

УТВЕРЖДЕНА
Правлением
ОАО Московская Биржа
04 апреля 2014 г.
(Протокол №22)

СПЕЦИФИКАЦИЯ ДОГОВОРОВ

ВАЛЮТНЫЙ СВОП

2014 г.

СПЕЦИФИКАЦИЯ ДОГОВОРОВ (КОНТРАКТОВ)

ВАЛЮТНЫЙ СВОП

2014 г.

Настоящие условия договоров (контрактов) валютный своп (далее – *Спецификация*) применяются к предусмотренным настоящей Спецификацией договорам валютный своп, заключаемым Участниками торгов одним из способов, предусмотренных в Правилах торгов и (или) Правилах клиринга, за исключением договоров валютный своп, заключаемых на основании безадресных Заявок. Спецификация совместно с Правилами клиринга и Правилами торгов определяет порядок возникновения, изменения и прекращения обязательств по договорам валютный своп.

1. ОБЩИЕ ОПРЕДЕЛЕНИЯ

- 1.1. **Базисный (базовый) актив** применительно к Договору означает валюту, указанную в Списке параметров договоров валютный своп на рынке Стандартизированных ПФИ, утверждаемом Биржей.
- 1.2. **Биржа** означает Открытое акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС».
- 1.3. **Дата договора** означает применительно к Договору дату Торгового дня, в который заключен Договор.
- 1.4. **Дата окончательного платежа** означает день, указанный в этом качестве в Заявке. Для целей Спецификации Дата окончательного платежа является Датой платежа.
- 1.5. **Дата первоначального платежа** означает Дату договора или иной день, указанный в этом качестве в Заявке. Для целей Спецификации Дата первоначального платежа является Датой платежа.
- 1.6. **Дата платежа** означает применительно к Договору день, в который стороны обязаны исполнить свои обязательства по Договору, указанные в пункте 3.3 Спецификации.
- 1.7. **Договор** означает Сделку валютный своп, как она определена в пункте 3.1 Спецификации.
- 1.8. **Основной финансовый центр** означает применительно к валюте финансовый центр или центры, указанные в Списке параметров договоров валютный своп на рынке Стандартизированных ПФИ, утверждаемом Биржей.
- 1.9. **Правила клиринга** означает Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 1.10. **Правила торгов** означает Правила организованных торгов на рынке Стандартизированных ПФИ ОАО Московская Биржа.
- 1.11. **Рабочий день** означает:
 - (а) для целей расчета и уплаты вариационной маржи в определенной валюте – любой день, когда Биржа проводит Торги в Основном режиме, и день, когда кредитные организации осуществляют банковские операции (в том числе на

валютном рынке в соответствии со сложившейся на нем практикой) в этой валюте в Основных финансовых центрах;

- (б) для целей осуществления иных платежей в определенных валютах в Дату платежа – любой день, когда Биржа проводит Торги в Основном режиме, и:
 - (i) день, являющийся Рабочим днем для целей расчета и уплаты вариационной маржи; и
 - (ii) день, когда кредитные организации осуществляют банковские операции (в том числе на валютном рынке в соответствии со сложившейся на нем практикой) в этих валютах в Основных финансовых центрах;
- (в) для целей остальных положений настоящей Спецификации или Заявки – день, когда Биржа проводит Торги в Основном режиме.

1.12. **Условие об окончании срока в нерабочий день** означает условие, в соответствии с которым определяется день окончания срока, если последний день срока приходится на нерабочий день. В Заявке может быть указан в качестве Условия об окончании срока в нерабочий день:

- (а) **«Следующий рабочий день»** – в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день;
- (б) **«Предшествующий рабочий день»** – в этом случае днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день;
- (в) **«Рабочий день в отчетном периоде»** – в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день, а если этот ближайший следующий Рабочий день является днем следующего месяца, то днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день.
- (г) **«Предыдущий рабочий день в отчетном периоде»** – в этом случае днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день, а если этот ближайший предшествующий Рабочий день является днем предшествующего месяца, то днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день.

1.13. **Центральный контрагент** означает ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр».

Термины и определения, прямо не указанные в настоящей Спецификации, понимаются в соответствии с законодательством Российской Федерации, Правилами торгов, Правилами клиринга.

2. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

- 2.1. Правила торгов и Правила клиринга применяются к Договорам в части, не урегулированной настоящей Спецификацией.
- 2.2. Спецификация может быть изменена Биржей в одностороннем порядке в соответствии с Правилами торгов.
- 2.3. 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.

Информация о введении в действие Спецификации, содержащей изменения и дополнения, доводится до сведения Участников торгов путем опубликования на сайте Биржи в сети Интернет не менее чем за 3 (три) Торговых дня до введения в действие.

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

- 2.4. Договору присваивается код (обозначение) [FXSWAP].
- 2.5. Первым Торговым днем, в который может быть заключен Договор на Торгах Биржи (далее – первый день заключения Договора), является Торговый день, указанный в этом качестве в решении Биржи о возможности заключения Договора, принимаемом Биржей в соответствии с Правилами торгов.
- 2.6. Последним днем, в ходе которого может быть заключен Договор на Торгах Биржи (далее – последний день заключения Договора), является Торговый день, в который Биржа приняла решение о прекращении возможности заключения Договора.
- 2.7. Вариационная маржа рассчитывается и уплачивается каждый Рабочий день в период с Даты договора до последней Даты платежа по Договору.
- 2.8. Вариационная маржа рассчитывается по следующим формулам:

$$ВМ_0 = Р_{Ст} ,$$

$$ВМ_t = Р_{Ст} - Р_{Сп},$$

где:

$ВМ_0$ – вариационная маржа по Договору, по которому расчет вариационной маржи ранее не осуществлялся;

$ВМ_t$ – вариационная маржа по Договору, по которому расчет вариационной маржи осуществлялся ранее;

$Р_{Ст}$ – текущая (последняя) расчетная стоимость Договора. При этом, при расчете вариационной маржи в последнюю Дату платежа по Договору или дату досрочного прекращения Договора $Р_{Ст} = 0$;

$Р_{Сп}$ – предыдущая расчетная стоимость Договора.

- 2.9. Вариационная маржа по Договору, рассчитанная в российских рублях по формулам, указанным в пункте 2.8 Спецификации, округляется с точностью до копеек по правилам математического округления.

Вариационная маржа по Договору, рассчитанная в иной валюте по формулам, указанным в пункте 2.8 Спецификации, округляется с точностью до второго знака после запятой по правилам математического округления.

Уплата вариационной маржи по Договору осуществляется на безвозвратной основе.

- 2.10. Расчетная цена Договора и Расчетная стоимость Договора определяется в порядке и сроки, установленные Методикой расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ, утвержденной Центральным контрагентом.

- 2.11. Исполнение обязательств по уплате вариационной маржи осуществляется в порядке и сроки, установленные Правилами клиринга.
- 2.12. Обязательства по Договору полностью прекращаются их надлежащим исполнением, если иное не установлено Правилами клиринга.
- 2.13. Стороны несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по Договору в соответствии с законодательством Российской Федерации, Правилами торгов и Правилами клиринга.

3. СДЕЛКИ ВАЛЮТНЫЙ СВОП

- 3.1. **Сделка валютный своп** означает поставочный своп договор (контракт), по которому на условиях, согласованных сторонами, в Дату первоначального платежа одна сторона уплачивает другой стороне сумму (далее — «Сумма первоначального платежа») в одной согласованной валюте (далее в настоящем пункте — «Первая валюта»), а другая сторона уплачивает первой стороне Сумму первоначального платежа в другой согласованной валюте (далее в настоящем пункте — «Вторая валюта»), а в Дату окончательного платежа, наступающую не ранее третьего Рабочего дня после Даты договора, первая сторона уплачивает другой стороне сумму (далее — «Сумма окончательного платежа») во Второй валюте, а другая сторона уплачивает первой стороне Сумму окончательного платежа в Первой валюте. Сделка валютный своп является производным финансовым инструментом.
- 3.2. Помимо условий, установленных Правилами торгов, в Заявке Участник торгов указывает условия Сделки валютный своп, установленные формой Заявки, предусмотренной Приложением 1 к настоящей Спецификации. Условия, заключенные в указанной форме Заявки в квадратные скобки, являются факультативными и указываются в Заявке в случае их применения к Сделке валютный своп.
- 3.3. **Порядок осуществления расчетов по Сделкам валютный своп.**
 - (а) В Дату первоначального платежа каждая Сторона уплачивает другой Стороне Сумму первоначального платежа, указанную для нее в этом качестве в Заявке.
 - (б) В Дату окончательного платежа каждая Сторона уплачивает другой Стороне Сумму окончательного платежа, указанную для нее в этом качестве в Заявке.
- 3.4. **Изменение условий Сделки валютный своп.**
 - (а) Следующие условия Сделки валютный своп могут быть изменены в порядке, определенном Правилами клиринга:
 - (i) Валюта уплаты вариационной маржи
 - (ii) Дополнительный платеж
 - (б) Все прочие условия Сделки валютный своп не могут быть изменены.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

к Спецификации договоров (контрактов) валютный своп 2014 г.

Форма Заявки для Сделки валютный своп

Условиями Договора, к которому относится настоящая Заявка, являются:

(а) Первоначальный платеж:

Дата первоначального платежа: [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]

Сумма первоначального платежа для Стороны А:

Сумма первоначального платежа для Стороны Б:

(б) Окончательный платеж:

Дата окончательного платежа: [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]

Сумма окончательного платежа для Стороны А:

Сумма окончательного платежа для Стороны Б:

(в) Валюта уплаты вариационной маржи:¹

(г) [Иные условия:]

[Дополнительный платеж]

[Плательщик дополнительного платежа] [Сторона А] [Сторона Б]

[Сумма дополнительного платежа]

[Валюта дополнительного платежа]

[Дата дополнительного платежа]

Условие окончания срока в нерабочий день для условий, указанных в разделе (а) настоящей формы Заявки:

Условие окончания срока в нерабочий день для условий, указанных в разделе (б) настоящей формы Заявки

¹ Указывается одна из валют, предусмотренных Списком параметров договоров валютный своп на рынке Стандартизированных ПФИ, утвержденным Биржей