

УТВЕРЖДЕНА

Приказом ПАО Московская Биржа
От 18 июня 2021 года № МБ-П-2021-1600

Спецификация поставочных своп контрактов на иностранную валюту и драгоценные металлы (в новой редакции)

Настоящая Спецификация поставочных своп контрактов на иностранную валюту и драгоценные металлы (далее – Спецификация) определяет условия заключения поставочных своп контрактов на иностранную валюту и драгоценные металлы (далее – своп контракты) на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа.

Спецификация совместно с правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество), регулирующими порядок осуществления клиринга по сделкам, заключенным 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 своп контрактам, а также иные условия своп контрактов в соответствии с нормативными актами Банка России.

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 обязательство по второй части своп контракта оплатить базисный актив своп контракта, под продавцом – сторона, имеющая обязательство по второй части своп контракта передать базисный актив своп контракта.

1. Общие положения

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

1.2. Формирование кода своп контракта осуществляется по следующим правилам:

Код своп контракта со стандартным периодом исполнения обязательств по второй части своп контракта (далее – стандартный своп контракт):

XXX_TOMNZ, где

XXX – код базисного актива,

ТОМ – код, определяющий дату исполнения обязательств по первой части стандартного своп контракта, которая приходится на первый расчетный день, следующий за датой заключения стандартного своп контракта,

NZ – код, определяющий дату исполнения обязательств по второй части стандартного своп контракта, где N – число, обозначающее количество недель, месяцев или лет, а Z – код, обозначающий недели – W, месяцы – M, либо Y – годы.

Определение даты исполнения обязательств по второй части стандартного своп контракта осуществляется по следующим правилам:

- NW обозначает дату, отстоящую от даты исполнения обязательств по первой части стандартного своп контракта на соответствующее количество (N) недель (W);
- NM обозначает дату с числом, совпадающим с числом даты исполнения обязательств по первой части стандартного своп контракта, в календарном месяце, отстоящем от месяца исполнения обязательств по первой части стандартного своп контракта на соответствующее количество (N) месяцев (M);
- NY обозначает дату с числом, совпадающим с числом даты исполнения обязательств по первой части стандартного своп контракта, в календарном месяце, отстоящем от месяца исполнения обязательств по первой части стандартного своп контракта на 12 месяцев, умноженных на соответствующее количество (N) лет (Y).

1.3. Базисным активом своп контракта является иностранная валюта или драгоценный металл.

1.4. Биржа утверждает Список параметров поставочных своп контрактов на иностранную валюту / драгоценные металлы со стандартным периодом исполнения обязательств по второй части своп контракта на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа, который содержит:

- код своп контракта;
- код базисного актива;
- наименование базисного актива;
- лот своп контракта;
- шаг цены;
- код, определяющий дату исполнения обязательств по второй части своп контракта.

1.5. Первым днем торгов, на которых может быть заключен стандартный своп контракт, является дата введения в действие Спецификации, если иное не установлено решением Биржи.

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

2. Обязательства по своп контрактам и порядок их прекращения

2.1. Стороны своп контракта обязаны периодически уплачивать друг другу денежные средства в российских рублях (вариационную маржу) в сумме, размер которой зависит от изменения цены базисного актива. Вариационная маржа рассчитывается и уплачивается в период с расчетного дня, следующего за датой заключения своп контракта, до даты исполнения обязательств по второй части своп контракта включительно. Порядок расчета и уплаты вариационной маржи определяется Правилами клиринга.

2.2. **Обязательства по первой части своп контракта.** В расчетный день, следующий за датой заключения своп контракта, покупатель обязан передать продавцу иностранную валюту / драгоценный металл, являющийся базисным активом своп контракта, в объеме лота своп контракта, а продавец обязан принять базисный актив и уплатить покупателю

сумму в российских рублях, равную произведению лота своп контракта на базовый курс своп контракта, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

Базовым курсом своп контракта является центральный курс по соответствующему базисному активу, определяемый на дату заключения своп контракта.

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

2.3. Обязательства по второй части своп контракта.

В дату исполнения обязательств по второй части своп контракта продавец обязан передать покупателю иностранную валюту / драгоценный металл, являющийся базисным активом своп контракта, в объеме лота своп контракта, а покупатель обязан принять базисный актив и уплатить продавцу сумму в российских рублях в объеме, определяемом в соответствии с Правилами клиринга, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

Если дата исполнения обязательств по второй части стандартного своп контракта, определенная по правилу NW, приходится на день, не являющийся расчетным днем по соответствующему базисному активу стандартного своп контракта, то датой исполнения обязательств по второй части стандартного своп контракта является ближайший следующий за ним расчетный день по соответствующему базисному активу стандартного своп контракта.

Если дата исполнения обязательств по второй части стандартного своп контракта, определенная по правилу NM, приходится на число, отсутствующее в этом календарном месяце, то датой исполнения обязательств по стандартному своп контракту является последний расчетный день этого месяца по соответствующему базисному активу стандартного своп контракта.

Если дата исполнения обязательств по второй части стандартного своп контракта, определенная по правилу NM или NY, приходится на день, не являющийся расчетным днем по соответствующему базисному активу стандартного своп контракта, то датой исполнения обязательств по второй части стандартного своп контракта является ближайший следующий за ним расчетный день по соответствующему базисному активу стандартного своп контракта в этом же календарном месяце, а если такой расчетный день приходится на следующий календарный месяц, то датой исполнения обязательств по второй части стандартного своп контракта является последний расчетный день по соответствующему базисному активу стандартного своп контракта календарного месяца, определенного по правилу NM или NY.

2.4. Порядок прекращения обязательств по своп контрактам определяется в Правилах клиринга.

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

3. Особые условия

3.1. В случае приостановления/прекращения заключения своп контрактов, в том числе в связи с ограничением обращения базисного актива своп контракта, 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 своп контракту;

3.1.2. о прекращении обязательств по своп контракту;

3.1.3. об изменении порядка расчета и перечисления вариационной маржи;

3.1.4. 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 своп контрактам считаются измененными с учетом таких изменений и дополнений.