

Центральный Банк
Российской Федерации (Банк России)
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО
Дата 01 ноября 2016 г.

УТВЕРЖДЕНА решением Правления
Акционерного общества «Национальная
товарная биржа»
(Протокол № 36
от 20 ноября 2016 г.)

Директор (Председатель Правления)
Акционерного общества «Национальная
товарная биржа»
«Национальная
товарная биржа»
National Mercantile
Exchange
«ноябрь» ноября 2016 года
С. А. Наумов

Спецификация поставочных договоров своп, базисным активом которых является товар

Настоящая Спецификация поставочных договоров своп, базисным активом которых является товар, (далее – Спецификация) определяет стандартные условия заключения поставочных договоров своп, базисным активом которых является товар, (далее – договоры своп) на организованных торгах Акционерного общества «Национальная товарная биржа» (далее – Биржа) на товарном рынке (торгах Акционерного общества «Национальная товарная биржа»).

Спецификация совместно с правилами клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество), регулирующими порядок оказания клиринговых услуг на торгах Акционерного общества «Национальная товарная биржа» (далее – Правила клиринга), Правила организованных торгов Акционерного общества «Национальная товарная биржа» на товарном рынке (далее – Правила торгов), определяют порядок возникновения, изменения, исполнения и прекращения обязательств по договорам своп, а также иные условия договоров своп в соответствии с нормативными актами в сфере финансовых рынков.

Термины и определения, используемые в Спецификации, понимаются в соответствии с законодательством Российской Федерации, Правилами торгов, Правилами клиринга.

В целях Спецификации под продавцом понимается сторона, имеющая обязательство по второй части договора своп оплатить базисный актив договора своп, под покупателем – сторона, имеющая обязательство по второй части договора своп передать базисный актив договора своп.

1. Общие положения

1.1. Вид договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, которые будут заключаться на условиях Спецификации - поставочные договоры своп.

1.2. Формирование кода договора своп осуществляется по следующим правилам:

SXXY, где

S – признак того, что заключаемый договор является договором своп.

XX – переменная величина, обозначающая краткий код Товара, являющегося базисным активом, в соответствии с Перечнем базисных активов.

Y – переменная величина, обозначающая признак основной характеристики Товара, являющегося базисным активом, в соответствии с Перечнем базисных активов.

Датой исполнения обязательств по первой части договора своп является дата заключения договора своп. Определение даты исполнения обязательств по второй части договора своп происходит при заключении договора своп.

1.3. Базисным активом договора своп является Товар с основной характеристикой в соответствии с Перечнем базисных активов. Дополнительные характеристики Товара, являющегося базисным активом, не учитываются при заключении договора своп и исполнения обязательств по данному договору.

1.4. Первым днем торгов, на которых может быть заключен договор своп, является дата вступления в действие Спецификации, если иное не установлено решением Биржи.

Последним днем торгов, на которых может быть заключен договор своп, является последний рабочий день, дата которого предшествует дате прекращения действия Спецификации, если иное не установлено решением Биржи.

Минимальный срок, на который может быть заключен договор своп (количество дней между днями исполнения обязательств по первой и второй частями договора своп, включая день исполнения второй части своп договора) не может быть менее трех календарных дней.

1.5. Биржа утверждает Список параметров поставочных договоров своп, который содержит:

- код Товара;
- наименование Товара;
- шаг цены;
- размер лота.

1.6. В случае, если договор своп заключается на основании заявки на заключение договора своп, Базовый курс договора своп равен Расчетной цене товара, являющегося базисным активом договора своп за единицу соответствующего базисного актива в соответствии с Методикой определения Расчетных цен товара Пшеница мягкая на соответствующий базисный актив, определенной по итогам торгов в ближайшую дату торгов, предшествующую дате заключения договора своп.

1.7. В случае, если договор своп заключается на основании комбинированной заявки, Базовый курс договора своп равен цене Товара по форвардному договору, одновременно с которым заключается указанный договор своп, и являющегося базисным активом договора своп за единицу соответствующего базисного актива.

1.8. Стоимость базисного актива, передаваемая сторонами по первой и второй частям договора своп, одинакова и определяется как произведение Базового курса договора своп на соответствующее количество единиц базисного актива.

2. Обязательства по договорам своп и порядок их прекращения

2.1. Стороны своп контракта обязаны одновременно уплатить денежные средства в российских рублях (стоимость договора своп) в сумме, размер которой зависит от изменения стоимости Товара. Стоимость договора своп рассчитывается и уплачивается в дату исполнения обязательств по второй части своп контракта. Порядок расчета и уплаты стоимость договора своп определяется Правилами клиринга.

2.2. **Обязательства по первой части договора своп.** В дату заключения договора своп продавец обязан передать покупателю Товар, являющийся базисным активом договора своп, обладающий основной качественной характеристикой в объеме договора своп в Товаре, а покупатель обязан принять Товар, являющийся базисным активом договора своп, и уплатить продавцу сумму в российских рублях, равную произведению количество единиц

базисного актива, соответствующего количеству лотов договора своп на базовый курс договора своп.

2.3. Обязательства по второй части договора своп. В дату исполнения обязательств по второй части договора своп покупатель обязан передать Товар, являющийся базисным активом договора своп, с определенными условиями договора своп основной характеристикой и Базисом продажи в объеме договора своп в Товаре, а продавец обязан принять Товар, являющийся базисным активом договора своп, и уплатить покупателю сумму в российских рублях, равную сумме:

- стоимости базисного актива, равного сумме в российских рублях, уплаченной покупателем по первой части договора своп, и;
- стоимости договора своп (своп – разнице), определяемой в соответствии с формулой:

$$SW_{points} = \frac{SUM_{sw} * rate * d}{100 * 365}$$

где:

SW_{points} – стоимость договора своп в российских рублях;

SUM_{sw} - стоимость товара, являющегося базисным активом договора своп, в российских рублях;

$Rate$ – цена договора своп в процентах годовых. В случае, если договор своп заключается на основании комбинированной заявки, цена договора своп в процентах определяется на основании ценового показателя, определяемого в соответствии с методикой определения ценовых показателей договоров своп, заключаемых на основании комбинированных заявок на организованных торгах Акционерного общества «Национальная товарная биржа»;

d – количество дней между датами исполнения первой части договора своп и второй части договора своп, включая день исполнения второй части своп договора.

Если дата исполнения обязательств по второй части договора своп приходится на день, не являющийся Расчетным днем, то датой исполнения обязательств по второй части договора своп является ближайший следующий за ним Расчетный день. Если дата исполнения обязательств и следующий Расчетный день находятся в разных кварталах, то датой исполнения обязательств по второй части договора своп является последний Расчетный день в календарном квартале, относящемся к дате исполнения обязательств по второй части договора своп.

2.4. Порядок прекращения обязательств по договорам своп определяется Правилами клиринга.

2.5. Стороны несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по договору своп в соответствии с законодательством Российской Федерации и Правилами клиринга.

3. Особые условия

3.1. В случае приостановления/прекращения заключения договоров своп, в том числе в связи с ограничением обращения базисного актива договора своп, Биржа и/или Клиринговый центр вправе по согласованию друг с другом принять одно или несколько из следующих решений:

- 3.1.1. об изменении дат исполнения обязательств по договору своп;
- 3.1.2. о прекращении обязательств по договору своп;
- 3.1.3. иные решения, предусмотренные Правилами торгов и/или Правилами клиринга.

3.2. Информация о решении, принятом Биржей и/или Клиринговым центром в соответствии с пунктом 4.1 Спецификации, раскрывается путем ее опубликования на сайтах Биржи и/или Клирингового центра в сети интернет не менее чем за три рабочих дня до вступления в силу соответствующих решений, если иной срок не установлен решением Биржи и/или Клирингового центра.

4. Внесение изменений и дополнений в Спецификацию

4.1. Биржа вправе по согласованию с Клиринговым центром внести изменения и дополнения в Спецификацию.

4.2. Изменения и дополнения в Спецификацию вступают в силу с момента введения Биржей в действие Спецификации, содержащей указанные изменения и дополнения, после ее регистрации в установленном порядке в Банке России.

4.3. Информация о введении в действие Спецификации, содержащей изменения и дополнения, раскрывается путем ее опубликования на сайте Биржи в сети интернет не позднее чем за три рабочих дня до даты введения ее в действие.

4.4. С момента вступления в силу изменений и дополнений в Спецификацию условия существующих обязательств по ранее заключенным договорам своп считаются измененными с учетом таких изменений и дополнений.