расчетной стоимости в Валюту платежа, определенный Расчетный агентом на основании информации из источника, указанного для этой цели в соответствующем Подтверждении или иным образом согласованного сторонами.
- 1.41. **Обменный курс стоимости дохода** означает применительно к каждому Доходу обменный курс, согласованный Сторонами в соответствии с пунктом 7.6 Стандартных условий.
- 1.42. **Полная расчетная цена** означает применительно к Облигациям сумму (А) произведения Расчетной цены и амортизационного фактора (погашения части основного долга) по таким Облигациям и (Б) суммы начисленного, но не выплаченного Дохода по таким Облигациям на Дату расчетов для Продавца, выраженную в процентах от номинальной стоимости такой Облигации, и применительно к Векселю Расчетную цену такого Векселя.
- 1.43. **Полная стоимость** означает применительно к Срочной сделке на облигации произведение Количества облигаций и Полной цены и применительно к Срочной сделке на векселя произведение Количества векселей и Полной цены.
- 1.44. **Полная цена** означает (а) применительно к Облигациям сумму (А) произведения Чистой цены таких Облигаций и амортизационного фактора (погашения части основного долга) по таким Облигациям и (Б) суммы начисленного, но не выплаченного Дохода по таким Облигациям на Дату отчета, как указано в соответствующем Подтверждении (применительно к Сделке открытый форвард на облигации), либо на Дату расчетов для Продавца (применительно к Поставочной сделке (кроме Сделки открытый поставочный форвард на облигации), либо на Дату расчетов (применительно к Беспоставочной сделке (кроме Сделки открытый беспоставочный форвард на облигации), выраженную в процентах от номинальной стоимости таких Облигаций, и (б) применительно к Векселю Чистую цену такого Векселя.
- 1.45. **Приведенная стоимость дохода** применительно к каждому Доходу по Облигациям, являющимся предметом Сделки, означает стоимость Дохода, рассчитываемую по следующей формуле:

$$\text{ПСД}_j = \text{СД}_j \times \text{ОКСД}_j / \left(\prod_{i=1}^{k-1} \text{ПФ}_i \right) / \text{ПФД}_j$$

где		
ПСД _j	–	Приведенная стоимость дохода применительно к <i>j</i> -тому Доходу;
СД _j	–	Стоимость дохода применительно к <i>j</i> -ому Доходу;
ОКСД _j	–	Обменный курс стоимости дохода применительно к <i>j</i> -тому Доходу;
ПФ _i	–	Процентный фактор <i>i</i> -го Процентного периода;
ПФД _i	–	Процентный фактор дохода применительно к <i>j</i> -тому Доходу;
<i>k</i>	–	порядковый номер Процентного периода по Сделке, в котором выплачен <i>j</i> -тый Доход;
<i>i</i>	–	порядковый номер Процентного периода по Сделке;
<i>j</i>	–	порядковый номер фактически выплаченного Дохода.

- 1.46. **Процентный фактор** означает применительно к Процентному периоду значение, рассчитываемое по следующей формуле:

$$\text{ПФ}_i = (1 + \text{ПС}_i \times (\text{ДО}_i - \text{ДН}_i) / \text{БНП})$$

где		
ПФ _i	–	Процентный фактор <i>i</i> -го Процентного периода;
ПС _i	–	Процентная ставка <i>i</i> -го Процентного периода;
ДО _i	–	Дата окончания <i>i</i> -го Процентного периода;
ДН _i	–	Дата начала <i>i</i> -го Процентного периода;
БНП	–	База начисления процентов;
<i>i</i>	–	порядковый номер Процентного периода по Сделке.

- 1.47. **Процентный фактор дохода** означает применительно к каждому Доходу, выплаченному в течение Процентного периода, фактор дохода, рассчитываемый по следующей формуле:

$$\text{ПФД}_j = (1 + \text{ПС}_k \times (\text{ДВ}_j - \text{ДН}_k) / \text{БНП})$$

где		
ПФД _j	–	Процентный фактор дохода применительно к <i>j</i> -тому Доходу;
ПС _k	–	Процентная ставка <i>k</i> -того Процентного периода;
ДВ _j	–	Дата фактической выплаты <i>j</i> -того Дохода;
ДН _k	–	Дата начала <i>k</i> -того Процентного периода;
БНП	–	База начисления процентов;
<i>k</i>	–	порядковый номер Процентного периода по Сделке, в котором выплачен <i>j</i> -тый Доход;
<i>j</i>	–	порядковый номер фактически выплаченного Дохода.

- 1.48. **Расчетная стоимость** означает применительно к Срочной сделке на облигации произведение Количества облигаций и Полной расчетной

цены и применительно к Срочной сделке на векселя произведение Количества векселей и Полной расчетной цены.

- 1.49. **Сделка опцион на векселя** означает Сделку поставочный опцион на векселя или Сделку беспоставочный опцион на векселя.
- 1.50. **Сделка форвард на векселя** означает Сделку поставочный форвард на векселя или Сделку беспоставочный форвард на векселя.
- 1.51. **Срочная сделка на векселя** означает Сделку опцион на векселя или Сделку форвард на векселя.
- 1.52. **Стоимость дохода** означает применительно к каждому Доходу, в отношении которого Дата выплаты дохода наступила в период с Даты отсчета (включая такую дату) до Даты расчетов для Продавца (применительно к Сделке открытый поставочный форвард на облигации) (включая такую дату), либо до Даты расчетов (применительно к Сделке открытый беспоставочный форвард на облигации) (включая такую дату) сумму такого Дохода; при условии что если (1) между сторонами достигнуто соглашение в отношении перечисления Дохода в отношении соответствующих Облигаций, как это предусмотрено в пункте 7.6 Стандартных условий, или (2) дата фактической выплаты Дохода наступила позднее Даты расчетов для Продавца (применительно к Сделке открытый поставочный форвард на облигации) либо Даты расчетов (применительно к Сделке открытый беспоставочный форвард на облигации), Стоимость дохода применительно к такому Доходу будет равна нулю.
- 1.53. **Чистая цена** означает применительно к Облигации или Векселю цену, указанную в таком качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами, выраженную в процентах от номинальной стоимости такой Облигации или Векселя.

Термины "База начисления процентов", "Дата исполнения", "Дата отсчета", "Потенциальная дата исполнения", "Потенциальная дата пересмотра процентной ставки", "Процентная ставка", "Процентный период", "Уведомление о дате исполнения" и "Уведомление о расчете" имеют значение, указанное в пункте 7.4 статьи 7 Генерального соглашения."

- 9.24 Подпункт (б) пункта 2.1 Условий сделок с облигациями изложить в следующей редакции:

"Количество опционов означает применительно к Сделке опцион (за исключением Сделки опцион на векселя) количество Предметов опциона, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, в отношении которых по Сделке опцион может быть осуществлено Право на исполнение, и применительно к Сделке опцион на векселя – 1 (единица)."

- 9.25 Подпункт (г) пункта 2.1 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (В):

- "(В) применительно к Сделке опцион на векселя номинальную стоимость Векселя, являющегося предметом Сделки, указанную в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке."
- 9.26 Подпункт (д) пункта 2.1 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (В):
- "(В) применительно к Сделке опцион на векселя сумму денежных средств в соответствующей валюте или процент от номинальной стоимости Векселя, указанный в Подтверждении, иным образом определяемый в соответствии с ним или иным образом согласованный сторонами."
- 9.27 В подпункте (А) подпункта (а) пункта 2.3 и подпункте (А) подпункта (б) пункта 2.3 Условий сделок с облигациями слова "Облигации или Корзины Облигаций" и "Облигацию или Корзину" дополнить словами "или Вексель, являющийся предметом Сделки,".
- 9.28 Положения подпунктов (Е) и (Л) подпункта (а) пункта 2.5 Условий сделок с облигациями не подлежат применению к Сделкам опцион на векселя.
- 9.29 Подпункт (а) пункта 2.5 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (М):
- "(М) Предмет опциона (применительно к Сделке опцион на векселя)."
- 9.30 В подпункте (В) подпункта (г) пункта 3.1 Условий сделок с облигациями удалить слова "с Даты начала срока до Даты истечения срока (обе даты включительно)".
- 9.31 Положения пунктов 3.3 и 3.4 Условий сделок с облигациями не подлежат применению к Сделкам опцион на векселя.
- 9.32 В подпункте (в) пункта 3.5 Условий сделок с облигациями слова "стоимость одной Корзины" дополнить словами "или стоимость Векселя, являющегося предметом Сделки".
- 9.33 Подпункт (в) пункта 3.5 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (В):
- "(В) применительно к Сделке опцион на векселя – стоимость, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время закрытия в Дату истечения срока по собственному усмотрению на основании разумных коммерческих оценок."
- 9.34 Пункт 4.1 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (В):
- "(В) применительно к Сделке форвард на векселя цену за Вексель, являющийся предметом Сделки, определяемую как процент от номинальной стоимости такого Векселя, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами."

- 9.35 Пункт 4.2(а) Условий сделок с облигациями дополнить словами "(за исключением Сделок открытый форвард на облигации и Сделок форвард на векселя)" после слов "Сделок форвард".
- 9.36 Подпункты (Е), (Ж) и (З) пункта 4.2(а) Условий сделок с облигациями заменить следующим подпунктом:
- "(Е) Чистая цена."
- 9.37 Пункт 4.2(б) Условий сделок с облигациями изложить в следующей редакции:
- "(б) Существенными условиями Сделок открытый форвард на облигации, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки в отношении каждой из этих Сделок, являются:
- (А) Покупатель;
 - (Б) Продавец;
 - (В) Базовый актив;
 - (Г) Количество облигаций;
 - (Д) Чистая цена;
 - (Е) Валюта платежа;
 - (Ж) Процентная ставка первого Процентного периода;
 - (З) Потенциальная дата пересмотра процентной ставки;
 - (И) сторона, имеющая право определить Дату исполнения, и Потенциальная дата исполнения для каждой такой стороны;
 - (К) Обменный курс полной стоимости и Обменный курс расчетной стоимости (если номинальная стоимость Облигаций выражена в валюте, отличной от Валюты платежа)."
- 9.38 Пункт 4.2 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (в):
- "(в) Существенными условиями Сделок форвард на векселя (за исключением Сделок открытый форвард на векселя), подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки в отношении каждой из этих Сделок, являются:
- (А) Покупатель;
 - (Б) Продавец;
 - (В) Базовый актив;
 - (Г) Чистая цена;

- (Д) Валюта платежа;
- (Е) Обменный курс полной стоимости и Обменный курс расчетной стоимости (если номинальная стоимость Векселя выражена в валюте, отличной от Валюты платежа).".

9.39 Пункт 4.2 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (г):

"(г) Существенными условиями Сделок открытый форвард на векселя, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки в отношении каждой из этих Сделок, являются:

- (А) Покупатель;
- (Б) Продавец;
- (В) Базовый актив;
- (Г) Чистая цена;
- (Д) Валюта платежа;
- (Е) Процентная ставка первого Процентного периода;
- (Ж) Потенциальная дата пересмотра процентной ставки;
- (З) сторона, имеющая право определить Дату исполнения, и Потенциальная дата исполнения для каждой такой стороны;
- (И) Обменный курс полной стоимости и Обменный курс расчетной стоимости (если номинальная стоимость Векселя выражена в валюте, отличной от Валюты платежа).".

9.40 Пункт 4.2 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (д):

"(д) Другие условия Сделок форвард подлежат согласованию в качестве существенных условий по требованию одной из сторон."

9.41 Положения пункта 5 Условий сделок с облигациями не подлежат применению в отношении Срочных сделок на векселя.

9.42 Пункт 6.1 Условий сделок с облигациями изложить в следующей редакции:

"Время оценки означает применительно к Сделкам время в течение Даты оценки, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон – любое время в течение Даты оценки по усмотрению Стороны А."

- 9.43 Подпункт (б) пункта 6.2 Условий сделок с облигациями изложить в следующей редакции:
- "(б) применительно к Сделке форвард Рабочий день, предшествующий Дате расчетов, если иное не указано в Подтверждении или иным образом не согласовано сторонами".
- 9.44 В первом абзаце подпункта (б) пункта 7.1 Условий сделок с облигациями слова "Сделке форвард на корзину облигаций" дополнить словами "или Сделке форвард на векселя".
- 9.45 Во втором абзаце подпункта (б) пункта 7.1 Условий сделок с облигациями слова "Сделке опцион на корзину облигаций" дополнить словами "и Сделке опцион на векселя".
- 9.46 В подпункте (а) пункта 7.2 Условий сделок с облигациями применительно к Сделкам форвард на облигации слова "Биржевую цену Облигации" заменить словами "цену одной Облигации, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки по собственному усмотрению на основании разумных коммерческих оценок".
- 9.47 В подпункте (в) пункта 7.2 Условий сделок с облигациями слова "Сделке поставочный опцион на корзину облигаций" дополнить словами "или Сделке поставочный опцион на векселя".
- 9.48 Пункт 7.2 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (г):
- "(г) применительно к Сделке беспоставочный опцион на векселя или Сделке форвард на векселя - цену Векселя, являющегося предметом Сделки, выраженную как процент от номинальной стоимости соответствующего Векселя, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, а при отсутствии такого порядка - цену Векселя, являющегося предметом Сделки, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки по собственному усмотрению на основании разумных коммерческих оценок,".
- 9.49 Последний абзац пункта 7.2 Условий сделок с облигациями исключить.
- 9.50 В первом абзаце подпункта (а) пункта 7.4 Условий сделок с облигациями слова "Даты оценки" заменить словами "Даты оценки (за исключением Сделок открытый форвард на облигации и Сделок открытый форвард на векселя) или Даты исполнения (в случае Сделок открытый форвард на облигации и Сделок открытый форвард на векселя)".
- 9.51 В подпункте (А) подпункта (б) пункта 7.4 Условий сделок с облигациями слова "к Облигациям" дополнить словами "или Векселю".
- 9.52 Подпункт (Б) пункта (б) пункта 7.4 Условий сделок с облигациями изложить в следующей редакции:

"(Б) применительно к Облигациям или Векселю, подлежащим поставке по Сделке форвард, день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке (при этом стороны вправе согласовать как общую Дату расчетов для обеих сторон, так и различные Даты расчетов для каждой стороны (и в этом случае каждая сторона обязана исполнить соответствующее обязательство в Дату расчетов, установленную для такой стороны)), а при отсутствии такого указания в Подтверждении или иного соглашения сторон - день, наступающий через один Расчетный цикл после Даты оценки (за исключением Сделок открытый форвард на облигации и Сделок открытый форвард на векселя) или Даты исполнения (в случае Сделок открытый форвард на облигации или Сделок открытый форвард на векселя) (или, если этот день не является Рабочим днем, ближайший следующий Рабочий день);".

9.53 Пункт 7 Условий сделок с облигациями дополнить следующими положениями:

"7.6. Доход по Облигациям по Сделке открытый форвард на облигации

(а) С учетом положений подпункта (б) ниже, Доход, выплаченный Эмитентом по соответствующим Облигациям, являющимся предметом Сделки открытый форвард на облигации, не подлежит передаче Продавцом Покупателю. При этом если валюта Дохода отличается от Валюты платежа, Стороны в течение трех Рабочих дней с момента выплаты соответствующего Дохода Эмитентом обязаны согласовать Обменный курс стоимости дохода применительно к такому Доходу для конвертации суммы такого Дохода в Валюту платежа. Если Стороны не согласуют Обменный курс стоимости дохода в указанный срок, Продавец обязан в течение пяти Рабочих дней после даты фактической выплаты дохода Эмитентом передать Покупателю сумму, равную сумме Дохода, в валюте выплаченного Эмитентом Дохода в отношении соответствующих Облигаций.

(б) Если:

(А) стороны согласовали условие о том, что указанный в подпункте (а) выше Доход по соответствующим Облигациям подлежит передаче Продавцом Покупателю, или

(Б) дата фактической выплаты Дохода наступила позднее Даты расчетов для Продавца (применительно к Сделке открытый поставочный форвард на облигации) либо Даты расчетов (применительно к Сделке открытый беспоставочный форвард на облигации),

то если в течение периода с Даты сделки (включительно) до Даты расчетов для Продавца (включительно) наступает Дата выплаты дохода, Продавец обязан передать Покупателю не позднее пятого Рабочего дня с даты фактической выплаты Дохода (если иной срок не

согласован Сторонами) сумму, равную сумме Дохода, в валюте выплаченного Эмитентом Дохода в отношении соответствующих Облигаций. При этом к таким платежам Продавца в пользу Покупателя не подлежат применению положения Сделки о Валюте платежа, и такие платежи должны быть произведены в валюте выплаченного Эмитентом соответствующего Дохода."

9.54 В подпункте (а) пункта 8.1 Условий сделок с облигациями слова "Сделке опцион на корзину облигаций" дополнить словами "или Сделке опцион на векселя".

9.55 Подпункт (б) пункта 8.1 Условий сделок с облигациями изложить в следующей редакции:

"(б) в Сделке форвард на облигации (за исключением Сделки открытый форвард на облигации), Сделке форвард на корзину облигаций или Сделке форвард на векселя (за исключением Сделки открытый форвард на векселя) - сумму, рассчитываемую по следующей формуле:

$$СП = ПС \times ОКПС - РС \times ОКРС$$

где		
СП	–	Сумма платежа;
ПС	–	Полная стоимость;
ОКПС	–	Обменный курс полной стоимости;
РС	–	Расчетная стоимость;
ОКРС	–	Обменный курс расчетной стоимости."

9.56 Пункт 8.1 Условий сделок с облигациями дополнить следующим подпунктом (в):

"(в) в Сделке открытый форвард на облигации или Сделке открытый форвард на векселя – сумму, рассчитываемую по следующей формуле:

$$СП = \left(ПС \times ОКПС - \sum_{j=1}^P ПСД_j \right) \times \prod_{i=1}^N ПФ_i - РС \times ОКРС$$

где		
СП	–	Сумма платежа;
ПС	–	Полная стоимость;
ОКПС	–	Обменный курс полной стоимости;
ПСД _j	–	Приведенная стоимость дохода применительно к j-тому Доходу;
ПФ _i	–	Процентный фактор i-того Процентного периода;
РС	–	Расчетная стоимость;
ОКРС	–	Обменный курс расчетной стоимости;
j	–	порядковый номер фактически выплаченного Дохода;
P	–	полное количество фактически выплаченных Доходов;
i	–	порядковый номер Процентного периода по Сделке; и

N	–	полное количество Процентных периодов по Сделке,
---	---	--

при этом применительно к Сделкам открытый форвард на векселя указанные выше параметры, относящиеся к Доходу, равны нулю."

9.57 Пункт 8.4 Условий сделок с облигациями изложить в следующей редакции:

"8.4. Расчеты по Сделке беспоставочный форвард (за исключением Сделок открытый беспоставочный форвард). По Сделке беспоставочный форвард (за исключением Сделки открытый беспоставочный форвард) применительно к каждой Дате расчетов:

- (a) если Сумма платежа имеет положительное значение, Покупатель обязан уплатить Продавцу Сумму платежа в соответствующую Дату расчетов;
- (б) если Сумма платежа имеет отрицательное значение, Продавец обязан уплатить Покупателю абсолютную величину Суммы платежа в соответствующую Дату расчетов."

9.58 Пункт 8 Условий сделок с облигациями дополнить следующими положениями:

"8.5. Особенности осуществления расчетов по Сделке открытый беспоставочный форвард

- (a) По Сделке открытый беспоставочный форвард применительно к каждой Дате расчетов:
 - (A) если Сумма платежа имеет положительное значение, Покупатель обязан уплатить Продавцу Сумму платежа в соответствующую Дату расчетов;
 - (Б) если Сумма платежа имеет отрицательное значение, Продавец обязан уплатить Покупателю абсолютную величину Суммы платежа в соответствующую Дату расчетов.
- (б) Сумма платежа применительно к Сделке открытый беспоставочный форвард рассчитывается Расчетным агентом и указывается в Уведомлении о расчете.
- (в) Не позднее Рабочего дня, следующего за датой получения Стороной Б Уведомления о расчете, Сторона Б обязана подписать полученное Уведомление о расчете и направить его Расчетному агенту."

9.59 Пункт 9.1 Условий сделок с облигациями изложить в следующей редакции:

"9.1 Расчеты по Сделке поставочный опцион.

- (a) **Расчеты по Сделке поставочный опцион (за исключением Сделки поставочный опцион на векселя).** По Сделке

поставочный опцион (за исключением Сделки поставочный опцион на векселя) применительно к каждой Дате осуществления права на исполнение в соответствующую Дату расчетов:

- (А) по Опциону на покупку (колл) Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, равную произведению Расчетной цены и (без округления) Количества облигаций или Количества корзин, а Продавец обязан передать Покупателю в собственность Количество облигаций или Количество корзин соответственно;
- (Б) по Опциону на продажу (пут) Покупатель обязан передать Продавцу в собственность Количество облигаций или Количество корзин, а Продавец обязан уплатить Покупателю сумму, равную произведению Расчетной цены и (без округления) Количества облигаций или Количества корзин;

при этом любые из указанных в настоящем подпункте (а) платежей или поставок должны осуществляться в соответствующую Дату расчетов на счета, определенные в соответствии с Генеральным соглашением.

- (б) **Расчеты по Сделке поставочный опцион на векселя.** По Сделке поставочный опцион на векселя применительно к каждой Дате осуществления права на исполнение в соответствующую Дату расчетов:

- (А) по Опциону на покупку (колл) Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, равную Расчетной цене, а Продавец обязан передать Покупателю в собственность Вексель, являющийся предметом Сделки, соответственно;
- (Б) по Опциону на продажу (пут) Покупатель обязан передать Продавцу в собственность Вексель, являющийся предметом Сделки, а Продавец обязан уплатить Покупателю сумму, равную Расчетной цене;

при этом любые из указанных в настоящем подпункте (б) платежей должны осуществляться в соответствующую Дату расчетов на счета, определенные в соответствии с Генеральным соглашением."

9.60 Подпункт (а) пункта 9.2 Условий сделок с облигациями изложить в следующей редакции:

- "(а) применительно к Сделке форвард на облигации (за исключением Сделки открытый форвард на облигации) Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, равную произведению Полной стоимости на Обменный курс полной стоимости, а Продавец обязан передать Покупателю в собственность Количество облигаций."

9.61 Пункт 9.2 Условий сделок с облигациями перед словами "при этом" дополнить следующим подпунктом (в):

"(в) применительно к Сделке открытый форвард на облигации Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, рассчитываемую по следующей формуле, а Продавец обязан передать Покупателю в собственность Количество облигаций:

$$СП = \left(ПС \times ОКПС - \sum_{j=1}^P ПСД_j \right) \times \prod_{i=1}^N ПФ_i$$

где		
СП	–	Сумма платежа;
ПС	–	Полная стоимость;
ОКПС	–	Обменный курс полной стоимости;
ПСД _j	–	Приведенная стоимость дохода применительно к <i>j</i> -тому Доходу;
ПФ _i	–	Процентный фактор <i>i</i> -того Процентного периода;
<i>P</i>	–	полное количество фактически выплаченных Доходов;
<i>N</i>	–	полное количество Процентных периодов по Сделке;
<i>i</i>	–	порядковый номер Процентного периода по Сделке; и
<i>j</i>	–	порядковый номер фактически выплаченного Дохода."

9.62 Пункт 9.2 Условий сделок с облигациями перед словами "при этом" дополнить следующим подпунктом (г):

"(г) применительно к Сделке открытый форвард на векселя Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, рассчитываемую по следующей формуле, а Продавец обязан передать Покупателю в собственность Вексель, являющийся предметом Сделки:

$$СП = (ПС \times ОКПС) \times \prod_{i=1}^N ПФ_i$$

где		
СП	–	Сумма платежа;
ПС	–	Полная стоимость;
ОКПС	–	Обменный курс полной стоимости;
ПФ _i	–	Процентный фактор <i>i</i> -того Процентного периода;
<i>N</i>	–	полное количество Процентных периодов по Сделке; и
<i>i</i>	–	порядковый номер Процентного периода по Сделке."

9.63 Пункт 9.2. Условий сделок с облигациями перед словами "при этом" дополнить следующим подпунктом (д):

"(д) применительно к Сделке форвард на векселя (за исключением Сделки открытый форвард на векселя) Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, равную произведению Полной стоимости на Обменный курс полной стоимости, а Продавец обязан передать Покупателю в собственность Вексель, являющийся предметом Сделки."

9.64 В последнем абзаце пункта 9.2 Условий сделок с облигациями слова "указанные в Подтверждении" заменить словами "определенные в соответствии с Генеральным соглашением".

9.65 В пункте 9.3 Условий сделок с облигациями исключить последнее предложение.

9.66 Положения пунктов 9.6 и 9.7 Условий сделок с облигациями распространить на передачу Векселей (насколько применимо).

9.67 В подпунктах (а) и (д) пункта 9.7 Условий сделок с облигациями слова "законодательством Российской Федерации" заменить словами "применимым законодательством".

9.68 Пункт 9 Условий сделок с облигациями дополнить следующими положениями:

"9.8. Особенности осуществления расчетов по Сделке открытый поставочный форвард.

(а) Сумма, подлежащая уплате по Сделке Покупателем, рассчитывается Расчетным агентом и указывается (А) в Уведомлении о дате исполнения, если Дата исполнения определяется Стороной А, или (Б) в Уведомлении о расчете, если Дата исполнения определяется Стороной Б.

(б) Не позднее Рабочего дня, следующего за датой получения Стороной Б Уведомления о расчете, Сторона Б обязана подписать полученное Уведомление о расчете и направить его Расчетному агенту.

9.9. Особенности осуществления расчетов по Сделкам поставочный форвард на векселя и Сделкам поставочный опцион на векселя. Передача Продавцом в собственность Покупателю Векселя, являющегося предметом Сделки поставочный форвард на векселя или Сделки поставочный опцион на векселя, осуществляется на основании акта приема-передачи, подписываемого сторонами."

9.69 В пункте 10.1 Условий сделок с облигациями слово "Банкротство" дополнить словами "Кросс-дефолт плательщика, Ухудшение финансового положения авалиста".

9.70 В первом абзаце пункта 10.2 Условий сделок с облигациями удалить слова "в Российской Федерации".

9.71 Пункт 10.3 Условий сделок с облигациями перед словами "сторона соответствующей Сделки" дополнить следующим подпунктом (д):

- "(д) принятия какого-либо акта, аналогичного указанным в подпунктах (а)-(г) настоящего пункта 10.3, судом или иным уполномоченным органом или лицом иностранного государства,".
- 9.72 Положения пункта 10.3 и подпункта (б) пункта 10.6 Условий сделок с облигациями распространить на Срочные сделки на векселя, при этом ссылки на "Облигации" должны рассматриваться как ссылки на "Вексель, являющийся предметом Сделки".
- 9.73 Положения пункта 10.3 и подпункта (б) пункта 10.6 Условий сделок с облигациями распространить на Срочные сделки на векселя, при этом ссылки на "Эмитента" должны рассматриваться как ссылки на "векселедателя по Векселю, являющемуся предметом Сделки (в случае простого векселя), или плательщика по Векселю, являющемуся предметом Сделки (в случае переводного векселя)".
- 9.74 Пункт 10.5 Условий сделок с облигациями дополнить следующими положениями:
- "Кросс-дефолт плательщика** означает неисполнение или ненадлежащее исполнение векселедателем по Векселю, являющемуся предметом Сделки (в случае простого векселя), или плательщиком по Векселю, являющемуся предметом Сделки (в случае переводного векселя), каких-либо обязательств по выпущенным таким векселедателем или плательщиком облигациям или каких-либо обязательств в отношении облигаций, обеспечение исполнения обязательств по которым предоставлено таким векселедателем или плательщиком.
- Ухудшение финансового положения авалиста** означает существенное ухудшение финансового положения лица, являющегося авалистом по Векселю, являющемуся предметом Сделки, определяемое Стороной А по собственному усмотрению."
- 9.75 Пункт 10.6(б) Условий сделок с облигациями изложить в следующей редакции:
- "(б) Если Изменение законодательства, Банкротство, Кросс-дефолт плательщика или Ухудшение финансового положения авалиста предусмотрено условиями Сделки в качестве применимого Особого обстоятельства, в случае его наступления Сторона А вправе по своему выбору расторгнуть Сделку, если направит другой стороне уведомление с указанием даты расторжения не менее чем за один Плановый торговый день, если меньший срок не требуется в соответствии с Изменением законодательства. В этом случае Сделка расторгается, а Определяющая сторона рассчитывает Сумму выплаты при расторжении, подлежащую уплате одной стороной другой стороне."
- 9.76 Приложения 5-8 к Условиям сделок с облигациями не подлежат применению к Сделкам открытой форвард на облигации.

10. ИЗМЕНЕНИЯ В СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ СРОЧНЫХ СДЕЛОК С АКЦИЯМИ И ФОНДОВЫМИ ИНДЕКСАМИ

- 10.1 К отношениям Сторон не подлежат применению положения Стандартных условий срочных сделок с акциями и фондовыми индексами 2011 г. (далее – "*Условия сделок с акциями*") о Срочных сделках на корзину акций и Срочных сделках на корзину индексов.
- 10.2 В пункте 1.1 Условий сделок с акциями слова "в значении, определенном законодательством Российской Федерации о рынке ценных бумаг" дополнить словами ", или аналогичные финансовые инструменты в соответствии с иностранным правом", а также исключить два последние предложения.
- 10.3 В пункте 1.2 Условий сделок с акциями слова "в пункте 1.18," дополнить словами "и Паи, как они определены в пункте 1.50 Стандартных условий,".
- 10.4 Пункт 1.3(б) Условий сделок с акциями дополнить словами ", с учетом изменений и дополнений, согласованных сторонами".
- 10.5 Пункт 1.5 Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (в):
- "(в) применительно к Паю и Срочной сделке на паи – каждую биржу или иного организатора торговли, указанного применительно к этому Паю в Подтверждении или иным образом согласованного сторонами применительно к Паю."
- 10.6 Пункт 1.7 Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (в):
- "(в) применительно к Паю - цену одного Пая, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, а при отсутствии такого порядка – цену одного Пая, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки по собственному усмотрению на основании разумных коммерческих оценок."
- 10.7 В пункте 1.14 Условий сделок с акциями слова "к Акции" дополнить словами "или Паю", слова "к этой Акции" дополнить словами "или этому Паю", слова "с Ациями" дополнить словами "или Паями" и слова "по Акции" дополнить словами "или Паю".
- 10.8 Пункт 1.21 Условий сделок с акциями изложить в следующей редакции:
- "Плановый торговый день"** означает применительно к Срочной сделке на акции, Срочной сделке на паи или Срочной сделке на индекс любой день, в который Биржа, указанная в Подтверждении по Сделке или иным образом согласованная сторонами применительно к Сделке (или каждая Биржа, если в Подтверждении указано или сторонами иным образом согласовано более одной Биржи) должна быть открыта в соответствии с графиком работы для проведения торгов в режиме основных торгов, или в случае отсутствия указания Биржи в условиях Подтверждения или иного соглашения сторон касательно Биржи – любой день,

в который могут быть осуществлены расчеты по сделкам с Акциями, Индексами или Паями на соответствующем рынке."

10.9 В пункте 1.22 Условий сделок с акциями слова "или иной форме, согласованной сторонами" дополнить словами ", или иной форме, приемлемой для Стороны А".

10.10 Пункт 1.25 Условий сделок с акциями дополнить словами ", с учетом изменений и дополнений, согласованных сторонами".

10.11 Пункт 1.28 Условий сделок с акциями дополнить следующими положениями после первого предложения:

"Расчетным агентом по Сделкам открытый форвард на акции и Сделкам открытый форвард на паи является Сторона А."

10.12 Пункт 1.31(а) Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (Д):

"(Д) Паям одного Паевого фонда (такая Сделка далее именуется "**Сделка беспоставочный опцион на паи**");".

10.13 В пункте 1.31(в) Условий сделок с акциями удалить слова ", а вместе со Сделкой поставочный опцион на акции – "**Сделка поставочный опцион**)".

10.14 Пункт 1.31 Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (г):

"(г) в Дату расчетов по Опциону колл получить от Продавца в собственность Паи одного Паевого фонда или по Опциону пут передать Продавцу в собственность такие Паи по Цене исполнения, а Продавец обязуется соответственно передать Покупателю в собственность такие Паи или получить от Покупателя в собственность такие Паи по Цене исполнения (далее – "**Сделка поставочный опцион на паи**", а вместе со Сделкой поставочный опцион на акции и Сделкой поставочный опцион на корзину акций – "**Сделка поставочный опцион**))."

10.15 В пункте 1.39(а) Условий сделок с акциями слова «Сумму платежа» в первой строке заменить на «абсолютное значение Суммы платежа», слово "положительном" в первой строке заменить словом "отрицательном", слова «абсолютное значение Суммы платежа» во второй строке заменить на «Сумму платежа», а слово "отрицательном" в третьей строке заменить словом "положительном".

10.16 Пункт 1.39(а) Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (Д):

"(Д) Паям одного Паевого фонда (такая Сделка далее именуется "**Сделка беспоставочный форвард на паи**");".

10.17 В пункте 1.39(в) Условий сделок с акциями удалить слова ", а вместе со Сделкой поставочный форвард на акции – "**Сделка поставочный форвард**)".

10.18 Пункт 1.39 Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (г):

"(г) в Дату расчетов Продавец обязуется передать Покупателю в собственность согласованное количество Паев одного Паевого фонда, а Покупатель обязуется оплатить их в сумме, рассчитанной на основе Форвардной цены (далее – "**Сделка поставочный форвард на паи**"), а вместе со Сделкой поставочный форвард на акции и Сделкой поставочный форвард на корзину акций – "**Сделка поставочный форвард**").".

10.19 Пункт 1.39 Условий сделок с акциями дополнить следующими положениями:

" Сделка беспоставочный форвард на акции, которая содержит указание на то, что она является Сделкой открытый беспоставочный форвард на акции (далее – "**Сделка открытый беспоставочный форвард на акции**"), подлежит исполнению с учетом особенностей, установленных пунктом 9.4(в)-(г) Стандартных условий.

Сделка поставочный форвард на акции, которая содержит указание на то, что она является Сделкой открытый поставочный форвард на акции (далее – "**Сделка открытый поставочный форвард на акции**"), подлежит исполнению с учетом особенностей, установленных пунктом 10.11 Стандартных условий.

Сделка открытый форвард на акции означает Сделку открытый беспоставочный форвард на акции или Сделку открытый поставочный форвард на акции.

Сделка беспоставочный форвард на паи, которая содержит указание на то, что она является Сделкой открытый беспоставочный форвард на паи (далее – "**Сделка открытый беспоставочный форвард на паи**"), подлежит исполнению с учетом особенностей, установленных пунктом 9.4(в)-(г) Стандартных условий.

Сделка поставочный форвард на паи, которая содержит указание на то, что она является Сделкой открытый поставочный форвард на паи (далее – "**Сделка открытый поставочный форвард на паи**"), подлежит исполнению с учетом особенностей, установленных пунктом 10.11 Стандартных условий.

Сделка открытый форвард на паи означает Сделку открытый беспоставочный форвард на паи или Сделку открытый поставочный форвард на паи."

10.20 Пункт 1 Условий сделок с акциями дополнить следующими определениями:

"1.48. **Количество паев** означает:

- (а) применительно к Сделке опцион на паи – количество Паев, полученное путем умножения Количества опционов на Предмет опциона;
- (б) применительно к Сделке форвард на паи – количество Паев, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке.

- 1.49. **Паевой фонд** означает применительно к Паю паевой инвестиционный фонд, доля в праве собственности на который как на обособленный имущественный комплекс удостоверяется Паем.
- 1.50. **Пай** означает применительно к Срочной сделке на паи инвестиционный пай паевого инвестиционного фонда в значении, определенном законодательством Российской Федерации, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.
- 1.51. **Сделка опцион на паи** означает Сделку поставочный опцион на паи или Сделку беспоставочный опцион на паи.
- 1.52. **Сделка форвард на паи** означает Сделку поставочный форвард на паи или Сделку беспоставочный форвард на паи.
- 1.53. **Срочная сделка на паи** означает Сделку опцион на паи или Сделку форвард на паи.
- 1.54. **Управляющая компания** означает применительно к [Паю и Паевому фонду] управляющую компанию, осуществляющую доверительное управление Паевым фондом.

Термины "Дата исполнения", "Потенциальная дата исполнения", "Потенциальная дата пересмотра процентной ставки", "Процентная ставка", "Процентный период", "Уведомление о дате исполнения" и "Уведомление о расчете" имеют значение, указанное в пункте 7.4 статьи 7 Генерального соглашения."

- 10.21 Пункт 2.1(в) Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (В):
- "(В) применительно к Сделке опцион на паи количество Паев, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания и иного соглашения сторон – один Пай."
- 10.22 Пункт 2.1(д) Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (Д):
- "(Д) применительно к Сделке опцион на паи цену за один Пай, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами."
- 10.23 Пункт 2.3(а)(А) Условий сделок с акциями изложить в следующей редакции:
- "(А) по Сделке поставочный опцион получить от Продавца в собственность Акции или Корзины Акции или Паи в обмен на уплату суммы, рассчитанной исходя из Цены исполнения за Аксию или Корзину или Пай;"
- 10.24 Пункт 2.3(б)(А) Условий сделок с акциями изложить в следующей редакции:

- "(А) по Сделке поставочный опцион передать Продавцу в собственность Акции или Корзины Акции или Паи в обмен на уплату суммы, рассчитанной исходя из Цены исполнения за Ацию или Корзину или Пай;"
- 10.25 Положения пункта 2.5(а)(Л) Условий сделок с акциями не подлежат применению к Сделкам опцион на акции и Сделкам опцион на паи, если Акции или Паи, являющиеся предметом соответствующей Сделки, не допущены к торгам биржей или иным организатором торгов.
- 10.26 В пункте 3.1(в)(В) Условий сделок с акциями удалить слова "с Даты начала срока до Даты истечения срока (обе даты включительно)".
- 10.27 В пункте 3.1(г) Условий сделок с акциями слова "согласованной сторонами" дополнить словами ", или иной форме, приемлемой для Стороны А".
- 10.28 Пункт 3.2(е)(В) Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (вв):
- "(вв) применительно к Сделке опцион на паи Пороговая цена превышает Цену исполнения;"
- 10.29 Пункт 3.2(е)(Г) Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (вв):
- "(вв) применительно к Сделке опцион на паи Пороговая цена меньше Цены исполнения."
- 10.30 В первом абзаце пункта 3.2(ж) Условий сделок с акциями слова "стоимость одной Корзины" дополнить словами "или цену за Пай".
- 10.31 Пункт 3.2(ж)(А) Условий сделок с акциями изложить в следующей редакции:
- "(А) применительно к Сделке опцион на акции или Сделке опцион на паи - Биржевую цену Акции или Пая (в этих целях Временем оценки и Датой оценки будут Время закрытия торгов (насколько применимо) и Дата истечения срока соответственно), а при отсутствии такой цены - цену Акции или Пая, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки (в этих целях Датой оценки будет Дата истечения срока) в Дату истечения срока по собственному усмотрению на основании разумных коммерческих оценок;"
- 10.32 Пункт 4.1(а) Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (Д):
- "(Д) применительно к Сделке форвард на паи цену за Пай, указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами."
- 10.33 В пунктах 4.1(б)-(в) Условий сделок с акциями слова "цену за Ацию" дополнить словами "или цену за Пай".
- 10.34 Пункт 4.2(а) Условий сделок с акциями дополнить следующими положениями:

"Положения о Предварительной оплате не подлежат применению к Сделкам форвард на акции и Сделкам форвард на паи. Равным образом к Сделкам форвард на акции и Сделкам форвард на паи не подлежат применению положения о Переменной сумме обязательства."

10.35 В пункте 4.3(а) Условий сделок с акциями слова "Сделок форвард" дополнить словами "(за исключением Сделок открытый форвард на акции и Сделок открытый форвард на паи)".

10.36 Положения пункта 4.3(а)(3) Условий сделок с акциями не подлежат применению к Сделкам форвард на акции и Сделкам форвард на паи, если Акции или Паи, являющиеся предметом соответствующей Сделки, не допущены к торгам биржей или иным организатором торгов.

10.37 Пункт 4.3(а) Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (И):

"(И) применительно к Сделке форвард на паи Количество паев."

10.38 Пункт 4.3(б) Условий сделок с акциями изложить в следующей редакции:

"(б) Существенными условиями Сделок открытый форвард на акции и Сделок открытый форвард на паи, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки в отношении каждой из этих Сделок, являются:

(А) Покупатель;

(Б) Продавец;

(В) Базовый актив;

(Г) применительно к Сделке открытый форвард на акции Количество акций;

(Д) применительно к Сделке открытый форвард на паи Количество паев;

(Е) Форвардная цена;

(Ж) Процентная ставка первого Процентного периода;

(З) Потенциальная дата пересмотра процентной ставки;

(И) сторона, имеющая право определить Дату исполнения, и Потенциальная дата исполнения для каждой такой стороны."

10.39 Пункт 4.3 Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (в):

"(в) Другие условия Сделок форвард подлежат согласованию в качестве существенных условий по требованию одной из сторон."

10.40 В пунктах 5.1(г) и (е) Условий сделок с акциями слова "не является Биржевым днем и Банковским днем, ближайший следующий Биржевой день, который

одновременно является Банковским днем" заменить словами "не является Банковским днем и днем, когда расчетные и (или) клиринговые системы, необходимые для осуществления соответствующей поставки, открыты для осуществления деятельности, ближайший следующий Банковский день, который одновременно является днем, когда расчетные и (или) клиринговые системы, необходимые для осуществления соответствующей поставки, открыты для осуществления деятельности".

10.41 Пункт 5.1(и)(Б) Условий сделок с акциями дополнить словами ", а при отсутствии такого значения – цену одной Акции, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки по собственному усмотрению на основании разумных коммерческих оценок".

10.42 Положения пункта 5.2(а)(3) Условий сделок с акциями не подлежат применению к Сделкам своп на акции, если Акции, являющиеся предметом соответствующей Сделки, не допущены к торгам биржей или иным организатором торгов.

10.43 В пункте 6.3 Условий сделок с акциями слова ", Акцию" дополнить словами ", Пай".

10.44 Пункт 6.5(в) Условий сделок с акциями изложить в следующей редакции:

"(в) при отсутствии в Подтверждении или ином соглашении сторон Времени оценки - любое время в течение Контрольной даты по усмотрению Стороны А."

10.45 Удалить пункт 6.5(г) Условий сделок с акциями.

10.46 В пункте 6.6 Условий сделок с акциями слова ", Акцией" дополнить словами ", Паем".

10.47 Пункт 7.1 Условий сделок с акциями изложить в следующей редакции:

"Время оценки означает применительно к всем Сделкам, за исключение Сделок опцион на акции и Сделок индексный опцион время в течение Даты оценки, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон – любое время в течение Даты оценки по усмотрению Стороны А и применительно к Сделкам опцион на акции и Сделкам индексный опцион – время в течение Даты оценки, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон – Время закрытия торгов на соответствующей Бирже в Дату оценки применительно к каждому Индексу или Акции, значение или стоимость которых подлежит определению или оценки, а для Акции, не обращающихся на Бирже, – любое время в течение Даты оценки по усмотрению Стороны А. Если Биржа закрывается раньше Времени закрытия торгов, и указанное в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами Время оценки наступает по окончании проведения торгов в режиме основных торгов, Временем закрытия будет фактическое время закрытия Биржи".

- 10.48 В пункте 7.2(б) Условий сделок с акциями удалить слова "Сделке форвард или".
- 10.49 Пункт 7.2 Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (в):
- "(в) применительно к Сделке форвард Рабочий день, предшествующий Дате расчетов, если иное не указано в Подтверждении или иным образом не согласовано сторонами".
- 10.50 В пунктах 7.3(а) и 7.3(б)(А)(аа) Условий сделок с Акциями слова "Акции", "Акцией", "Акция", "Акциями" дополнить словами "или Пай" в таком же числе и падеже.
- 10.51 В пункте 7.5(а) Условий сделок с акциями слова "Срочной сделке на акции" дополнить словами "или Срочной сделки на паи".
- 10.52 Пункт 7.5(а)(Б)(бб) Условий сделок с акциями изложить в следующей редакции:
- "(бб) применительно к Срочной сделке на акции или Срочной сделке на паи стоимость Акции или Пая по состоянию на Время оценки в этот восьмой Плановый торговый день, исходя из своей добросовестной оценки;"
- 10.53 В пункте 8.1(б) Условий сделок с акциями слова "Сделке форвард на акции" дополнить словами ", Сделке форвард на паи".
- 10.54 В последнем абзаце пункта 8.1 Условий сделок с акциями слова "Сделке опцион на акции" дополнить словами ", Сделке опцион на паи".
- 10.55 Пункт 8.3(а) Условий сделок с акциями дополнить следующими положениями:
- "а при отсутствии Биржевой цены - цену одной Акции, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки по собственному усмотрению на основании разумных коммерческих оценок."
- 10.56 В пункте 8.3(в) Условий сделок с акциями слова "Сделке поставочный опцион на корзину акций" дополнить словами "или Сделке поставочный опцион на паи".
- 10.57 Пункт 8.3 Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (е):
- "(е) применительно к Сделке беспоставочный опцион на паи или Сделке форвард на паи - цену одного Пая, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки в порядке, установленном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами, а при отсутствии такого порядка - цену одного Пая, определенную Расчетным агентом по состоянию на Время оценки в Дату оценки по собственному усмотрению на основании разумных коммерческих оценок."
- 10.58 В первом абзаце пункта 8.4(а) Условий сделок с акциями слова "Даты оценки" заменить словами "Даты оценки (за исключением Сделки открытый форвард на акции или Сделки открытый форвард на паи) или Даты исполнения (в случае Сделки открытый форвард на акции или Сделки открытый форвард на паи)".
- 10.59 Пункт 8.4(б)(А) Условий сделок с акциями изложить в следующей редакции:

"(А) применительно к Акциям или Паям, подлежащим поставке по Сделке опцион, день, наступающий через один Расчетный цикл после соответствующей Даты осуществления права на исполнение (или (1) применительно к Сделке опцион [в случае указания Биржи в условиях соответствующего Подтверждения или иного соглашения сторон касательно Биржи], если этот день не является Клиринговым днем, ближайший следующий Клиринговый день; или (2) применительно к Сделке опцион [в случае отсутствия указания Биржи в условиях соответствующего Подтверждения или иного соглашения сторон касательно Биржи], если этот день не является Рабочим днем, ближайший следующий Рабочий день);".

10.60 Пункт 8.4(б)(Б) Условий сделок с акциями изложить в следующей редакции:

"(Б) применительно к Акциям, подлежащим поставке по Сделке форвард или Сделке своп, или Паям, подлежащим поставке по Сделке форвард, день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке (при этом стороны вправе согласовать как общую Дату расчетов для обеих сторон, так и различные Даты расчетов для каждой стороны (и в этом случае каждая сторона обязана исполнить соответствующее обязательство в Дату расчетов, установленную для такой стороны)), а при отсутствии такого указания в Подтверждении или иного соглашения сторон - день, наступающий через один Расчетный цикл после Даты оценки (за исключением Сделки открытый форвард на акции или Сделки открытый форвард на паи) или Даты исполнения (в случае Сделки открытый форвард на акции или Сделки открытый форвард на паи) (или, если этот день не является Рабочим днем, ближайший следующий Рабочий день).".

10.61 Удалить подпункты (В)-(Г) в пункте 8.4(б) Условий сделок с акциями.

10.62 В пункте 8.5(а) Условий сделок с акциями слова "Сделке форвард на корзину акций" дополнить словами ", Сделке опцион на паи и Сделке форвард на паи".

10.63 В пункте 9.1(б) Условий сделок с акциями слова "Сделке опцион на корзину акций" дополнить словами "или Сделке опцион на паи".

10.64 Пункт 9.1(д) Условий сделок с акциями изложить в следующей редакции:

"(д) в Сделке форвард на акции, Сделке форвард на корзину акций или Сделке форвард на паи (за исключением Сделки открытый форвард на акции или Сделки открытый форвард на паи), к которым не применимы условия о Предварительной оплате и о Переменной сумме обязательства, - сумму, равную произведению Количества акций, Количества корзин или Количества паев и разности Расчетной цены и Форвардной цены:

$$СП = К \times (ФЦ - РЦ)$$

где		
СП	–	Сумма платежа;
К	–	Количество акций, Количество корзин или Количество

		паев;
ФЦ	–	Форвардная цена;
РЦ	–	Расчетная цена."

10.65 Пункт 9.1 Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (и):

"(и) в Сделке открытый форвард на акции или Сделке открытый форвард на паи, к которой не применимы условия о Предварительной оплате и о Переменной сумме обязательства, - сумму, рассчитываемую по следующей формуле:

$$СП = К \times (ФЦ \times \prod_{i=1}^N ПФ_i - РЦ)$$

где		
СП	–	Сумма платежа;
К	–	Количество акций или Количество паев;
РЦ	–	Расчетная цена;
ФЦ	–	Форвардная цена.
ПФ _{<i>i</i>}	-	Процентный фактор <i>i</i> -того Процентного периода;
<i>i</i>	-	порядковый номер Процентного периода по Сделке; и
<i>N</i>	-	полное количество Процентных периодов по Сделке."

10.66 Пункты 9.4(а)(А)-(Б) Условий сделок с акциями изложить в следующей редакции:

- "(А) если Сумма платежа имеет положительное значение, Покупатель обязан уплатить Продавцу Сумму платежа в соответствующую Дату расчетов;
- (Б) если Сумма платежа имеет отрицательное значение, Продавец обязан уплатить Покупателю абсолютную величину Суммы платежа в соответствующую Дату расчетов;"

10.67 Пункт 9.4 Условий сделок с акциями дополнить следующими подпунктами (в)-(г):

- "(в) Сумма платежа применительно к Сделке открытый беспоставочный форвард на акции или Сделке открытый беспоставочный форвард на паи рассчитывается Расчетным агентом и указывается в Уведомлении о расчете.
- (г) Не позднее Рабочего дня, следующего за датой получения Стороной Б Уведомления о расчете, Сторона Б обязана подписать полученное Уведомление о расчете и направить его Расчетному агенту."

10.68 В пункте 10.1 Условий сделок с акциями:

- (а) слова "Количества корзин, подлежащих поставке (без округления)," дополнить словами "или Количества паев, подлежащих поставке (без округления),";
- (б) слова "Количество корзин, подлежащих поставке," дополнить словами "или Количество паев, подлежащих поставке,".

10.69 Первый абзац пункта 10.2(а) Условий сделок с акциями дополнить словами "(за исключением Сделки открытый форвард на акции)".

10.70 В последнем абзаце пункта 10.1, последнем абзаце пункта 10.2 и последнем абзаце пункта 10.3 Условий сделок с акциями слова "указанные в Подтверждении" заменить словами "определенные в соответствии с Генеральным соглашением".

10.71 Пункт 10.2 Условий сделок с акциями перед словами "При этом" дополнить следующими подпунктами (в)-(г):

- "(в) применительно к Сделке форвард на паи (за исключением Сделки открытый форвард на паи) Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, равную произведению Форвардной цены и Количества паев, а Продавец обязан передать Покупателю в собственность Количество паев;
- (г) применительно к Сделке открытый форвард на акции или Сделке открытый форвард на паи Покупатель обязан уплатить Продавцу сумму, рассчитываемую по следующей формуле, а Продавец обязан передать Покупателю в собственность Количество акций или Количество паев:

$$СП = К \times \Phi Ц \times \prod_{i=1}^N П\Phi_i$$

где		
СП	–	Сумма платежа;
К	–	Количество акций или Количество паев;
ФЦ	–	Форвардная цена.
ПФ _{<i>i</i>}	-	Процентный фактор <i>i</i> -того Процентного периода;
<i>i</i>	-	порядковый номер Процентного периода по Сделке; и
<i>N</i>	-	полное количество Процентных периодов по Сделке."

10.72 Пункт 10.4 Условий сделок с акциями дополнить следующими положениями:

"Количество паев, подлежащих поставке, означает применительно к Дате осуществления права на исполнение по Сделке опцион количество Паев, равное произведению количества Опционов, осуществленных в эту Дату осуществления права на исполнение, и Предмета опциона."

- 10.73 В пункте 10.7 Условий сделок с акциями слово "Акции" дополнить словами "или Паю".
- 10.74 В пунктах 10.8 и 10.10 Условий сделок с акциями слово "Акция" дополнить словами "или Паев".
- 10.75 В пункте 10.9 Условий сделок с акциями слова "законодательством Российской Федерации" заменить словами "применимым законодательством".
- 10.76 Положения пункта 10.9 Условий сделок с акциями распространить на передачу Паев (насколько применимо), при этом ссылки на "Акции" должны толковаться как ссылки на "Паи", а ссылки на "Эмитента" – как ссылки на "Управляющую компанию".
- 10.77 Пункт 10 Условий сделок с акциями дополнить следующими положениями:

"10.11. Особенности осуществления расчетов по Сделке открытый поставочный форвард на акции или Сделке открытый поставочный форвард на паи.

- (а) Сумма, подлежащая уплате по Сделке Покупателем, рассчитывается Расчетным агентом и указывается (А) в Уведомлении о дате исполнения, если Дата исполнения определяется Стороной А, или (Б) в Уведомлении о расчете, если Дата исполнения определяется Стороной Б.
- (б) Не позднее Рабочего дня, следующего за датой получения Стороной Б Уведомления о расчете, Сторона Б обязана подписать полученное Уведомление о расчете и направить его Расчетному агенту."
- 10.78 Положения пункта 11 Условий сделок с акциями распространить на выплату дохода от доверительного управления имуществом, составляющим соответствующий Паевой фонд (насколько применимо), при этом ссылки на "Акции" должны толковаться как ссылки на "Паи", а ссылки на "Эмитента" – как ссылки на "Управляющую компанию".
- 10.79 Пункт 12 Условий сделок с акциями дополнить следующими положениями:

"Корректировка Срочных сделок на паи

- 12.7. Если иное не предусмотрено Подтверждением или иным образом не согласовано сторонами применительно к Сделке, в случае раскрытия сообщения или иного объявления Основания корректировки в отношении паев Расчетный агент:
- (а) корректирует одно или более следующих условий:
- (А) по Сделке опцион на паи Цену исполнения, Количество опционов, Предмет опциона, Барьерную цену и Количество паев;

(Б) по Сделке форвард на паи Форвардную цену, Минимальную форвардную цену, Максимальную форвардную цену, Барьерную цену и Количество паев,

а также любой другой параметр или значение, связанное с исполнением, расчетами, платежом или иными условиями Сделки. Корректировка должна осуществляться с целью учесть влияние указанного события на оценку стоимости Паев. При этом изменения ставки РЕПО или ликвидности, имеющие отношение к Паю, не могут быть единственным основанием для корректировки условий Сделки;

(б) определяет дату или даты вступления в силу скорректированных параметров и значений.

12.8. **Основание корректировки в отношении паев** означает принятие Управляющей компанией решения о дроблении Паев и любое иное событие, которое может повлиять на оценку стоимости Паев вследствие увеличения или уменьшения общего количества [инвестиционных паев] Паевого фонда иначе, чем в результате выдачи, обмена или погашения [инвестиционных паев], за исключением Обмена паев[, Банкротства] и Прекращения фонда."

10.80 В пункте 13.1(а) Условий сделок с акциями слово "Делистинг" дополнить словами ", Обмен паев".

10.81 Пункт 13.1 Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (п):

"(п) **Обмен паев** означает обмен всех [инвестиционных паев] Паевого фонда на инвестиционные паи другого паевого инвестиционного фонда по решению Управляющей компании, если дата конвертации [инвестиционных паев] (далее – "**Дата конвертации**") наступает до или в:

(А) Дату истечения срока или последнюю из Дат расчетов в зависимости от того, какая из этих дат наступает позднее, - применительно к Сделкам поставочный опцион;

(Б) соответствующую Дату расчетов - применительно к Сделкам поставочный форвард;

(В) последнюю из Дат оценки - в остальных случаях.

Если иное не указано в Подтверждении или иным образом не определено сторонами применительно к Сделке, последствие Обмена паев определяется Стороной А по собственному усмотрению. В таком случае в качестве последствия Обмена паев Стороной А может быть определено либо "Замена базового актива" (согласно пункту 13.2(а) Стандартных условий (насколько применимо), при этом ссылки на "Акции" должны толковаться как ссылки на "Паи", ссылки на "Новые акции" – как ссылки на паи другого инвестиционного фонда, а ссылки на "Эмитента" – как

ссылки на "Управляющую компанию"), либо "Расторжение с выплатой" согласно пункту 13.2(б) Стандартных условий (насколько применимо)).".

10.82 В пункте 13.6(а) Условий сделок с акциями слова "имущества Эмитента" дополнить словами "либо все Паи или все либо существенная часть имущества, составляющего Паевой фонд,".

10.83 В пункте 13.6(б) Условий сделок с акциями удалить слова "в Российской Федерации".

10.84 Положения пунктов 13.6(б) – 13.6(г)(А)-(Б) [и 13.9(а)(Б)-(З)] Условий сделок с акциями распространить на Паи (насколько применимо), при этом ссылки на "Акции" должны толковаться как ссылки на "Паи", а ссылки на "Эмитента" – как ссылки на "Управляющую компанию".

10.85 Первый абзац пункта 13.7(б) Условий сделок с акциями изложить в следующей редакции:

"Применительно к Сделке опцион (за исключением Сделки опцион на паи) сумма, подлежащая уплате Продавцом Покупателю, определяется по соглашению сторон не позднее пяти [Рабочих] дней после Даты поглощения, Даты приобретения по публичной оферте, даты прекращения расчета Индекса при наступлении События, требующего корректировки индекса, или даты наступления события, указанного в пункте 13.6 Стандартных условий.

Применительно к Сделке опцион на паи сумма, подлежащая уплате Продавцом Покупателю, определяется по соглашению сторон не позднее пяти Плановых торговых дней после Даты конвертации или даты наступления события, указанного в пункте 13.6 Стандартных условий.

Далее каждая из этих дат применительно к Сделке опцион – "*Дата события*".".

10.86 В пункте 13.9(а)(А) Условий сделок с акциями слова "подпунктах (Б)-(З)" дополнить словами "и подпунктах (Р)-(Щ)".

10.87 Пункт 13.9(а)(Б) Условий сделок с акциями перед словами "сторона соответствующей Сделки" дополнить следующим подпунктом (дд):

"(д) принятия какого-либо акта, аналогичного указанным в подпунктах (аа)-(гг) настоящего пункта 13.9(а)(А), судом или иным уполномоченным органом или лицом иностранного государства,".

10.88 В пункте 13.9(а)(Г) Условий сделок с акциями слова "ссылками на Эмитента" заменить словами "применительно к Срочной сделке на акции, Срочной сделке на корзину акций, Срочной сделке на индекс или Срочной сделке на корзину индексов ссылками на Эмитента и применительно к Срочной сделке на паи ссылками на Управляющую компанию".

10.89 Пункт 13.9(а) Условий сделок с акциями дополнить следующими подпунктами (Р)-(У):

"(Р) *Прекращение фонда* означает прекращение Паевого фонда;

- (С) **Изменение управляющей компании** означает передачу прав и обязанностей по договору доверительного управления Паевым фондом другой управляющей компании;
- (Т) **Регистрация изменений в правила** означает регистрацию изменений и дополнений в правила доверительного управления Паевым фондом [и/или иные документы Управляющей компании в отношении Паевого фонда], которые могут повлиять на оценку стоимости Паев;
- (У) **Приостановление** означает приостановление выдачи, погашения и/или обмена Паев на срок более 5 (Пяти) дней;
- (Ф) **Изменение срока договора** означает применительно к Паевому фонду, являющемуся закрытым паевым инвестиционным фондом, досрочное прекращение или продление срока действия договора доверительного управления таким Паевым фондом;
- (Х) **Дополнительная выдача паев** означает применительно к Паевому фонду, являющемуся закрытым паевым инвестиционным фондом, выдачу дополнительных [паев] после завершения (окончания) формирования такого Паевого фонда;
- (Ц) **Установление запрета** означает введение Банком России запрета Управляющей компании на проведение всех или части операций, осуществляемых на основании лицензии Управляющей компании на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами;
- (Ч) **Нарушение правил инвестирования** означает нарушение Управляющей компанией стратегии инвестирования или ограничений на инвестирование в отношении [Паевого фонда];
- (Ш) **Изменения в оценке** означает принятие изменений в законодательство, затрагивающих Паевую фонд и/или Управляющую компанию, которые могут повлиять на оценку стоимости Паев;
- (Щ) **Расследование** означает расследование или судебное преследование в отношении Управляющей компании, если это может повлиять на оценку стоимости Паев."

10.90 Пункт 13.9 Условий сделок с акциями дополнить следующим подпунктом (е):

- "(е) Последствия наступления Иного события, препятствующего исполнению, указанного в подпунктах (а)(Р)-(У) настоящего пункта 13.9, определяются Стороной А по собственному усмотрению."

10.91

В ПОДТВЕРЖДЕНИЕ ВЫШЕИЗЛОЖЕННОГО Стороны подписали настоящее Генеральное соглашение в день, указанный в преамбуле настоящего Генерального соглашения.

ПОДПИСАНО

За и от имени

АО "АЛЬФА-БАНК"

Печать

ПОДПИСАНО

Ф.И.О.:

Должность:

За и от имени

Наименование Стороны Б

Печать

ПРИЛОЖЕНИЕ 1
ФОРМА ДОВЕРЕННОСТИ ДЛЯ СТОРОНЫ А
(ЗАКЛЮЧЕНИЕ СДЕЛОК)

г. Москва

" ___ " _____ 20__ г.

АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК" (акционерное общество, созданное в соответствии с законодательством Российской Федерации, место нахождения: 107078, г. Москва, ул. Каланчевская, д. 27, ОГРН 1027700067328) ("**Сторона А**") в лице [указать должность] [указать фамилию, имя, отчество], действующего на основании [указать основание действий], настоящим уполномочивает [указать фамилию, имя, отчество работника] (зарегистрирован[ый/ая] по адресу: [•]; паспорт № [указать номер паспорта], выданный [указать дату выдачи] [указать наименование органа, выдавшего паспорт], код подразделения [указать код подразделения]) ("**Дилер**") на заключение, изменение и прекращение от имени Стороны А [всех и любых] сделок в соответствии с Генеральным соглашением о срочных сделках на финансовых рынках от [указать дату] между Стороной А и [указать наименование Стороны Б] (с внесенными на тот или иной момент изменениями и дополнениями).

Образец подписи Дилера [указать образец подписи] удостоверяю.

Настоящая доверенность выдана сроком на [указать срок].

[Подпись и печать]

[указать должность] [указать фамилию, имя, отчество]

(ПОДТВЕРЖДЕНИЕ СДЕЛОК)

г. Москва

" ___ " _____ 20__ г.

АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК" (акционерное общество, созданное в соответствии с законодательством Российской Федерации, место нахождения: 107078, г. Москва, ул. Каланчевская, д. 27, ОГРН 1027700067328) ("**Сторона А**") в лице [указать должность] [указать фамилию, имя, отчество], действующего на основании [указать основание действий], настоящим уполномочивает [указать фамилию, имя, отчество работника] (зарегистрирован[ый/ая] по адресу: [•]; паспорт № [указать номер паспорта], выданный [указать дату выдачи] [указать наименование органа, выдавшего паспорт], код подразделения [указать код подразделения]) ("**Дилер**") на составление и подписание любых документов, связанных со сделками, заключенными Стороной А в соответствии с Генеральным соглашением о срочных сделках на финансовых рынках от [указать дату] между Стороной А и [указать наименование Стороны Б] ("**Генеральное соглашение**") (с внесенными на тот или иной момент изменениями и дополнениями) (в том числе Подтверждения (как определено в Генеральном соглашении)).

Образец подписи Дилера [указать образец подписи] удостоверяю.

Настоящая доверенность выдана сроком на [указать срок].

[Подпись и печать]

[указать должность] [указать фамилию, имя, отчество]

ПРИЛОЖЕНИЕ 2
ФОРМА ДОВЕРЕННОСТИ ДЛЯ СТОРОНЫ Б

г. Москва

" ____ " _____ 20__ г.

[Указать наименование Стороны Б] ([указать организационно-правовую форму], созданное в соответствии с законодательством Российской Федерации, место нахождения: [•], ОГРН [•]) ("**Сторона Б**") в лице [указать должность] [указать фамилию, имя, отчество], действующего на основании [указать основание действий], настоящим уполномочивает [указать фамилию, имя, отчество работника] (зарегистрирован[ый/ая] по адресу: [•]; паспорт № [указать номер паспорта], выданный [указать дату выдачи] [указать наименование органа, выдавшего паспорт], код подразделения [указать код подразделения]) ("**Дилер**") на заключение[, изменение и прекращение] от имени Стороны Б [всех и любых] сделок в соответствии с Генеральным соглашением о срочных сделках на финансовых рынках от [указать дату] между Стороной Б и АКЦИОНЕРНЫМ ОБЩЕСТВОМ "АЛЬФА-БАНК" ("**Генеральное соглашение**") (с внесенными на тот или иной момент изменениями и дополнениями) [и составление и подписание любых документов, связанных с такими сделками (в том числе Подтверждения (как определено в Генеральном соглашении))].

Образец подписи Дилера [указать образец подписи] удостоверяю.

Настоящая доверенность выдана сроком на [указать срок].

[Подпись и печать]

[указать должность и фамилию, имя, отчество]

ПРИЛОЖЕНИЕ 3

Порядок предоставления информации в Репозитарий

1. Настоящим Стороны устанавливают порядок предоставления информации о Генеральном соглашении и заключаемых в рамках него сделках (далее - Сделки) репозитарию исходя из требований ст. 51.5 Федерального закона "О рынке ценных бумаг" и нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и/или Банка России и условиями Репозитария, определенного в п. 2 Приложения.

2. Стороны выбирают Небанковскую кредитную организацию закрытое акционерное общество "Национальный расчетный депозитарий" (НКО ЗАО НРД) в качестве репозитария (далее - Репозитарий), который информируется о Генеральном соглашении и о заключаемых в рамках него Сделках в установленном порядке.

3. Стороны пришли к соглашению, что АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК" выступает Базовым информирующим лицом и Информирующим лицом, которому поручается передача Репозитарию информации о Генеральном соглашении и Сделках, заключенных по Генеральному соглашению. Информация о Генеральном соглашении и заключенных в соответствии с ним Сделках будет предоставляться Репозитарию по мере необходимости в соответствии с требованиями, в порядке и сроки, предусмотренные законодательством Российской Федерации и условиями Репозитария. Сторона Б настоящим выражает свое безотзывное и безусловное согласие на передачу информации Репозитарию в объеме, установленном нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и/или Банка России и условиями Репозитария.

Сторона Б подтверждает, что при заключении Сделок в рамках Генерального соглашения действует в своих интересах. В случае заключения Сделки в интересах третьих лиц Сторона Б обязуется не позднее даты заключения соответствующей Сделки уведомить об этом АО «АЛЬФА-БАНК» по каналу связи Swift, Telex, Факс, системе «Альфа-подтверждение» указанные в настоящем Генеральном соглашении, с предоставлением сведений, необходимых для направления информации в репозитарий, к которым относятся следующие сведения: «Тип клиента стороны», «Тип кода клиента стороны», «Код клиента стороны», «Наименование клиента стороны».

4. В случае, если соответствующей Стороне станет известно о ненадлежащем и/или несвоевременном исполнении Базовым информирующим лицом и Информирующим лицом обязательств по предоставлению информации о Генеральном соглашении и Сделках, заключенных по Генеральному соглашению, то она вправе осуществить предоставление информации в Репозитарий самостоятельно.

5. Стороны обязуются иметь заключенные с Репозитарием соглашения необходимые для предоставления информации в Репозитарий, за исключением случая, если Сторона не является лицом, обязанным предоставлять информацию в репозитарий, в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации.

6. Стороны несут расходы по оплате услуг Репозитария самостоятельно.

7. В целях обеспечения идентичного заполнения информации, предоставляемой в Репозиторий, Стороны договорились указывать при взаимодействии с Репозитарием следующее:

– в качестве первой стороны – АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "АЛЬФА-БАНК";
Идентификационный код первой стороны в Репозитории: MC000050REPO

– в качестве второй стороны - _____

[вставить наименование];

Идентификационный код второй стороны в Репозитории: _____

[вставить данные];

Международный код идентификации юридического лица первой стороны (Legal Entity Identifier, LEI): 253400QWEQNERA6RJS29

Международный код идентификации юридического лица второй стороны (Legal Entity Identifier, LEI): _____ *[вставить данные];*

Каждая из Сторон обязуется сообщать другой Стороне об изменении идентификационных кодов, Международного кода идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI) по электронным каналам связи, указанным в настоящем Дополнительном соглашении, в течение 3 (трех) рабочих дней с даты такого изменения, но в любом случае до даты заключения какой-либо новой Сделки.

8. Каждая из Сторон вправе назначить своим Базовым информирующим лицом и Информирующим лицом иное лицо, при условии, что Сторона, изменяющая свое Базовое информирующее лицо и Информирующее лицо, письменно уведомила другую Сторону о такой замене не позднее, чем за 30 (тридцать) календарных дней до соответствующей замены, и своевременно и в требуемой форме предоставила информацию о своем новом Базовом информирующем лице и информирующем лице Репозитарию и другой Стороне.

9. Контактные данные Сторон по вопросам, связанным с предоставлением информации в репозиторий:

	первая сторона	вторая сторона
Адрес:	107078, Москва, Каланчевская, 27;	_____
Вниманию:	сотрудников Отдела отчетности и контроля данных	_____
Телефон:	+7 499 6812717	_____
Факс:	+7 495 7953699	_____
Swift:	ALFARUMM	_____
Telex:	412 089 ALFA RU	_____
Адрес электронной почты:	Repositoryteam@alfa-bank.ru, ReportingTeam@alfa-bank.ru	_____

10. Настоящее Приложение является неотъемлемой частью Генерального соглашения.

За и от имени

**АКЦИОНЕРНОГО ОБЩЕСТВА
"АЛЬФА-БАНК"**

Подпись: _____

М.П.

Ф.И.О. _____

Должность

За и от имени

(Наименование Стороны Б)

Подпись: _____

М.П.

Ф.И.О. _____

Должность
