

## УТВЕРЖДЕНА

Приказом

ПАО Московская Биржа

от 24 Марта 2022 г. №МБ-П-2022-652

### **Спецификация сделок спот и сделок своп с иностранной валютой и драгоценными металлами**

Настоящая Спецификация сделок спот и сделок своп с иностранной валютой и драгоценными металлами (далее – Спецификация) определяет стандартные условия заключения сделок спот, в т.ч. сделок фикс и средневзвешенных сделок и сделок своп с иностранной валютой и драгоценными металлами (далее – сделки спот, сделки фикс, средневзвешенные сделки и сделки своп) на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа.

Спецификация совместно с правилами клиринга Небанковской кредитной организации «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество), регулирующими порядок оказания клиринговых услуг на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа (далее – Правила клиринга), правилами, регулирующими порядок проведения торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа (далее – Правила торгов), определяет порядок возникновения, изменения, исполнения и прекращения обязательств по сделкам спот, сделкам фикс, средневзвешенным сделкам и сделкам своп, а также иные условия, предусмотренные настоящей Спецификацией.

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

В целях Спецификации под покупателем понимается сторона, имеющая обязательства по второй части сделки своп оплатить валюту лота, под продавцом – сторона, имеющая обязательства по второй части сделки своп передать валюту лота.

#### **1. Общие положения**

1.1. Формирование кода сделки спот осуществляется по следующим правилам:

XXXYYY\_ZZZ, где

XXX – код валюты лота,

YYY – код сопряженной валюты,

ZZZ – код, определяющий дату исполнения обязательств по сделке спот.

1.2. Формирование кода сделки фикс осуществляется по следующим правилам:

XXXYYYFIX0, для сделок фикс, где

XXX – код валюты лота,

YYY – код сопряженной валюты,

FIX0 – код, определяющий сделку фикс, заключаемую в дату определения курса фиксинга;

1.3. Формирование кода средневзвешенной сделки осуществляется по следующим правилам:

XXXYYYWAP0, для средневзвешенных сделок, где

XXX – код валюты лота,

YYY – код сопряженной валюты,

WAP0 – код, определяющий средневзвешенную сделку, заключаемую в дату определения средневзвешенного курса.

XXXYYYWAPV, для средневзвешенных сделок, где

XXX – код валюты лота,

YYY – код сопряженной валюты,

WAPV – код, определяющий средневзвешенную сделку, заключаемую в дату определения средневзвешенного курса с ценой с учетом премии/дисконта.

1.4. Формирование кода сделки своп осуществляется по следующим правилам:

XXX\_TTTZZZ, где

XXX – код валюты лота,

TTT – код, определяющий дату исполнения обязательств по первой части сделки своп,

ZZZ – код, определяющий дату исполнения обязательств по второй части сделки своп.

Код сделки своп может также формироваться по следующим правилам:

XXXYYYTTZZ, где

XXX – код валюты лота,

YYY – код сопряженной валюты,

TT – код, определяющий дату исполнения обязательств по первой части сделки своп,

ZZ – код, определяющий дату исполнения обязательств по второй части сделки своп.

1.5. Первым днем торгов, на которых может быть заключена сделка спот, сделка фикс или сделка своп, является дата введения в действие Спецификации, если иное не установлено решением Биржи.

Последним днем торгов, на которых может быть заключена сделка спот, сделка фикс или сделка своп, является последний рабочий день, дата которого предшествует дате прекращения действия Спецификации, если иное не установлено решением Биржи.

1.6. Биржа утверждает Список параметров сделок спот, сделок фикс и сделок своп на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа (далее – Список параметров), который содержит:

Для сделок спот:

- код сделки спот;
- код валюты лота;
- наименование валюты лота;
- наименование сопряженной валюты;

- лот сделки спот;
- шаг цены;
- дату исполнения обязательств по сделке спот.

Для сделок фикс:

- код сделки фикс;
- код валюты лота;
- наименование валюты лота;
- наименование сопряженной валюты;
- лот сделки фикс;
- количество торговых дней, на которое дата заключения сделки фикс предшествует дате определения курса фиксинга, по которому заключается сделка.

Для сделок своп:

- код сделки своп;
- код валюты лота;
- наименование валюты лота;
- наименование сопряженной валюты;
- лот сделки своп;
- шаг цены;
- точность базового курса;
- точность итогового курса;
- дату исполнения обязательств по первой и второй части сделки своп.

## **2. Обязательства по сделкам спот и сделкам своп и порядок их прекращения**

**2.1. Обязательства по сделке спот.** В дату исполнения обязательств по сделке спот, определяемый в соответствии со Списком параметров, продавец обязан передать покупателю иностранную валюту / драгоценный металл, являющийся валютой лота сделки спот, в объеме, кратном лоту сделки спот, а покупатель обязан уплатить продавцу сумму в сопряженной валюте, равную произведению соответствующего объема иностранной валюты / драгоценного металла на курс сделки спот, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

**2.2. Обязательства по сделке фикс.** В дату исполнения обязательств по сделке фикс, определяемой в соответствии со Списком параметров, продавец обязан передать покупателю иностранную валюту, являющуюся валютой лота сделки фикс, в объеме, кратном лоту сделки фикс, а покупатель обязан уплатить продавцу сумму в сопряженной валюте, равную произведению соответствующего объема иностранной валюты на курс фиксинга Московской Биржи, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

**2.3. Обязательства по средневзвешенной сделке.** В дату исполнения обязательств по средневзвешенной сделке, определяемой в соответствии со Списком параметров, продавец

обязан передать покупателю иностранную валюту, являющуюся валютой лота средневзвешенной сделки, в объеме, кратном лоту средневзвешенной сделки, а покупатель обязан уплатить продавцу сумму в сопряженной валюте, равную произведению соответствующего объема иностранной валюты на средневзвешенный курс, определенный на момент времени, установленный Списком параметров, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

## **2.4. Обязательства по сделке своп.**

**2.4.1. Обязательства по первой части сделки своп.** В дату исполнения обязательств по первой части сделки своп, определяемую в соответствии со Списком параметров, покупатель обязан передать продавцу иностранную валюту / драгоценный металл в объеме, кратном лоту сделки своп, а продавец обязан принять иностранную валюту / драгоценный металл и уплатить покупателю сумму в сопряженной валюте, равную произведению соответствующего объема иностранной валюты / драгоценного металла на базовый курс сделки своп, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

Базовым курсом сделки своп является центральный курс по соответствующей иностранной валюте / драгоценному металлу, определяемый на дату заключения сделки своп.

При заключении внесистемных сделок своп базовый курс устанавливается по соглашению участников торгов – конечных контрагентов.

**2.4.2. Обязательства по второй части сделки своп.** В дату исполнения обязательств по второй части сделки своп, определяемую в соответствии со Списком параметров, продавец обязан передать покупателю иностранную валюту / драгоценный металл в объеме, равном объему переданной по первой части сделки своп иностранной валюты / драгоценного металла, а покупатель обязан принять иностранную валюту / драгоценный металл и уплатить продавцу сумму в сопряженной валюте, равную произведению соответствующего объема иностранной валюты / драгоценного металла на итоговый курс сделки своп, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

2.5. Порядок прекращения обязательств по сделкам спот, сделкам фикс и сделкам своп определяется в Правилах клиринга.

2.6. Стороны несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по сделкам спот, сделкам фикс и сделкам своп в соответствии с законодательством Российской Федерации и Правилами клиринга.

## **3. Особые условия**

3.1. В случае приостановления/прекращения заключения сделок спот, сделок фикс или сделок своп, в том числе в связи с ограничением обращения валюты лота сделок спот, сделок фикс или сделок 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 сделке спот, сделке фикс или сделке своп;

3.1.2. о прекращении обязательств по сделке спот, сделке фикс или сделке 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 3.1 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.

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 сделкам спот, сделкам фикс и сделкам своп считаются измененными с учетом таких изменений и дополнений.