



Россия, 119021, г. Москва,
бульвар Зубовский, дом 11 А,
этаж 9, помещение I, комната 1
Тел.: (495) 777-29-64
www.region-bk.ru

НАСТУПЛЕНИЕ СЛУЧАЕВ ПРОВЕДЕНИЯ ПЕРЕОЦЕНКИ. СПОСОБЫ ПЕРЕОЦЕНКИ

1. Определение наступления случаев Переоценки

Если иное не согласовано сторонами Сделки РЕПО, наступление случая Нижней переоценки определяет покупатель по первой части Сделки РЕПО, а наступление случая Верхней переоценки определяет продавец по первой части Сделки РЕПО.

Требовать проведения Нижней переоценки вправе покупатель по первой части Сделки РЕПО, а проведения Верхней переоценки – продавец по первой части Сделки РЕПО.

Переоценка проводится одним из Способов переоценки, по выбору стороны, имеющей право требовать проведения Переоценки, или по соглашению сторон Сделки РЕПО.

Определения Способов переоценки приведены в части 2 настоящего Приложения №16 к Регламенту брокерского обслуживания Общества с ограниченной ответственностью «Брокерская компания «РЕГИОН»».

Случай Нижней переоценки наступает, когда значение Дисконта становится ниже значения установленного соглашением Сторон – минимального предельного значения Дисконта.

Случай Верхней переоценки наступает, когда значение Дисконта становится выше значения установленного соглашением Сторон – максимального предельного значения Дисконта.

2. Термины и определения

Верхняя переоценка - порядок, установленный соглашением сторон сделки РЕПО, в соответствии с которым в случае увеличения Текущей стоимости свыше установленного уровня продавец по Сделке РЕПО имеет право провести переоценку обязательств по второй части Сделки РЕПО одним из Способов переоценки.

Дисконт – величина, выраженная в процентах и отражающая разницу между Текущей стоимостью и Текущей суммой выкупа.

Способ переоценки – один из следующих способов: Досрочное исполнение Сделки РЕПО, Досрочное исполнение Сделки РЕПО и заключение новой Сделки РЕПО, Компенсационный взнос денежными средствами, Компенсационный взнос ценными бумагами, Маржинальный взнос денежными средствами, Маржинальный взнос ценными бумагами.

Досрочное исполнение Сделки РЕПО – Способ переоценки, при котором вторая часть Сделки РЕПО подлежит досрочному исполнению по одностороннему требованию стороны, определяющая возникновение оснований для проведения Переоценки.

Досрочное исполнение Сделки РЕПО и заключение новой Сделки РЕПО – Способ переоценки, при котором вторая часть Сделки РЕПО подлежит досрочному исполнению по одностороннему требованию стороны, определяющая возникновение оснований для проведения Переоценки, с последующим обязательным заключением новой Сделки РЕПО, на условиях

Приложение № 16 к Регламенту брокерского обслуживания ООО «БК РЕГИОН»

аналогичных условиям досрочно исполненной Сделки РЕПО, за исключением: даты исполнения первой части и суммы оплаты по первой части.

Компенсационный взнос денежными средствами - Способ переоценки, при котором сторона Сделки РЕПО (покупатель по Сделке РЕПО в случае проведения Верхней переоценки или продавец по Сделке РЕПО в случае проведения Нижней переоценки) перечисляет денежные средства другой стороне Сделки РЕПО в случае возникновения у нее права требовать проведения Переоценки. Перечисление указанных денежных средств изменяет размер обязательств по оплате по второй части соответствующей Сделки РЕПО.

Компенсационный взнос ценными бумагами - Способ переоценки, при котором сторона Сделки РЕПО (покупатель по Сделке РЕПО в случае проведения Верхней переоценки или продавец по Сделке РЕПО в случае проведения Нижней переоценки) передает ценные бумаги другой стороне Сделки РЕПО в случае возникновения у нее права требовать проведения Переоценки. Передача указанных ценных бумаг изменяет размер обязательств по поставке ценных бумаг по второй части соответствующей Сделки РЕПО.

Маржинальный взнос денежными средствами - Способ переоценки, при котором сторона Сделки РЕПО (покупатель по Сделке РЕПО в случае проведения Верхней переоценки или продавец по Сделке РЕПО в случае проведения Нижней переоценки) перечисляет на срочной и возвратной основе денежные средства другой стороне Сделки РЕПО в случае возникновения у нее права требовать проведения Переоценки.

Маржинальный взнос ценными бумагами - Способ переоценки, при котором сторона Сделки РЕПО (покупатель по Сделке РЕПО в случае проведения Верхней переоценки или продавец по Сделке РЕПО в случае проведения Нижней переоценки) передает на срочной и возвратной основе ценные бумаги другой стороне Сделки РЕПО в случае возникновения у нее права требовать проведения Переоценки.

Нижняя переоценка – порядок, установленный соглашением сторон сделки РЕПО, в соответствии с которым в случае уменьшения Текущей стоимости ниже установленного уровня покупатель по Сделке РЕПО имеет право провести переоценку обязательств по второй части Сделки РЕПО одним из Способов переоценки.

Переоценка – порядок, предусмотренный соглашением сторон Сделки РЕПО, в соответствии с которым в зависимости от изменения Текущей стоимости одна из сторон Сделки РЕПО приобретает прав требовать от другой стороны передать денежные средства и ценные бумаги или совершить иные действия, предусмотренные соглашением Сторон.

Срок РЕПО – период в календарных днях, исчисляемый со дня исполнения первой части Сделки РЕПО по дату исполнения второй части Сделки РЕПО включительно.

Текущая стоимость - стоимость ценных бумаг, являющихся предметом Сделки РЕПО или переданных в качестве Маржинального взноса, которая может быть рассчитана в любой день в течение Срока РЕПО в порядке, согласованном сторонами Сделки РЕПО

Текущая сумма выкупа - сумма оплаты по второй части Сделки РЕПО, которая может быть рассчитана в порядке, согласованном сторонами, в любой день в течение Срока РЕПО.