

СЛУЖБА БАНКА РОССИИ
ПО ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО
Дата "17" октября 2013 г.
в реестре за № 13-264/173-ч
Заместитель руководителя
Подпись



УТВЕРЖДЕНА
Правлением
ОАО Московская Биржа
18 сентября 2013 г.
(Протокол № 82)

СПЕЦИФИКАЦИЯ ДОГОВОРОВ

ВАЛЮТНЫЙ СВОП

2013 г.

СЛУЖБА БАНКА РОССИИ
ПО ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ
**УПРАВЛЕНИЕ ДЕЛАМИ
И АРХИВА**
ПРИЛОЖЕНИЕ
К вх. № 13-5346
от 20.09.2013

СПЕЦИФИКАЦИЯ ДОГОВОРОВ (КОНТРАКТОВ)

ВАЛЮТНЫЙ СВОП

2013 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. Спецификация совместно с Правилами клиринга, 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 Приложении 2 к настоящей Спецификации.
- 1.2. *Биржа* означает Открытое акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС».
- 1.3. *Дата истечения срока* означает применительно к Договору последний день срока Договора, указанный в этом качестве в Подтверждении. Дата истечения срока не подлежит переносу в соответствии с применимым к Договору Условием об окончании срока в нерабочий день.
- 1.4. *Дата окончательного платежа* означает Дату истечения срока или иной день, указанный в этом качестве в Подтверждении. Для целей Спецификации Дата окончательного платежа является Датой платежа.
- 1.5. *Дата первоначального платежа* означает Дату начала срока или иной день, указанный в этом качестве в Подтверждении. 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, указанный в качестве Даты платежа в Подтверждении или определяемый в соответствии с ним.
- 1.7. *Дата договора* означает применительно к Договору Дату сделки, указанную в этом качестве в Подтверждении.
- 1.8. *Договор* означает Сделку валютный своп, как она определена в пункте 3.1 Спецификации.
- 1.9. *Основной финансовый центр* означает применительно к Договору или валюте финансовый центр или центры, указанные в Подтверждении, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон – финансовый центр или центры, перечисленные по каждому виду валют в Приложении 2 к настоящей Спецификации.
- 1.10. *Подтверждение* означает Подтверждение в значении, определенном в Правилах торгов.
- 1.11. *Правила клиринга* означает Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 1.12. *Правила торгов* означает Правила организованных торгов на рынке Стандартизированных ПФИ ОАО Московская Биржа.
- 1.13. *Рабочий день* означает:
 - (а) для целей осуществления платежей в Дату платежа – любой день, когда Биржа проводит Торги в Основном режиме, и:
 - (i) днем, когда кредитные организации осуществляют банковские операции (в том числе на валютном рынке в соответствии со сложившейся на нем практикой) в месте или местах, указанных в Подтверждении для целей определения Рабочего дня;
 - (ii) при отсутствии такого указания:
 - (1) если евро является валютой, в которой должен быть осуществлен платеж, – днем, когда открыта Трансъевропейская автоматическая система валовых расчетов и экспресс-переводов в режиме реального времени (Система TARGET);
 - (2) если другая иностранная валюта является валютой, в которой должен быть осуществлен платеж, – днем, когда кредитные организации осуществляют банковские операции (в том числе на валютном рынке в соответствии со сложившейся на нем практикой) в Основном финансовом центре этой иностранной валюты;

(3) если несколько видов иностранных валют подлежат уплате, – Рабочим днем в соответствии с настоящим определением для каждой валюты соответственно;

(б) для целей остальных положений настоящей Спецификации или Подтверждения – день, когда Биржа проводит Торги в Основном режиме.

1.14. **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 Подтверждении 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.

Если последний день срока в соответствии с настоящей Спецификацией приходится на нерабочий день, день окончания срока определяется по правилу «Следующий рабочий день», указанному в подпункте (а) настоящего пункта 1.14, если иное не предусмотрено Подтверждением.

Термины и определения, прямо не указанные в настоящей Спецификации, понимаются в соответствии с законодательством Российской Федерации, Правилами торгов и 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 ближайший Торговый день, следующий за днем принятия Биржей решения о возможности заключения Договора 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 в период с Даты Договора до Даты истечения срока Договора.

2.8. Вариационная маржа рассчитывается по следующим формулам:

$$ВМ_0 = РС_T,$$

$$ВМ_T = РС_T - РС_0,$$

где:

ВМ₀ – 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;

РСт – текущая (последняя) расчетная стоимость Договора. При этом, при расчете вариационной маржи в Дату истечения срока Договора (дату досрочного прекращения Договора) РСт = 0;

РСП – 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.

- 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, если Подтверждением не установлено, что Первоначальный платеж не применяется, 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 сделки, 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. В Заявке Участник торгов указывает условия Сделки валютный своп, установленные формой Подтверждения, предусмотренной Приложением 1 к настоящей Спецификации. Условия, заключенные в указанной форме Подтверждения 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) Если Подтверждением не установлено, что Первоначальный платеж не применяется, в Дату первоначального платежа каждая Сторона уплачивает другой Стороне Сумму первоначального платежа, указанную для нее в этом качестве в Подтверждении.
- (б) В Дату окончательного платежа каждая Сторона уплачивает другой Стороне Сумму окончательного платежа, указанную для нее в этом качестве в Подтверждении.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

к Спецификации договоров (контрактов) валютный своп

Форма Подтверждения для Сделки валютный своп

Условиями Договора, к которому относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Дата истечения срока:

(б) Первоначальный платеж: [Применимо] [Не применимо]

[Дата первоначального платежа: [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]¹

Сумма первоначального платежа для Стороны А:

Сумма первоначального платежа для Стороны Б:]

(в) Окончательный платеж:

Дата окончательного платежа: [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]²

Сумма окончательного платежа для Стороны А:

Сумма окончательного платежа для Стороны Б:

[(г) Иные условия:

[Валюта уплаты вариационной маржи:] [Рубли]/[Доллары США]

[Дополнительные платежи] []

[Плательщик дополнительных платежей]

[Сумма дополнительных платежей] [Сторона А] [Сторона Б]

[Финансовый центр для валюты для стороны А]

[Финансовый центр для валюты для стороны Б]

[(д) Условие окончания срока в нерабочий день:]

¹ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Спецификации о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

² Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Спецификации о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

ПРИЛОЖЕНИЕ 2
К СПЕЦИФИКАЦИИ ДОГОВОРОВ ВАЛЮТНЫЙ СВОП

Основные финансовые центры

Валюта	Основной финансовый центр
<i>Доллар США</i>	Нью-Йорк
<i>Российский рубль</i>	Москва
<i>Евро</i>	