

РЕГЛАМЕНТ

подачи, обработки и исполнения распоряжений клиентов о фиксации цены базового актива при совершении операций с беспоставочными внебиржевыми финансовыми инструментами в ОАО «Технобанк»

г. Минск

1. Настоящий Регламент подачи, обработки и исполнения распоряжений Клиентов о фиксации цены базового актива при совершении операций с беспоставочными внебиржевыми финансовыми инструментами (далее – Регламент) устанавливает и описывает этапы выполнения распоряжений Клиентов при совершении операций с беспоставочными внебиржевыми финансовыми инструментами (далее – операция).

2. Термины и определения, используемые в Регламенте, применяются в значениях, определённых Правилами совершения операций с беспоставочными внебиржевыми финансовыми инструментами в ОАО «Технобанк».

3. Операция состоит из двух частей: открытие и закрытие позиции.

4. Для открытия позиции по Инструменту Клиенту необходимо с помощью инвестиционной платформы создать Ордер. В Ордере указываются все параметры, являющиеся существенными для совершения операции с выбранным Клиентом Инструментом.

5. Существенными параметрами Ордера, подлежащими согласованию, являются:

5.1. Инструмент;

5.2. тип Операции (покупка (Buy), продажа (Sell) Инструмента или закрытие текущей позиции (Close);

5.3. объём Операции (должен быть кратным минимально допустимому значению согласованного финансового инструмента). Информация по минимальному объёму Операции доступна на Сайте, а также задана на инвестиционной платформе. В случае расхождений, информация, заданная на инвестиционной платформе, имеет преимущественное значение;

5.4. цена Операции (если применимо для выбранного вида Ордера).

6. Ордер считается принятым к исполнению, а позиция открытой после согласования и подтверждения Клиентом всех существенных параметров Ордера и появления соответствующей записи в log-file инвестиционной платформы. В инвестиционной платформе каждой Открытой Позиции присваивается Тикет с уникальным номером.

7. Ордер на открытие позиции по Инструменту принимается к исполнению Банком только при условии наличия на реальном аккаунте Клиента достаточного размера маржинального обеспечения.

8. Виды Ордеров.

8.1. Рыночный Ордер (MarketOrder) – распоряжение Клиента открыть/закрыть позицию непосредственно после получения такого распоряжения по текущей рыночной котировке (Актуальной цене) на момент получения такого распоряжения Банком. При данном виде Ордера Клиент выражает свое желание совершить Операцию, заранее соглашаясь с тем, что Операция будет совершена по цене, актуальной на инвестиционной платформе Банка. Для открытия позиции посредством Рыночного Ордера Клиенту необходимо в инвестиционной платформе нажать кнопку Buy («Покупаю») или Sell («Продаю») в тот момент, когда его устраивает цена Инструмента в инвестиционной платформе.

8.2. Отложенный Ордер – распоряжение Клиента совершить Операцию в будущем при достижении заданных в нем условий в соответствии с видом Отложенного Ордера. Виды Отложенных Ордеров:

8.2.1. Лимит Ордер (BuyLimit, SellLimit, TakeProfit «t/p») – вид Ордера, присваиваемый Отложенному Ордеру в случае, если такой Отложенный Ордер выставляется на продажу по цене (курсу) выше текущего рыночного уровня или на покупку по цене (курсу) ниже текущего рыночного уровня;

8.2.2. Стоп Ордер (BuyStop, SellStop, StopLoss «s/l») – вид Ордера, присваиваемый Отложенному Ордеру Клиента в случае, если такой Отложенный Ордер выставляется на продажу по ценам (курсу) ниже текущего рыночного уровня или на покупку по ценам (курсу) выше текущего рыночного уровня.

9. Исполнение Ордеров и типы исполнения Ордеров.

9.1. Рыночное исполнение (Market Execution) — тип совершения Операций, при котором Клиент выражает свое желание совершить Операцию, заранее соглашаясь с тем, что Операция будет совершена по Актуальной цене (без предложения новых котировок).

9.2. Немедленное исполнение (Instant Execution) — тип совершения Операций, при котором Клиент выражает свое желание совершить Операцию путем отправки распоряжения по цене в инвестиционной платформе. Если цена не перестала быть актуальной, происходит подтверждение Операции. Если Котировка в инвестиционной платформе перестала быть актуальной, Клиенту предлагается новая цена для совершения Операции и/или сервер Банка присылает отказ в совершении Операции. Клиент соглашается на возможное совершение Операции по любой актуальной на сервере Банка цене.

9.3. Ордера исполняются Банком, когда это возможно, по лучшей доступной на момент обработки ордера цене.

9.4. Ордера не исполняются во внеоперационное время соответствующего рынка для выбранного Инструмента (далее – внеоперационное время). Поэтому, если Ордер принят во внеоперационное время, то цена, по которой может быть исполнен Ордер, может существенно отличаться от цены, указанной в Ордере.

9.5. Цена, по которой может быть исполнен Ордер, может значительно отличаться от цены, указанной в Ордере, при наличии волатильности цен Инструмента, а также во время начала и окончания Операционного времени базового актива.

Если цена, указанная в Ордере, будет значительно отличаться от цены Инструмента при начале или во время Операционного времени финансового инструмента (Гэп), Банк исполнит Ордер по доступной цене.

9.6. Банк вправе исполнить Ордер в отношении Инструментов, передаваемых вне Операционного времени финансового инструмента, по согласованной с Клиентом цене.

9.7. Принятые Отложенные Ордера (ОТС – GoodTillCancelled), считаются действительными неограниченно долго, пока либо не будут отменены Клиентом, либо не будут исполнены, либо не будут удалены вследствие недостаточного маржинального обеспечения.

9.8. Отложенные Ордера, представленные к исполнению, но не соответствующие требованиям маржинального обеспечения, сразу и обязательно отменяются без согласования с Клиентом.

10. Любой Отложенный Ордер может быть изменен либо отменен в Операционное время финансового инструмента, если цена, указанная в Ордере, не достигла уровня исполнения.

11. Особенности исполнения Ордеров на реальных аккаунтах «Техно-старт», «Техно-стандарт», «Техно-Pro», «ТехноИнвест».

11.1. При исполнении Ордеров на реальном аккаунте «Техно -старт»: Стоп Ордера и Лимит Ордера не могут быть размещены, если абсолютная разница между ценой исполнения Ордера и текущей ценой финансового инструмента меньше минимального лимита, установленного для стоп-ордеров для такого финансового инструмента. Значения лимитов приведены на Сайте. Лимиты могут быть увеличены в случае публикации экономических данных (см. раздел «Экономический календарь» на Сайте) или при высокой рыночной волатильности для данного финансового инструмента. Лимиты для Стоп и Лимит Ордеров увеличиваются при открытии рынка. Лимиты возвращаются к установленным значениям, как только это позволит ликвидность и волатильность на основных рынках. Обычно этот процесс занимает 10-20 минут, однако, в случаях ограниченной ликвидности и высокой волатильности, может длиться дольше. Ордер на открытие/закрытие позиции на реальном аккаунте «Техно-старт» может быть размещён следующими способами:

11.1.1. путём размещения Рыночного ордера по текущей цене, транслируемой в инвестиционной платформе;

11.1.2. путём размещения Лимит Ордера на совершение операции (buylimit, selllimit, takeprofit «t/p»);

11.1.3. путём размещения Стоп Ордера на совершение операции (buystop, sellstop, stoploss «s/l»).

Рыночные Ордера на реальном аккаунте «Техно-старт» исполняются по цене, указанной в Ордере с учётом того, что Банк может отменить Ордер до совершения операции, если цена финансового инструмента значительно

изменится по сравнению с ценой Ордера. Лимит Ордера на реальном аккаунте «Техно-старт» исполняются по цене, указанной Клиентом, или лучше.

11.2. Исполнение Ордеров на реальном аккаунте «Техно-стандарт». Ордер на совершение операций на реальном аккаунте «Техно-стандарт» может быть размещён следующими способами:

11.2.1. путём размещения Рыночного Ордера по текущей цене, транслируемой в инвестиционной платформе;

11.2.2. путём размещения Лимит Ордера на совершение операции (buylimit, selllimit, takeprofit «t/p»);

11.2.3. путём размещения Стоп Ордера на совершение операции (buystop, sellstop, stoploss «s/l»).

Рыночные ордера с немедленным типом исполнения на реальном аккаунте «Техно-стандарт» исполняются по цене, указанной в Ордере, с учётом того, что Банк может отменить Ордер до совершения операции, если цена финансового инструмента значительно изменится по сравнению с ценой, указанной в Ордере.

Лимит Ордера на реальном аккаунте «Техно-стандарт» исполняются по цене, указанной Клиентом или лучшей.

Стоп Ордера на реальном аккаунте «Техно-стандарт» исполняются по рыночным ценам в момент активации Ордера.

11.3. Исполнение Ордеров на реальном аккаунте «Техно-Pro», «ТехноИнвест». Ордер на совершение операций на реальном аккаунте «Техно-Pro», «ТехноИнвест» может быть размещён следующими способами:

11.3.1. путём размещения Рыночного Ордера по текущей цене, транслируемой в инвестиционной платформе;

11.3.2. путём размещения Лимит Ордера на совершение операции (buylimit, selllimit, takeprofit «t/p»). На реальных аккаунтах «ТехноИнвест» Ордер на совершение операции selllimit недоступен;

11.3.3. путём размещения Стоп Ордера на совершение операции (buystop, sellstop, stoploss «s/l»).

Рыночные Ордера с рыночным типом исполнения на реальном аккаунте «Техно-Pro», «ТехноИнвест» исполняются по средневзвешенной цене (VWAP). Цены, транслируемые в инвестиционной платформе, при рыночном типе исполнения являются исключительно индикативными, и нет никаких гарантий, что такая цена будет ценой исполнения Ордера. Исполнение Ордера Клиента происходит по доступным рыночным ценам, предоставляемым провайдером ликвидности. Результат исполнения ордера зависит от рыночной ситуации и текущей ликвидности.

Лимит Ордера на реальном аккаунте «Техно-Pro», «ТехноИнвест» исполняются по цене, указанной Клиентом или лучшей.

Стоп Ордера на реальном аккаунте «Техно-Pro», «ТехноИнвест» исполняются по рыночным ценам в момент активации Ордера»

12. Особые правила исполнения Ордеров с финансовыми инструментами, где в качестве базового актива выступают ценные бумаги. Исходя из характеристики инструментов, их правил и условий обращения на базовых биржах, исполнение Ордеров с финансовыми инструментами на ценные бумаги,

может отличаться в некоторых аспектах от стандартных правил проведения Операций, где в качестве базового актива выступают иностранная валюта, драгоценные металлы, фьючерсные контракты, а также иные базовые активы, как описано выше.

Перед совершением любой операции с финансовыми инструментами на ценные бумаги необходимо понимать, как различные виды Ордеров исполняются для данных финансовых инструментов и как это может повлиять на цену операции.

Ордер на исполнение Операций с финансовыми инструментами на ценные бумаги может быть размещён следующими способами:

12.1. путём размещения рыночного ордера по текущей цене, транслируемой в инвестиционной платформе;

12.2. путём размещения Лимитного Ордера на совершение операции (buylimit, selllimit, takeprofit «t/p»). На реальных аккаунтах «ТехноИнвест» Ордер на совершение операции selllimit недоступен;

12.3. путём размещения Стопового Ордера на совершение операции (buystop, sellstop, stoploss «s/l»). На реальных аккаунтах «ТехноИнвест» Ордер на совершение операции sellstop недоступен.

Стоп Ордера по финансовым инструментам на ценные бумаги исполняются как Рыночные Ордера в момент, когда происходит активация stop уровня. Банк не гарантирует исполнение таких Ордеров в точности по цене, указанной Клиентом.

Лимитные Ордера по финансовым инструментам на ценные бумаги исполняются по цене, указанной Клиентом, или лучшей.

13. Банк вправе заблокировать величину необходимого залога на реальном аккаунте Клиента при размещении Отложенного Ордера, для открытия Лимитного или Стопового Ордера по финансовым инструментам на ценные бумаги. Рыночные Ордера не подлежат повторной котировке. Это значит, что, указав «Sell» или «Buy», Клиент желает открыть позицию на продажу или покупку по финансовому инструменту на ценные бумаги по первой доступной рыночной цене выбранного Инструмента. Если Клиент хочет совершить Операцию с Инструментом на ценные бумаги, а соответствующий Инструмент в это время приостановлен для совершения Операций (заморожен) на поставщике ликвидности, то Ордер Клиента будет отменён или останется активным в соответствии с Правилами.

14. В индивидуальном порядке по соглашению между Банком и Клиентом во взаимоотношениях между ними отдельные нормы настоящего Регламента могут быть изменены.