**НАСТОЯЩИЙ ДОГОВОР О ПОРЯДКЕ УПЛАТЫ ПЛАВАЮЩИХ МАРЖЕВЫХ СУММ № \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_** (далее - "***Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм***") заключен "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 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 доверенности \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_, с одной стороны, и
	2. лицом, заключившим Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм путем присоединения (далее - "***Сторона Б***"), с другой стороны,

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

**Принимая во внимание, что**

* + - 1. Стороны заключили или заключат в дату Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм Генеральное соглашение о срочных сделках на финансовых рынках № \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_от "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года (далее - "***Генеральное соглашение***");
			2. Стороны заключили и/или намереваются заключить Сделки, как они определены в Генеральном соглашении, в соответствии с Генеральным соглашением,

Стороны договорились о следующем:

* 1. К отношениям Сторон в связи с уплатой Плавающих маржевых сумм применяются положения Стандартных условий договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм 2011 г., разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией "Национальная ассоциация участников фондового рынка" (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованных в сети Интернет на их страницах (далее - "***Стандартные условия***"), с учетом изменений и дополнений, установленных в Договоре о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.
	2. Термины, используемые с заглавной буквы в Договоре о порядке уплаты плавающих маржевых сумм и не определенные в Договоре о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, имеют значение, указанное в статье 9 Стандартных условий (с учетом изменений, внесенных Договором о порядке уплаты плавающих маржевых сумм), Генеральном соглашении и Стандартной документации.
	3. Для целей Генерального соглашения, в том числе для целей пункта 1.7 статьи 1, пункта 2.2 статьи 2 и статьи 6 Примерных условий договора, настоящий Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм представляет собой Сделку, а для целей пункта 2.7 статьи 2 Примерных условий договора настоящий экземпляр Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм представляет собой Подтверждение.
	4. Заключение Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм осуществляется путем присоединения Стороны Б к Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм в соответствии со статьей 428 Гражданского кодекса Российской Федерации при условии, что до даты (или в дату) заключения Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм между Сторонами также было заключено Генеральное соглашение.
	5. Присоединение Стороны Б к Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм осуществляется путем предоставления Стороной Б Стороне А заявления о присоединении к Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм по форме Приложения 1 к Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм на бумажном носителе (в двух экземплярах), подписанного собственноручной подписью уполномоченного представителя Стороны Б и заверенного оттиском печати Стороны Б (при наличии), или путем направления в ПО «Альфа-Бизнес Онлайн» Стороной Б Стороне А заявления о присоединении, подписанного в соответствии с правилами взаимодействия участников ПО «Альфа-Бизнес Онлайн» с последующим предоставлением заявления на бумажном носителе по требованию Стороны А (в случае предъявления такого требования) не позднее чем в течение двух Рабочих дней после предъявления требования.
	6. Настоящий Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм распространяется в электронной форме путем копирования файла, содержащего электронный образ Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм в текстовом формате, находящегося на официальном сайте Стороны А в сети Интернет по адресу https://alfabank.ru/corporate/rko/docstariffs/?tab=investproduct.
	7. В соответствии с пунктом 1 статьи 450 Гражданского кодекса Российской Федерации Стороны договорились, что Сторона А имеет право в одностороннем порядке вносить изменения и (или) дополнения в Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм. При этом изменения и (или) дополнения, внесенные Стороной А в Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, становятся обязательными для Сторон в дату введения редакции Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм в действие, установленную Стороной А. Сторона А обязана не менее чем за 2 (два) календарных дня до даты введения новой редакции Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм в действие опубликовать новую редакцию Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм на официальном сайте Стороны А в сети Интернет по адресу https://alfabank.ru/corporate/rko/docstariffs/?tab=investproduct.
	8. Ответственность за получение сведений о новой редакции Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, о внесенных изменениях и (или) дополнениях несет Сторона Б. Получить необходимые сведения Сторона Б может самостоятельно обратившись к Стороне А, в т.ч. на официальный сайт Стороны А в сети Интернет по адресу https://alfabank.ru/corporate/rko/docstariffs/?tab=investproduct.
	9. Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм является договором, предусматривающим обязанность по внесению (передаче в собственность) одной из сторон договора в пользу другой стороны (или обеими сторонами, если применимо) обеспечительного платежа, предусмотренного ст. 51.7 Федерального закона от 22.04.1996 г. №39-ФЗ «О рынке ценных бумаг», в целях обеспечения исполнения обязательств из договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора)», в соответствии со статьей 51.5 Федерального закона от 22.04.1996 г. №39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» и статьи 4.1 Федерального закона от 26.10.2002 № 127-ФЗ «О несостоятельности (банкротстве)».
1. Специальные договоренности Сторон
	1. ***Плавающая маржевая сумма и Общая сумма маржевых обязательств***

(а) Плавающая маржевая сумма рассчитывается в соответствии со статьей 2 Стандартных условий с учетом следующих положений:

(А) пункт 2.2 статьи 2 Стандартных условий изложить в следующей редакции:

* 1. "Если на Дату оценки (а) Плавающая маржевая сумма, рассчитанная в соответствии с пунктом 2.1 настоящей статьи 2, составляет положительное число, равное Минимальной сумме платежа, установленной для Плательщика плавающих маржевых сумм, или превышающее такую Минимальную сумму платежа, и (б) такая Плавающая маржевая сумма, выраженная в процентах от Нетто-обязательства по портфелю, превышает Порог переоценки по портфелю, Получатель плавающих маржевых сумм вправе в эту Дату оценки или Рабочий день, следующий за Датой оценки, потребовать от Плательщика плавающих маржевых сумм уплаты Плавающей маржевой суммы (с учетом округления в соответствии с пунктом 2.5 статьи 2 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм), посредством направления Требования об уплате маржевых сумм.

С учетом статей 3 и 4 Стандартных условий, Плательщик плавающих маржевых сумм обязан, получив Требование об уплате маржевых сумм от Получателя плавающих маржевых сумм, уплатить ему Плавающую маржевую сумму в размере, не менее указанного в Требовании об уплате маржевых сумм, согласно настоящему пункту 2.2 выше, в любой Приемлемой валюте или нескольких Приемлемых валютах. В соответствии с пунктом 6.12 Генерального соглашения, Плавающая маржевая сумма в соответствии с Требованием об уплате маржевых сумм может быть списана Стороной А без дополнительного распоряжения Плательщика плавающих маржевых сумм со счетов Плательщика плавающих маржевых сумм, в отношении которых Стороне А предоставлено право списывать денежные средства без дополнительного распоряжения Плательщика плавающих маржевых сумм.

При уплате Плавающей маржевой суммы Получатель плавающих маржевых сумм вправе (но не обязан) направить Плательщику плавающих маржевых сумм Уведомление касательно уплаты маржевых сумм. Ненаправление Получателем плавающих маржевых сумм Плательщику плавающих маржевых Уведомления касательно уплаты маржевых сумм не отменяет и не изменяет обязательства Плательщика плавающих маржевых сумм по уплате Плавающей маржевой суммы согласно настоящему пункту 2.2 выше.

При увеличении Плавающей маржевой суммы на Дату оценки по сравнению с Плавающей маржевой суммой, рассчитанной Агентом по расчету плавающих маржевых сумм по состоянию на более раннее Время оценки в Дату оценки, в отношении которой Получатель плавающих маржевых сумм направил Плательщику плавающих маржевых сумм Требование об уплате маржевых сумм, Получатель плавающих маржевых сумм вправе в эту Дату оценки или Рабочий день, следующей за Датой оценки, (а)  направить Плательщику плавающих маржевых сумм дополнительное Требование об уплате маржевых сумм или (б) отменить ранее направленное Требование об уплате маржевых сумм и направить новое Требование об уплате маржевых сумм. Такое дополнительное Требование об уплате маржевых сумм или новое Требование об уплате маржевых сумм подлежат исполнению Плательщиком плавающих маржевых сумм в соответствии с общими положениями Стандартных условий и Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм об исполнении Требования об уплате маржевых сумм, направленного Получателем плавающих маржевых сумм Плательщику плавающих маржевых сумм (в том числе в соответствии с настоящим пунктом 2.2 выше и пунктом 3.1 статьи 3 Стандартных условий).";

При получении Требования об уплате маржевых сумм Плательщик плавающих маржевых сумм вместо уплаты Плавающей маржевой суммы в размере, указанном в Требовании об уплате маржевых сумм, или какой-либо ее части имеет право предложить Получателю плавающих маржевых сумм:

(a) заключить одну или несколько Сделок; и/или

(b) досрочно прекратить обязательства по одной или нескольким Сделкам в соответствии с пунктом 6.16 Генерального соглашения,

в результате заключения (прекращения) которых Плавающая маржевая сумма при пересчете на ту же Дату оценки уменьшилась бы или стала бы равной нулю.

В случае заключения (прекращения) Сделок в соответствии с пунктами (а) – (b) выше, обязательства Плательщика плавающих маржевых сумм по уплате Плавающей маржевой суммы в размере, указанном в Требовании об уплате маржевых сумм, прекращаются полностью (если в результате заключения (прекращения) соответствующих сделок Плавающая маржевая сумма при пересчете на ту же Дату оценки была бы равной нулю) или в части, на которую Плавающая маржевая сумма при пересчете на ту же Дату оценки стала бы меньше (при этом обязательство по уплате оставшейся части Плавающей маржевой суммы сохраняется). ";

(Б) пункт 2.3 статьи 2 Стандартных условий изложить в следующей редакции:

"Если на Дату оценки (а) Плавающая маржевая сумма, рассчитанная в соответствии с пунктом 2.1 настоящей статьи 2, составляет отрицательное число, абсолютная величина которого равна Минимальной сумме платежа, установленной для Получателя плавающих маржевых сумм, или превышает такую Минимальную сумму платежа, и (б) такая абсолютная величина Плавающей маржевой суммы, выраженная в процентах от Нетто-обязательства по портфелю, превышает Порог переоценки по портфелю, Плательщик плавающих маржевых сумм вправе в Дату оценки или в Рабочий день, следующий за Датой оценки, направить Получателю плавающих маржевых сумм Требование об уплате маржевых сумм на сумму в размере, не превышающем (А) абсолютной величины Плавающей маржевой суммы (с учетом округления в соответствии с пунктом 2.5 статьи 2 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм); (Б) для каждой Приемлемой валюты - Плавающей маржевой суммы, уплаченной в такой Приемлемой валюте в соответствии с пунктом 2.2 статьи 2 Стандартных условий; и (В) сумму Накопленных маржевых сумм.

Требование об уплате маржевых сумм должно содержать (А) информацию о Приемлемой валюте, в отношении которой предъявлено соответствующее Требование об уплате маржевых сумм, и (Б) указание на сумму, в отношении которой предъявлено Требование об уплате маржевых сумм, в Приемлемой валюте и российских рублях. Требование об уплате маржевых сумм может относиться только к одной Приемлемой валюте, при этом Плательщик плавающих маржевых сумм имеет право в Дату оценки направить несколько Требований об уплате маржевых сумм.

Требование об уплате маржевых сумм направляется Плательщиком плавающих маржевых сумм либо по электронным каналам связи и подписывается электронной цифровой подписью Плательщика плавающих маржевых сумм либо в ПО «Альфа-Бизнес Онлайн. При направлении Требования об уплате маржевых сумм по электронным каналам связи либо посредством ПО «Альфа-Бизнес Онлайн» по требованию Стороны А Сторона Б не позднее чем в течение двух Рабочих дней после предъявления требования Стороной А обязана направить оригинал Требования об уплате маржевых сумм на бумажном носителе, подписанного уполномоченным лицом Стороны Б и заверенного печатью Стороны Б (при наличии)».

Положения настоящего пункта 2.3 выше не подлежат применению в случае Нарушения обязательства, Технического дефолта, Банкротства, Потенциального банкротства или Иного основания досрочного прекращения, в каждом случае, по которым Плательщик плавающих маржевых сумм является Нарушившей стороной или Затронутой стороной (или одной из Затронутых сторон).

С учетом статей 3 и 4 Стандартных условий, Получатель плавающих маржевых сумм вправе (но не обязан), получив Требование об уплате маржевых сумм от Плательщика плавающих маржевых сумм, уплатить ему Плавающую маржевую сумму в размере, указанном в первом абзаце настоящего пункта 2.3, согласно настоящему пункту 2.3 выше.

Без ущерба для положений настоящего пункта 2.3 выше, Получатель плавающих маржевых сумм вправе (но не обязан) по своему усмотрению уплатить Плательщику плавающих маржевых сумм Плавающую маржевую сумму в размере, указанном в первом абзаце настоящего пункта 2.3, до получения Требования об уплате маржевых сумм от Плательщика плавающих маржевых сумм.

При уплате Плавающей маржевой суммы Получатель плавающих маржевых сумм направляет Плательщику плавающих маржевых сумм Уведомление касательно уплаты маржевых сумм, которое при получении должно быть подписано Плательщиком плавающих маржевых сумм и направлено Получателю плавающих маржевых сумм в тот же день.

Накопленные маржевые суммы уменьшаются на соответствующую сумму после каждой такой уплаты Плавающей маржевой суммы.";

(В) пункт 2.4 статьи 2 Стандартных условий не подлежит применению.

(б) Общая сумма маржевых обязательств рассчитывается в соответствии со статьей 9 Стандартных условий.

* 1. ***Первоначальные маржевые суммы***

(а) "Первоначальная маржевая сумма" означает применительно к Стороне А: 0 (ноль).

(б) "Первоначальная маржевая сумма" означает применительно к Стороне Б: сумма Первоначальных маржевых сумм по позиции в отношении всех Позиций.

* 1. ***Маржевая пороговая сумма***

(а) "Маржевая пороговая сумма" означает применительно к Стороне А: бесконечность.

(б) "Маржевая пороговая сумма" означает применительно к Стороне Б: 0 (ноль) или, в случае заключения Сделок соответствии с п. 2.1-2.3 Генерального соглашения сумма, указанная на Дату оценки в качестве Маржевой пороговой суммы (лимита под маржевые обязательства) в личном кабинете Стороны Б в ПО «Альфа-Бизнес Онлайн». При этом Сторона Б соглашается, что:

(А) в отношении Маржевой пороговой суммы могут быть установлены условия ее включения в расчет Общей суммы маржевых обязательств (такие как (i) Базовый актив или Валютная пара; (ii) тип Сделок; (iii) срок исполнения обязательств по Сделкам; (iv) направленность обязательств по Сделкам; (v) иные условия), подлежащие указанию в личном кабинете Стороны Б в ПО «Альфа-Бизнес Онлайн», и в таком случае Маржевая пороговая сумма будет уменьшать не всю, а только ту часть Общей суммы маржевых обязательств, которая относится к Сделкам, в отношении которых установлена Маржевая пороговая сумма;

(Б) Сторона А имеет право время от времени изменять значение Маржевой пороговой суммы и условия ее включения в расчет Общей суммы маржевых обязательств при условии уведомления Стороны Б путем размещения соответствующей информации в личном кабинете Стороны Б в ПО «Альфа-Бизнес Онлайн» не позднее, чем за один Рабочий день до Даты оценки, с которой начинает применяться новое значение Маржевой пороговой суммы.

***Минимальная сумма платежа***

(а) "Минимальная сумма платежа" означает применительно к Стороне А: 0 (ноль).

(б) "Минимальная сумма платежа" означает применительно к Стороне Б: 0 (ноль).

* 1. ***Округление.*** Для определения наличия обязательства по уплате Плавающей маржевой суммы в пользу Получателя плавающих маржевых сумм Плавающая маржевая сумма подлежит округлению в сторону уменьшения до ближайшего целого числа, кратного 100 (сто). При уплате Плавающей маржевой суммы в пользу Плательщика плавающих маржевых сумм Плавающая маржевая сумма не округляется.
	2. ***Оценка и значения времени***

(а) "Агент по расчету плавающих маржевых сумм" означает Сторону А для целей любых положений Стандартных условий и Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

(б) "Дата оценки" означает каждый Рабочий день.

(в) "Время оценки" означает любое время по усмотрению Агента по расчету плавающих маржевых сумм в период с 9:00 до 19:00 часов по московскому времени в Дату оценки или в день, когда осуществляются какие-либо расчеты (калькуляция).

(г) "Время уведомления" означает 19:00 часов по московскому времени в любой Рабочий день.

(д) Второе предложение в пункте 3.2 Стандартных условий изложить в следующей редакции:

"Без ущерба для пункта 4.1 статьи 4 Стандартных условий, Агент по расчету плавающих маржевых сумм обязан, по требованию любой Стороны (или другой Стороны, если Агентом по расчету плавающих маржевых сумм является одна из Сторон), уведомить Стороны (или другую Сторону, если Агентом по расчету плавающих маржевых сумм является одна из Сторон) о произведенном им расчете (калькуляции) не позднее Времени уведомления в Дату оценки.".

* 1. ***Порядок урегулирования разногласий***

(а) "Срок урегулирования разногласий" означает в отношении Требований об уплате маржевых сумм, полученных Плательщиком плавающих маржевых сумм с 9:00 до 14:00 по московскому времени - период времени, оканчивающийся в 16:00 по московскому времени в тот же Рабочий день; в отношении Требований об уплате маржевых сумм, полученных Плательщиком плавающих маржевых сумм с 14:00 до 19:00 по московскому времени – период времени, оканчивающийся в 11:00 по московскому времени на следующий Рабочий день.

(б) ***Альтернативный порядок урегулирования разногласий.*** Статья 4 Стандартных условий применяется.

(в) Пункт 4.1 статьи 4 Стандартных условий изложить в следующей редакции:

"4.1. Если какая-либо из Сторон (далее – «***Оспаривающая сторона***») обоснованно оспаривает расчет (калькуляцию) Плавающей маржевой суммы, произведенный Агентом по расчету плавающих маржевых сумм для целей статьи 2 Стандартных условий, то:

(а) Оспаривающая сторона обязана обязана уведомить об этом другую Сторону и Агента по расчету плавающих маржевых сумм (если эта другая Сторона не является Агентом по расчету плавающих маржевых сумм) не позднее 15:00 часов по московскому времени в тот же Рабочий день (в отношении Требований об уплате маржевых сумм, полученных Плательщиком плавающих маржевых сумм с 9:00 до 14:00 по московскому времени) или 10:00 часов по московскому времени на следующий Рабочий день (в отношении Требований об уплате маржевых сумм, полученных Плательщиком плавающих маржевых сумм с 14:00 до 19:00 по московскому времени);

(б) при этом Сторона-плательщик обязана перевести Плавающую маржевую сумму в неоспариваемом размере другой Стороне не позднее даты, в которую должна быть уплачена Плавающая маржевая сумма в соответствии со статьей 3 Стандартных условий (без учета ссылки в ней на статью 4 Стандартных условий);

(в) Стороны обязаны предпринять попытку урегулировать возникшие разногласия путем переговоров;

(г) если разногласия не будут устранены до истечения Срока урегулирования разногласий, то, если пунктом 2.2 статьи 2 не предусмотрено иное, Агент по расчету плавающих маржевых сумм обязан пересчитать Оценочную стоимость сделок по состоянию на Дату пересчета следующим образом:

1. использовать для целей пересчета любые расчеты той части Оценочной стоимости сделок, в отношении которой у Сторон отсутствуют разногласия;
2. применительно к той части Оценочной стоимости сделок, в отношении которой у Сторон имеются разногласия, запросить у третьих лиц четыре текущие котировки, содержащие цены спроса и предложения, используемые для расчета Ликвидационной суммы, и рассчитать среднее арифметическое значение указанных котировок,

при этом:

(1) если применительно к Сделке будет получено менее четырех котировок, то полученные в меньшем количестве котировки также могут быть использованы для расчетов;

(2) если применительно к Сделке не получено ни одной котировки, используется первоначальный расчет Агента по расчету плавающих маржевых сумм;

(3) вместо котировок третьих лиц Агент по расчету плавающих маржевых сумм вправе использовать информацию, отражающуюся в системах «Reuters-Dealing» и «Bloomberg» (при этом распечатка информации о ценах спроса и предложения, используемых для расчета Ликвидационной суммы, из систем «Reuters-Dealing» и «Bloomberg» является достаточным подтверждением такой цены), и ссылки на котировки в подпункте (Б), (Б)(1) и (Б)(2) подпункта (г) выше должны толковаться соответствующим образом.

Агент по расчету плавающих маржевых сумм обязан уведомить Стороны (или другую Сторону, если Агентом по расчету плавающих маржевых сумм является одна из Сторон) о результатах пересчета, произведенного в соответствии с настоящим пунктом 4.1, в возможно короткий срок после его завершения.

После уведомления Агента по расчету плавающих маржевых сумм о результатах пересчета или достижения соглашения об урегулировании разногласий в соответствии с подпунктом (в) настоящего пункта 4.1, Сторона, с которой причитается платеж, обязана по получении соответствующего требования от другой Стороны произвести такой платеж не позднее дня получения такого требования."

(г) Во втором абзаце пункта 4.2 статьи 4 Стандартных условий слова "подпункт (а)" заменить словами "подпункт (Б) подпункта (а)".

* 1. ***Проценты***

(а) ***Процентная ставка.*** Источник определения Процентной ставки, а также размер дисконта (если применимо) применительно к каждой Приемлемой валюте, определяется Получателем плавающих маржевых сумм, в том числе путем указания соответствующей информации в личном кабинете Плательщика плавающих маржевых сумм в ПО «Альфа-Бизнес Онлайн».

(б) ***Перечисление Процентов.*** Перечисление Процентов не осуществляется. Проценты подлежат капитализации в Рабочие дни на остаток Накопленных маржевых сумм в соответствующей Приемлемой валюте, по состоянию на конец предшествующего Рабочего дня.

(в) ***Пересмотр Процентной ставки.*** Получатель плавающих маржевых сумм вправе в любой момент пересматривать размер Процентной ставки, применимой к Накопленным маржевым суммам, состоящим из какой-либо Приемлемой валюты. Первоначальный размер Процентной ставки, применимой к Накопленным маржевым суммам, состоящим из соответствующей Приемлемой валюты, указывается в первом Уведомлении касательно уплаты маржевых сумм, направленном после уплаты Плавающей маржевой суммы в такой Приемлемой валюте.

В случае принятия решения об изменении размера Процентной ставки Получатель плавающих маржевых сумм обязуется составить и направить Плательщику плавающих маржевых сумм не позднее даты, с которой подлежит применению пересмотренная Процентная ставка, Уведомление о пересмотре процентной ставки. Не позднее Рабочего дня, следующего за датой получения Плательщиком плавающих маржевых сумм соответствующего Уведомления о пересмотре процентной ставки, Плательщик плавающих маржевых сумм обязан подписать такое Уведомление о пересмотре процентной ставки и направить его Получателю плавающих маржевых сумм.

Без ущерба для положений настоящего подпункта (г) выше, данные о пересмотренной Процентной ставке, вместо Уведомления о пересмотре процентной ставки, могут быть указаны в Уведомлении касательно уплаты маржевых сумм, направляемом в дату принятия Получателем плавающих маржевых сумм решения о пересмотре Процентной ставки, и в таком случае Получатель плавающих маржевых сумм не будет обязан направлять Плательщику плавающих маржевых сумм соответствующее Уведомление о пересмотре процентной ставки.

* 1. ***Реквизиты для исполнения обязательств***

Обязательства Стороны по осуществлению платежей по Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм исполняются с использованием следующих счетов:

(а) в части обязательств Плательщика плавающих маржевых сумм по уплате Плавающих маржевых сумм - счета, реквизиты которых дополнительно предоставлены Получателем плавающих маржевых сумм Плательщику плавающих маржевых сумм путем указания соответствующей информации в личном кабинете Плательщика плавающих маржевых сумм в ПО «Альфа-Бизнес Онлайн».

(б) в части обязательств Получателя плавающих маржевых сумм по уплате Плавающих маржевых сумм – расчетного счета Плательщика плавающих маржевых сумм в соответствующей валюте, реквизиты которого указаны в заявлении о присоединении к Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, или иного счета, реквизиты которого дополнительно предоставлены Плательщиком плавающих маржевых сумм Получателю плавающих маржевых сумм (в том числе, путем указания соответствующей информации в личном кабинете Плательщика плавающих маржевых сумм в ПО «Альфа-Бизнес Онлайн»).

В случае отсутствия у Стороны информации о соответствующих реквизитах другой Стороны, она обязана незамедлительно запросить их у другой Стороны.

ИЛИ

[Реквизиты Стороны А:

[•][[1]](#footnote-2)

Реквизиты Стороны Б:

[•][[2]](#footnote-3)]

* 1. ***Прочие положения***
		1. *Требования и уведомления*

Требование об уплате маржевых сумм, а также любые уведомления, направляемые Сторонами по Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, направляются Стороной А по реквизитам Стороны Б, указанным в заявлении Стороны Б о присоединении к Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, а Стороной Б по реквизитам Стороны А, указанным в статье 5.1 Генерального соглашения.

* + 1. *Валюта платежей*

Плавающие маржевые суммы, Дополнительные маржевые суммы, а также любые суммы в счет исполнения будущих обязательств по Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм и все иные суммы, подлежащие уплате в соответствии с Договором о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, уплачиваются Плательщиком плавающих маржевых сумм в одной или нескольких Приемлемых валютах (вне зависимости от того, что сумма, подлежащая уплате в соответствии с Требованием об уплате маржевых сумм, может быть указана только в российских рублях).

Уплата Плавающих маржевых сумм в соответствии с пунктом 2.3 статьи 2 Стандартных условий осуществляется (А) в той же Приемлемой валюте и (Б) в пределах суммы, полученной Получателем плавающих маржевых сумм в соответствующей Приемлемой валюте при уплате Плавающих маржевых сумм согласно пункту 2.2 статьи 2 Стандартных условий.

* + 1. *Расчет и уплата Плавающих маржевых сумм*

Расчет Общей суммы маржевых обязательств, сумм Процентов, Первоначальной маржевой суммы, Маржевой пороговой суммы, Минимальной суммы платежа, а также любых иных сумм по Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм осуществляется в российских рублях.

Плавающие маржевые суммы, уплаченные в валюте отличной от российских рублей, для целей исполнения обязательств по уплате Плавающих маржевых сумм Плательщиком плавающих маржевых сумм подлежат пересчету в российские рубли по обменному курсу такой валюты в российские рубли, установленному Агентом по расчету плавающих маржевых сумм на момент исполнения Плательщиком плавающих маржевых сумм обязательства по уплате Плавающей маржевой суммы.

Любые иные суммы, уплаченные или выраженные в валюте отличной от российских рублей, для целей расчетов подлежат пересчету в российские рубли по обменному курсу такой валюты в российские рубли на Дату оценки, определенному Агентом по расчету плавающих маржевых сумм, действующим добросовестно и разумно.

* + 1. *Досрочное прекращение обязательств по Сделкам*

В статье 6 Стандартных условий слова "может не быть Нарушившей стороной" дополнить словами "или Затронутой стороной".

* + 1. *Условия Сделок*

(А) Для целей Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм Стороны должны согласовать следующие дополнительные условия Сделки (в противном случае такая Сделка не учитывается для целей определения Оценочной стоимости сделок, что, во избежание сомнений, не влечет недействительность такой Сделки или признание ее незаключенной или иным образом не влияет на действительность или возможность судебной защиты такой Сделки):

(1) Коэффициент первоначальной маржевой суммы;

(2) Порог переоценки (с учетом положений подпункта (Б) настоящего подпункта (д));

(3) Уровень прекращения;

(4) Базовый актив;

(5) Количество базового актива.

(Б) Если Стороны не указали в Подтверждении Порог переоценки, то Порог переоценки для соответствующей Сделки равен 0 (ноль).

(В) Для целей применения положений Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм о Дополнительной маржевой сумме, Стороны должны согласовать Дополнительную маржевую сумму применительно к соответствующей Сделке.

* + 1. *Дополнительная маржевая сумма*

(А) Если в Подтверждении Стороны указали Дополнительную маржевую сумму, Получатель плавающих маржевых сумм имеет право в любой момент времени, пока есть хотя бы одна Сделка, в отношении которой в Подтверждении указана Дополнительная маржевая сумма, посредством направления Требования об уплате маржевых сумм потребовать от Плательщика плавающих маржевых сумм по своему усмотрению (и без указания конкретной Сделки или Сделок, в связи с которыми требуется уплата Дополнительной маржевой суммы) уплаты Дополнительной маржевой суммы в размере, не превышающем Общий лимит дополнительных маржевых сумм.

(Б) Плательщик плавающих маржевых сумм обязан исполнить Требование об уплате маржевых сумм в отношении Дополнительной маржевой суммы в день предъявления такого Требования об уплате маржевых сумм либо в непосредственно следующий за таким днем Рабочий день.

(В) Обязательство по уплате Дополнительной маржевой суммы является самостоятельным обязательством Плательщика плавающих маржевых сумм и не зависит от обязательства по уплате Плавающей маржевой суммы.

(Г) При уплате Дополнительной маржевой суммы Получатель плавающих маржевых сумм направляет Плательщику плавающих маржевых сумм Уведомление касательно уплаты маржевых сумм.

(Д) Уплата Дополнительной маржевой суммы Получателем плавающих маржевых сумм Плательщику плавающих маржевых сумм осуществляется (1) в размере суммы превышения суммы фактически полученных средств, составляющих Дополнительную маржевую сумму, над Общим лимитом дополнительных маржевых сумм или (2) по усмотрению Получателя плавающих маржевых сумм в любом размере в пределах полученных средств, составляющих Дополнительные маржевые суммы.

(Ж) К отношениям по уплате Дополнительной маржевой суммы применяются положения об уплате Плавающей маржевой суммы, если иное не определено в Договоре о порядке уплаты плавающих маржевых сумм или не вытекает из существа отношений.

* + 1. *Изменение Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм*

Изменение Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм осуществляется в соответствии с пунктом 1.7 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

* + 1. *Определения в Стандартных условиях*

(А) В пункте 9.1 статьи 9 Стандартных условий определение "Дата платежа" изложить в следующей редакции:

"***Дата платежа*** означает применительно к Дате оценки в отношении уплаты Плавающей маржевой суммы согласно пунктам 2.2 и 2.3 статьи 2 Стандартных условий:

(a) в отношении Требования об уплате маржевых сумм, полученного Плательщиком плавающих маржевых сумм или Получателем плавающих маржевых сумм с 9:00 до 14:00 по московскому времени в Дату оценки – не позднее 19:00 по московскому времени текущего Рабочего дня;

(b) в отношении Требования об уплате маржевых сумм, полученного Плательщиком плавающих маржевых сумм или Получателем плавающих маржевых сумм с 14:00 до 19:00 по московскому времени в Дату оценки – не позднее 12:00 по московскому времени в следующий Рабочий день.".

(Б) В пункте 9.1 статьи 9 Стандартных условий определение "Накопленные маржевые суммы" изложить в следующей редакции:

"**Накопленные маржевые суммы** означает в Дату оценки:

(c) Плавающие маржевые суммы, в совокупности ранее уплаченные Получателю плавающих маржевых сумм в соответствии с Договором о порядке уплаты плавающих маржевых сумм;

(d) любые суммы, перечисленные Плательщиком плавающих маржевых сумм Получателю плавающих маржевых сумм в добровольном порядке в счет исполнения будущих обязательств по уплате Плавающих маржевых сумм;

(e) любые суммы, перечисленные Плательщиком плавающих маржевых сумм Получателю плавающих маржевых сумм сверх Плавающей маржевой суммы, подлежащей уплате в Дату платежа в соответствии с Требованием об уплате маржевых сумм, за вычетом Плавающих маржевых сумм, уплаченных Получателем плавающих маржевых сумм в соответствии с пунктом 2.3 статьи 2 Стандартных условий. Проценты, начисленные, но не переведенные в соответствии со статьей 5 Стандартных условий (или не капитализированные в соответствии с Договором о порядке уплаты плавающих маржевых сумм), добавляются к Накопленным маржевым суммам.

Исключительно для целей расчета Плавающей маржевой суммы в соответствии с пунктом 2.1 статьи 2 Стандартных условий Накопленные маржевые суммы не включают Дополнительные маржевые суммы, уплаченные Сторонами в соответствии с Договором о порядке уплаты плавающих маржевых сумм. Во избежание сомнений, для целей иных положений Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм (в том числе, для целей положений о Процентах и статьи 6 Стандартных условий) Накопленные маржевые суммы также включают в себя Дополнительные маржевые суммы.".

(В) В определении "Оценочная стоимость сделок" в пункте 9.1 статьи 9 Стандартных условий слова "с использованием его оценок по среднему значению между ценой спроса и ценой предложения сумм" заменить словами "с использованием его оценок цен спроса и цен предложения сумм".

(Г) В пункте 9.1 статьи 9 Стандартных условий определение «Оценочная стоимость сделок» дополнить следующими положениями в конце определения:

«При этом:

(А) Конверсионные сделки (Сделки спот) с Датой платежа, совпадающей с Датой сделки исключаются из расчета Оценочной стоимости сделок;

(Б) Сделки, в отношении которых Сторонами было достигнуто соглашение о досрочном прекращении обязательств в соответствии с пунктом 6.16 Генерального соглашения, исключаются из расчета Оценочной стоимости сделок с даты заключения соглашения о прекращении в отношении соответствующей Сделки;

(В) Сделки, не соответствующие условиям пункта 2.10(д) Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, исключаются из расчета Оценочной стоимости сделок;

(Г) обязательства по Сделкам валютный своп с Датой первоначального платежа, совпадающей с Датой сделки, приходящиеся на Дату первоначального платежа, исключаются из расчета Оценочной стоимости сделок».

(Д) В пункте 9.1 статьи 9 Стандартных условий определение "Плательщик плавающих маржевых сумм" изложить в следующей редакции:

"***Плательщик плавающих маржевых сумм означает Сторону Б".***

(Е) В пункте 9.1 статьи 9 Стандартных условий определение "Получатель плавающих маржевых сумм" изложить в следующей редакции:

"***Получатель плавающих маржевых сумм*** означает Сторону А.".

(Ж) В пункте 9.1 статьи 9 Стандартных условий определение "Процентный период" изложить в следующей редакции:

"***Процентный период*** означает применительно к части Накопленных маржевых сумм в соответствующей Приемлемой валюте, период времени начиная с (а) последнего Рабочего дня (исключая этот день), когда была осуществлена капитализация Процентов по таким Накопленным маржевым суммам или (б) если еще не была осуществлена капитализация Процентов по таким Накопленным маржевым суммам, с Рабочего дня (исключая этот день), когда Плавающая маржевая сумма в соответствующей Приемлемой валюте была получена Получателем плавающих маржевых сумм, по (включительно) Рабочий день, в который осуществляется капитализация Процентов по таким Накопленным маржевым суммам, за этот период времени."

 (З) Определение "Проценты" в пункте 9.1 статьи 9 Стандартных условий изложить в следующей редакции:

"***Проценты*** означает применительно к Процентному периоду сумму процентов, начисленных за каждый день в этом Процентном периоде на часть Накопленных маржевых сумм, состоящих из соответствующей Приемлемой валюты, и рассчитанных Агентом по расчету плавающих маржевых сумм на каждый такой день в следующем порядке:

(а) такая часть Накопленных маржевых сумм, увеличенная на сумму капитализированных Процентов по таким Накопленным плавающим суммам (если Получателем плавающих маржевых сумм установлено условие о капитализации процентов по таким Накопленным маржевым суммам), по состоянию на этот день, умноженные на

(б) Процентную ставку, действующую в этот день применительно к соответствующей Приемлемой валюте, и разделенные на

(в) действительное число календарных дней в году (365 или 366 дней соответственно), если иная база начисления процентов не предусмотрена в Уведомлении касательно уплаты маржевых сумм применительно к такой Приемлемой валюте в качестве базы начисления Процентов.".

(И) В пункте 9.2 статьи 9 Стандартных условий слова ""Иное основание прекращения"" заменить словами ""Иное основание досрочного прекращения"".

(К) Во втором абзаце пункта 3.1 статьи 3 Стандартных условий слова "требование об уплате Плавающей маржевой суммы" заменить словами "Требование об уплате маржевых сумм".

* + 1. *Дополнительные определения*

Следующие термины, написанные с заглавной буквы в Договоре о порядке уплаты плавающих маржевых сумм и не определенные в Стандартных условиях, Генеральном соглашении или Стандартной документации, имеют следующее значение:

 ***для Сделок, заключаемых в соответствии с пунктами 2.4-2.14 Генерального соглашенияБазовый актив*** означает применительно к Сделке валюту, процентные ставки, ценные бумаги, товары и иной тип актива, который Стороны определили в Подтверждении как "Базовый актив";

***Дельта опциона*** означает применительно к Сделке опцион в Дату оценки измеряемую в долях единицы или процентах величину (взятую по модулю), на которую изменится премия за аналогичный опцион при изменении цены Базового актива на один базисный пункт, рассчитываемую с использованием соответствующей Опционной модели, заполненной данными на усмотрение Агента по расчету плавающих маржевых сумм. Если (А) Базовый актив отсутствует в системе Bloomberg; (Б) система Bloomberg недоступна; или (В) соответствующую информацию невозможно получить из системы Bloomberg по любым иным причинам, в качестве опционной модели могут быть применены внутренние модели Агента по расчету плавающих маржевых сумм для соответствующих опционов, реализованные на основе общерыночных методов оценки опционов. Для целей настоящего определения "Дельта опциона" "аналогичный опцион" означает сделку опцион, совершенную на таких же существенных условиях, что и соответствующая Сделка опцион, в части:

(аа) базового актива, его количества и валюты;

(бб) является ли опцион поставочным или расчетным;

(вв) типа опциона;

(гг) стиля опциона;

(дд) цены исполнения;

(ее) даты и времени истечения срока;

(жж) даты осуществления права на исполнение;

(зз) типа условия о барьере (отлагательное или отменительное); барьерного курса; порядка определения текущего значения барьера;

(ии) порядка определения расчетной цены, даты и времени ее определения;

(кк) порога исполнения; и

(лл) условия об автоматическом исполнении;

***Дополнительная маржевая сумма*** означает сумму, подлежащую уплате в соответствии с подпунктом (е) пункта 2.10 статьи 2 Договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм;

***Количество базового актива*** означает применительно к Сделке (А) в отношении облигаций и иных долговых ценных бумаг, имеющих аналогичную природу, являющихся Базовым активом по такой Сделке, их общую номинальную стоимость; и (Б) в отношении любого иного вида Базового актива, количество единиц Базового актива, являющегося предметом Сделки;

***Коэффициент первоначальной маржевой суммы*** означает применительно к Сделке число, выраженное в процентах и указанное в качестве «Коэффициента первоначальной маржевой суммы» в соответствующем Подтверждении;

***Коэффициент первоначальной маржевой суммы по позиции*** означает применительно к Позиции (за исключением Позиций, образованных Сделками своп) в Дату оценки коэффициент, рассчитываемый как средневзвешенное значение Коэффициента первоначальной маржевой суммы по всем Сделкам, формирующим одну Позицию; при этом в качестве меры весов выступает (А) в случае Сделок с базовым активом, Количество базового актива по соответствующей Сделке и (Б) в отношении Сделок опцион, Количество базового актива по соответствующей Сделке, умноженное на Дельту опциона (при этом такое произведение Количества базового актива и Дельты опциона рассчитывается для каждой Сделки опцион отдельно и получившиеся произведения складываются);

***Коэффициент стратегии*** означает понижающий коэффициент в диапазоне от 0 (ноль) до 1 (единица), установленный в отношении Стратегии в порядке, предусмотренном пунктом 1.4 Приложения 1 к Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм;

***Нетто-обязательство по позиции*** означает применительно к Позиции в Дату оценки:

(А) в случае Позиции, образованной из Сделок с Базовым активом

$$N\_{i}=\left|\left(Pr∙\sum\_{b=1}^{n\_{1}}Q\_{b}∙K\_{b}+Pr∙\sum\_{v=1}^{m\_{1}}Q\_{v}∙D\_{v}∙K\_{v}\right)-\left(Pr∙\sum\_{s=1}^{n\_{2}}Q\_{s}∙K\_{s}+Pr∙\sum\_{w=1}^{m\_{2}}Q\_{w}∙D\_{w}∙K\_{w}\right)\right|$$

где:

*Ni* – Нетто-обязательство для каждой *i*-ой Позиции;

*Pr* – Эквивалент текущей цены соответствующего Базового актива;

*Qb* – Количество базового актива, подлежащего поставке Получателем плавающих маржевых сумм (или, в случае расчетных Сделок, Количество базового актива, которое подлежало бы поставке Получателем плавающих маржевых сумм, если бы соответствующая Сделка была поставочной) по каждой Сделке *b* из набора *n1*, входящих в Позицию;

*Qs* – Количество базового актива, подлежащего поставке Плательщиком плавающих маржевых сумм (или, в случае расчетных Сделок, Количество базового актива, которое подлежало бы поставке Плательщиком плавающих маржевых сумм, если бы соответствующая Сделка была поставочной) по каждой Сделке *s* из набора *n2*, входящих в Позицию;

*Qv* – Количество базового актива по каждой Сделке опцион *c* из набора *m1*, по условиям которой Получатель плавающих маржевых сумм является Покупателем в отношении Опциона на продажу (пут) или Продавцом в отношении Опциона на покупку (колл);

*Qw* – Количество базового актива по каждой Сделке опцион *p* из набора *m2*, по условиям которой Получатель плавающих маржевых сумм является Продавцом в отношении Опциона на продажу (пут) или Покупателем в отношении Опциона на покупку (колл);

*Dv* - Дельта опциона по *v*-ой Сделке опцион;

*Dw* – Дельта опциона по *w*-ой Сделке опцион;

K­­b, Kv, Ks, Kw – если применимо, соответствующий коэффициент стратегии (если не применимо, коэффициент полагается равным 1).

 (Б)       в случае Позиции, образованной из Сделок своп, 0 (ноль),

при этом:

(аа)      Сделки, в Подтверждении по которым указано, что положения о Нетто-обязательстве по позиции не применяются, исключаются из расчета Нетто-обязательства по позиции;

(бб)     в случае Сделок своп и Сделок, в Подтверждении по которым указано, что положения о Нетто-обязательстве по позиции не применяются, (аа) положения о Коэффициенте гарантийного взноса, Пороге прекращения и Пороге переоценки не применяются к таким Сделкам (и не указываются в соответствующем Подтверждении); (бб) такие Сделки не учитываются при определении Коэффициента гарантийного взноса по позиции, Порога переоценки по позиции и Уровня прекращения по позиции; (вв) Позиции, образованные такими Сделками, не учитываются при определении Порога переоценки по портфелю и Уровня прекращения по портфелю; (гг) если все Позиции образованы такими Сделками, то не подлежат применению положения пунктов 2.2 и 2.3 статьи 2 Стандартных условий о превышении Плавающей маржевой суммы, выраженной в процентах от Нетто-обязательства по портфелю, Порога переоценки по портфелю;

(вв)     если Сделка опцион, по условиям которой Сторона Б является Покупателем, не включена в Стратегию, положения подпункта (бб) выше применяются к такой Сделке и такая Сделка не будет учитываться для целей расчета Нетто-обязательства по позиции.

***Нетто-обязательство по портфелю*** означает в Дату оценки сумму Нетто-обязательств по позиции по всем Позициям;

***Общий лимит дополнительных*** ***маржевых сумм*** означает сумму всех значений Дополнительных маржевых сумм, указанных в соответствующих Подтверждениях по непрекращенным Сделкам;

***Опционная модель*** означает модель, используемую для расчета Дельты опциона, на основании показателей волатильности, цены соответствующего Базового актива и процентных ставок, которая доступна на одной из следующих страниц системы Bloomberg:

(А) в отношении Сделок опцион, Базовым активом в которых выступает валюта, - страница "OVML";

(Б) в отношении Сделок опцион, Базовым активом в которых выступают акции, - страница "OVME";

(В) в отношении Сделок опцион, Базовым активом в которых выступают облигации или иные долговые ценные бумаги, имеющие аналогичную природу, - страница "OVME";

(Г) в отношении Сделок опцион, Базовым активом в которых выступают товары, - страница "OVML",

а если такая страница недоступна - на другой странице системы Bloomberg, на которой может быть получена такая информация, или, если такая страница системы Bloomberg не доступна, на странице иной системы, на которой может быть получена такая информация;

***Первоначальная маржевая сумма по позиции*** означает:



где:

*IAi* – Первоначальная маржевая сумма по позиции *i*;

*Ni* – Нетто-обязательство по позиции *i*;

*mrk* – Коэффициент первоначальной маржи по *k*-ой Сделке из набора *n*, входящей в Позицию *i*;

*Qk* – Количество базового актива по *k*-ой Сделке из набора *n*, входящей в Позицию *i*;

*mrj* – Коэффициент первоначальной маржи по *j*-ой Сделке опцион из набора *m*, входящей в позицию *i*;

*Qj* – Количество базового актива по *j*-ой Сделке опцион из набора *m*, входящей в позицию *i*;

*Dj –* Дельта опциона по *j*-ой Сделке опцион;

при этом, Первоначальная маржевая сумма по позиции равняется 0 (нулю), если выполняется равенство:

$$\sum\_{k=1}^{n}Q\_{k}+\sum\_{j=1}^{m}Q\_{j}∙D\_{j}=0$$

***Позиция*** означает в Дату оценки:

(А) в случае Сделок с базовым активом и Сделок опцион, совокупность непрекращенных Сделок с базовым активом и Сделок опцион, заключенных в отношении одного и того же вида и типа Базового актива. При этом, во избежание сомнений, совокупность таких Сделок с базовым активом и Сделок опцион образуют единую Позицию;

(Б) в отношении Сделок своп, каждую непрекращенную Сделку своп,

при этом в отношении (А) и (Б) выше:

(аа) в каждом случае не исполненные полностью на соответствующую Дату оценки Сделки включаются в состав Позиции в их неисполненной части; и

(бб) по Сделкам, входящим в какую-либо Стратегию, Позиции определяются внутри соответствующей Стратегии в порядке, описанном выше;

***Порог переоценки*** означает применительно к Сделке процент, указанный в соответствующем Подтверждении (если не указан - 0);

***Порог переоценки по позиции*** означает в отношении Позиции (за исключением Позиций, образованных Сделками своп) в Дату оценки процент, рассчитываемый как средневзвешенное значение Порога переоценки по всем Сделкам с базовым активом и Сделкам опцион, формирующим одну Позицию; при этом в качестве меры весов выступает (А) в случае Сделок с базовым активом, Количество базового актива по соответствующей Сделке и (Б) в отношении Сделок опцион, Количество базового актива по соответствующей Сделке, умноженное на Дельту опциона (при этом такое произведение Количества базового актива и Дельты опциона рассчитывается для каждой Сделки опцион отдельно и получившиеся произведения складываются);

***Порог переоценки по портфелю*** означает в Дату оценки процент, рассчитываемый как средневзвешенное значение Порога переоценки по позиции по всем Позициям; при этом в качестве меры весов выступает Нетто-обязательство по позиции по соответствующим Позициям;

***Приемлемая валюта*** означает российские рубли, евро и доллары США;

***Сделка опцион*** означает Сделку, являющуюся Сделкой валютный опцион (как определено в Стандартных условиях валютных сделок), Сделкой свопцион (как определено в Стандартных условиях сделок на процентные ставки), Сделкой опцион (как определено в Стандартных условиях сделок с акциями), Сделкой опцион (как определено в Стандартных условиях сделок с облигациями), и любую иную Сделку, которую Стороны определили в Подтверждении как "Сделку опцион";

***Сделка с базовым активом*** означает Сделку, кроме Сделки своп и Сделки опцион;

***Сделка своп*** означает Сделку, являющуюся Сделкой валютный своп (как определено в Стандартных условиях валютных сделок), Сделкой процентный своп (как определено в Стандартных условиях сделок на процентные ставки), Сделкой валютно-процентный своп (как определено в Стандартных условиях сделок на процентные ставки), Сделкой своп (как определено в Стандартных условиях сделок с акциями), и любую иную Сделку, которую Стороны определили в Подтверждении как "Сделку своп";

***Стратегия*** означает совокупность Сделок, сформированную в порядке, предусмотренном Приложением 1 к Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, к которым для целей расчета Нетто-обязательства по позиции применяется Коэффициент стратегии;

***Текущая цена*** означает применительно к любому активу (в том числе, во избежание сомнения, к валюте) цену за единицу такого актива, определенную Агентом по расчету плавающих маржевых сумм по собственному усмотрению на основании разумных коммерческих оценок в любое время в течение Даты оценки;

***Требование об уплате маржевых сумм*** означает, в зависимости от контекста, требование об уплате Плавающей маржевой суммы или Дополнительной маржевой суммы, составленное по форме, приемлемой для Стороны А;

***Уведомление касательно уплаты маржевых сумм*** означает уведомление, подтверждающее уплату Плавающих маржевых сумм или Дополнительных маржевых сумм (в зависимости от того, что применимо), составленное по форме, приемлемой для Стороны А;

***Уведомление о пересмотре процентной ставки*** означает уведомление, содержащее информацию об изменении Процентной ставки, применимой к Плавающим маржевым суммам, составленное по форме, приемлемой для Стороны А;

***Уровень прекращения*** означает применительно к Сделке число, выраженное в процентах, указанное в качестве «Уровня прекращения» в соответствующем Подтверждении;

***Уровень прекращения по позиции*** означает применительно к Позиции (за исключением Позиций, образованных Сделками своп) процент, рассчитываемый как средневзвешенное значение Уровня прекращения по всем Сделкам с базовым активом и Сделкам опцион, формирующим одну Позицию; при этом в качестве меры весов выступает (А) в случае Сделок с базовым активом, Количество базового актива по соответствующей Сделке с базовым активом, и (Б) в отношении Сделок опцион, Количество базового актива по соответствующей Сделке опцион, умноженное на Дельту опциона;

***Уровень прекращения по портфелю*** означает процент, рассчитываемый как средневзвешенное значение Уровня прекращения по позиции по всем Позициям; при этом в качестве меры весов выступает Нетто-обязательство по позиции по соответствующим Позициям;

***Эквивалент текущей цены*** означает (1) применительно к Текущей цене, выраженной в рублях, такую Текущую цену, и (2) применительно к Текущей цене в иной валюте, Текущую цену, пересчитанную в рубли на основании соответствующего курса конвертации, определенного Агентом по расчету плавающих маржевых сумм по собственному усмотрению на основании разумных коммерческих оценок на дату такой конвертации.

***для Сделок, заключаемых в соответствии с п. 2.1-2.3 Генерального соглашенияБазовый актив*** означает применительно к Сделке валюту, которую Стороны определили в Подтверждении как "Базовый актив";

***Количество базового актива*** означает применительно к Сделке количество единиц Базового актива, являющегося предметом Сделки;

***Коэффициент первоначальной маржевой суммы*** означает применительно к Сделке число, выраженное в процентах и указанное в качестве «Коэффициента первоначальной маржевой суммы» в соответствующем Подтверждении;

***Коэффициент первоначальной маржевой суммы по позиции*** означает применительно к Позиции в Дату оценки коэффициент, рассчитываемый как средневзвешенное значение Коэффициента первоначальной маржевой суммы по всем Сделкам, формирующим одну Позицию; при этом в качестве меры весов выступает Количество базового актива по соответствующей Сделке;

***Нетто-обязательство по позиции*** означает применительно к Позиции в Дату оценки:



 где:

*Ni* – Нетто-обязательство для каждой *i*-ой Позиции;

*Pr* – Эквивалент текущей цены соответствующего Базового актива;

*Qb* – Количество базового актива, подлежащего поставке Получателем плавающих маржевых сумм (или, в случае расчетных Сделок, Количество базового актива, которое подлежало бы поставке Получателем плавающих маржевых сумм, если бы соответствующая Сделка была поставочной) по каждой Сделке *b* из набора *n*, входящих в Позицию;

*Qs* – Количество базового актива, подлежащего поставке Плательщиком плавающих маржевых сумм (или, в случае расчетных Сделок, Количество базового актива, которое подлежало бы поставке Плательщиком плавающих маржевых сумм, если бы соответствующая Сделка была поставочной) по каждой Сделке *s* из набора *m*, входящих в Позицию;

***Нетто-обязательство по портфелю*** означает в Дату оценки сумму Нетто-обязательств по позиции по всем Позициям;

***Первоначальная маржевая сумма по позиции*** означает:



где:

*IAi* – Первоначальная маржевая сумма по позиции i;

*Ni* – Нетто-обязательство по позиции i;

*mrk* – Коэффициент первоначальной маржи по k-ой Сделке из набора n, входящей в Позицию i;

*Qk* – Количество базового актива по k-ой Сделке из набора n, входящей в Позицию i;

при этом, Первоначальная маржевая сумма по позиции равняется 0 (нулю), если выполняется равенство:

 

***Позиция*** означает в Дату оценки совокупность Сделок, или частей сделок применительно к сделкам имеющим несколько дат исполнения обязательств, заключенных в отношении одной и той же Валютной пары, и с одинаковой датой исполнения обязательств, обязательства по которым еще не были исполнены в соответствии с условиями соответствующих Сделок, включаемых в расчет Оценочной стоимости сделок;

***Порог переоценки*** означает применительно к Сделке процент, указанный в соответствующем Подтверждении (если не указан - 0);

***Порог переоценки по позиции*** означает в отношении Позиции в Дату оценки процент, рассчитываемый как средневзвешенное значение Порога переоценки по всем Сделкам, формирующим одну Позицию; при этом в качестве меры весов выступает Количество базового актива по соответствующей Сделке;

***Порог переоценки по портфелю*** означает в Дату оценки процент, рассчитываемый как средневзвешенное значение Порога переоценки по позиции по всем Позициям; при этом в качестве меры весов выступает Нетто-обязательство по позиции по соответствующим Позициям;

***Приемлемая валюта*** означает российские рубли, евро и доллары США;

***Текущая цена*** означает применительно к любому активу (в том числе, во избежание сомнения, к валюте) цену за единицу такого актива, определенную Агентом по расчету плавающих маржевых сумм по собственному усмотрению на основании разумных коммерческих оценок в любое время в течение Даты оценки;

***Требование об уплате маржевых сумм*** означает требование об уплате Плавающей маржевой суммы, составленное по форме, приемлемой для Стороны А;

***Уведомление касательно уплаты маржевых сумм*** означает уведомление, подтверждающее уплату Плавающих маржевых сумм или Дополнительных маржевых сумм (в зависимости от того, что применимо), составленное по форме, приемлемой для Стороны А;

***Уведомление о пересмотре процентной ставки*** означает уведомление, содержащее информацию об изменении Процентной ставки, применимой к Плавающим маржевым суммам, составленное по форме, приемлемой для Стороны А;

***Уровень прекращения*** означает применительно к Сделке число, выраженное в процентах, указанное в качестве «Уровня прекращения» в соответствующем Подтверждении;

***Уровень прекращения по позиции*** означает применительно к Позиции процент, рассчитываемый как средневзвешенное значение Уровня прекращения по всем Сделкам, формирующим одну Позицию; при этом в качестве меры весов выступает Количество базового актива по соответствующей Сделке;

***Уровень прекращения по портфелю*** означает процент, рассчитываемый как средневзвешенное значение Уровня прекращения по позиции по всем Позициям; при этом в качестве меры весов выступает Нетто-обязательство по позиции по соответствующим Позициям;

***Эквивалент текущей цены*** означает (1) применительно к Текущей цене, выраженной в рублях, такую Текущую цену, и (2) применительно к Текущей цене в иной валюте, Текущую цену, пересчитанную в рубли на основании соответствующего курса конвертации, определенного Агентом по расчету плавающих маржевых сумм по собственному усмотрению на основании разумных коммерческих оценок на дату такой конвертации.

2.11 Сторона Б подтверждает, что ей понятен порядок расчета всех сумм и величин, предусмотренных в настоящем Договоре о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

**В ПОДТВЕРЖДЕНИЕ ВЫШЕИЗЛОЖЕННОГО** Стороны подписали Договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм в дату присоединения Стороны Б к Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм.

|  |
| --- |
| **ПОДПИСАНО** |
| Ф.И.О.:  |
| Должность:  |
| За и от имени |
| **АО "АЛЬФА-БАНК"** |
| [*Печать*] |
| Ф.И.О.:  |
| Должность:  |
| За и от имени |
| **[Наименование Стороны Б]** |
| [*Печать*] |

ПРИЛОЖЕНИЕ 1
Установление и прекращение стратегий

(*применяется в отношении Сделок, заключаемымых в сответствии с пунктами 2.4-2.14 Генерального соглашения)*

* + - 1. Для целей настоящего Приложения 1 к Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм (далее – «***Приложение***») следующие термины, написанные с заглавной буквы, будут иметь следующее значение:

***Идентификационный номер стратегии*** означает номер Стратегии, присваиваемый каждой вновь образуемой Стратегии;

***Подтверждение установления стратегии*** означает подтверждение, составленное по форме, согласованной Сторонами, или иной форме, приемлемой для Стороны А;

***Уведомление о прекращении стратегии*** означает уведомление, составленное по форме, согласованной Сторонами, или иной форме, приемлемой для Стороны А;

***Уведомление об установлении стратегии*** означает уведомление, составленное по форме, согласованной Сторонами, или иной форме, приемлемой для Стороны А.

* + - 1. Для целей определения размера риска, связанного с неисполнением обязательств по Сделкам, Сделки могут объединяться в Стратегии.
			2. Каждая Стратегия может включать в себя любые Сделки, но одна и та же Сделка в каждый конкретный момент времени не может входить в более чем одну Стратегию.
			3. Объединение Сделок в Стратегии и установление Коэффициента стратегии производится:

(а) по соглашению Сторон посредством составления и направления Стороной А Стороне Б Подтверждения установления стратегии и подписания Подтверждения установления стратегии Стороной Б. Стратегия считается образованной и соответствующий Коэффициент стратегии вступают в действие со дня получения Стороной А Подтверждения установления стратегии, подписанного Стороной Б; либо

(б) посредством направления Стороной А Стороне Б Уведомления об установлении стратегии в случае, если установление Стратегии не приведет незамедлительно к увеличению размера Общей суммы маржевых обязательств.

* + - 1. При образовании Стратегии ей присваивается Стороной А Идентификационный номер стратегии, который указывается в соответствующем Подтверждении установления стратегии либо Уведомлении об установлении стратегии (в зависимости от обстоятельств).
			2. Стратегия и соответствующий Коэффициент стратегии прекращают свое действие в более раннюю из следующих дат:

(а) в Дату оценки, непосредственно предшествующую дню, в который происходят окончательные расчеты по хотя бы одной из Сделок, входящих в состав Стратегии;

 (б) в дату, в которую образована новая Стратегия, в которую входит хотя бы одна из Сделок, входящих в существующую Стратегию; или

(в) в дату, определенную по усмотрению Стороны А и указанную в Уведомлении о прекращении стратегии, составленном и направленным Стороной А Стороне Б.

**ПРИЛОЖЕНИЕ 1**

**заявление о присоединении**

**к договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм (в отношении сделок, заключаемых в соответствии с пунктом 2.1-2.3 генерального соглашения)**

|  |
| --- |
| *(полное наименование юридического лица)* |
| Сокращенное наименование юридического лица  |  |
| Адрес юридического лица |  |
| Регистрационный номер (ОГРН) |  |
| ИНН |  |
| Телефон(ы)  |  |
| Адрес электронной почты (e-mail) (*указывается, если информация отличается от информации, указанной в заявлении о присоединении к генеральному соглашению о срочных сделках на финансовых рынках*)  | Адрес электронной почты (e-mail) для направления Требований об уплате маржевых сумм:Адрес электронной почты (e-mail) для направления иных уведомлений: |
| Реквизиты банковского счета в рублях |  |
| Реквизиты банковского счета в долларах |  |
| Реквизиты банковского счета в евро  |  |
| Реквизиты генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках *(указывается, если генеральное соглашение о срочных сделках на финансовых рынках было заключено ранее даты настоящего заявления о присоединении)* |  |

в соответствии со статьей 428 Гражданского кодекса Российской Федерации уведомляем АО «АЛЬФА-БАНК» о присоединении к Договору о порядке уплаты плавающих маржевых сумм (далее – «Договор»). Подтверждаем, что до заключения Договора ознакомились с положениями Договора через сайт Банка в cети Интернет по адресу https://alfabank.ru/corporate/rko/docstariffs/?tab=investproduct.

Подтверждаем своё согласие с условиями Договора и обязуемся их выполнять.

Дата: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |
| *(должность руководителя Клиента)* |  | подпись |  | Ф.И.О. |
|  |  |  |  |  |

М.П. (при наличии)

1. Указать для каждой валюты [↑](#footnote-ref-2)
2. Указать для каждой валюты [↑](#footnote-ref-3)