

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

СПЕЦИФИКАЦИЯ ДОГОВОРОВ
ВАЛЮТНО-ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП

2014 г.

СПЕЦИФИКАЦИЯ ДОГОВОРОВ (КОНТРАКТОВ)

ВАЛЮТНО-ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП

2014 г.

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

1. ОБЩИЕ ОПРЕДЕЛЕНИЯ

- 1.1. *Амортизация* означает условие Договора о постепенной амортизации (уменьшении) Номинальной суммы применительно к последующим Процентным периодам в соответствии с предусмотренным Договором графиком. В случае применения к Договору Амортизации Фиксированные суммы и/или Плавающие суммы в отношении Процентных периодов, следующих за уменьшением Номинальной суммы в соответствии с графиком амортизации, рассчитываются на основе такой уменьшенной Номинальной суммы. Условие об Амортизации может быть предусмотрено сторонами, если иное не установлено решением Биржи.
- 1.2. *Базисный (базовый) актив* применительно к Договору означает Плавающие и Фиксированные ставки, и валюту, указанную в Списке параметров договоров валютно-процентный своп на рынке Стандартизированных ПФИ, утверждаемом Биржей.
- 1.3. *Биржа* означает Открытое акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС».
- 1.4. *Дата начала срока* означает применительно к Договору день, указанный в этом качестве в Заявке, а при отсутствии такого указания – Дату договора. Дата начала срока не подлежит переносу в соответствии с применимым к Договору Условием об окончании срока в нерабочий день.
- 1.5. *Дата истечения срока* означает применительно к Договору последний день срока Договора, указанный в этом качестве в Заявке. Дата истечения срока не подлежит переносу в соответствии с применимым к Договору Условием об окончании срока в нерабочий день.
- 1.6. *Дата окончательного платежа* означает Рабочий день, указанный в этом качестве в Заявке. Для целей Спецификации Дата окончательного платежа является Датой платежа.
- 1.7. *Дата первоначального платежа* означает Рабочий день, указанный в этом качестве в Заявке. Для целей Спецификации Дата первоначального платежа является Датой платежа.
- 1.8. *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 Заявке или определяемый в соответствии с ней.

- 1.9. **Дата промежуточного платежа** означает каждую из Дат платежа между Датой первоначального платежа и Датой окончательного платежа, если срок Сделки валютно-процентный своп состоит из двух или более Процентных периодов. Для целей Спецификации каждая из Дат промежуточного платежа является Датой платежа.
- 1.10. **Дата договора** означает применительно к Договору дату Торгового дня, в который заключен Договор.
- 1.11. **Дата изменения плавающей ставки** означает, если иное не установлено решением Биржи, применительно к Договору каждый день, указанный в этом качестве в Заявке, в который Центральный контрагент определяет Плавающую ставку применительно к соответствующему Процентному периоду, с учетом применимого Условия об окончании срока в нерабочий день. При этом если Условие об окончании срока в нерабочий день не определено применительно к Дате изменения плавающей ставки, применяется Условие об окончании срока в нерабочий день, установленное для Дат платежа Плавающих сумм по этому Договору, за исключением случаев, когда применение такого Условия об окончании срока в нерабочий день приведет к совпадению Даты изменения плавающей ставки и Даты платежа применительно к Процентному периоду, к которому относится Дата изменения плавающей ставки. В последнем случае применяется Условие об окончании срока в нерабочий день «Предшествующий рабочий день».
- 1.12. **Дата калькуляции** означает применительно к Дате платежа или Процентному периоду наиболее ранний день, когда Центральный контрагент с учетом сложившихся обстоятельств может направить требуемое уведомление применительно к этой Дате платежа или Процентному периоду. Дата калькуляции должна наступить не позднее окончания Рабочего дня, непосредственно предшествующего Дате платежа, кроме случаев, когда этот предшествующий Рабочий день является Датой изменения плавающей ставки. В этом случае Датой калькуляции является день, который позволит осуществить платеж в Дату платежа.
- 1.13. **Договор** означает Сделку валютно-процентный своп, как она определена в пункте 3.1 Спецификации.
- 1.14. **Номинальная сумма** означает сумму в каждой из валют, указанную в этом качестве в Заявке применительно к Договору в целях расчета сумм платежей по Договору.
- 1.15. **Основной финансовый центр** означает применительно к валюте финансовый центр или центры, указанные в Списке параметров договоров валютно-процентный своп на рынке Стандартизированных ПФИ, утверждаемом Биржей.
- 1.16. **Округление** означает для целей любых расчетов, производимых в соответствии со Спецификацией:
- (а) округление любых сумм, выраженных в процентах, до пятого знака после запятой (включительно) по математическому методу;
 - (б) округление любых сумм в валюте до четвертого знака после запятой (включительно), если иной порядок округления не предусмотрен Спецификацией и (или) не используется в соответствии со сложившейся рыночной практикой на рынке соответствующей валюты.
- 1.17. **Период плавающей ставки** означает срок кредитования или иной аналогичный период, в отношении которого публикуется или определяется Плавающая ставка, указанный в этом качестве в Заявке.

- 1.18. **Плавающая ставка** означает процентную ставку, определяемую Центральным контрагентом в Дату изменения плавающей ставки применительно к соответствующему Процентному периоду в соответствии с согласованным Способом определения плавающей ставки.
- 1.19. **Правила клиринга** означает Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 1.20. **Правила торгов** означает Правила организованных торгов на рынке Стандартизированных ПФИОАО Московская Биржа.
- 1.21. **Рабочий день** означает:
- (а) применительно к Дате изменения плавающей ставки (если в Способе определения плавающей ставки не предусмотрено иное) и Способу определения плавающей ставки, выраженной в определенной валюте – любой 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 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;
 - (в) для целей осуществления иных платежей в определенной валюте для одной стороны Договора 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 этой валюте в Основных финансовых центрах и день, когда кредитные организации осуществляют банковские операции (в том числе на валютном рынке в соответствии со сложившейся на нем практикой) в валюте для другой стороны Договора в Основных финансовых центрах;
 - (г) для целей остальных положений настоящей Спецификации или Заявки – день, когда Биржа проводит Торги в Основном режиме.
- 1.22. **Смещение для Даты изменения плавающей ставки** – количество Рабочих дней, на которое уменьшается Дата изменения плавающей ставки, указанное в качестве Смещения для Даты изменения плавающей ставки в Заявке.
- 1.23. **Спрэд** означает процентную надбавку в виде ставки процентов годовых (которая может быть выражена отрицательным числом), указанную в этом качестве в Заявке применительно к Договору или стороне.
- 1.24. **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.

1.25. **Фиксированная ставка** означает процентную ставку, указанную в этом качестве в Заявке применительно к соответствующему Процентному периоду.

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

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

2. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

2.1. Срок Договора может состоять из одного или нескольких периодов начисления процентов (далее – **«Процентный период»**).

Первый Процентный период начинается в Дату начала срока (включительно) и оканчивается в день (исключая его), именуемый далее в Спецификации **«Дата окончания периода»**.

Каждый последующий Процентный период начинается в Дату окончания периода предшествующего Процентного периода (включительно) и оканчивается в Дату окончания периода (исключая ее) или применительно к последнему Процентному периоду – в Дату истечения срока (исключая ее).

Датами окончания, за исключением последнего Процентного периода, периода являются каждая из установленных сторонами Дат платежа.

2.2. Применительно к Договорам все процентные ставки выражаются целым числом или десятичной дробью в виде ставки процентов годовых.

2.3. Правила торгов и Правила клиринга применяются к Договорам в части, не урегулированной настоящей Спецификацией.

2.4. Спецификация может быть изменена Биржей в одностороннем порядке в соответствии с Правилами торгов.

2.5. 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.

- 2.6. Договору присваивается код (обозначение) [ХССУ].
- 2.7. 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.
- 2.8. 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.
- 2.9. Вариационная маржа рассчитывается и уплачивается каждый Рабочий день в период с Даты договора до последней Даты платежа по Договору.
- 2.10. Вариационная маржа рассчитывается по следующим формулам:

$$ВМ_0 = РС_т,$$

$$ВМ_т = РС_т - РС_п,$$

где:

ВМ₀ – вариационная маржа по Договору, по которому расчет вариационной маржи ранее не осуществлялся;

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

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

РС_п – предыдущая расчетная стоимость Договора.

- 2.11. Вариационная маржа по Договору, рассчитанная в российских рублях по формулам, указанным в пункте 2.10 Спецификации, округляется с точностью до копеек по правилам математического округления.

Вариационная маржа по Договору, рассчитанная в иной валюте по формулам, указанным в пункте 2.10 Спецификации, округляется с точностью до второго знака после запятой по правилам математического округления.

Уплата вариационной маржи по Договору осуществляется на безвозвратной основе.

- 2.12. Исполнение обязательств по уплате вариационной маржи осуществляется в порядке и сроки, установленные Правилами клиринга.
- 2.13. Обязательства по Договору полностью прекращаются их надлежащим исполнением, если иное не установлено Правилами клиринга.

2.14. Стороны несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по Договору в соответствии с законодательством Российской Федерации, Правилами торгов и Правилами клиринга.

3. СДЕЛКИ ВАЛЮТНО-ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП

3.1. **Сделка валютно-процентный своп** означает договор (контракт), предусматривающий (если иного не предусмотрено условиями Сделки валютно-процентный своп) (i) обязанность одной стороны передать валюту в собственность второй стороне в размере Номинальной суммы, установленной для второй стороны, и обязанность второй стороны уплатить первой стороне Номинальную сумму, установленную для первой стороны, (ii) обязанность второй стороны в установленную будущую дату, но не ранее третьего Рабочего дня после Даты договора, передать валюту первой стороне в размере Номинальной суммы, установленной для второй стороны, и обязанность первой стороны уплатить второй стороне Номинальную сумму, установленную для первой стороны, и (iii) обязанность стороны или сторон уплачивать друг другу единовременно или периодически Фиксированные суммы и/или Плавающие суммы, рассчитанные на основе Номинальных сумм, установленных для соответствующей стороны. Сделка валютно-процентный своп является производным финансовым инструментом.

3.2. Помимо условий, установленных Правилами торгов, в Заявке Участник торгов указывает условия Сделки валютно-процентный 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 валютно-процентный своп.

3.3. Порядок осуществления расчетов по Сделкам валютно-процентный своп.

- (а) Стороны уплачивают друг другу Фиксированные суммы или Плавающие суммы, указанные в этом качестве в Заявке или определяемые в соответствии с ней, в Дату окончательного платежа и в каждую из Дат промежуточного платежа, если срок Сделки валютно-процентный своп состоит из двух или более Процентных периодов.
- (б) Фиксированные суммы по Сделкам валютно-процентный своп рассчитываются в порядке, установленном пунктом 4.2 Спецификации. Плавающие суммы по Сделкам валютно-процентный своп рассчитываются в порядке, установленном пунктом 4.3 Спецификации.
- (в) Если предусмотрено условиями Договора, в Дату первоначального платежа каждая из сторон уплачивает другой стороне Номинальную сумму, определенную для этой стороны в Заявке (далее – **«Сумма первоначального платежа»**). Если предусмотрено условиями Договора, в Дату окончательного платежа каждая из сторон уплачивает другой стороне сумму в размере Суммы первоначального платежа, полученной от другой стороны в Дату первоначального платежа, или в ином размере, предусмотренном в Заявке (далее – **«Сумма окончательного платежа»**).
- (г) Вместо единовременного обмена Суммами окончательного платежа в Дату окончательного платежа в порядке, установленном подпунктом (в) выше, стороны вправе предусмотреть, если иное не установлено решением Биржи, что Суммы окончательного платежа уплачиваются в рассрочку, то есть по частям (далее каждая такая часть - **«Сумма промежуточного платежа»**) в каждую Дату промежуточного платежа с выплатой остатка Суммы

окончательного платежа в Дату окончательного платежа. При этом Фиксированные суммы или Плавающие суммы для каждого последующего Процентного периода рассчитываются на основе Номинальных сумм за вычетом уплаченных соответствующей стороной Сумм промежуточного платежа.

3.4. Изменение условий Сделки валютно-процентный своп.

- (a) Следующие условия Сделки валютно-процентный своп могут быть изменены в порядке, определенном Правилами клиринга:
- (i) Валюта уплаты вариационной маржи
 - (ii) Фиксированная ставка
 - (iii) Коэффициент расчета дней в процентном периоде для Фиксированной ставки
 - (iv) Способ определения плавающей ставки
 - (v) Спред
 - (vi) Коэффициент расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки
 - (vii) Смещение для Даты изменения плавающей ставки
 - (viii) Дополнительный платеж
- (б) Все прочие условия Сделки валютно-процентный своп не могут быть изменены.

4. РАСЧЕТ ФИКСИРОВАННЫХ СУММ И ПЛАВАЮЩИХ СУММ

4.1. Фиксированная сумма или Плавающая сумма применительно к какой-либо Дате платежа рассчитывается по Фиксированной ставке или Плавающей ставке, применимой к Процентному периоду, оканчивающемуся в такую Дату платежа или, если Дата платежа не является Датой окончания периода, ближайшую к этой Дате платежа Дату окончания периода. Если иное не предусмотрено решением Биржи, расчет (калькуляция) Фиксированных сумм и Плавающих сумм осуществляется Центральным контрагентом и направляется Участнику торгов не позднее Даты калькуляции.

Фиксированные суммы

4.2. Фиксированная сумма, подлежащая уплате в Дату платежа Фиксированной суммы, составляет:

сумму, равную произведению Номинальной суммы, Фиксированной ставки и Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, указанного в Заявке для расчета Фиксированных сумм:

$$\text{Фиксированная сумма} = \text{Номинальная сумма} \times \text{Фиксированная ставка} \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном}$$

Плавающие суммы

4.3. Плавающая сумма, подлежащая уплате в Дату платежа Плавающей суммы, равна:

- (а) если в отношении такого Договора не установлено условия о капитализации, – произведению Номинальной суммы, Плавающей ставки (с добавлением спреда) и Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, указанного в Заявке для расчета Плавающих сумм:

$$\text{Плавающая сумма} = \frac{\text{Номинальная сумма}}{\text{сумма}} \times (\text{Плавающая ставка} + \text{спред}) \times \frac{\text{Коэффициент для расчета дней в процентном}}{\text{в процентном}}$$

- (б) если в отношении такого Договора установлено условие о капитализации, – сумме Сумм периодов капитализации, рассчитанных в порядке, установленном пунктом 4.5 Спецификации, за каждый Период капитализации в Процентном периоде применительно к Дате платежа.

Коэффициент для расчета дней в процентном периоде

4.4. В целях расчета Фиксированных сумм, Плавающих сумм или Сумм периода капитализации Участники торгов, если иное не установлено решением Биржи, указывают в Заявке один из следующих коэффициентов для расчета количества дней в Процентном периоде или Периоде капитализации, исходя из которого начисляются Фиксированные суммы, Плавающие суммы или Суммы периода капитализации (далее – «*Коэффициент для расчета дней в процентном периоде*»):

- (а) **30E/360** означает количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, которое условно рассчитывается на основе года, состоящего из 12 месяцев продолжительностью 30 дней каждый, разделенное на 360. В случае если последний день Процентного периода или Периода капитализации приходится на последний день февраля, за количество дней, истекшее в этом месяце, принимается фактическое количество дней);

- (б) **30/360 (30/360 US, 30/360 ISDA)** означает

$$(360 * (Y2 - Y1) + 30 * (M2 - M1) + (D2 - D1)) / 360, \text{ где}$$

D1 - это первый день в Процентном периоде или Периоде капитализации;

D2- это последний день в Процентном периоде или Периоде капитализации;

M1 – это номер месяца первого дня в Процентном периоде или Периоде капитализации;

M2 - это номер месяца последнего дня в Процентном периоде или Периоде капитализации;

Y1 – это номер года первого дня в Процентном периоде или Периоде капитализации;

Y2 - это номер года последнего дня в Процентном периоде или Периоде капитализации;

Для целей определения Коэффициента для расчета дней в процентном периоде применяется следующая последовательность поправок:

1. Полагаем D2 = 30, если:

последний день каждого Процентного периода или Периода капитализации приходится на последний день месяца, и если первый

день Процентного периода или Периода капитализации приходится на последний день февраля, и последний день Процентного периода или Периода капитализации приходится на последний день февраля.

2. Полагаем $D1 = 30$, если:

последний день каждого Процентного периода или Периода капитализации приходится на последний день месяца, и первый день Процентного периода или Периода капитализации приходится на конец февраля.

3. Полагаем $D2 = 30$, если:

$D2$ равно 31, и $D1$ равно 30 или 31.

4. Полагаем $D1 = 30$, если:

$D1$ равно 31.

- (в) **Фактическое/360** означает фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на 360;
- (г) **Фактическое/365** означает фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на 365;
- (д) **Фактическое/Фактическое** означает:
 - (i) фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на действительное число календарных дней в году (365 или 366 дней соответственно);
 - (ii) если части Процентного периода или Периода капитализации приходятся на календарные годы с различным количеством дней (365 и 366 дней соответственно), то начисление процентов за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 365, производится из расчета 365 календарных дней в году, а за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 366, производится из расчета 366 календарных дней в году.

Капитализация

4.5. Для целей расчета Плавающей суммы в случае, когда в отношении Договора установлено условие о капитализации:

- (а) **Период капитализации** означает применительно к Процентному периоду каждый период времени, начиная с (включительно) Даты начала срока или Даты капитализации по (исключая) следующую Дату капитализации или Дату истечения срока;
- (б) **Дата капитализации** означает каждый день в течение срока соответствующего Договора, указанный в этом качестве в Заявке;
- (в) **Сумма периода капитализации** означает применительно к каждому Периоду капитализации сумму, равную произведению Уточненной номинальной суммы, Плавающей ставки (с добавлением спреда) и Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, применимого для расчета Плавающих сумм:

$$\text{Сумма периода капитализации} = \frac{\text{Уточненная номинальная сумма}}{\text{Уточненная номинальная сумма}} \times (\text{Плавающая ставка} + \text{спред})^* \times \frac{\text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}}{\text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}}$$

- (г) **Уточненная номинальная сумма** означает:
- (i) применительно к первому Периоду капитализации в Процентном периоде - Номинальную сумму для этого Процентного периода;
 - (ii) применительно к каждому последующему Периоду капитализации в этом Процентном периоде – сумму Номинальной суммы для этого Процентного периода и Сумм периодов капитализации за каждый предшествующий Период капитализации в этом Процентном периоде.

Условие о капитализации может быть предусмотрено Сторонами, если иное не установлено решением Биржи.

5. СПОСОБЫ ОПРЕДЕЛЕНИЯ ПЛАВАЮЩЕЙ СТАВКИ

- 5.1. Для целей расчета Плавающих сумм по Договору Участники торгов указывают в Заявке способ определения Плавающей ставки (далее – «**Способ определения плавающей ставки**») путем ссылки на наименование любого из способов, указанных в настоящей статье 5 Спецификации.
- 5.2. Если иное не установлено решением Биржи, Сторонами могут быть использованы следующие Способы определения плавающей ставки:

По суммам, выраженным в рублях

- (а) **NFEA SWAP Rate** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является индикативная премия по операциям своп на российском рынке - NFEA SWAP Rate, формируемая НАЦИОНАЛЬНОЙ ВАЛЮТНОЙ АССОЦИАЦИЕЙ (НВА) на основе котировок премий по операциям своп \$/RUB с расчетами по первой части обмена сроком «завтра» (“tomorrow”, TOM), объявляемых ведущими участниками российского финансового рынка и публикуемая НВА в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (б) **NFEA RUONIA OIS FIXING** (или **ROISfix**) означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка NFEA RUONIA OIS FIXING (или ROISfix), формируемая НАЦИОНАЛЬНОЙ ВАЛЮТНОЙ АССОЦИАЦИЕЙ (НВА) на основе котировок, объявляемых участниками фиксинга, и публикуемая НВА в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (в) **RUB-MOSPRIME-NFEA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является предлагаемая ставка по депозитам в рублях на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая на странице MOSPRIME1 в системе Reuters в 12 часов 30 минут по московскому времени в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.

- (г) **RUONIA** или **Ruble OverNight Index Average** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является индикативная взвешенная ставка однодневных рублевых кредитов (депозитов) в рублях на московском межбанковском рынке, рассчитываемая Банком России по методике, разработанной Национальной валютной ассоциацией (далее – «**НВА**») совместно с Банком России, и публикуемая в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (д) **RUONIA-OIS-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, рассчитываемая Центральным контрагентом на основе ставок RUONIA, публикуемых за соответствующий Процентный период, с ежедневной капитализацией накопленных процентов по следующей формуле:

$$\frac{\text{РДо}}{\prod_{i=1}^{\text{РДо}} (1 + [\text{RUONIA}_i * \text{КРД}_i]) - 1} * 1 / \sum_{i=1}^{\text{РДо}} \text{КРД}_i$$

где:

РДо - количество рабочих дней в периоде с Даты начала срока до Даты истечения срока (далее – Период накопления процентов); при этом рабочим днем для целей настоящего Способа определения плавающей ставки считается день, когда кредитные организации осуществляют банковские операции в г. Москве;

i - порядковое значение соответствующего рабочего дня в соответствующем Периоде накопления процентов, входящее во множество последовательных целых чисел от одного до РДо;

RUONIA_i - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает значение ставки RUONIA, публикуемой на следующий Рабочий день после дня i ;

КРД_i - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает Коэффициент расчета дней в процентном периоде, применимый к Плавающей ставке в таком Процентном периоде. При этом под Процентным периодом в целях настоящего Способа определения плавающей ставки понимается исчисляемый в календарных днях срок от каждого дня i (включая такой день i) до ближайшего следующего i (исключая такой день). Во избежание сомнений, если ближайшим следующим днем i для какого-либо дня i является следующий календарный день, Процентный период, начинающийся в такой день i , составляет один день.

По суммам, выраженным в долларах США

- (а) **USD-LIBOR BBA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам в долларах США на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.

- (б) **USFEDFUNDS или USD-Federal Funds-H.15** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, установленная в еженедельном выпуске H.15(519) Федеральной резервной системы США на соответствующую дату под заголовком «EFFECT», публикуемая на странице FEDFUNDS1 в системе Reuters в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (в) **USFEDFUNDS-OIS-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, рассчитываемая Центральным контрагентом на основе ставок USFEDFUNDS, публикуемых за соответствующий Процентный период, с ежедневной капитализацией накопленных процентов по следующей формуле:

$$P_{До} = \left[\prod_{i=1}^{R_{До}} (1 + [USFEDFUNDS_i * KPD_i]) - 1 \right] * 1 / \sum_{i=1}^{R_{До}} KPD_i$$

где:

$R_{До}$ - количество рабочих дней в периоде с Даты начала срока до Даты истечения срока (далее – Период накопления процентов); при этом рабочим днем для целей настоящего Способа определения плавающей ставки считается день, когда кредитные организации осуществляют банковские операции в финансовом центре, который соответствует долларам США;

i - порядковое значение соответствующего рабочего дня в соответствующем Периоде накопления процентов, входящее во множество последовательных целых чисел от одного до $R_{До}$;

$USFEDFUNDS_i$ - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает значение ставки USFEDFUNDS, соответствующее Рабочему дню i ;

KPD_i - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает Коэффициент расчета дней в процентном периоде, применимый к Плавающей ставке в таком Процентном периоде. При этом под Процентным периодом в целях настоящего Способа определения плавающей ставки понимается исчисляемый в календарных днях срок от каждого дня i (включая такой день i) до ближайшего следующего i (исключая такой день). Во избежание сомнений, если ближайшим следующим днем i для какого-либо дня i является следующий календарный день, Процентный период, начинающийся в такой день i , составляет один день.

По суммам, выраженным в евро

- (а) **EUR-EURIBOR-Reuters** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам в евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая в 11 часов по брюссельскому времени на странице EURIBOR01 в системе Reuters в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (б) **EONIA или Euro OverNight Index Average** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является индикативная взвешенная

ставка однодневных кредитов (депозитов) в евро на межбанковском рынке государств еврозоны, публикуемая в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки около 12 часов по брюссельскому времени на странице EONIA= или EONIARECAP в системе Reuters.

- (в) **EONIA-OIS-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, рассчитываемая Центральным контрагентом на основе ставок EONIA, публикуемых за соответствующий Процентный период, с ежедневной капитализацией накопленных процентов по следующей формуле:

$$\frac{РДо}{\left[\prod_{i=1} (1 + [EONIA_i * КРД_i]) - 1 \right] * 1 / \sum_{i=1} КРД_i}$$

где:

РДо - количество рабочих дней в периоде с Даты начала срока до Даты истечения срока (далее – Период накопления процентов); при этом рабочим днем для целей настоящего Способа определения плавающей ставки считается день, когда кредитные организации осуществляют банковские операции в финансовом центре, который соответствует евро;

i - порядковое значение соответствующего рабочего дня в соответствующем Периоде накопления процентов, входящее во множество последовательных целых чисел от одного до РДо;

EONIA_i - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает значение ставки EONIA, соответствующее Рабочему дню i;

КРД_i - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает Коэффициент расчета дней в процентном периоде, применимый к Плавающей ставке в таком Процентном периоде. При этом под Процентным периодом в целях настоящего Способа определения плавающей ставки понимается исчисляемый в календарных днях срок от каждого дня i (включая такой день i) до ближайшего следующего i (исключая такой день). Во избежание сомнений, если ближайшим следующим днем i для какого-либо дня i является следующий календарный день, Процентный период, начинающийся в такой день i, составляет один день.

По суммам, выраженным в фунтах стерлинга

- (а) **GBP-LIBOR BBA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам в фунтах стерлинга на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая ICE Benchmark Administration Limited (IBA) в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (б) **SONIA или Sterling OverNight Index Average** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является индикативная взвешенная ставка однодневных кредитов (депозитов) в фунтах стерлинга на межбанковском рынке, публикуемая British Bankers' Association (BBA) в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.

- (в) **SONIA-OIS-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, рассчитываемая Центральным контрагентом на основе ставок SONIA, публикуемых за соответствующий Процентный период, с ежедневной капитализацией накопленных процентов по следующей формуле:

$$\frac{\text{РДо}}{\left[\prod_{i=1} (1 + [\text{SONIA}_i * \text{КРД}_i]) - 1 \right] * 1 / \sum_{i=1} \text{КРД}_i}$$

где:

РДо - количество рабочих дней в периоде с Даты начала срока до Даты истечения срока (далее – Период накопления процентов); при этом рабочим днем для целей настоящего Способа определения плавающей ставки считается день, когда кредитные организации осуществляют банковские операции в финансовом центре, который соответствует фунтам стерлинга;

i - порядковое значение соответствующего рабочего дня в соответствующем Периоде накопления процентов, входящее во множество последовательных целых чисел от одного до РДо;

SONIA_i - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает значение ставки SONIA, соответствующее Рабочему дню i ;

КРД_i - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает Коэффициент расчета дней в процентном периоде, применимый к Плавающей ставке в таком Процентном периоде. При этом под Процентным периодом в целях настоящего Способа определения плавающей ставки понимается исчисляемый в календарных днях срок от каждого дня i (включая такой день i) до ближайшего следующего i (исключая такой день). Во избежание сомнений, если ближайшим следующим днем i для какого-либо дня i является следующий календарный день, Процентный период, начинающийся в такой день i , составляет один день.

По суммам, выраженным в швейцарских франках

- (а) **CHF-Libor BBA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам в швейцарских франках на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая ICE Benchmark Administration Limited (IBA) в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (б) **SARON или Swiss Average Rate OverNight** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является индикативная взвешенная ставка однодневных операций РЕПО в швейцарских франках на межбанковском рынке, публикуемая Швейцарским Национальным Банком в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (в) **SARON-OIS-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, рассчитываемая Центральным контрагентом на основе ставок SARON, публикуемых за соответствующий Процентный период, с ежедневной капитализацией накопленных процентов по следующей формуле:

$$\frac{РДо}{\prod_{i=1} [1 + [SARON_i * КРД_i)] - 1} * 1 / \sum_{i=1} КРД_i$$

где:

РДо - количество рабочих дней в периоде с Даты начала срока до Даты истечения срока (далее – Период накопления процентов); при этом рабочим днем для целей настоящего Способа определения плавающей ставки считается день, когда кредитные организации осуществляют банковские операции в финансовом центре, который соответствует швейцарским франкам;

i - порядковое значение соответствующего рабочего дня в соответствующем Периоде накопления процентов, входящее во множество последовательных целых чисел от одного до РДо;

$SARON_i$ - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает значение ставки SARON, соответствующее Рабочему дню i ;

$КРД_i$ - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает Коэффициент расчета дней в процентном периоде, применимый к Плавающей ставке в таком Процентном периоде. При этом под Процентным периодом в целях настоящего Способа определения плавающей ставки понимается исчисляемый в календарных днях срок от каждого дня i (включая такой день i) до ближайшего следующего i (исключая такой день). Во избежание сомнений, если ближайшим следующим днем i для какого-либо дня i является следующий календарный день, Процентный период, начинающийся в такой день i , составляет один день.

По суммам, выраженным в китайских юанях

- (a) **SHIBOR** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам в китайских юанях на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая в 11:30 часов по пекинскому времени в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (б) **SHIFON** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам овернайт в китайских юанях, публикуемая в 11:30 часов по пекинскому времени в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (в) **SHIFON-OIS-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, рассчитываемая Центральным контрагентом на основе ставок SHIFON, публикуемых за соответствующий Процентный период, с ежедневной капитализацией накопленных процентов по следующей формуле:

$$\frac{РДо}{\prod_{i=1} [1 + [SHIFON_i * КРД_i)] - 1} * 1 / \sum_{i=1} КРД_i$$

где:

РДо - количество рабочих дней в периоде с Даты начала срока до Даты истечения срока (далее – Период накопления процентов); при этом рабочим днем для целей настоящего Способа определения плавающей ставки считается день, когда кредитные организации осуществляют банковские операции в финансовом центре, который соответствует китайским юаням;

i - порядковое значение соответствующего рабочего дня в соответствующем Периоде накопления процентов, входящее во множество последовательных целых чисел от одного до РДо;

$SHIFON_i$ - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает значение ставки SHIFON, соответствующее Рабочему дню i ;

КРД $_i$ - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает Коэффициент расчета дней в процентном периоде, применимый к Плавающей ставке в таком Процентном периоде. При этом под Процентным периодом в целях настоящего Способа определения плавающей ставки понимается исчисляемый в календарных днях срок от каждого дня i (включая такой день i) до ближайшего следующего i (исключая такой день). Во избежание сомнений, если ближайшим следующим днем i для какого-либо дня i является следующий календарный день, Процентный период, начинающийся в такой день i , составляет один день.

По суммам, выраженным в шведских кронах

- (a) **SEK-Libor BBA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам в шведских кронах на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая ICE Benchmark Administration Limited (IBA) в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (б) **SIOR или Stockholm Interbank Offered Rate T/N** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам в шведских кронах на срок Tomnext публикуемая ICE Benchmark Administration Limited (IBA) в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (в) **SIOR-OIS-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, рассчитываемая Центральным контрагентом на основе ставок SIOR, публикуемых за соответствующий Процентный период, с ежедневной капитализацией накопленных процентов по следующей формуле:

$$\frac{РДо}{\prod_{i=1}^{РДо} (1 + [SIOR_i * КРД_i])} - 1 \cdot 1 / \sum_{i=1}^{РДо} КРД_i$$

где:

РДо - количество рабочих дней в периоде с Даты начала срока до Даты истечения срока (далее – Период накопления процентов); при этом рабочим днем для целей настоящего Способа определения плавающей ставки считается день, когда кредитные организации осуществляют банковские операции в финансовом центре, который соответствует шведским кронам;

i - порядковое значение соответствующего рабочего дня в соответствующем Периоде накопления процентов, входящее во множество последовательных целых чисел от одного до РДо;

$SIOR_i$ - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает значение ставки $SIOR$, соответствующее Рабочему дню i ;

$KPД_i$ - применительно к какому-либо дню i в соответствующем Процентном периоде означает Коэффициент расчета дней в процентном периоде, применимый к Плавающей ставке в таком Процентном периоде. При этом под Процентным периодом в целях настоящего Способа определения плавающей ставки понимается исчисляемый в календарных днях срок от каждого дня i (включая такой день i) до ближайшего следующего i (исключая такой день). Во избежание сомнений, если ближайшим следующим днем i для какого-либо дня i является следующий календарный день, Процентный период, начинающийся в такой день i , составляет один день.

По суммам, выраженным в канадских долларах

- (a) **CAD-Libor BBA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам в канадских долларах на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая ICE Benchmark Administration Limited (IBA) в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (б) **CORRA или Canadian Overnight Repo Rate** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является индикативная взвешенная ставка однодневных операций РЕПО в канадских долларах на межбанковском рынке, публикуемая Банком Канады в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (в) **CORRA-OIS-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, рассчитываемая Центральным контрагентом на основе ставок CORRA, публикуемых за соответствующий Процентный период, с ежедневной капитализацией накопленных процентов по следующей формуле:

$$\frac{РДо}{\prod_{i=1} (1 + [CORRA_i * KPД_i]) - 1} * 1 / \sum_{i=1} KPД_i$$

где:

РДо - количество рабочих дней в периоде с Даты начала срока до Даты истечения срока (далее – Период накопления процентов); при этом рабочим днем для целей настоящего Способа определения плавающей ставки считается день, когда кредитные организации осуществляют банковские операции в финансовом центре, который соответствует канадским долларам;

i - порядковое значение соответствующего рабочего дня в соответствующем Периоде накопления процентов, входящее во множество последовательных целых чисел от одного до РДо;

CORRA_i - применительно к какому-либо дню *i* в соответствующем Процентном периоде означает значение ставки CORRA, соответствующее Рабочему дню *i*;

КРД_i - применительно к какому-либо дню *i* в соответствующем Процентном периоде означает Коэффициент расчета дней в процентном периоде, применимый к Плавающей ставке в таком Процентном периоде. При этом под Процентным периодом в целях настоящего Способа определения плавающей ставки понимается исчисляемый в календарных днях срок от каждого дня *i* (включая такой день *i*) до ближайшего следующего *i* (исключая такой день). Во избежание сомнений, если ближайшим следующим днем *i* для какого-либо дня *i* является следующий календарный день, Процентный период, начинающийся в такой день *i*, составляет один день.

По суммам, выраженным в японских йенах

- (a) ***JPY-Libor BBA*** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам в японских йенах на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая ICE Benchmark Administration Limited (IBA) в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (б) ***TONAR или Tokyo OverNight Average Rate*** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является индикативная взвешенная ставка однодневных необеспеченных кредитов (депозитов) в японских юанях на межбанковском рынке, публикуемая Банком Японии в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки на Смещение для Даты изменения плавающей ставки.
- (в) ***TONAR-OIS-COMPOUND*** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, рассчитываемая Центральным контрагентом на основе ставок TONAR, публикуемых за соответствующий Процентный период, с ежедневной капитализацией накопленных процентов по следующей формуле:

$$\frac{РДо}{\prod_{i=1} (1 + [TONAR_i * КРД_i]) - 1} * 1 / \sum_{i=1} КРД_i$$

где:

РДо - количество рабочих дней в периоде с Даты начала срока до Даты истечения срока (далее – Период накопления процентов); при этом рабочим днем для целей настоящего Способа определения плавающей ставки считается день, когда кредитные организации осуществляют банковские операции в финансовом центре, который соответствует японским юаням;

i - порядковое значение соответствующего рабочего дня в соответствующем Периоде накопления процентов, входящее во множество последовательных целых чисел от одного до РДо;

TONAR_i - применительно к какому-либо дню *i* в соответствующем Процентном периоде означает значение ставки TONAR, соответствующее Рабочему дню *i*;

КРДі - применительно к какому-либо дню і в соответствующем Процентном периоде означает Коэффициент расчета дней в процентном периоде, применимый к Плавающей ставке в таком Процентном периоде. При этом под Процентным периодом в целях настоящего Способа определения плавающей ставки понимается исчисляемый в календарных днях срок от каждого дня і (включая такой день і) до ближайшего следующего і (исключая такой день). Во избежание сомнений, если ближайшим следующим днем і для какого-либо дня і является следующий календарный день, Процентный период, начинающийся в такой день і, составляет один день.

- 5.3. Биржа вправе принять решение о возможности применения Участниками торгов при заключении Договоров Способов определения плавающей ставки, не указанных в пункте 5.2 Спецификации. Информация о решении, принятом Биржей в соответствии с настоящим пунктом Спецификации, доводится до сведения Участников торгов путем ее опубликования на сайте Биржи в сети Интернет не менее чем за 3 (три) Торговых дня до вступления в силу соответствующего решения. В указанном решении Биржа указывает код, который будет присвоен Договорам, по которым будет использоваться такой Способ определения плавающий ставки.
- 5.4. Если применимая к Договору публикуемая процентная ставка, указанная в Способе определения плавающей ставки, или источник ее опубликования официально меняется на иную публикуемую процентную ставку или источник ее опубликования, такое событие не является Сбоем публикации. В этом случае Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки будет определяться так, как если бы в Способе определения плавающей ставки была указана новая публикуемая процентная ставка или источник ее опубликования.

6. СБОЙ ПУБЛИКАЦИИ

- 6.1. **Сбой публикации** означает невозможность к моменту проведения расчетов в соответствии с Правилами клиринга получить информацию о процентной ставке из источника информации о процентных ставках, указанного в согласованном сторонами Способе определения плавающей ставки, или любую иную информацию, необходимую для определения Плавающей ставки на Дату изменения плавающей ставки.
- 6.2. Если в отношении Договора наступает Сбой публикации:
 - (а) и если Сбой публикации происходит в Дату изменения плавающей ставки, Дата изменения плавающей ставки переносится на ближайший Рабочий день после того, как Сбой публикации перестанет иметь место;
 - (б) в иных случаях стороны должны согласовать новый Способ определения плавающей ставки, если Сбой публикации имеет место в течение пяти Рабочих дней. Если стороны не согласуют новый Способ определения плавающей ставки в течение пяти Рабочих дней (и Сбой публикации при этом продолжает иметь место), Центральный контрагент вправе по своему усмотрению определить новый Способ определения плавающей ставки.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

к Спецификации договоров (контрактов) валютно-процентный своп 2014 г.

Форма Заявки для Сделки валютно-процентный своп

Условиями Договора, к которому относится настоящая Заявка, являются:

(а) Общие условия:

Номинальная сумма и валюта для
Стороны А:¹

Номинальная сумма и валюта для
Стороны Б:²

[Дата начала срока:]³

Дата истечения срока: [●]

(б) [Фиксированные суммы:]

[Плательщик фиксированной [Сторона А] [Сторона Б]
суммы:]

[Даты платежа Фиксированных [●], [с учетом Условия окончания
сумм:] срока в нерабочий день: [●]]

[Фиксированная сумма [или
Фиксированная ставка и
Коэффициент для расчета дней в
процентном периоде для
Фиксированной ставки]:]

(в) [Плавающие суммы:]

[Плательщик плавающей суммы:] [Сторона Б] [Сторона А]

[Даты платежа Плавающих сумм:] [●], [с учетом Условия окончания
срока в нерабочий день: [●]]

[Плавающая ставка для первого
Процентного периода:]

[Способ определения плавающей
ставки:]

¹ Номинальной суммой для Стороны А является сумма, используемая для расчета Фиксированных/Плавающих сумм Стороны А, то есть Сумма первоначального платежа, установленная для Стороны Б, если к Сделке применяется условие о совершении первоначального платежа.

² Номинальной суммой для Стороны Б является сумма, используемая для расчета Фиксированных/Плавающих сумм Стороны Б, то есть Сумма первоначального платежа, установленная для Стороны А, если к Сделке применяется условие о совершении первоначального платежа.

³ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.4 Спецификации о том, что Датой начала срока является Дата договора.

[Период плавающей ставки:]	Указание «O/N», «1M», «3M», «6M» означает, что Период плавающей ставки составляет, соответственно, один день, один месяц, три месяца, шесть месяцев.
[Спред:]	[плюс/минус [●] %] [Отсутствует]
[Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки:]	
[Даты изменения плавающей ставки:]	[●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]
[Смещение для Даты изменения плавающей ставки:]	Указание «TODAY» означает, что Смещение составляет ноль Рабочих дней. Указание «TOM» означает, что Смещение составляет один Рабочий день. Указание «SPOT» означает, что Смещение составляет два Рабочих дня
(г) Капитализация:	[Применимо] [Не применимо]
[Даты капитализации:]	
(д) Первоначальный платеж:	[Применимо] [Не применимо]
[Дата первоначального платежа:]	[●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]
[Сумма первоначального платежа для Стороны А:]	
[Сумма первоначального платежа для Стороны Б:]	
(е) [Промежуточные платежи:] ⁴	
[Дата или Даты промежуточного платежа:]	
[Сумма промежуточного платежа для Стороны А:]	
[Сумма промежуточного платежа для Стороны Б:]	
(ж) Окончательный платеж:	[Применимо] [Не применимо]

⁴ Стороны должны включить положения о промежуточных платежах, если они хотят предусмотреть амортизацию Номинальных сумм в соответствии с пунктом 1.1. Спецификации.

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

[Сумма окончательного платежа для Стороны А:]

[Сумма окончательного платежа для Стороны Б:]

(з) [Амортизация Номинальной [Согласно прилагаемому графику] суммы:]

(и) Валюта уплаты вариационной маржи:⁵

(к) [Иные условия:]

I. [Дополнительный платеж]

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

[Сумма дополнительного платежа]

[Валюта дополнительного платежа]

[Дата дополнительного платежа]

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

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

⁵ Указывается одна из валют, предусмотренных Списком параметров договоров валютно-процентный своп на рынке Стандартизированных ПФИ, утвержденным Биржей.