

УТВЕРЖДЕНА
решением Правления НКО НКЦ (АО)
от «12» марта 2020 г. (Протокол № 11)



СПЕЦИФИКАЦИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ ДОГОВОРОВ

ВАЛЮТНЫЙ СВОП

СПЕЦИФИКАЦИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ ДОГОВОРОВ (КОНТРАКТОВ)

ВАЛЮТНЫЙ СВОП

Настоящие условия внебиржевых договоров (контрактов) валютный своп (далее – **Спецификация**) применяются к предусмотренным настоящей Спецификацией внебиржевым поставочным Договорам валютный своп, заключаемым на рынке Стандартизированных ПФИ Участниками клиринга одним из способов, предусмотренных в Правилах клиринга. Спецификация совместно с Правилами клиринга определяет порядок возникновения, изменения и прекращения обязательств по указанным внебиржевым Договорам валютный своп.

1. ОБЩИЕ ОПРЕДЕЛЕНИЯ

- 1.1. **Базисный (базовый) актив** применительно к Договору означает каждую из валют Валютной пары.
- 1.2. **Валютная пара** означает применительно к Договору Первую валюту и Вторую валюту.
- 1.3. **Дата договора** означает применительно к Договору дату Рабочего дня, в который заключен Договор.
- 1.4. **Дата окончательного платежа** означает применительно к Договору день, в который стороны обязаны исполнить свои обязательства по Договору, указанные в подпункте (б) пункта 3.3 Спецификации, с учетом применимого Условия об окончании срока в нерабочий день.
- 1.5. **Дата первоначального платежа** означает применительно к Договору день, в который стороны обязаны исполнить свои обязательства по Договору, указанные в подпункте (а) пункта 3.3 Спецификации, с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день «Следующий рабочий день».
- 1.6. **Договор валютный своп (Договор)** означает Договор валютный своп, как он определен в пункте 3.1 Спецификации.
- 1.7. **Клиринговый центр** означает Небанковскую кредитную организацию – центрального контрагента "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество).
- 1.8. **Курс спот** означает применительно к Договору обменный курс, указанный в Предложении, выраженный как отношение количества Второй валюты к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Первой валюты.
- 1.9. **Правила клиринга** означают правила клиринга, утвержденные Клиринговым центром, регулирующие порядок оказания клиринговых услуг на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 1.10. **Рабочий день** означает:
 - (а) для целей уплаты депозитной маржи, возврата накопленной депозитной маржи, за исключением возврата при изменении валюты депозитной маржи, уплаты процентов на накопленную депозитную маржу, уплаты компенсации при досрочном прекращении Договора в определенной валюте – любой день, являющийся Расчетным днем по такой валюте согласно Правилам клиринга;

- (б) для целей осуществления платежей, предусмотренных пунктом 3.3 Спецификации – любой день, являющийся одновременно:
 - (i) Рабочим днем для целей уплаты депозитной маржи согласно подпункту (а) настоящего пункта Спецификации, и
 - (ii) Расчетным днем по обоим соответствующим валютам (валютам Валютной пары) согласно Правилам клиринга;
- (в) для целей возврата накопленной депозитной маржи и уплаты накопленной депозитной маржи, предусмотренных пунктом 3.5 Спецификации, при изменении валюты уплаты депозитной маржи – любой день, являющийся одновременно:
 - (i) Рабочим днем для целей уплаты депозитной маржи согласно подпункту (а) настоящего пункта Спецификации в валюте до изменения, и
 - (ii) Рабочим днем для целей уплаты депозитной маржи согласно подпункту (а) настоящего пункта Спецификации в валюте после изменения;
- (г) для целей осуществления иных платежей в определенной валюте – любой день, являющийся одновременно:
 - (i) Рабочим днем для целей уплаты депозитной маржи согласно подпункту (а) настоящего пункта Спецификации, и
 - (ii) Расчетным днем по такой валюте согласно Правилам клиринга;
- (д) для целей остальных положений настоящей Спецификации или Предложения – день, являющийся Расчетным днем по российским рублям согласно Правилам клиринга.

1.11. **Условие об окончании срока в нерабочий день** означает условие, в соответствии с которым определяется (переносится) день окончания любого срока, предусмотренного Спецификацией, за исключением сроков, даты окончания которых не подлежат переносу согласно Спецификации, если последний день срока приходится на нерабочий день. В Предложении 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.

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

2. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

- 2.1. Правила клиринга применяются к Договорам в части, не урегулированной настоящей Спецификацией.
- 2.2. В целях осуществления клиринга в отношении обязательств из Договоров, заключенных на основании настоящей Спецификации, Клиринговый центр составляет список предметов указанных обязательств (далее - Список). Список публикуется на сайте Клирингового центра в сети Интернет.
- 2.3. Спецификация может быть изменена Клиринговым центром в одностороннем порядке.
- 2.4. Изменения и дополнения в Спецификацию вступают в силу с момента введения Клиринговым центром в действие Спецификации, содержащей указанные изменения и дополнения.

Информация о введении в действие Спецификации, содержащей изменения и дополнения, доводится до сведения Участников клиринга путем опубликования на сайте Клирингового центра в сети Интернет не менее чем за 3 (три) Рабочих 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.

- 2.5. Договору присваивается код (обозначение) [FXSWAPOTC].
- 2.6. Депозитная маржа рассчитывается и уплачивается в порядке, установленном Правилами клиринга.
- 2.7. Исполнение (прекращение) обязательств по уплате депозитной маржи, а также иных обязательств, предусмотренных Спецификацией, осуществляется в порядке и сроки, установленные Правилами клиринга, с учетом положений Спецификации.
- 2.8. Уплата депозитной маржи по Договору осуществляется на возвратной основе.

Накопленная депозитная маржа подлежит возврату (уплате) в порядке, установленном Правилами клиринга.

- 2.9. Проценты на накопленную депозитную маржу рассчитываются каждый Рабочий день в период, начиная с Рабочего дня, следующего за первым днем расчета Депозитной маржи, до Рабочего дня, в который осуществляется возврат накопленной депозитной маржи включительно, за исключением возврата при изменении валюты уплаты депозитной маржи.

Проценты на накопленную депозитную маржу рассчитываются и уплачиваются в порядке, установленном Правилами клиринга.

- 2.10. Валюта исполнения обязательств, возникающих в случае, если сторонами Договора согласована уплата дополнительного платежа, обязательств, возникающих при изменении условий Договора, за исключением обязательств, возникающих при изменении валюты уплаты депозитной маржи согласно пункту 3.5 Спецификации, и (или) обязательств,

возникающих при досрочном прекращении Договора, указывается в Приложении 2 к Спецификации.

- 2.11. При изменении валюты уплаты депозитной маржи исполнение обязательств, предусмотренных пунктом 3.5 Спецификации, осуществляется в дату такого изменения с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день «Следующий рабочий день». Если при изменении валюты уплаты депозитной маржи сторонами Договора был согласован платеж, исполнение обязательства по его уплате осуществляется в дату указанного исполнения обязательств, предусмотренных пунктом 3.5 Спецификации, с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день «Следующий рабочий день». Начиная со дня указанного исполнения обязательств, предусмотренных пунктом 3.5 Спецификации, расчет и уплата депозитной маржи осуществляется в валюте уплаты депозитной маржи после ее изменения.

Исполнение обязательств, возникающих при изменении условий Договора, за исключением изменения валюты уплаты депозитной маржи, осуществляется в дату такого изменения с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день «Следующий рабочий день».

Исполнение обязательства по возврату накопленной депозитной маржи при досрочном прекращении Договора осуществляется в дату такого досрочного прекращения с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день «Следующий рабочий день». Исполнение обязательства по уплате компенсации при досрочном прекращении Договора осуществляется в дату исполнения обязательства по возврату накопленной депозитной маржи при досрочном прекращении Договора с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день «Следующий рабочий день».

Исполнение обязательства по уплате дополнительного платежа, согласованного при заключении Договора, осуществляется в Дату договора с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день «Следующий рабочий день».

- 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 и Правилами клиринга.
- 2.14. Стороны указывают в Предложении условия Договора, исходя из возможных условий, указанных в Приложении 2 к Спецификации

3. ДОГОВОР ВАЛЮТНЫЙ СВОП

- 3.1. *Договор валютный своп (Договор)* означает поставочный валютный своп договор (контракт), по которому на условиях, согласованных сторонами, в Дату первоначального платежа одна сторона уплачивает другой стороне сумму (далее — «**Сумма первоначального платежа**») в одной согласованной валюте (далее — «**Первая валюта**»), а другая сторона уплачивает первой стороне Сумму первоначального платежа в другой согласованной валюте (далее — «**Вторая валюта**»), а в Дату окончательного платежа, наступающую не ранее третьего Рабочего дня после Даты договора, первая сторона уплачивает другой стороне сумму (далее — «**Сумма окончательного платежа**») во Второй валюте, а другая сторона уплачивает первой стороне Сумму окончательного платежа в Первой валюте.

Договор является производным финансовым инструментом.

3.2. Помимо условий, установленных Правилами клиринга, в Предложении Участник клиринга указывает условия Договора, установленные формой Предложения, предусмотренной Приложением 1 к Спецификации. Условия, заключенные в указанной форме Предложения в квадратные скобки, являются факультативными и указываются в Предложении в случае их применения к Договору.

3.3. Порядок осуществления расчетов по Договору.

(а) В Дату первоначального платежа каждая сторона уплачивает другой стороне Сумму первоначального платежа. Суммы первоначального платежа устанавливаются в следующем порядке:

(i) Сумма первоначального платежа для одной из сторон устанавливается в Предложении (далее – Фиксированная сумма первоначального платежа);

(ii) Сумма первоначального платежа для другой стороны определяется (А) как произведение Фиксированной суммы первоначального платежа и Курса спот, если валюта Фиксированной суммы первоначального платежа является Первой валютой, либо (Б) как частное от деления Фиксированной суммы первоначального платежа на Курс спот, если валюта Фиксированной суммы первоначального платежа является Второй валютой.

(б) В Дату окончательного платежа каждая сторона уплачивает другой стороне Сумму окончательного платежа. Суммы окончательного платежа устанавливаются в следующем порядке:

(i) Сумма окончательного платежа в валюте Фиксированной суммы первоначального платежа устанавливается равной Фиксированной сумме первоначального платежа;

(ii) Сумма окончательного платежа в другой валюте определяется (А) как произведение Фиксированной суммы первоначального платежа и суммы Курса спот и цены Договора, если валюта Фиксированной суммы первоначального платежа является Первой валютой, либо (Б) как частное от деления Фиксированной суммы первоначального платежа на сумму Курса спот и цены Договора, если валюта Фиксированной суммы первоначального платежа является Второй валютой.

(в) Суммы первоначального платежа и Суммы окончательного платежа округляются с точностью до второго знака после запятой по правилам математического округления.

3.4. Изменение условий Договора.

(а) Следующие условия Договора могут быть изменены по согласованию сторон в порядке, определенном Правилами клиринга:

(i) Валюта уплаты депозитной маржи;

(ii) Дополнительный платеж.

(б) Все прочие условия Договора не могут быть изменены по согласованию сторон.

- 3.5. При изменении валюты уплаты депозитной маржи сторона, для которой предыдущая расчетная стоимость Договора в валюте уплаты депозитной маржи до ее изменения является положительной, должна уплатить другой стороне накопленную депозитную маржу в размере указанной расчетной стоимости, а другая сторона должна уплатить накопленную депозитную маржу в валюте уплаты депозитной маржи после ее изменения в размере расчетной стоимости Договора, рассчитанной на день определения предыдущей расчетной стоимости Договора в валюте уплаты депозитной маржи до ее изменения.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

к Спецификации внебиржевых договоров (контрактов) валютный своп

Форма Предложения для внебиржевого договора валютный своп

Условиями Договора, к которому относится настоящее Предложение, являются:

(а) Общие условия:

Валюта уплаты депозитной маржи: ¹

Условие окончания срока в нерабочий день:

Цена договора:

(б) Первоначальный платеж:

Дата первоначального платежа:

[Сумма первоначального платежа для Стороны А:]²

[Валюта первоначального платежа для Стороны А:]¹ [Первая валюта] [Вторая валюта]

[Сумма первоначального платежа для Стороны Б:]²

[Валюта первоначального платежа для Стороны Б:]¹ [Вторая валюта] [Первая валюта]

Курс спот: ²

(в) Окончательный платеж:

Дата окончательного платежа:

(г) [Иные условия:]

[Дополнительный платеж]

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

[Сумма дополнительного платежа]

[Валюта дополнительного платежа]

¹ указывается одна из валют, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

² Стороны обязаны указать (а) Курс спот и Сумму и валюту первоначального платежа для Стороны А или (б) Курс спот и Сумму и валюту первоначального платежа для Стороны Б. Одна из Сумм окончательного платежа устанавливается равной указанной Сумме первоначального платежа.

ПРИЛОЖЕНИЕ 2

к Спецификации внебиржевых договоров (контрактов) валютный своп

Таблица соответствия базисного актива, валюты уплаты депозитной маржи, валюты уплаты дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора и ограничения на срок договора:

Базисный актив (Валютная пара): Первая валюта/ Вторая валюта	Валюта уплаты депозитной маржи	Валюта уплаты дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора	Максимальный срок между ближайшим Рабочим днем для платежей в каждой из валют Валютной пары, следующим за Датой договора, и Датой окончательного платежа
Доллар США/ Российский рубль	Российский рубль Доллар США	Российский рубль Доллар США Евро Швейцарский франк	5 лет
Евро/ Российский рубль	Российский рубль Доллар США	Российский рубль Доллар США Евро Швейцарский франк	5 лет
Евро/Доллар США	Российский рубль Доллар США	Российский рубль Доллар США Евро Швейцарский франк	5 лет
Швейцарский франк/ Российский рубль	Российский рубль Доллар США	Российский рубль Доллар США Евро Швейцарский франк	5 лет

Всего прошито, пронумеровано и скреплено
печатью 9 (девятю) лист 20