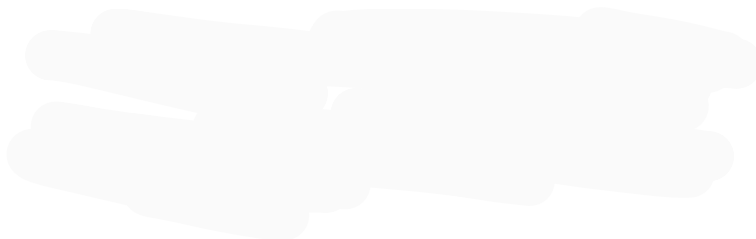


УТВЕРЖДЕНА
решением Правления НКО НКЦ (АО)
от «17» февраля 2023 г. (Протокол № 14)



**СПЕЦИФИКАЦИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ ВАЛЮТНЫХ
ФОРВАРДНЫХ ДОГОВОРОВ**

СПЕЦИФИКАЦИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ ВАЛЮТНЫХ

ФОРВАРДНЫХ ДОГОВОРОВ (КОНТРАКТОВ)

Настоящие условия внебиржевых валютных форвардных договоров (контрактов) (далее – *Спецификация*) применяются к предусмотренным настоящей Спецификацией внебиржевым поставочным и расчетным валютным форвардным Договорам, 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 расчетным и поставочным валютным форвардным Договорам.

1. ОБЩИЕ ОПРЕДЕЛЕНИЯ

- 1.1. *Базисный (базовый) актив* применительно к Договору означает каждую из валют Валютной пары.
- 1.2. *Базовая валюта* означает применительно к расчетному Договору валюту, указанную в этом качестве в Предложении в соответствии с Приложением 2 к Спецификации.
- 1.3. *Валюта платежа* означает применительно к расчетному Договору валюту, в которой проводятся расчеты (уплата Суммы платежа) по указанному Договору, указанную в Приложении 2 к Спецификации.
- 1.4. *Валюта суммы платежа* означает применительно к расчетному Договору:
 - (а) Валюту платежа если Валютой платежа является Базовая валюта или Расчетная валюта;
 - (б) валюту, указанную в этом качестве в Предложении и совпадающую с Базовой валютой или Расчетной валютой, если Валютой платежа является валюта, не входящая в валютную пару;
- 1.5. Валютная пара означает:
 - (а) применительно к поставочному Договору — Первую валюту и Вторую валюту, как они определены в подпункте 3.1(а) Спецификации и указаны в этом качестве в Предложении в соответствии с Приложением 2 к Спецификации;
 - (б) применительно к расчетному Договору — Расчетную валюту и Базовую валюту.
- 1.6. *Дата договора* означает применительно к Договору дату Рабочего дня, в который заключен Договор.
- 1.7. *Дата оценки* означает применительно к расчетному Договору Дату оценки курса спот и (или) Дату оценки курса спот к валюте платежа.

- 1.8. **Дата оценки курса спот** означает применительно к расчетному Договору день, по состоянию на который определяется значение Курса спот.
- 1.9. **Дата оценки курса спот к валюте платежа** означает применительно к расчетному Договору день, по состоянию на который определяется значение Курса спот к валюте платежа в целях проведения расчетов.
- 1.10. **Дата платежа** означает применительно к Договору день, указанный в этом качестве в Предложении, в который стороны с учетом применимого Условия об окончании срока в нерабочий день обязаны исполнить свои обязательства по Договору, предусмотренные пунктом 3.3 Спецификации.
- 1.11. **Договор (валютный форвардный Договор)** означает поставочный валютный форвардный Договор, как он определен в пункте 3.1(а) Спецификации, и (или) расчетный валютный форвардный Договор, как он определен в пункте 3.1(б) Спецификации.
- 1.12. **Клиринговый центр** означает Небанковскую кредитную организацию – центрального контрагента "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество).
- 1.13. **Курс спот** означает применительно к расчетному Договору — обменный курс валюты, выраженный как количество Расчетной валюты за одну единицу (или иному числу, кратному десяти) Базовой валюты, на Дату оценки курса спот, определенный в соответствии с согласованным Способом определения курса спот.
- 1.14. **Курс спот к валюте платежа** означает применительно к расчетному Договору — обменный курс валюты, выраженный как количество Валюты платежа за одну единицу (или иному числу, кратному десяти) Валюты суммы платежа, на Дату оценки курса спот к валюте платежа, определенный в соответствии с согласованным Способом определения курса спот к валюте платежа.
- 1.15. **Направление** означает условие Договора, указанное в Предложении (покупка или продажа), в отношении Первой валюты (для поставочного Договора) / Базовой валюты (для расчетного Договора) в целях определения Покупателя и Продавца Первой валюты / базовой валюты.
- 1.16. **Номинальная сумма** означает применительно к поставочному Договору сумму в Первой валюте и (или) во Второй валюте, подлежащую уплате одной из сторон Договора в соответствии с условиями, указанными в Предложении.
- 1.17. **Номинальная сумма в базовой валюте** означает применительно к расчетному Договору сумму в Базовой валюте, указанную в этом качестве в Предложении в целях расчета платежей по Договору.
- 1.18. **Номинальная сумма в расчетной валюте** означает применительно к расчетному Договору сумму в Расчетной валюте, указанную в этом качестве в Предложении.
- 1.19. **Покупатель базовой валюты** означает сторону расчетного Договора, для которой в Предложении Направлением в отношении Базовой валюты является покупка Базовой валюты.

- 1.20. **Покупатель Первой валюты (Продавец Второй валюты)** означает сторону поставочного Договора, для которой в Предложении Направлением в отношении Первой валюты является покупка Первой валюты.
- 1.21. **Правила клиринга** означают правила клиринга, утвержденные Клиринговым центром, регулирующие порядок оказания клиринговых услуг на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 1.22. **Продавец базовой валюты** означает сторону расчетного Договора, для которой в Предложении Направлением в отношении Базовой валюты является продажа Базовой валюты.
- 1.23. **Продавец Первой валюты (Покупатель Второй валюты)** означает сторону поставочного Договора, для которой в Предложении Направление в отношении Первой валюты является продажа Первой валюты.
- 1.24. Рабочий день означает:
- (a) 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, в который Клиринговый центр, проводит клиринговую сессию на рынке Стандартизированных ПФИ;
 - (б) применительно к Дате оценки курса спот, к Дате оценки курса спот к валюте платежа, а также для целей осуществления платежей в Дату платежа при расчетах по расчетному Договору, предусмотренных пунктом 3.3 Спецификации - любой день, являющийся одновременно:
 - (i) днем, когда определяется (публикуется) Курс спот, определенный в соответствии с согласованным Способом определения курса спот; и
 - (ii) днем, когда определяется (публикуется) Курс спот к валюте платежа, определенный в соответствии с согласованным Способом определения курса спот к валюте платежа; и
 - (iii) Рабочим днем для целей уплаты депозитной маржи согласно подпункту (a) настоящего пункта Спецификации;
 - (в) для целей осуществления платежей в Дату платежа при расчетах по поставочному Договору, предусмотренных пунктом 3.3 Спецификации – любой день, являющийся одновременно:
 - (i) Рабочим днем для целей уплаты депозитной маржи согласно подпункту (a) настоящего пункта Спецификации, и
 - (ii) Расчетным днем по обоим соответствующим валютам (валютам Валютной пары) согласно Правилам клиринга;

- (г) 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;
- (д) 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;
- (е) для целей остальных положений настоящей Спецификации или Предложения – день, являющийся Рабочим днем для целей уплаты депозитной маржи в российских рублях согласно подпункту (а) настоящего пункта Спецификации.

1.25. **Расчетная валюта** означает применительно к расчетному Договору валюту, указанную в этом качестве в Предложении в соответствии с Приложением 2 к Спецификации.

1.26. **Смещение для Даты оценки курса спот / Даты оценки курса спот к валюте платежа (Смещение)** означает количество Рабочих дней применительно к Дате оценки курса спот / Дате оценки курса спот к валюте платежа, на которое изменяется Дата платежа в целях определения Даты оценки курса спот / Даты оценки курса спот к валюте платежа, указанное в этом качестве в Предложении в соответствии с Приложением 2 к Спецификации. Смещение для Даты оценки курса спот / Даты оценки курса спот к валюте платежа может принимать только отрицательное значение и Смещение означает уменьшение Даты оценки курса спот / Даты оценки курса спот к валюте платежа.

1.27. **Сумма платежа** означает применительно к расчетному Договору сумму в Валюте суммы платежа, определяемую в Дату платежа по формуле, указанной в подпункте 3.3(б) Спецификации, и подлежащую уплате в Дату платежа в порядке, установленном подпунктами 3.3(б)(i) и 3.3(б)(ii) Спецификации.

1.28. **Условие об окончании срока в нерабочий день (Конвенция)** 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» («Following»)** – в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день.
- (б) **«Предшествующий рабочий день» («Preceding»)** – в этом случае днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день;
- (в) **«Рабочий день в отчетном периоде» («Modified Following» или «Modified»)** – 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» («Modified Preceding»)** – 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.

1.29. Форвардный курс (Курс) означает:

- (а) применительно к поставочному Договору — обменный курс, указанный в Предложении, выраженный как отношение количества Второй валюты к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Первой валюты;
- (б) применительно к расчетному Договору — обменный курс, указанный в Предложении, выраженный как отношение количества Расчетной валюты к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Базовой валюты.

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) [FWDOTC].
- 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 (за исключением случая, указанного в пункте 3.6 Спецификации), 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».

Исполнение обязательства по уплате дополнительного платежа в случае, указанном в пункте 3.6 Спецификации, осуществляется в дату первого определения расчетной стоимости Договора в соответствии с измененным порядком, установленным Методикой расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ, в целях расчета суммы депозитной маржи по Договору, если иная дата не определена решением Клирингового центра, принимаемом в соответствии с пунктом 3.6 Спецификации.

- 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. **ВАЛЮТНЫЙ ФОРВАРДНЫЙ ДОГОВОР**

3.1. **Валютный форвардный Договор (Договор)** означает валютный форвардный договор (контракт), по которому на условиях, согласованных сторонами:

- (а) одна сторона уплачивает другой стороне сумму в одной валюте, входящей в Валютную пару (далее — «**Первая валюта**»), а другая сторона уплачивает первой стороне сумму в другой валюте, входящей в Валютную пару (далее — «**Вторая валюта**»), в Дату платежа, наступающую не ранее третьего Рабочего дня после Даты договора (далее - «**поставочный Договор**»); или
- (б) одна сторона обязуется единовременно уплатить другой стороне в согласованную Дату платежа Сумму платежа в зависимости от изменения обменного курса Расчетной валюты и Базовой валюты по отношению к Форвардному курсу (далее - «**расчетный Договор**»).

Договор, как расчетный, так и поставочный, 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.

(a) Поставочный Договор.

В Дату платежа по поставочному Договору Продавец Первой валюты обязан уплатить Покупателю Первой валюты Номинальную сумму в Первой валюте, а Покупатель Первой валюты обязан уплатить Продавцу Первой валюты Номинальную сумму во Второй валюте.

(б) Расчетный Договор.

Сумма платежа применительно к расчетному Договору рассчитывается в Валюте Суммы платежа:

(i) если Валютой суммы платежа является Базовая валюта, то Сумма платежа в Базовой валюте рассчитывается по следующей формуле:

$$\text{Сумма платежа} = \frac{\text{Номинальная сумма в базовой валюте}}{\left[1 - \frac{\text{Форвардный курс}}{\text{Курс спот}}\right]}$$

(ii) если Валютой суммы платежа является Расчетная валюта, то Сумма платежа в Расчетной валюте рассчитывается по следующей формуле:

$$\text{Сумма платежа} = \frac{\text{Номинальная сумма в базовой валюте}}{\left[\text{Курс спот} - \text{Форвардный курс}\right]}$$

В Дату платежа по расчетному Договору:

(iii) если Сумма платежа имеет положительное значение, Продавец базовой валюты обязан уплатить Покупателю базовой валюты:

(1) эту сумму в Базовой валюте / Расчетной валюте (если Базовая валюта / Расчетная валюта является Валютой платежа);

(2) эквивалент этой суммы в Валюте платежа по Курсу спот к валюте платежа (если Валютой платежа является валюта, не входящая в Валютную пару);

(iv) если Сумма платежа имеет отрицательное значение, Покупатель базовой валюты обязан уплатить Продавцу базовой валюты абсолютную величину:

(1) этой суммы в Базовой валюте / Расчетной валюте (если Базовая валюта / Расчетная валюта является Валютой платежа);

- (2) эквивалента этой суммы в Валюте платежа по Курсу спот к валюте платежа (если Валютой платежа является валюта, не входящая в Валютную пару);

3.4. Изменение условий Договора

- (a) Следующие условия Договора могут быть изменены по согласованию сторон в порядке, определенном Правилами клиринга:
 - (i) Валюта уплаты депозитной маржи
 - (ii) Способ определения Курса спот
 - (iii) Способ определения Курса спот к валюте платежа
- (б) Все прочие условия Договора не могут быть изменены по согласованию сторон.

В случае изменения для расчетного Договора валюты уплаты депозитной маржи, Валюта платежа автоматически изменяется на измененную валюту уплаты депозитной маржи. В указанном случае стороны должны согласовать новые Способ определения Курса спот и Способ определения Курса спот к валюте платежа.

- 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.

- 3.6. В случае внесения изменений в Методику расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ, влекущих изменение порядка определения расчетной стоимости Договора, Клиринговый центр вправе принять решение о необходимости проведения дополнительных платежей. Сумма дополнительного платежа определяется с учетом изменения расчетной стоимости Договора, рассчитанной на основании ранее действовавшего порядка определения расчетной стоимости и введенного в действие измененного порядка определения расчетной стоимости, установленного Методикой расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ, в порядке, установленном указанным решением о необходимости проведения дополнительных платежей.

О принятом (принятых) решении (решениях) в соответствии с настоящим пунктом Спецификации Клиринговый центр уведомляет сторону Договора посредством ЭДО не позднее, чем за 30 (тридцать) календарных дней до наступления даты исполнения обязательства по уплате дополнительного платежа.

Исполнение обязательства по уплате дополнительного платежа в соответствии с настоящим пунктом Спецификации осуществляется в валюте депозитной маржи.

4. **ОКРУГЛЕНИЕ**

4.1. Для целей любых расчетов, производимых в соответствии с настоящей Спецификацией:

- (a) округление любых сумм, подлежащих уплате в соответствии с пунктом 3.3 Спецификации, осуществляется до второго знака после запятой (включительно) по правилам математического округления;
- (б) округление любых других значений (валютных курсов и т.д.) не осуществляется. Указанные значения используются с той точностью, с которой они могут быть указаны при вводе Предложения, получены из источника публикации и т.д.

5. **СПОСОБЫ ОПРЕДЕЛЕНИЯ КУРСА СПОТ**

5.1. Применительно к расчетному Договору для целей расчета Суммы платежа в Валюте суммы платежа и эквивалента этой суммы в Валюте платежа стороны должны указать в Предложении способ определения Курса спот и способ определения Курса спот к валюте платежа (далее указанные определения именуются «*Способ определения Курса спот*») путем ссылки на наименование любого Способа определения Курса спот, указанного в Приложении 2 к Спецификации.

5.2. Если применимый к Договору публикуемый обменный курс валюты, указанный в Способе определения Курса спот, или источник его опубликования официально меняется на иной публикуемый обменный курс валюты или источник его опубликования, такое событие не является Сбоем публикации. В этом случае Курс спот для Даты оценки будет определяться так, как если бы в Способе определения Курса спот был указан новый публикуемый обменный курс валюты или источник его опубликования.

6. **СБОЙ ПУБЛИКАЦИИ**

6.1. *Сбой публикации* означает невозможность к моменту проведения расчетов по расчетному Договору в соответствии с Правилами клиринга получить информацию о Курсе спот из источника информации об обменном курсе, указанном в согласованном сторонами Способе определения Курса спот.

6.2. Если в отношении валюты наступает Сбой публикации и иное решение не принято в соответствии с Правилами клиринга:

- (a) расчеты по Договору в соответствии с Правилами клиринга в Дату платежа осуществляются Клиринговым центром с использованием последней известной (официально опубликованной) информации об обменном курсе, указанном в согласованном сторонами Способе определения Курса спот.
- (б) Клиринговый центр вправе в течение пяти Рабочих дней после Даты платежа провести корректирующие расчеты, в том числе, с учетом новой информации об обменном курсе, указанном в согласованном сторонами Способе определения Курса спот. Рабочий день в целях данного подпункта означает Рабочий день в целях осуществления платежей в Валюте платежа.

Корректирующие расчеты осуществляются Клиринговым центром в следующем порядке:

- (i) Клиринговый центр определяет новое значение Суммы платежа, в том числе, с учетом новой информации об обменном курсе, указанном в согласованном сторонами Способе определения Курса спот;
- (ii) Клиринговый центр определяет разность между новым значением Суммы платежа и значением Суммы платежа, определенной в целях проведения расчетов в соответствии с подпунктом (а) настоящего пункта Спецификации;
- (iii) Если указанная разность является положительной, то Продавец базовой валюты обязан уплатить Покупателю базовой валюты эту разность в Валюте платежа. Если указанная разность является отрицательной, то Покупатель базовой валюты обязан уплатить Продавцу базовой валюты абсолютную величину этой разности в Валюте платежа.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

к Спецификации внебиржевых валютных форвардных договоров (контрактов)

а) Форма Предложения для внебиржевого валютного форвардного договора

Условиями Договора, к которому относится настоящее Предложение, являются:

(а) Общие условия:

Дата платежа:

Валюта уплаты депозитной маржи,
(Валюта ДМ)¹

Валюта платежа (для Расчетного
договора)¹

Конвенция Даты платежа

Тип Договора: [Расчетный NDF] /
[Поставочный NDF]²

(б) Расчетный Договор:

Валютная пара (Базовая валюта /
Расчетная валюта)³

Направление в отношении Базовой
валюты Покупка (Buy) / Продажа (Sell)

Номинальная сумма в базовой валюте:

Форвардный курс:

[Валюта суммы платежа]⁴: [Базовая валюта / Расчетная
валюта]

Способ определения Курса спот :

[Способ определения Курса спот к
валюте платежа]⁵:

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

² Заполненное поле NDF в Предложении означает, что Предложение подано на заключение расчетного внебиржевого валютного форвардного договора. Отсутствие заполненного поля NDF в Предложении означает, что Предложение подано на заключение поставочного внебиржевого валютного форвардного договора.

³ указывается одна из валютных пар, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

⁴ указывается если Валюта платежа отличается от Базовой валюты и Расчетной валюты

⁵ указывается если Валюта платежа отличается от Базовой валюты и Расчетной валюты

Смещение:

(в) Поставочный Договор:

Валютная пара (Первая валюта / Вторая валюта)⁶

Направление в отношении Первой валюты

Покупка (Buy) / Продажа (Sell)

[Номинальная сумма в Первой валюте (Buy / Sell Первая валюта):]⁷

[Номинальная сумма во Второй валюте (Sell / Buy Вторая валюта):]⁷

[Форвардный курс:]⁷

(г) [Иные условия:]

[Дополнительный платеж]

Получение / Уплата

[Сумма дополнительного платежа (Сумма)]

[Валюта дополнительного платежа (Валюта)]⁸

⁶ указывается одна из валютных пар, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации/

⁷ Стороны обязаны указать (а) Номинальную сумму в Первой валюте и Номинальную сумму во Второй валюте; или (б) Форвардный курс и либо Номинальную сумму в Первой валюте, либо Номинальную сумму во Второй валюте.

⁸ указывается одна из валют, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

ПРИЛОЖЕНИЕ 2

к Спецификации внебиржевых валютных форвардных договоров (контрактов)

Таблица соответствия базисного актива, Валюты платежа, Смещения для Даты оценки курса спот, валюты уплаты депозитной маржи, валюты уплаты платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора и ограничения на срок договора:

№	Базисный актив (Валютная пара): Первая валюта/Вторая валюта Базовая валюта/Расчетная валюта	Валюта уплаты депозитной маржи и Валюта платежа	Смещение	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 платежа
1	Доллар США/ Российский рубль	Российский рубль Доллар США Евро	0, -1, -2	Российский рубль Доллар США Евро	10 лет
2	Евро/ Российский рубль	Российский рубль Доллар США Евро	0, -1, -2	Российский рубль Доллар США Евро	10 лет
3	Евро/Доллар США	Российский рубль Доллар США Евро	0, -1, -2	Российский рубль Доллар США Евро	10 лет
4	Китайский юань/ Российский рубль	Российский рубль	0, -1, -2	Российский рубль	5 лет

Таблица способов определения Курса спот:

№	Наименование способа определения Курса спот	Валютная пара	Порядок определения Курса спот и источник информации*
1	USDRUB MOEX	USD/RUB	Фиксинг доллар США / российский рубль Московской Биржи, выраженный как количество российских рублей за один доллар США, определяемый в соответствии с Методикой расчета фиксингов Московской Биржи, утверждаемой Биржей, и публикуемый на сайте Биржи в сети Интернет по адресу www.moex.com
2	EURRUB MOEX	EUR/RUB	Фиксинг евро / российский рубль Московской Биржи, выраженный как количество российских рублей за одно евро, определяемый в соответствии с Методикой расчета фиксингов Московской Биржи, утверждаемой Биржей, и публикуемый на сайте Биржи в сети Интернет по адресу www.moex.com
3	USDRUB CBR	USD/RUB	Официальный курс доллара США по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России и публикуемый на сайте Банка России в сети Интернет по адресу www.cbr.ru
4	EURRUB CBR	EUR/RUB	Официальный курс евро по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России и публикуемый на сайте Банка России в сети Интернет по адресу www.cbr.ru
5	EURUSD MOEX	EUR/USD	Фиксинг евро / доллар США Московской Биржи, выраженный как количество долларов США за одно евро, определяемый в соответствии с Методикой расчета фиксингов Московской Биржи, утверждаемой Биржей, и публикуемый на сайте Биржи в сети Интернет по адресу www.moex.com
6	CNYRUB MOEX	CNY/RUB	Фиксинг китайский юань/ российский рубль Московской Биржи, выраженный как количество российских рублей за один китайский юань, определяемый в соответствии с Методикой расчета фиксингов Московской Биржи, утверждаемой Биржей, и публикуемый на сайте Биржи в сети Интернет по адресу www.moex.com
7	CNYRUB CBR	CNY/RUB	Официальный курс китайского юаня по отношению к рублю, устанавливаемый Банком России и публикуемый на сайте Банка России в сети Интернет по адресу www.cbr.ru

* обратный курс (курс обратной валютной пары) определяется как отношение 1 (единицы) к значению Курса спот. Указанное отношение округляется по правилам математического округления с точность, которую имеет Курс спот.