

# ПАСПОРТ ФИНАНСОВОГО ИНСТРУМЕНТА

## ВНЕБИРЖЕВОЙ ОПЦИОННЫЙ ДОГОВОР

### «ФИКСИРОВАННЫЙ КУПОН»

Этот документ предназначен для информирования Вас об основных характеристиках данного финансового инструмента, связанной с ним структуре расходов, наличии ограничений на досрочный выход из инвестиций и о существенных рисках

## 1. ЭТО ВАЖНО!

- 1.1. Представленная информация не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией, а также не является рекламой.
- 1.2. Данный финансовый инструмент не является банковским депозитом, связанные с ним риски не подлежат страхованию в соответствии с Федеральным законом от 23 декабря 2003 года № 177-ФЗ «О страховании вкладов физических лиц в банках Российской Федерации». Возврат инвестиций и доходность вложений в данный финансовый инструмент не гарантированы государством.
- 1.3. Данный финансовый инструмент может быть труден для понимания.
- 1.4. Перед приобретением данного финансового инструмента следует ознакомиться с указанной ниже информацией.

## 2. ЧТО ПРЕДСТАВЛЯЕТ СОБОЙ ФИНАНСОВЫЙ ИНСТРУМЕНТ

### Краткая информация о финансовом инструменте

Вид финансового инструмента	Внебиржевой опционный договор «Фиксированный купон»
Категория инвестора, которой предназначен финансовый инструмент	Предназначен для квалифицированных инвесторов (с учетом рекомендаций Банка России от 15.12.2020)

### Информация о создателе (разработчике) финансового инструмента

Полное наименование	OTKRITIE LTD
Контакты	1 Agias Zonis & Thessalonikis, Nicolaou Pentadromos Center, Block A, 9th floor, office 908G, 3025 Limassol, Cyprus, тел: +357 25 256 944 e-mail: info@otkritield.com

### Информация о разработчике паспорта финансового инструмента

Полное наименование	Акционерное общество «Открытие Брокер»
Контакты	115114, г. Москва, ул. Летниковская, д 2, стр. 4 тел.: +7 (495) 777 56 56

### Информация о паспорте финансового инструмента

Дата разработки паспорта финансового инструмента	31.03.2021
Дата последней актуализации паспорта финансового инструмента	18.05.2021

В данном паспорте в соответствии с требованиями стандарта НАУФОР приведены **основные характеристики данного финансового инструмента**.

Полная спецификация финансового инструмента приведена на сайте АО «Открытие Брокер» в сети Интернет по адресу: <https://open-broker.ru/documents/dokumenty/>.

- Финансовый инструмент предоставляет возможность получения платежа (купона) в размере фиксированного процента от суммы инвестирования.
- Выплата купона происходит в дату погашения финансового инструмента, указанную в Поручении на структурный продукт, и не зависит от цены на базисный актив.
- Если цена базисного актива на дату погашения находится ниже Пороговой цены, указанной в Поручении, Вам осуществляется поставка базисного актива в количестве, указанном в Поручении, по Пороговой цене. В противном случае возвращается инвестированная сумма. **Важно!** Обратите внимание, что Вы получаете на Ваш счет ценные бумаги в случае падения цены ниже уровня Пороговой цены к дате погашения финансового инструмента.
- Ваш итоговый финансовый результат зависит от того, где будет находиться цена закрытия базисного актива на день, предшествующей дате погашения, относительно Пороговой цены.
- Финансовый инструмент не предусматривает досрочного погашения.

## ОСНОВНЫЕ ХАРАКТЕРИСТИКИ ИНСТРУМЕНТА

Тип и стиль опциона	Европейский поставочный опцион PUT. Исполнение опциона происходит в дату погашения финансового инструмента. Сумма выплаты рассчитывается по формуле, указанной в соответствующей спецификации.
Срок опционного договора ( $T$ в формулах)	Определяется как срок между датой начала срока действия договора и датой погашения, определяемой в соответствии с поручением на структурный продукт.
Базисный (базовый) актив	Ценные бумаги. Конкретные ценные бумаги определяются в соответствии с поручением на структурный продукт.
Сумма инвестирования ( $S_{inv}$ в формулах) и ее валюта	Сумма денежных средств, которую Вы инвестируете (уплачиваете) в соответствии с опционным договором. Определяется в соответствии с поручением на структурный продукт.
Дата погашения (исполнения) опциона	Определяется в соответствии с поручением на структурный продукт.
Пороговая цена базисного (базового) актива ( $Strike$ в формулах) и валюта указанной цены	Определяется в соответствии с поручением на структурный продукт.
Цена исполнения опциона	Равна пороговой цене.
Текущая цена базисного (базового) актива ( $P_1$ в формулах)	Определяется как цена закрытия в основном режиме торгов (основной торговой сессии) на день, предшествующий дате погашения опциона. Валюта указанной цены – российский рубль.
Купонная ставка ( $r_c$ в формулах)	Ставка купона в процентах от суммы инвестирования, определяемая в соответствии с поручением на структурный продукт.
Количество поставляемого актива ( $Q$ в формулах)	Определяется в соответствии с поручением на структурный продукт.
Адрес и время публикации информации о значениях базисного актива	<a href="https://www.moex.com/ru/marketdata/#/group=4&amp;collection=3&amp;boardgroup=57&amp;data_type=history&amp;mode=groups&amp;sort=SHORTNAME&amp;order=asc">https://www.moex.com/ru/marketdata/#/group=4&amp;collection=3&amp;boardgroup=57&amp;data_type=history&amp;mode=groups&amp;sort=SHORTNAME&amp;order=asc</a> Цены базисных активов раскрываются Московской биржей с задержкой, равной 15 минутам.

## ФОРМУЛЫ ДЛЯ РАСЧЕТОВ

### Расчет суммы купона к выплате

$$C = \frac{S_{inv} \times r_c \times T}{365}$$

$S_{inv}$ ,  $r_c$ ,  $T$  определяются, как указано в перечне параметров; Выплата купона осуществляется вне зависимости от динамики цены базисного актива.

### Расчет суммы выплаты при погашении инструмента

Если  $P_1 < Strike$ , то Вам осуществляется поставка базисного актива в количестве  $Q$  по цене  $Strike$ .  
**В противном случае** - Вам возвращается сумма инвестирования  $S_{inv}$ .

$S_{inv}$ ,  $Q$ ,  $P_1$ ,  $strike$  определяются, как указано в перечне параметров;  
**Важно!** Обратите внимание, что при негативной динамике цены базисного актива Вы получаете физически ценные бумаги.

### Расчет суммы выплаты при досрочном расторжении по Вашей инициативе

Досрочное расторжение внебиржевого опционного договора не предусмотрено.

## 3. ЧТО ПРОИЗОЙДЕТ, ЕСЛИ СТОРОНА ПО ДОГОВОРУ НЕ СМОЖЕТ ИСПОЛНИТЬ СВОИ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА

Финансовый инструмент не защищен какими-либо способами обеспечения исполнения обязательств, схемами компенсаций или гарантий инвестору. В случае частичного или полного дефолта (банкротства) стороны по договору инвестор может частично или полностью потерять вложенные инвестиции.

## 4. КАК ДОЛГО РЕКОМЕНДУЕТСЯ ВЛАДЕТЬ ФИНАНСОВЫМ ИНСТРУМЕНТОМ, ВОЗМОЖЕН ЛИ ДОСРОЧНЫЙ ВОЗВРАТ ИНВЕСТИЦИЙ

Рекомендуемый период инвестирования в финансовый инструмент – ДО ДАТЫ ПОГАШЕНИЯ, указанной в Поручении на структурный продукт.

Финансовый инструмент не предусматривает досрочного расторжения.

## 5. КАКИЕ РИСКИ НЕСЕТ ДАННЫЙ ФИНАНСОВЫЙ ИНСТРУМЕНТ

Инвестициям в данный финансовый инструмент свойственны следующие ключевые риски:

- **Вы МОЖЕТЕ ЧАСТИЧНО ИЛИ ПОЛНОСТЬЮ ПОТЕРЯТЬ** инвестированные средства при неблагоприятном движении цены базисного актива;
- Досрочное расторжение опционного договора не предусмотрено;
- Если организатор торговли (биржа) прекратит торги базисным активом данного инструмента, **Вы МОЖЕТЕ ЧАСТИЧНО ИЛИ ПОЛНОСТЬЮ ПОТЕРЯТЬ** инвестированные средства.

Кроме того, инвестициям в данный финансовый инструмент свойственны иные риски, являющиеся общими (типовыми) для многих инвестиций: риск изменения политической ситуации, экономические, правовые, рыночные (ценовой, процентный, кредитный, операционный, риск ликвидности и др.) и иные риски.

С полным описанием рисков, характерных для инвестиций в финансовые инструменты, Вы можете ознакомиться в спецификации структурного продукта «Фиксированный купон».

## 6. КАКОВА СТРУКТУРА РАСХОДОВ

При покупке финансового инструмента «Фиксированный купон» вы вносите сумму инвестирования, которая является премией по опционному договору (размер суммы инвестирования указан в поручении на структурный продукт), а также оплачиваете вознаграждение брокера за заключение сделок с производными финансовыми инструментами на внебиржевом рынке в размере 10 рублей за сделку.

При создании финансового инструмента разработчик может закладывать в его стоимость до 2% за структурирование продукта. Данный расход учитывается при определении параметров инструмента.

## 7. КУДА ЖАЛОВАТЬСЯ

Если в связи с заключением данного договора Вы считаете, что Ваши права и/или интересы нарушены либо есть признаки возможного нарушения законодательства Российской Федерации, Вы можете подать жалобу о восстановлении или защите Ваших прав и интересов либо жалобу, содержащую сведения о возможном нарушении законодательства Российской Федерации одним из следующих способов:

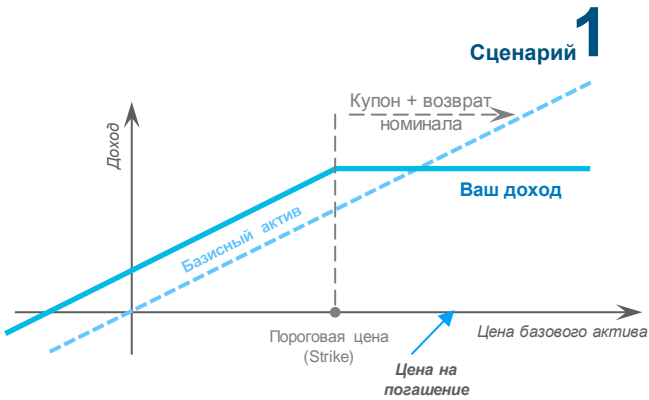
**АО «Открытие Брокер» (организация – разработчик данного паспорта финансового инструмента)**  
в письменном виде на бумажном носителе по адресу: 115114, г. Москва, ул. Летниковская, д.2, стр.4  
в электронном виде посредством Личного кабинета на сайте <https://open-broker.ru/>

**НАУФОР – (Национальная ассоциация участников фондового рынка - саморегулируемая организация, членом которой является разработчик данного паспорта финансового инструмента)**  
в письменном виде на бумажном носителе по адресу: 109004, г. Москва, ул. Земляной Вал, д.65, стр.2  
в электронном виде по адресу: <https://naufor.ru/lk/tree.asp?n=13710>

**Банк России (Центральный банк Российской Федерации)**  
в письменном виде на бумажном носителе по адресу: 107016, г. Москва, ул. Неглинная, д. 12  
в письменном виде лично через экспедицию по адресу: г. Москва, Сандуновский пер., д.3, стр.1  
по факсу: +7 495 6216465, +7 495 621 6288 (проверка прохождения факса +7 495 771 48 30)  
в электронном виде по адресу: <https://www.cbr.ru/Reception/Message/Register?messageType=Complaint>

# ВОЗМОЖНЫЕ СЦЕНАРИИ ВЫПЛАТ ПО ВАШЕМУ ДОГОВОРУ

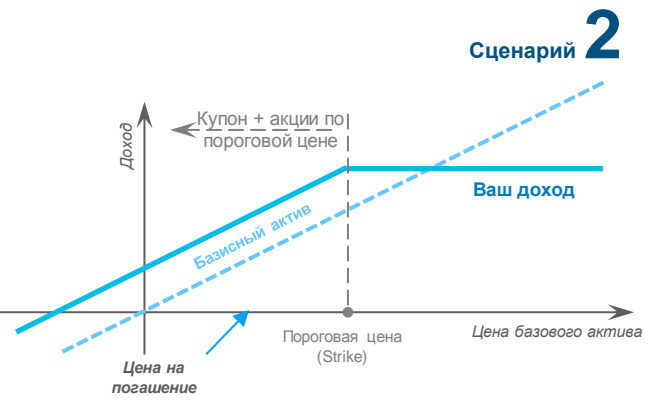
На погашение цена базисного актива **выше или равна** Пороговой цене (Strike)



Вы получаете:

- ✓ фиксированный купон
- ✓ возврат инвестированной суммы

На погашение цена базисного актива ниже Пороговой цены (Strike)



Вы получаете:

- ✓ фиксированный купон
- ✓ акции, купленные по пороговой цене (Strike) на инвестированную сумму

Ознакомьтесь повторно с данным документом и спецификацией финансового инструмента, если Вы не понимаете принцип его работы