

ПАСПОРТ ФИНАНСОВОГО ИНСТРУМЕНТА

ВНЕБИРЖЕВОЙ ОПЦИОННЫЙ ДОГОВОР

«С НЕПОЛНОЙ ЗАЩИТОЙ КАПИТАЛА»

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 «С неполной защитой капитала»
Категория инвестора, которой предназначен финансовый инструмент	Предназначен для всех категорий инвесторов (до 01.04.2022 договор не заключается брокером с физическими лицами – неквалифицированными инвесторами, а также при оказании таким инвесторам брокерских услуг по их поручениям и за их счет).

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@otkritieltld.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	4.10.2021

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 участия в потенциальном росте цены выбранного базисного актива пропорционально коэффициенту участия.
- Вне зависимости от динамики базового актива при погашении выплачивается защищенная часть инвестированной суммы в соответствии с выбранным КЗК (коэффициент защиты капитала), определенным в Поручении.
- Получение или неполучение дохода будет зависеть от фактического изменения цены Базисного актива к дате погашения относительно пороговой цены, определенной в Поручении.

ОСНОВНЫЕ ХАРАКТЕРИСТИКИ ИНСТРУМЕНТА

Стиль опциона	Американский. Вы имеете право требовать исполнения в любую дату в течение срока действия опционного договора. Сумма выплаты рассчитывается по формуле соответствующей спецификации.
Тип опциона	Определяет качественный характер участия в движении цены базисного актива: обозначение «CALL» указывает на участие в росте цены базисного актива; обозначение «PUT» указывает на участие в падении цены базисного актива; обозначение «SPREAD» указывает на то, что участие ограничено значением параметра Верхняя/Нижняя ограничительная цена.
Срок опционного договора	Определяется как срок между датой начала срока действия договора и датой погашения, определяемой в соответствии с поручением на структурный продукт.
Базисный (базовый) актив (активы)	Ценные бумаги. Конкретные ценные бумаги определяются в соответствии с поручением на структурный продукт.
Сумма инвестирования, премия (сумма номинала) и ее валюта (S _{инв} или Pr в формулах)	Сумма денежных средств, которую Вы инвестируете (уплачиваете) в соответствии с опционным договором. Определяется в соответствии с поручением на структурный продукт.
Дата погашения (исполнения) опциона	Дата, определяемая в соответствии с поручением на структурный продукт, по состоянию на которые определяется факт наступления условий, предусмотренных договором.
Пороговая цена (Strike)	Фиксированная цена базисного актива, с которой сравнивается Цена (значение) базисного актива при расчете Суммы выплаты.
Цена (значение) базисного актива (R)	Определяется способом, указанным в поручении. В случае проведения корпоративного действия, влекущего изменение номинальной стоимости базисного актива (дробление, консолидация, иное), R изменяется согласно ставке, указанной в уведомлении депозитария о корпоративном действии.
Коэффициент защиты капитала (КЗК)	Доля Суммы инвестирования, которая будет возвращена покупателю в дату погашения структурного продукта.
Коэффициент участия (КУ)	Доля изменения цены базисного актива, которую получает покупатель структурного продукта в качестве дохода.
Верхняя/Нижняя ограничительная цена (CapStrike/FloorStrike)	фиксированная цена базисного актива, с которой сравнивается Цена (значение) базисного актива при расчете Суммы выплаты, если в Типе опциона указано обозначение «SPREAD».
Адрес и время публикации информации о значениях базисного актива	Публикуются ежедневно (в зависимости от базисного актива): 1) https://www.moex.com/ru/marketdata/#/group=4&collection=3&boardgroup=57&data_type=current&mode=groups&sort=SHORTNAME&order=asc . 2) https://www.nasdaq.com/market-activity/quotes/real-time 3) https://www.nyse.com/market-data/historical 4) https://www.solactive.com/indices/#page-section-1

ФОРМУЛА ДЛЯ РАСЧЕТОВ

Расчет суммы выплаты

Где:

- $\Delta R = R - Strike$, если «CALL»
- $\Delta R = \min(R; CapStrike) - Strike$, если «CALL SPREAD»
- $\Delta R = Strike - R$, если «PUT»
- $\Delta R = Strike - \max(R; FloorStrike)$, если «PUT SPREAD»

$$S = S_{инв} \times \left(КЗК \times rFX_{взк} + \frac{\max(\Delta R; 0)}{Strike} \times КУ \times rFX_{впц} \right)$$

В случае направления требования о досрочном исполнении опциона сумма выплаты уменьшается на величину: $1,5 \times S_{инв} \times r_{цбр} \times \frac{N_d}{365}$, и если Тип опциона с обозначением «SPREAD», то КУ в целях расчета Суммы выплаты определяется как $0,5 \times КУ$, где КУ – указанный в поручении

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 его покупку.

Инвестор вправе потребовать досрочного исполнения финансового инструмента. Однако сумма, которую получит инвестор при досрочном исполнении, может быть МЕНЬШЕ СУММЫ ИНВЕСТИРОВАНИЯ.

5. КАКИЕ РИСКИ НЕСЕТ ДАННЫЙ ФИНАНСОВЫЙ ИНСТРУМЕНТ

Инвестициям в данный финансовый инструмент свойственны следующие ключевые риски:

- Доход по данному продукту Вы получите только при **БЛАГОПРИЯТНОМ ДВИЖЕНИИ ЦЕН** базисного актива (наступлении обстоятельств, предусмотренных договором);
- При **НЕБЛАГОПРИЯТНОМ ДВИЖЕНИИ ЦЕН** базисного актива Вы **МОЖЕТЕ ПОТЕРЯТЬ ЧАСТЬ ИНВЕСТИРОВАННЫХ СРЕДСТВ** в зависимости от коэффициента защиты капитала;
- При **ДОСРОЧНОМ РАСТОРЖЕНИИ** договора по Вашей инициативе Вы **МОЖЕТЕ ПОТЕРЯТЬ ЧАСТЬ ИНВЕСТИРОВАННЫХ СРЕДСТВ**;
- Если организатор торговли (биржа) прекратит торги данным базисным активом, Вы **МОЖЕТЕ ПОТЕРЯТЬ ЧАСТЬ ИНВЕСТИРОВАННЫХ СРЕДСТВ** в зависимости от коэффициента защиты капитала.

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 «С защитой капитала».

6. КАКОВА СТРУКТУРА РАСХОДОВ

При покупке финансового инструмента «С неполной защитой капитала» 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% годовых 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: 129090, г. Москва, 1-й Коптевский пер., д. 18, стр.1

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

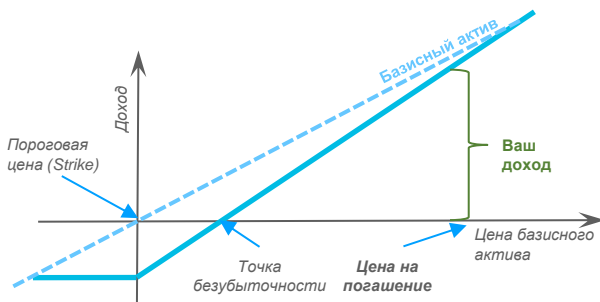
по факсу: +7 495 6216465, +7 495 621 6288 (проверка прохождения факса +7 495 771 48 30)

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** Пороговой цены (Strike)

Сценарий 1



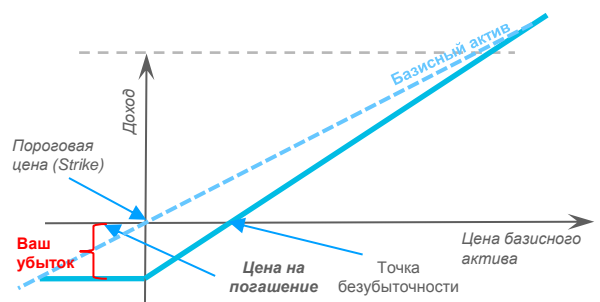
Вы получаете:

- ✓ доход от роста базисного актива;
- ✓ защищенную часть инвестированной суммы в соответствии с коэффициентом защиты капитала (КЗК).

ВАЖНО! Доход рассчитывается с учетом Коэффициента участия. Доход от роста базисного актива может не компенсировать взятый частичный риск.

На погашение цена базисного актива **ниже** Пороговой цены (Strike)

Сценарий 2



Вы получаете:

- ✓ защищенную часть инвестированной суммы в соответствии с коэффициентом защиты капитала (КЗК).

ВАЖНО! Размер потенциального убытка определяется коэффициентом защиты капитала.

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