

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



УТВЕРЖДЕНА
Правлением
ОАО Московская Биржа

18 сентября 2013 г.

(Протокол № 82)

СПЕЦИФИКАЦИЯ ДОГОВОРОВ

ВАЛЮТНО-ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП

2013 г.

СЛУЖБА БАНКА РОССИИ
ПО ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ
**УПРАВЛЕНИЕ ДЕЛАМИ
И АРХИВА**
ПРИЛОЖЕНИЕ
К ВХ. № 13-5344
ОТ 20.09.2013

СПЕЦИФИКАЦИЯ ДОГОВОРОВ

ВАЛЮТНО-ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП

2013 г.

СПЕЦИФИКАЦИЯ ДОГОВОРОВ (КОНТРАКТОВ)

ВАЛЮТНО-ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП

2013 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 Правилами торгов и (или) Правилами клиринга. Спецификация совместно с Правилами клиринга, 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 Приложении 2 к Спецификации.
- 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 Подтверждении, 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 Подтверждении. 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 Дату истечения срока или иной день, указанный в этом качестве в *Подтверждении*. Для целей Спецификации Дата окончательного платежа является Датой платежа.
- 1.7. *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.
- 1.8. *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 Подтверждении или определяемый в соответствии с ним.
- 1.9. *Дата промежуточного платежа* означает каждую из Дат платежа между Датой начала срока 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 сделки указанную в этом качестве в *Подтверждении*.
- 1.11. *Дата изменения плавающей ставки* означает, если иное не установлено решением Биржи, применительно к Договору каждый день, указанный в этом качестве в Подтверждении, 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 Подтверждении применительно к Договору в целях расчета сумм платежей по Договору.
- 1.15. **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 Спецификации.
- 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 Плавающая ставка.
- 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. **Подтверждение** означает Подтверждение в значении, определенном в Правилах торгов.
- 1.20. **Правила клиринга** означает Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 1.21. **Правила торгов** означает Правила организованных торгов на рынке Стандартизированных ПФИОАО Московская Биржа.
- 1.22. **Рабочий день** означает:
- (а) для целей осуществления платежей в Дату платежа и/или применительно к Дате изменения плавающей ставки и Способу определения плавающей ставки – 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, и/или применительно к Дате изменения плавающей ставки и Способу определения плавающей ставки сумма выражена в евро – днем, когда открыта Трансьевропейская 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, и/или применительно к Дате изменения плавающей ставки и Способу определения плавающей ставки сумма выражена в такой другой иностранной валюте, – 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, и/или применительно к Дате изменения плавающей ставки и Способу определения плавающей ставки суммы выражены в нескольких видах иностранных валют, – Рабочим днем в соответствии с настоящим определением для каждой валюты соответственно;
 - (б) для целей остальных положений Спецификации или Подтверждения – день, когда Биржа проводит Торги в Основном режиме.
- 1.23. **Спрэд** означает процентную надбавку в виде ставки процентов годовых (которая может быть выражена отрицательным числом), указанную в этом качестве в Подтверждении 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 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 со Спецификацией приходится на нерабочий день, день окончания срока определяется по правилу «Следующий рабочий день», указанному в подпункте (а) настоящего пункта 1.24, если иное не предусмотрено Подтверждением.

1.25. **Фиксированная ставка** означает процентную ставку, указанную в этом качестве в Подтверждении 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**»). Если иное не предусмотрено настоящей Спецификацией:

- (а) Первый Процентный период начинается в Дату начала срока (включительно) и оканчивается в день (исключая его), согласованный сторонами (день, в который оканчивается Процентный период, именуется в Спецификации «**Дата окончания периода**»).
- (б) 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).
- (в) Если в Подтверждении не установлены Даты окончания периода, Датами окончания 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 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 ближайший Торговый день, следующий за днем принятия Биржей решения о возможности заключения Договора 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 в период с Даты договора до Даты истечения срока Договора.
- 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 Дату истечения срока Договора (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.

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

- 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 сделки, 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 одновременно 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. В Заявке Участник торгов указывает условия Сделки валютно-процентный своп, установленные формой Подтверждения, предусмотренной Приложением 1 к Спецификации. Условия, заключенные в указанной форме Подтверждения 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 Подтверждении или определяемые в соответствии с ним, 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 Подтверждении (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 Подтверждении (далее – «**Сумма окончательного платежа**»).
- (д) 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.

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:
- (а) сумму, указанную в Подтверждении;
- (б) при отсутствии такого указания - сумму, равную произведению Номинальной суммы, Фиксированной ставки и Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, указанного в Подтверждении для расчета Фиксированных сумм:

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

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 Подтверждении для расчета Плавающих сумм:

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

- (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) $1/1$ означает 1;
- (б) $30E/360$ 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);

- (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 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 Подтверждении;
- (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:

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

- (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.

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”, ТОМ), объявляемых ведущими участниками российского финансового рынка и публикуемая НВА в Дату изменения плавающей ставки или в Рабочий день, предшествующий Дате 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 Дату изменения плавающей ставки или в Рабочий день, предшествующий Дате 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.
- (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 (НВА) совместно с Банком России, и публикуемая в Дату изменения плавающей ставки около 17 часов по московскому времени на странице RUONIA= в системе Reuters и/или в Интернет на официальном сайте Банка России и/или на странице <http://www.ruonia.ru>.
- (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:

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

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 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 дня какого-либо дня i , является следующий календарный день, Процентный период, начинающийся в такой день i , составляет один день.

По суммам, выраженным в долларах США

- (е) **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 11 часов по лондонскому времени на странице LIBOR01 в системе Reuters в день, наступающий за два Рабочих дня, в которые кредитные организации открыты для проведения операций в г. Лондоне, до Даты изменения плавающей ставки.
- (ж) **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. Если к 17 часам по нью-йоркскому времени на следующий Рабочий день, в который кредитные организации открыты для проведения операций в г. Нью-Йорке, после Даты изменения плавающей ставки указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters и не опубликована в выпуске H.15(519), Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, установленная в Ежедневном обновлении выпуска H.15 или ином признанном электронном источнике, используемом для публикации такой ставки, по состоянию на указанный день напротив заголовка «Federal funds (effective)». Если к 17 часам по нью-йоркскому времени указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters и не опубликована в выпуске H.15(519), Ежедневном обновлении выпуска H.15 или ином признанном электронном источнике, Плавающей

ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, установленная в ближайший предшествующий день в выпуске H.15(519) напротив заголовка «Federal funds (effective)» на странице FEDFUNDS1 в системе Reuters.

(з)

По суммам, выраженным в евро

(и) **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 день, наступающий за два дня, являющихся рабочими днями для системы TARGET до Даты изменения плавающей ставки.

(к)

(л) 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 Дату изменения плавающей ставки около 12 часов по брюссельскому времени на странице EONIA= или EONIARECAP в системе Reuters.

5.3. 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 2013 г.

Форма Подтверждения для Сделки валютно-процентный своп

Условиями Договора, к которому относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Номинальная сумма и валюта для Стороны А:¹

Номинальная сумма и валюта для Стороны Б:²

Дата сделки:

[Дата начала срока:]³

Дата истечения срока: [●]

(б) [Фиксированные суммы:]

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

[Даты платежа Фиксированных сумм:] [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]⁴

[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: [●]]⁵

[Плавающая ставка для первого Процентного периода:]

Способ определения плавающей ставки:

Период плавающей ставки:

Сред: [плюс/минус [●] %] [Отсутствует]

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 сделки.

⁴ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.24 Спецификации о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

⁵ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.24 Спецификации о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки:

Даты изменения плавающей ставки: [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]⁶

[(г) Капитализация:

Условие о капитализации: [Применимо] [Не применимо]

Даты капитализации:]

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

[Дата первоначального платежа:] [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]⁷

[Сумма первоначального платежа для Стороны А:]

[Сумма первоначального платежа для Стороны Б:]

[(е) Промежуточные платежи:

Дата или Даты промежуточного платежа: [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]⁸

Сумма промежуточного платежа для Стороны А:

Сумма промежуточного платежа для Стороны Б:]⁹

[(ж) Окончательный платеж:

[Дата окончательного платежа:] [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]¹⁰

[Сумма окончательного платежа для Стороны А:]

[Сумма окончательного платежа для Стороны Б:]

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

[(и) Иные условия:

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

⁶ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.24 Спецификации о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

⁷ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.24 Спецификации о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

⁸ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.24 Спецификации о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

⁹ Стороны должны включить положения о промежуточных платежах, если они хотят предусмотреть амортизацию Номинальных сумм в соответствии с пунктом 1.1. Спецификации.

¹⁰ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.24 Спецификации о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

II. [Дополнительные платежи]

[]

[Плательщик дополнительных платежей]

[Сторона А] [Сторона Б]

[Сумма дополнительных платежей]

III. [Условие окончания срока в нерабочий день:]

IV. [Финансовый центр для валюты для стороны А]

[Финансовый центр для валюты для стороны Б]

ПРИЛОЖЕНИЕ 2

К СПЕЦИФИКАЦИИ ДОГОВОРОВ ВАЛЮТНО-ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП

Основные финансовые центры

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