УТВЕРЖДЕНА
решением Правления НКО НКЦ (АО)
от «26» августа 2021 г. (Протокол № 51)

СПЕЦИФИКАЦИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ ДОГОВОРОВ

ВАЛЮТНО-ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП

СПЕЦИФИКАЦИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ ДОГОВОРОВ

ВАЛЮТНО-ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП

Настоящие условия внебиржевых Договоров валютно-процентный своп (далее – ***Спецификация***) применяются к предусмотренным настоящей Спецификацией внебиржевым поставочным Договорам валютно-процентный 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 валютно-процентный своп.

1. Общие определения

1.1. ***Базисный (базовый) актив*** применительно к Договору означает Плавающие и (или) Фиксированные ставки и Валюты номинальных сумм.

1.2. ***Валюта номинальной суммы*** означает валюту, указанную в Предложении в соответствии с Приложением 2 к Спецификации, в которой выражена Номинальная сумма.

1.3. ***Дата договора*** означает применительно к Договору дату Рабочего дня, в который заключен Договор.

1.4. ***Дата изменения плавающей ставки*** означает применительно к Договору каждый день, определяемый в соответствии со статьей 5 Спецификации, по состоянию на который Клиринговый центр определяет Плавающую ставку применительно к соответствующему Процентному периоду или Периоду капитализации.

1.5. ***Дата истечения срока (Окончание)*** означает применительно к Договору последний день срока Договора, указанный в этом качестве в Предложении, с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день, применимого к Дате окончательного платежа.

1.6. ***Дата начала срока (Начало)*** означает применительно к Договору день, указанный в этом качестве в Предложении, а при отсутствии такого указания –Дату договора. Дата начала срока не подлежит переносу в соответствии с применимым к Дате окончательного платежа Условием об окончании срока в нерабочий день.

1.7. ***Дата окончательного платежа*** означает применительно к Договору день, в который стороны обязаны исполнить свои обязательства по Договору, указанные в подпункте 3.3(в)(iii) Спецификации, с учетом применимого Условия об окончании срока в нерабочий день.

1.8. ***Дата первоначального платежа*** означает применительно к Договору день, в который стороны обязаны исполнить свои обязательства по Договору, указанные в подпункте 3.3(в)(i) Спецификации, с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день «Следующий рабочий день».

1.9. ***Дата платежа*** означает применительно к Договору Дату окончательного платежа или Дату промежуточного платежа.

1.10. ***Дата промежуточного платежа*** означает применительно к Договору день между Датой первоначального платежа и Датой окончательного платежа, в который стороны обязаны исполнить свои обязательства по Договору, указанные в подпункте 3.3(а) или подпункте

3.3(б) Спецификации, с учетом применимого Условия об окончании срока в нерабочий день к Дате окончательного платежа.

1.11. ***Договор валютно-процентный своп (Договор)*** означает Договор валютно-процентный своп, как он определен в пункте 3.1 Спецификации.

1.12. ***Изменение номинальной суммы*** означает условие Договора об уменьшении/увеличении Номинальной суммы применительно к последующим Процентным периодам или Периодам капитализации в соответствии с условиями Договора. В случае применения к Договору условия об Изменении номинальной суммы, Фиксированные суммы и/или Плавающие суммы в отношении Процентных периодов, следующих за уменьшением/увеличением Номинальной суммы, рассчитываются на основе такой уменьшенной/увеличенной Номинальной суммы. Условие об Изменении номинальной суммы может быть предусмотрено сторонами только при заключении Договора, если это установлено решением Клирингового центра.

1.13. ***Клиринговый центр*** означает Небанковскую кредитную организацию – центрального контрагента "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество).

1.14. ***Направление в отношении Плавающей суммы*** означает условие Договора, указанное в Предложении (уплата или получение), в отношении Плавающей суммы в целях определения Плательщика плавающей суммы.

1.15. ***Направление в отношении Фиксированной суммы*** означает условие Договора, указанное в Предложении (уплата или получение), в отношении Фиксированной суммы в целях определения Плательщика фиксированной суммы.

1.16. ***Номинальная сумма*** означает сумму, указанную в этом качестве в Предложении, применительно к Договору в целях расчета сумм платежей по Договору.

1.17. ***Период изменения плавающей ставки (Смена ставки)*** означает период, используемый для возможности установления условия об усреднении Плавающей ставки и определения Плавающей ставки для Процентного периода или Периода капитализации, указанный в этом качестве в Предложении.

1.18. ***Период плавающей ставки (Тенор)*** означает срок кредитования или иной аналогичный период, в отношении которого публикуется или определяется Плавающая ставка, указанный в этом качестве в Предложении.

1.19. ***Плавающая ставка*** означает процентную ставку, определяемую Клиринговым центром по состоянию на Дату изменения плавающей ставки применительно к соответствующему Процентному периоду или Периоду капитализации в соответствии с согласованным Способом определения плавающей ставки, указанным в Предложении в соответствии с Приложением 2 к Спецификации. Клиринговый центр определяет Плавающую ставку не позднее соответствующей Даты платежа применительно к Процентному периоду или Периоду капитализации.

1.20. ***Правила клиринга*** означают Правила клиринга, утвержденные Клиринговым центром, регулирующие порядок оказания клиринговых услуг на рынке Стандартизированных ПФИ.

1.21. ***Продолжительность периода капитализации (Период капитализации)*** означает срок, используемый для определения Периодов капитализации, указанный в этом качестве в Предложении.

1.22. ***Продолжительность процентного периода (Процентный период)*** означает Продолжительность процентного периода Плавающей ставки (Процентный период Плавающих сумм) или Продолжительность процентного периода Фиксированной ставки (Процентный период Фиксированных сумм).

1.23. ***Продолжительность процентного периода Плавающей ставки (Процентный период Плавающих сумм)*** означает срок, используемый для определения Процентных периодов для Плательщика плавающей суммы, указанный в этом качестве в Предложении.

1.24. ***Продолжительность процентного периода Фиксированной ставки (Процентный период Фиксированных сумм)*** означает срок, используемый для определения Процентных периодов для Плательщика фиксированной суммы, указанный в этом качестве в Предложении.

1.25. Рабочий день означает:

(а) для целей уплаты депозитной маржи, возврата накопленной депозитной маржи, за исключением возврата при изменении валюты уплаты 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 изменения плавающей ставки и Способу определения плавающей ставки – любой день, когда определяется (публикуется) (i) Плавающая ставка или (ii) замещаемая Плавающая ставка (в случаях, установленных в Приложении 2 к Спецификации);

(в) 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 обеим соответствующим валютам (Валютам номинальных сумм для обеих сторон Договора) 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 (далее – «Календарь СПФИ»).

1.26. ***Смещение для Даты изменения плавающей ставки (Смещение)*** означает количество Рабочих дней применительно к Дате изменения плавающей ставки, на которое изменяется Дата изменения плавающей ставки в целях определения Плавающей ставки, указанное в этом качестве в Предложении в соответствии с Приложением 2 к Спецификации. Отрицательное значение Смещения для Даты изменения плавающей ставки означает уменьшение Даты изменения плавающей ставки, положительное значение Смещения для Даты изменения плавающей ставки означает увеличение Даты изменения плавающей ставки.

1.27. ***Спред*** означает надбавку в виде ставки, установленной в базисных пунктах (которая может быть выражена отрицательным числом), указанную в этом качестве в Предложении применительно к Договору или стороне Договора.

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

1.30. ***Число дней для первого Процентного периода*** означает количество календарных дней, на которое уменьшается дата начала первого Процентного периода в целях расчета Плавающих или Фиксированных сумм, указанное в этом качестве в Предложении применительно к стороне Договора.

Термины и определения, прямо не указанные в настоящей Спецификации, понимаются в соответствии с законодательством Российской Федерации, Правилами клиринга, иными внутренними документами ПАО Московская Биржа и НКО НКЦ (АО).

2. Общие положения

2.1. Срок Договора в отношении каждой стороны 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***» или «***Дата окончания периода***», с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день, применимого к Дате окончательного платежа.

Каждый последующий Процентный период начинается в Дату окончания предшествующего Процентного периода (включительно) и оканчивается в Дату окончания периода (исключая ее) или применительно к последнему Процентному периоду – в Дату истечения срока (исключая ее) с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день, применимого к Дате окончательного платежа.

2.2. Правила клиринга применяются к Договорам в части, не урегулированной настоящей Спецификацией.

2.3. 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.

2.4. Спецификация может быть изменена Клиринговым центром в одностороннем порядке.

2.5. 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.

2.6. Договору присваивается код (обозначение) [XCCYOTC].

2.7. Депозитная маржа рассчитывается и уплачивается в порядке, установленном Правилами клиринга.

2.8. 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.

2.9. Уплата депозитной маржи по Договору осуществляется на возвратной основе.

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

2.10. 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.

2.11. Валюта исполнения обязательств, возникающих в случае, если сторонами Договора согласована уплата дополнительного платежа (за исключением случаев, указанных в пункте 3.6 и пункте 6.3 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.

2.12. 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.

Исполнение обязательства по уплате дополнительного платежа в соответствии с пунктом 6.3 Спецификации осуществляется в дату первого определения расчетной стоимости Договора на основании условий Договора, измененных в одностороннем порядке Клиринговым центром, в целях расчета суммы депозитной маржи по Договору , если иная дата не определена решением Клирингового центра об изменении условий Договора, принимаемом в соответствии с пунктом 6.3 Спецификации.

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 и Правилами клиринга.

2.15. Стороны указывают в Предложении условия Договора, исходя из возможных условий, указанных в Приложении 2 к Спецификации.

3. ДОГОВОР ВАЛЮТНО-ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП

3.1. ***Договор валютно-процентный своп (Договор)*** означает поставочный валютно-процентный своп договор, по которому на условиях, согласованных сторонами:

(а) одна сторона единовременно или периодически уплачивает другой стороне либо (i) сумму в одной согласованной валюте, рассчитанную на основе Номинальной суммы в этой валюте и Плавающей ставки (далее – «***Плавающая сумма***»), либо (ii) сумму в одной согласованной валюте, рассчитанную на основе Номинальной суммы в этой валюте и Фиксированной ставки (далее – «***Фиксированная сумма***»), а другая сторона единовременно или периодически уплачивает первой стороне либо (i) Фиксированную сумму в другой согласованной валюте, рассчитанную на основе Номинальной суммы в этой валюте и Фиксированной ставки, либо (ii) Плавающую сумму в другой согласованной валюте, рассчитанную на основе Номинальной суммы в этой валюте и другой Плавающей ставки. Уплата Плавающей суммы и Фиксированной суммы осуществляется с учетом особенностей, установленных подпунктами (а) и (б) пункта 3.3 Спецификации;

(б) обязанность одной стороны передать одну согласованную валюту в собственность второй стороне в размере установленной Номинальной суммы, и обязанность второй стороны передать первой стороне другую согласованную валюту в размере установленной Номинальной суммы, и в установленную будущую дату, но не ранее третьего Рабочего дня после Даты договора, обязанность каждой стороны передать полученную ранее валюту в размере установленной Номинальной суммы.

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 каждую Дату промежуточного платежа Плавающей суммы и в Дату окончательного платежа сторона, обязанная уплатить Плавающую сумму (далее – ***«Плательщик плавающей суммы»***), уплачивает другой стороне Плавающую сумму, рассчитанную для такой Даты платежа, если такая Плавающая сумма

является положительной. Если такая Плавающая сумма является отрицательной, то другая сторона должна уплатить Плательщику плавающей суммы сумму, равную абсолютному значению такой Плавающей суммы;

(б) В каждую Дату промежуточного платежа Фиксированной суммы и в Дату окончательного платежа сторона, обязанная уплатить Фиксированную сумму (далее – «***Плательщик фиксированной суммы***»), уплачивает другой стороне Фиксированную сумму, рассчитанную для такой Даты платежа, если такая Фиксированная сумма является положительной. Если такая Фиксированная сумма является отрицательной, то другая сторона должна уплатить Плательщику фиксированной суммы сумму, равную абсолютному значению такой Фиксированной суммы;

(в) Стороны осуществляют обмен платежами в соответствии со следующими условиями:

(i) в Дату первоначального платежа каждая из сторон уплачивает другой стороне Номинальную сумму (далее – «***Сумма первоначального платежа***»);

(ii) каждая из сторон, являющаяся Плательщиком плавающей суммы или Плательщиком фиксированной суммы в одной валюте, уплачивает другой стороне Сумму первоначального платежа в другой валюте.

(iii) в Дату окончательного платежа каждая из сторон уплачивает другой стороне сумму в размере Суммы первоначального платежа, полученной от другой стороны в Дату первоначального платежа (далее – «***Сумма окончательного платежа***»).

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) Фиксированная ставка;

(iii) Коэффициент расчета количества дней в процентном периоде для Фиксированной ставки;

(iv) Продолжительность процентного периода Фиксированной ставки;

(v) Условие окончания срока в нерабочий день, применимое к Дате окончательного платежа;

(vi) Способ определения плавающей ставки;

(vii) Период плавающей ставки;

(viii) Спред;

(ix) Коэффициент расчета количества дней в процентном периоде для Плавающей ставки;

(x) Смещение для Даты изменения плавающей ставки;

(xi) Продолжительность процентного периода Плавающей ставки;

(xii) Период изменения плавающей ставки;

(xiii) Дополнительный платеж.

(б) Все прочие условия Договора, в том числе, о применимости или не применимости условия об Изменении номинальной суммы, не могут быть изменены по согласованию сторон.

(в) Изменение Номинальной суммы осуществляется при установленном условии об Изменении номинальной суммы в соответствии с пунктом 4.17 Спецификации.

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 уплаты депозитной маржи.

4. РАСЧЕТ ФИКСИРОВАННЫХ СУММ И ПЛАВАЮЩИХ СУММ

4.1. Расчет Фиксированной суммы или Плавающей суммы, подлежащей уплате в первую Дату платежа, осуществляется для Процентных периодов, Даты окончания которых предшествуют такой Дате платежа или совпадают с такой Датой платежа. Расчет Фиксированной суммы или Плавающей суммы, подлежащей уплате во вторую и последующие Даты платежа, осуществляется для Процентных периодов, Даты окончания которых предшествуют такой Дате платежа или совпадают с такой Датой платежа, и следуют за ближайшей предшествующей Датой платежа. Расчет Фиксированной суммы или Плавающей суммы применительно к Дате платежа для таких Процентных периодов осуществляется Клиринговым центром в эту Дату платежа. Указанный расчет осуществляется на основании условий Договора, действующих на начало Даты окончания последнего из таких Процентных периодов.

Фиксированные суммы

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

(а) сумму, равную произведению Номинальной суммы, Фиксированной ставки и Коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде для Фиксированной ставки:

Фиксированная сумма	**=**	***Номинальная сумма***	***x***	***Фиксированная ставка***	***x***	***Коэффициент для расчета количества 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 может быть установлено условие о капитализации в соответствии с пунктом 4.7 Спецификации, – произведению Номинальной суммы, Плавающей ставки (с добавлением Спреда) и Коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде для Плавающей ставки:

Плавающая сумма	**=**	***Номинальная сумма***	***x***	***(Плавающая ставка + Спред)***	***x***	***Коэффициент для расчета количества дней в процентном периоде***

(б) если в отношении Договора установлен метод без капитализации, – сумме Сумм периодов капитализации, рассчитанных в порядке, установленном подпунктом 4.9(а) Спецификации, за каждый Период капитализации в Процентном периоде;

(в) если в отношении Договора установлен метод капитализации с учетом Спреда, – сумме Сумм периодов капитализации, рассчитанных в порядке, установленном подпунктом 4.10(а) Спецификации, за каждый Период капитализации в Процентном периоде;

(г) если в отношении Договора установлен метод капитализации с учетом Спреда для Номинальной суммы, – сумме Базовых сумм периодов капитализации, рассчитанных в порядке, установленном подпунктом 4.11(а) Спецификации, за каждый Период капитализации в Процентном периоде, и сумме Дополнительных сумм периодов капитализации, рассчитанных в порядке, установленном подпунктом 4.11(б) Спецификации, за каждый Период капитализации в Процентном периоде.

(д) если в отношении Договора установлен метод капитализации с простым учетом Спреда, – сумме Базовых сумм периодов капитализации, рассчитанных в порядке, установленном подпунктом 4.12(а) Спецификации, за каждый Период капитализации в Процентном периоде, и сумме Дополнительных сумм периодов капитализации, рассчитанных в порядке, установленном подпунктом 4.12(в) Спецификации, за каждый Период капитализации в Процентном периоде.

Коэффициент для расчета количества дней в процентном периоде

4.4. В целях расчета Фиксированных сумм, Плавающих сумм, Сумм периодов капитализации, Базовых сумм периодов капитализации, Дополнительных сумм периодов капитализации Участники клиринга указывают в Предложении согласно Приложению 2 к Спецификации один из коэффициентов для расчета количества дней в Процентном периоде или Периоде капитализации, исходя из которого начисляются Фиксированные суммы, Плавающие суммы, Суммы периодов капитализации, Базовые суммы периодов капитализации, Дополнительные суммы периодов капитализации (далее – «***Коэффициент для расчета количества дней в процентном периоде***», «***Конвенция дней»***), путем ссылки на обозначение любого из Коэффициентов для расчета количества дней в процентном периоде, указанных в Приложении 2 к Спецификации.

4.5. В Предложении на заключение Договора может быть указано Число дней для первого Процентного периода в следующих случаях:

- в случае необходимости заключения Участником клиринга офсетного Договора;
- в случае необходимости заключения Клиринговым центром закрывающих или балансирующих сделок в соответствии с Правилами клиринга.

При этом порядок определения количества дней в первом Процентном периоде в целях расчета Плавающей суммы или Фиксированной суммы осуществляется с учетом указанного Числа дней для первого Процентного периода.

Договор является офсетным по отношению к учитываемому на регистре учета позиций в соответствии с Правилами клиринга Договору, если одновременно выполняются следующие условия:

- оба Договора учитываются на одном и том же регистре учета позиций Участника клиринга;
- неисполненные обязательства (условия) по Договорам совпадают, за исключением Направления уплаты Плавающей и Фиксированной сумм (либо уплаты Плавающих сумм, если условиями Договора предусмотрена уплата Плавающих сумм обеими сторонами, либо уплаты Фиксированных сумм, если условиями Договора предусмотрена уплата Фиксированных сумм обеими сторонами) и обязательств по уплате дополнительного платежа;
- Участник клиринга является стороной в одном Договоре, противоположной стороне в другом Договоре.

Капитализация

4.6. Условие о капитализации может быть предусмотрено сторонами, если это установлено решением Клирингового центра.

4.7. Стороны имеют возможность установить условие о капитализации в отношении Плательщика плавающей суммы, если соответствующая Продолжительность процентного периода превышает соответствующую Продолжительность периода капитализации.

При этом стороны должны согласовать один из следующих методов капитализации:

(a) без капитализации;

(б) с учетом Спреда;

(в) с учетом Спреда для Номинальной суммы;

(г) с простым учетом Спреда.

4.8. Для целей расчета Плавающей суммы в случае, когда в отношении Договора может быть установлено условие о капитализации в соответствии с пунктом 4.7 Спецификации:

(а) ***Даты капитализации*** применительно к Процентному периоду устанавливаются в следующем порядке:

(i) Датой капитализации является каждая из дат, предшествующая дате, в которую оканчивается Процентный период, на периоды времени, кратные Продолжительности периода капитализации, с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день, применимого к Дате окончательного платежа;

(ii) В случае если в соответствии с правилом, указанным в подпункте (а)(i) настоящего пункта Спецификации, в месяце даты, предшествующей дате, в которую оканчивается Процентный период, на период времени, кратный Продолжительности периода капитализации, отсутствует соответствующий день, днем указанной даты является последний день месяца указанной даты;

Пример. Пусть Процентный период начался 31 декабря 2015 года, а Датой окончания Процентного периода является 31 марта 2016 года и Продолжительностью периода капитализации является один месяц. Тогда датами, предшествующими дате, в которую оканчивается Процентный период, на периоды времени, кратные Продолжительности периода капитализации будут являться следующие даты: 29 февраля 2016 года, 31 января 2016 года.

(б) ***Период капитализации*** означает применительно к Процентному периоду период времени, начиная с даты, в которую начинается Процентный период (включая ее), или Даты капитализации (включая ее) по следующую Дату капитализации (исключая ее) или дату, в которую оканчивается Процентный период (исключая ее).

4.9. Для целей расчета Плавающей суммы в случае, когда в отношении Договора установлен метод без капитализации в соответствии с подпунктом 4.7(а) Спецификации:

(а) ***Сумма периода капитализации*** означает сумму, рассчитываемую в порядке, установленном подпунктом 4.3(а) Спецификации.

4.10. Для целей расчета Плавающей суммы в случае, когда в отношении Договора установлен метод капитализации с учетом Спреда в соответствии с подпунктом 4.7(б) Спецификации:

(а) ***Сумма периода капитализации*** означает применительно к каждому Периоду капитализации сумму, равную произведению Уточненной номинальной суммы, Плавающей ставки (с добавлением Спреда) и Коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде для Плавающей ставки:

Сумма периода капитализации	**=**	***Уточненная номинальная сумма***	***x***	***(Плавающая ставка + Спред)***	***x***	***Коэффициент для расчета количества дней в процентном периоде***

(б) 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.

4.11. Для целей расчета Плавающей суммы в случае, когда в отношении Договора установлен метод капитализации с учетом Спреда для Номинальной суммы в соответствии с подпунктом 4.7(в) Спецификации:

(а) ***Базовая сумма периода капитализации*** означает применительно к каждому Периоду капитализации сумму, рассчитываемую в порядке, установленном подпунктом 4.3(а) Спецификации.

(б) ***Дополнительная сумма периода капитализации*** означает применительно к каждому Периоду капитализации сумму, равную произведению Суммы процентов, Плавающей ставки (без добавления Спреда) и Коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде для Плавающей ставки:

Дополнительная сумма периода капитализации	**=**	***Сумма процентов***	***x***	***Плавающая ставка***	***x***	***Коэффициент для расчета количества дней в процентном периоде***

(в) Сумма процентов означает:

(i) применительно к первому Периоду капитализации в Процентном периоде – нулевая сумма;

(ii) применительно к каждому последующему Периоду капитализации в этом Процентном периоде – сумму Базовых сумм периодов капитализации и Дополнительных сумм периодов капитализации за каждый предшествующий Период капитализации в этом Процентном периоде.

4.12. Для целей расчета Плавающей суммы в случае, когда в отношении Договора установлен метод капитализации с простым учетом Спреда в соответствии с подпунктом 4.7(г) Спецификации:

(а) ***Базовая сумма периода капитализации*** означает применительно к каждому Периоду капитализации сумму, равную произведению Уточненной номинальной суммы, Плавающей ставки и Коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде для Плавающей ставки:

Базовая сумма периода капитализации	=	***Уточненная номинальная сумма***	***x***	***Плавающая ставка***	***x***	***Коэффициент для расчета количества дней в процентном периоде***

(б) 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.

(в) ***Дополнительная сумма периода капитализации*** означает применительно к каждому Периоду капитализации сумму, равную произведению Номинальной суммы, Спреда и Коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде для Плавающей ставки:

Дополнительная сумма периода капитализации	=	***Номинальная сумма***	***x***	***Спред***	***x***	***Коэффициент для расчета количества дней в процентном периоде***

Усреднение

4.13. Условие об усреднении Плавающей ставки в отношении Плательщика плавающей суммы устанавливается, если:

- Продолжительность периода капитализации превышает Период изменения плавающей ставки и существует возможность установления условия о капитализации. В этом случае усреднение применяется к Периоду капитализации;

- Продолжительность процентного периода превышает Период изменения плавающей ставки и не существует возможности установления условия о капитализации. В этом случае усреднение применяется к Процентному периоду.

При установленном условии об усреднении Датами ставки применительно к Процентному периоду или Периоду капитализации являются даты, предшествующие дате, в которую оканчивается Процентный период или Период капитализации на периоды времени, кратные Периоду изменения плавающей ставки, и входящие в Процентный период или Период капитализации, а также дата начала Процентного периода или Периода капитализации.

Пример. Пусть Процентный период начался 31 декабря 2015 года, а Датой окончания Процентного периода является 31 марта 2016 года и Период изменения плавающей ставки является один месяц. Тогда датами, предшествующими дате, в которую оканчивается Процентный период, на периоды времени, кратные Периоду изменения плавающей ставки будут являться следующие даты: 29 февраля 2016 года, 31 января 2016 года.

При установленном условии об усреднении стороны должны согласовать один из следующих методов усреднения Плавающей ставки:

(а) Средняя плавающая ставка;

В целях расчета Плавающей суммы Плавающая ставка применительно к Процентному периоду или Периоду капитализации рассчитывается на основании значений процентной ставки, указанной в согласованном Способе определения плавающей ставки, действующих в Даты ставки по следующей формуле:

$$\text{Плавающая ставка} = \sum_{i=1}^{\text{ИПС}} \text{Ставка}_i \ / \ \text{ИПС}$$

где,

Плавающая ставка - Плавающая ставка применительно к Процентному периоду или Периоду капитализации в целях расчета Плавающей суммы;

ИПС – число Дат ставки применительно к Процентному период или Периоду капитализации;

i – порядковый номер Даты ставки применительно к Процентному периоду или Периоду капитализации в диапазоне от 1 до ИПС;

Ставка_i –процентная ставка, указанная в согласованном Способе определения плавающей ставки, действующая в Дату ставки i;

(б) Средневзвешенная плавающая ставка;

В целях расчета Плавающей суммы Плавающая ставка применительно к Процентному периоду или Периоду капитализации рассчитывается на основании значений процентной ставки, указанной в согласованном Способе определения плавающей ставки, действующих в Даты ставки по следующей формуле:

$$\text{Плавающая ставка} = \left[\sum_{i=1}^{\text{ИПС}} \text{Ставка}_i \ * \text{КРД}_i\right] / \sum_{i=1}^{\text{ИПС}} \text{КРД}_i$$

где,

Плавающая ставка – Плавающая ставка применительно к Процентному периоду или Периоду капитализации в целях расчета Плавающей суммы;

ИПС – число Дат ставки применительно к Процентному периоду или Периоду капитализации;

i – порядковый номер Даты ставки применительно к Процентному периоду или Периоду капитализации в диапазоне от 1 до ИПС;

Ставка_i – процентная ставка, указанная в согласованном Способе определения плавающей ставки, действующая в Дату ставки i;

КРД_i – применительно к какой-либо Дате ставки i означает количество календарных дней от Даты ставки i (включая ее) до следующей Даты ставки (исключая ее) или

даты, в которую оканчивается Процентный период или Период капитализации (исключая ее).

Изменение номинальной суммы

4.14. Для целей изменения Номинальной суммы в случае, когда в отношении Договора установлено условие об изменении номинальной суммы:

(а) ***Дата изменения номинальной суммы*** означает день в течение срока соответствующего Договора, в который осуществляется изменение Номинальной суммы;

(б) ***Значение изменения номинальной суммы*** означает величину, на которую изменяется Номинальная сумма, указанное в этом качестве в Предложении;

(в) ***Ведущая валюта изменения номинальной суммы (Ведущая валюта)*** означает одну из Валют номинальной суммы, указанную в этом качестве в Предложении применительно к Договору. Другая Валюта номинальной суммы именуется ***Ведомой валютой***;

(г) ***Период изменения номинальной суммы*** означает период времени, указанный в этом качестве в Предложении.

4.15. Период изменения номинальной суммы, указываемый в Предложении, должен быть кратен большему из Процентных периодов, указанных в Предложении.

4.16. Даты изменения номинальной суммы устанавливаются в следующем порядке:

(а) Датами изменения номинальной суммы являются даты, предшествующие Дате истечения срока на периоды времени, кратные Периоду изменения номинальной суммы.

(б) В случае если в соответствии с правилом, указанным в подпункте (а) настоящего пункта Спецификации, в месяце Даты изменения номинальной суммы отсутствует соответствующий день, днем Даты изменения номинальной суммы является последний день месяца Даты изменения номинальной суммы.

(в) Дата изменения номинальной суммы не подлежит переносу в соответствии с применимым к Дате окончательного платежа Условием об окончании срока в нерабочий день.

Пример. Пусть Датой истечения срока является 31 мая 2016 года и Периодом изменения номинальной суммы является три месяца. Тогда Датами изменения номинальной суммы будут являться следующие даты: 29 февраля 2016 года, 30 ноября 2015 года и т.д.

4.17. В Дату изменения номинальной суммы Номинальная сумма в Ведущей валюте подлежит изменению в соответствии со следующими формулами:

$$\textit{Номинальная сумма после изменения} = \textit{Номинальная сумма до изменения} \times \textit{(1 - Значение изменения номинальной суммы)}$$

если Значение изменения номинальной суммы указано в процентном выражении.

Номинальная сумма после изменения	=	***Номинальная сумма до изменения***	-	***Значение изменения номинальной суммы***

если Значение изменения номинальной суммы указано в виде суммы в Ведущей валюте.

При первом изменении Номинальная сумма до изменения устанавливается равной Номинальной сумме, указанной в Предложении.

Номинальная сумма в Ведомой валюте подлежит изменению в соответствии со следующей формулой:

Номинальная сумма после изменения в Ведомой валюте	=	***Номинальная сумма после изменения в Ведущей валюте***	***x***	***Номинальная сумма в Ведомой валюте, указанная в Предложении***	/	***Номинальная сумма в Ведущей валюте, указанная в Предложении***

Округление

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

(а) округление любых сумм, выраженных в определенной валюте, осуществляется до второго знака после запятой (включительно) по правилам математического округления;

(б) округление любых других значений (процентных ставок, 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. Даты платежа, Даты окончания периода, Даты изменения плавающей ставки

5.1. В Дату договора Даты окончания периода и Даты платежа определяются в соответствии с пунктами 5.3, 5.4 Спецификации.

Если после Даты договора в ходе срока Договора Дата истечения срока / Дата окончания периода / Дата платежа перестают быть Рабочими днями, то по отношению к ним используется Условие об окончании срока в нерабочий день, применимое к Дате окончательного платежа.

5.2. Если Продолжительность процентного периода равна сроку Договора, то срок Договора состоит из одного Процентного периода.

5.3. Если Продолжительность процентного периода не равна сроку Договора, то даты, предшествующие Дате истечения срока на периоды времени, кратные соответствующей Продолжительности процентного периода, с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день, применимого к Дате окончательного платежа, являются Датами окончания периода, за следующим исключением:

- не является Датой окончания периода дата, месяц которой совпадает с месяцем Даты начала срока, и Продолжительность процентного периода составляет не меньше месяца.

В случае если в месяце даты, предшествующей Дате истечения срока на период времени, кратный соответствующей Продолжительности процентного периода, отсутствует соответствующий день, днем указанной даты является последний день месяца указанной даты.

Пример. Пусть Датой истечения срока является 31 мая 2016 года и Продолжительность процентного периода равна одному месяцу. Тогда датами, предшествующими Дате истечения срока на периоды времени, кратные соответствующей Продолжительности процентного периода, будут являться следующие даты: 30 апреля 2016 года, 31 марта 2016 года, 29 февраля 2016 года, 31 января 2016 года и т.д.

Если число Дат окончания периода отлично от нуля, то срок Договора состоит из нескольких Процентных периодов, иначе срок Договора состоит из одного Процентного периода.

5.4. Дата первоначального платежа и Даты платежа применительно к Договору устанавливаются в следующем порядке:

(а) Датой первоначального платежа является Дата начала срока;

(б) Датой окончательного платежа является Дата истечения срока;

(в) При наличии нескольких Процентных периодов Плавающей ставки или нескольких Процентных периодов Фиксированной ставки Датами промежуточных платежей Плавающих сумм или Датами промежуточных платежей Фиксированных сумм, соответственно, являются Даты окончания периода;

5.5. Если не установлено условие об усреднении Плавающей ставки, Датой изменения плавающей ставки применительно к Процентному периоду или Периоду капитализации является:

(а) дата, в которую начинается Процентный период или Период капитализации (далее в настоящем пункте – Дата начала периода) с учетом применимого Смещения для Даты изменения плавающей ставки, если Дата начала периода является Рабочим днем применительно к Дате изменения плавающей ставки;

(б) ближайший предшествующий Дате начала периода Рабочий день применительно к Дате изменения плавающей ставки с учетом применимого Смещения для Даты изменения плавающей ставки, если указанная Дата начала периода не является Рабочим днем применительно к Дате изменения плавающей ставки.

В случае указания в Предложении Числа дней для первого Процентного периода указанное правило определения Даты изменения плавающей ставки применяется к первому Процентному периоду так, как если бы первый Процентный период начинался в дату, предшествующую Дате начала срока на указанное Число дней для первого Процентного периода.

5.6. Если установлено условие об усреднении Плавающей ставки, Датой изменения плавающей ставки применительно к Процентному периоду или Периоду капитализации является дата, в которую оканчивается Процентный период или Период капитализации.

6. СПОСОБЫ ОПРЕДЕЛЕНИЯ ПЛАВАЮЩЕЙ СТАВКИ

6.1. Для целей расчета Плавающих сумм по Договору Участники клиринга указывают в Предложении способ определения Плавающей ставки (далее – ***«Способ определения плавающей ставки, Индекс ставки***») путем ссылки на наименование любого из способов, указанных в Приложении 2 к Спецификации.

6.2. 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 Плавающая ставка или источник ее опубликования.

6.3. В случае приостановления/прекращения публикации процентной ставки, указанной в применимом к Договору Способе определения плавающей ставки, и/или в случае возникновения обстоятельств, свидетельствующих об утрате либо о возможности утраты репрезентативности процентной ставки, указанной в применимом к Договору Способе определения плавающей ставки, а также в иных случаях (в том числе на основании информации, полученной от Банка России) при наступлении обстоятельств, которые, по мнению Клирингового центра, могут оказать существенное влияние на условия исполнения обязательств по Договору, Клиринговый центр, уведомив сторону Договора о таком изменении посредством ЭДО не позднее, чем за 30 (тридцать) Рабочих дней, вправе принять решение об изменении в одностороннем порядке следующих условий Договора:

(а) Способ определения плавающей ставки;

(б) Период плавающей ставки;

(в) Спред;

Вышеуказанные изменения начинают действовать для Дат изменения плавающей ставки, приходящихся или следующих за датой одностороннего изменения условий Договора.

В указанном решении Клиринговый центр вправе указать на необходимость проведения дополнительных платежей. Сумма дополнительного платежа определяется с учетом изменения расчетной стоимости Договора, рассчитанной на основании *замещаемой*[1] и *замещающей*[2] Плавающей ставки, указанной в новом Способе определения плавающей ставки, в порядке, установленном указанным решением об изменении условий Договора.

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

7. СБОЙ ПУБЛИКАЦИИ

7.1. ***Сбой публикации*** в отношении Плательщика плавающей суммы по Договору означает невозможность к моменту проведения расчетов в соответствии с Правилами клиринга

[1] Здесь и по тексту Спецификации - процентная ставка, согласованная Сторонами в Способе определения плавающей ставки, действующая применительно к Договору до принятия решения Клиринговым центром в соответствии с пунктом 6.3 Спецификации.

[2] Здесь и по тексту Спецификации – процентная ставка, указанная в Способе определения плавающей ставки в решении Клирингового центра в соответствии с пунктом 6.3 Спецификации.

получить информацию о процентной ставке из источника информации о процентных ставках, указанного в согласованном сторонами Способе определения плавающей ставки для данного Плательщика плавающей суммы по Договору.

7.2. Если в отношении Плательщика плавающей суммы по Договору наступает Сбой публикации:

(а) расчеты по Договору в соответствии с Правилами клиринга в Дату платежа осуществляются Клиринговым центром с использованием последней известной (официально опубликованной) информации о процентной ставке, указанной в согласованном сторонами Способе определения плавающей ставки для данного Плательщика плавающей суммы по Договору.

(б) Клиринговый центр вправе в течение 5 (пяти) Рабочих дней после Даты платежа провести корректирующие расчеты, в том числе, с учетом новой информации о процентной ставке, указанной в согласованном сторонами Способе определения плавающей ставки для данного Плательщика плавающей суммы по Договору. Рабочий день в целях данного подпункта означает Рабочий день в целях осуществления платежей в каждой Валюте номинальной суммы.

Корректирующие расчеты осуществляются Клиринговым центром в следующем порядке:

(i) Клиринговый центр определяет новое значение Плавающей суммы, в том числе, с учетом новой информации о процентной ставке, указанной в согласованном сторонами Способе определения плавающей ставки;

(ii) Клиринговый центр определяет разность между новым значением Плавающей суммы и значением Плавающей суммы, определенной в целях проведения расчетов в соответствии с подпунктом (а) настоящего пункта Спецификации;

(iii) Если указанная разность является положительной, то данный Плательщик плавающей суммы по Договору должен уплатить указанную разность другой стороне. Если указанная разность является отрицательной, то данному Плательщику плавающей суммы по Договору другая сторона должна уплатить сумму, равную абсолютному значению указанной разности.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1
к Спецификации внебиржевых договоров валютно-процентный своп

Форма Предложения для внебиржевого договора валютно-процентный своп

(если условиями Договора предусмотрена уплата/получение Плавающих сумм и Фиксированных сумм)

Условиями Договора, к которому относится настоящее Предложение, являются:

а) Общие условия:

Номинальная сумма в одной валюте:

Валюта одной номинальной суммы (Валюта):[3]

Номинальная сумма в другой валюте:

Валюта другой номинальной суммы (Валюта):[3]

[Начало]:[4]

Окончание:[5]

Конвенция Даты окончательного платежа:

Валюта уплаты депозитной маржи (Валюта ДМ):

Направление в отношении Плавающей суммы:[6]	Уплата (Pay FLOAT) / Получение (Receive FLOAT)
Направление в отношении Фиксированной суммы:[7]	Уплата (Pay FIXED) / Получение (Receive FIXED)

б) Фиксированные суммы:[8]

Ставка:

---

[3] Указывается одна из валют, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[4] Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.6 Спецификации о том, что Датой начала срока является Дата договора.

[5] Срок договора, равный количеству календарных дней между Датой начала срока и Датой истечения срока, должен быть больше Тенора (Теноров), указанного (указанных) в Предложении.

[6] Допустимо указание для каждой стороны Договора. В этом случае условия Договора, установленные разделом (в) Формы Предложения, указываются для каждой стороны Договора.

[7] Допустимо указание для каждой стороны Договора. В этом случае условия Договора, установленные разделом (б) Формы Предложения, указываются для каждой стороны Договора.

[8] Указывается для направления в отношении Фиксированной суммы.

[Конвенция дней]:[9]

[Число дней для первого Процентного периода]:

[Процентный период]: Указание «ежемесячно», «ежеквартально», «каждые полгода», «ежегодно» означает, что Процентный период Фиксированных сумм равен одному месяцу, трем месяцам, шести месяцам, двенадцати месяцам соответственно.
Указание «в конце периода» означает, что Процентный период Фиксированной суммы равен сроку Договора

в) Плавающие суммы:[10]

Индекс ставки:[11]

Тенор:[12]

[Спред]: [плюс/минус [●] б.п.]

Конвенция дней:[13]

[Число дней для первого Процентного периода]:

Смещение:[14]

Процентный период:[15]

Период капитализации:[16]

Смена ставки:[17]

[Метод усреднения]: [Средняя плавающая ставка (Unweighted)] [Средневзвешенная плавающая ставка (Weighted)]

---

[9] Указывается одно из обозначений Коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[10] Указывается для направления в отношении Плавающей суммы.

[11] Указывается одно из наименований Способа определения плавающей ставки, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[12] Указывается один из Периодов плавающей ставки, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[13] Указывается одно из обозначений Коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[14] Указывается одно из Смещений для Даты изменения плавающей ставки, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[15] Указывается Продолжительность процентного периода, предусмотренная Приложением 2 к Спецификации.

[16] Указывается Продолжительность периода капитализации, предусмотренная Приложением 2 к Спецификации.

[17] Указывается Период изменения плавающей ставки, предусмотренный Приложением 2 к Спецификации. Период изменения плавающей ставки не может превышать Период плавающей ставки.

г) [Капитализация]:

[Метод капитализации]:	[Без капитализации] [С учетом Спреда] [С учетом Спреда для Номинальной суммы] [С простым учетом Спреда]
д) [Изменение номинальной суммы]:	[Не применимо] [Применимо]
[Ведущая валюта изменения номинальной суммы]:	[Валюта одной номинальной суммы] [Валюта другой номинальной суммы]
[Период изменения номинальной суммы]:	
[Значение изменения номинальной суммы]:	[плюс/минус [●][%]]
е) [Иные условия]:	
[Дополнительный платеж]:	[Получение / Уплата]
[Сумма дополнительного платежа (Сумма)]:	
[Валюта дополнительного платежа (Валюта)]:[18]	

[18] Указывается одна из валют, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

Форма Предложения для внебиржевого договора валютно-процентный своп

(если условиями Договора предусмотрена уплата / получение только Плавающих сумм)

Условиями Договора, к которому относится настоящее Предложение, являются:

а) Общие условия:

Номинальная сумма в одной валюте:

Валюта одной номинальной суммы (Валюта):[19]

Номинальная сумма в другой валюте:

Валюта другой номинальной суммы (Валюта):[39]

[Начало]:[20]

Окончание:[21]

Конвенция Даты окончательного платежа:

Валюта уплаты депозитной маржи (Валюта ДМ):

б) Получение Плавающей суммы: Получение (Receive FLOAT)

Индекс ставки:[22]

Тенор:[23]

[Спред]: [плюс/минус [●] б.п.]

Конвенция дней:[24]

[Число дней для первого Процентного периода]:

Смещение:[25]

---

[19] Указывается одна из валют, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[20] Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.6 Спецификации о том, что Датой начала срока является Дата договора.

[21] Срок Договора, равный количеству календарных дней между Датой начала срока и Датой истечения срока, должен быть больше Тенора (Теноров), указанного (указанных) в Предложении.

[22] Указывается одно из наименований Способа определения плавающей ставки, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[23] Указывается один из Периодов плавающей ставки, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[24] Указывается одно из обозначений Коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[25] Указывается одно из Смещений для Даты изменения плавающей ставки, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

Процентный период:[26]

Период капитализации:[27]

Смена ставки:[28]

[Метод усреднения]: [Средняя плавающая ставка (Unweighted)] [Средневзвешенная плавающая ставка (Weighted)]

в) Уплата Плавающей суммы: Уплата (Pay FLOAT)

Индекс ставки:[29]

Тенор:[30]

[Спред]: [плюс/минус [●] б.п.]

Конвенция дней:[31]

[Число дней для первого Процентного периода]:

Смещение:[32]

Процентный период:[33]

Период капитализации:[34]

Смена ставки:[35]

[Метод усреднения]: [Средняя плавающая ставка (Unweighted)] [Средневзвешенная плавающая ставка (Weighted)]

г) [Капитализация]:

[Метод капитализации]: [Без капитализации] [С учетом Спреда] [С учетом Спреда для Номинальной суммы] [С простым учетом Спреда]

---

[26] Указывается Продолжительность процентного периода, предусмотренная Приложением 2 к Спецификации.

[27] Указывается Продолжительность периода капитализации, предусмотренная Приложением 2 к Спецификации.

[28] Указывается Период изменения плавающей ставки, предусмотренный Приложением 2 к Спецификации. Период изменения плавающей ставки не может превышать Период плавающей ставки.

[29] Указывается одно из наименований Способа определения плавающей ставки, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[30] Указывается один из Периодов плавающей ставки, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[31] Указывается одно из обозначений Коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[32] Указывается одно из Смещений для Даты изменения плавающей ставки, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[33] Указывается Продолжительность процентного периода, предусмотренная Приложением 2 к Спецификации.

[34] Указывается Продолжительность периода капитализации, предусмотренная Приложением 2 к Спецификации.

[35] Указывается Период изменения плавающей ставки, предусмотренный Приложением 2 к Спецификации. Период изменения плавающей ставки не может превышать Период плавающей ставки.

д) [Изменение номинальной суммы]:	[Не применимо] [Применимо]
[Ведущая валюта изменения номинальной суммы]:	[Валюта одной номинальной суммы] [Валюта другой номинальной суммы]
[Период изменения номинальной суммы]:	
[Значение изменения номинальной суммы]:	[плюс/минус [●][%]]
е) [Иные условия]:	
[Дополнительный платеж]:	[Получение / Уплата]
[Сумма дополнительного платежа (Сумма)]:	
[Валюта дополнительного платежа (Валюта)]:[36]	

[36] Указывается одна из валют, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

Форма Предложения для внебиржевого договора валютно-процентный своп

(если условиями Договора предусмотрена уплата / получение только Фиксированных сумм)

Условиями Договора, к которому относится настоящее Предложение, являются:

а) Общие условия:	
Номинальная сумма в одной валюте:	
Валюта одной номинальной суммы (Валюта):[37]	
Номинальная сумма в другой валюте:	
Валюта другой номинальной суммы (Валюта):[37]	
[Начало]:[38]	
Окончание:[39]	
Конвенция Даты окончательного платежа:	
Валюта уплаты депозитной маржи (Валюта ДМ):	
б) Получение Фиксированной суммы:	Получение (Receive FIXED)
Ставка:	
[Конвенция дней]:[40]	
[Число дней для первого Процентного периода]:	
[Процентный период]:	Указание «ежемесячно», «ежеквартально», «каждые полгода», «ежегодно» означает, что Процентный период Фиксированной суммы равен одному месяцу, трем месяцам, шести месяцам, двенадцати месяцам соответственно. Указание «в конце периода» означает, что Процентный период

[37] Указывается одна из валют, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[38] Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.6 Спецификации о том, что Датой начала срока является Дата договора.

[39] Срок Договора, равный количеству календарных дней между Датой начала срока и Датой истечения срока, должен быть больше Тенора (Теноров), указанного (указанных) в Предложении.

[40] Указывается одно из обозначений Коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

	Фиксированной суммы равен сроку Договора
в) Уплата Фиксированной суммы:	Уплата (Pay FIXED)
Ставка:	
[Конвенция дней:][41]	
[Число дней для первого Процентного периода]:	
[Процентный период]:	Указание «ежемесячно», «ежеквартально», «каждые полгода», «ежегодно» означает, что Процентный период Фиксированной суммы равен одному месяцу, трем месяцам, шести месяцам, двенадцати месяцам соответственно. Указание «в конце периода» означает, что Процентный период Фиксированной суммы равен сроку Договора
г) [Капитализация]:	
[Метод капитализации]:	[Без капитализации] [С учетом Спреда] [С учетом Спреда для Номинальной суммы] [С простым учетом Спреда]
д) [Изменение номинальной суммы]:	[Не применимо] [Применимо]
[Ведущая валюта изменения номинальной суммы]:	[Валюта одной номинальной суммы] [Валюта другой номинальной суммы]
[Период изменения номинальной суммы]:	
[Значение изменения номинальной суммы]:	[плюс/минус [●][%]]
е) [Иные условия]:	
[Дополнительный платеж]:	[Получение / Уплата]
[Сумма дополнительного платежа (Сумма)]:	
[Валюта дополнительного платежа (Валюта)]:[42]	

[41] Указывается одно из обозначений Коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

[42] Указывается одна из валют, предусмотренных Приложением 2 к Спецификации.

ПРИЛОЖЕНИЕ 2
к Спецификации внебиржевых договоров
валютно-процентный своп

Таблица № 1

Таблица соответствия Базисного актива, Валюты номинальной суммы, валюты уплаты депозитной маржи, валюты дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора, Смещения для Даты изменения плавающей ставки и ограничения на срок Договора:

№	Базисный актив (Плавающая ставка и Валюта номинальной суммы)				Валюта номинальной суммы другой стороны*	Смещение для Даты изменения плавающей ставки (в Рабочих днях)	Валюта уплаты депозитной маржи	Валюта дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора	Максимальный срок между ближайшим Рабочим днем для платежей в каждой из Валют номинальной суммы, следующим за Датой договора, и Датой истечения срока
	Способ определения плавающей ставки			Валюта номинальной суммы					
	Наименование способа	Наименование процентной ставки, источник информации для процентной ставки и порядок определения	Период плавающей ставки						
1	MOSPRIME	Ставка предоставления или привлечения рублевых кредитов (депозитов) на межбанковском рынке (Mosprime Rate) на срок, равный Периоду плавающей ставки, рассчитываемая Саморегулируемой организацией «Национальная финансовая ассоциация» (СРО НФА) и публикуемая на сайте СРО НФА в сети Интернет по адресу mosprime.com	один месяц три месяца шесть месяцев	Российский рубль	Доллар США Евро Швейцарский франк	-1	Российский рубль Доллар США Евро	Российский рубль Доллар США Евро	10 лет
2	USD-LIBOR	Ставка LIBOR по депозитам в долларах США на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая в системе Bloomberg под кодами: US0001M Index, US0003M Index, US0006M Index, где 1M, 3M, 6M – обозначение соответствующих Периодов плавающей ставки	один месяц три месяца шесть месяцев	Доллар США	Российский рубль Евро Швейцарский франк	-2	Российский рубль Доллар США Евро	Российский рубль Доллар США Евро	10 лет
3	EURIBOR	Ставка EURIBOR по депозитам в евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая в системе Bloomberg под кодами:	один месяц три месяца шесть месяцев	Евро	Российский рубль	-2	Российский рубль Доллар США Евро	Российский рубль Доллар США Евро	10 лет

		EUR001M Index, EUR003M Index, EUR006M Index, где 1M, 3M, 6M – обозначение соответствующих Периодов плавающей ставки			Доллар США Швейцарский франк				
4	CHF- LIBOR[43]	Ставка LIBOR по депозитам в швейцарских франках на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая в системе Bloomberg под кодами: SF0001M Index, SF0003M Index, SF0006M Index, где 1M, 3M, 6M – обозначение соответствующих Периодов плавающей ставки	один месяц три месяца шесть месяцев	Швейцарский франк	Российский рубль Доллар США Евро	-2	Российский рубль Доллар США Евро	Российский рубль Доллар США Евро	10 лет
5	KEYRATE-AVERAGE	Средневзвешенная ставка, рассчитываемая в соответствии с пунктом 4.13.□(б) Спецификации на основе ключевой ставки Банка России, публикуемой на официальном сайте Банка России в сети Интернет (www.cbr.ru). При этом Рабочим днем применительно к ключевой ставке является Рабочий день Календаря СПФИ	устанавливается равным Периоду изменения плавающей ставки	Российский рубль	Доллар США Евро Швейцарский франк	-	Российский рубль Доллар США Евро	Российский рубль Доллар США Евро	10 лет
6	USD-ARR	Ставка ARR в долларах США на срок, равный Периоду плавающей ставки, является замещающей Плавающей ставкой, указанной в новом Способе определения плавающей ставки для USD-LIBOR**; применяется с учетом спреда SA: ARR+SA, где ставка ARR и спред SA определяются Клиринговым центром в соответствии с ISDA IBOR Fallback Rate Adjustments Rule	один месяц три месяца шесть месяцев	Доллар США	Российский рубль Евро Швейцарский франк	-2	Российский рубль Доллар США Евро	Российский рубль Доллар США Евро	10 лет

[43] Указание Участником клиринга в Предложении / Заявлении об изменении условий Договора СПФИ в качестве процентной ставки для Способа определения плавающей ставки невозможно, если иное не предусмотрено решением Клирингового центра

		Book, опубликованном на сайте data.bloomberglp.com и/ или isda.org							
7	EUR-ARR	Ставка ARR в евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, является замещающей Плавающей ставкой, указанной в новом Способе определения плавающей ставки для EURIBOR**; применяется с учетом спреда SA: ARR+SA, где ставка ARR и спред SA определяются Клиринговым центром в соответствии с ISDA IBOR Fallback Rate Adjustments Rule Book, опубликованном на сайте data.bloomberglp.com и/ или isda.org	один месяц три месяца шесть месяцев	Евро	Российский рубль Доллар США Швейцарский франк	-2	Российский рубль Доллар США Евро	Российский рубль Доллар США Евро	10 лет
8	CHF-ARR	Ставка ARR в швейцарских франках на срок, равный Периоду плавающей ставки, является замещающей Плавающей ставкой, указанной в новом Способе определения плавающей ставки для CHF LIBOR**; применяется с учетом спреда SA: ARR+SA, где ставка ARR и спред SA определяются Клиринговым центром в соответствии с ISDA IBOR Fallback Rate Adjustments Rule Book, опубликованном на сайте data.bloomberglp.com и/ или isda.org	один месяц три месяца шесть месяцев	Швейцарский франк	Российский рубль Доллар США Евро	-2	Российский рубль Доллар США Евро	Российский рубль Доллар США Евро	10 лет

* для другой стороны Договора доступны Фиксированная ставка и любая Плавающая ставка, указанная в данной таблице для соответствующей Валюты номинальной суммы в столбце Валюта номинальной суммы другой стороны.

**

В случае принятия Клиринговым центром соответствующего решения, предусмотренного пунктом 6.3 Спецификации:

Для ставок IBOR замещающей Плавающей ставкой для Способа определения плавающей ставки становится применяемая с учетом спреда процентная ставка ARR в соответствующей валюте и с соответствующим Периодом плавающей ставки, определяемая Клиринговым центром в соответствии с ISDA IBOR Fallback Rate Adjustments Rule Book, опубликованном на сайте data.bloomberglp.com и/или isda.org.

Спред определяется как спред SA, рассчитанный в соответствии с ISDA IBOR Fallback Rate Adjustments Rule Book, опубликованном на сайте data.bloomberglp.com и/ или isda.org.

Начало первого после замещения процентной ставки (Способа определения плавающей ставки) смещенного Процентного периода определяется на основании Даты изменения плавающей ставки IBOR с учетом Смещения.

Окончание смещенного Процентного периода определяется на основании начала смещенного Процентного периода и Тенора ставки семейства IBOR.

Замещающая Плавающая ставка (новый Способ определения плавающей ставки) начинает применяться начиная с Процентного периода, для которого соответствующая Дата изменения плавающей ставки наступает после истечения 2 (двух) Рабочих дней со дня вступления в силу решения Клирингового центра, принятого в соответствии с п.6.3 Спецификации, и / или наступления даты прекращения публикации Способа определения плавающей ставки в зависимости от того, какая из указанных дат наступила ранее.

Рабочим днем применительно к Дате изменения плавающей ставки и замещающему Способу определения плавающей ставки признается Рабочий день, определяемый применительно к замещаемой Плавающей ставке (новому Способу определения плавающей ставки) в соответствии с подпунктом 1.25(б) Спецификации.

Таблица № 2

Таблица допустимых значений Продолжительности процентного периода, Продолжительности периода капитализации, Периода изменения плавающей ставки

№	Наименование способа определения плавающей ставки	Продолжительность процентного периода	Продолжительность периода капитализации	Период изменения плавающей ставки
1	MOSPRIME	Равна Периоду плавающей ставки	Равна Продолжительности процентного периода	Равен Продолжительности процентного периода
2	USD-LIBOR USD-ARR	Равна Периоду плавающей ставки	Равна Продолжительности процентного периода	Равен Продолжительности процентного периода
3	EURIBOR EUR-ARR	Равна Периоду плавающей ставки	Равна Продолжительности процентного периода	Равен Продолжительности процентного периода
4	CHF-LIBOR CHF-ARR	Равна Периоду плавающей ставки	Равна Продолжительности процентного периода	Равен Продолжительности процентного периода
5	KEYRATE-AVERAGE	Одна неделя Один месяц Три месяца Шесть месяцев Двенадцать месяцев Срок договора	Равна Продолжительности процентного периода	Ежедневно

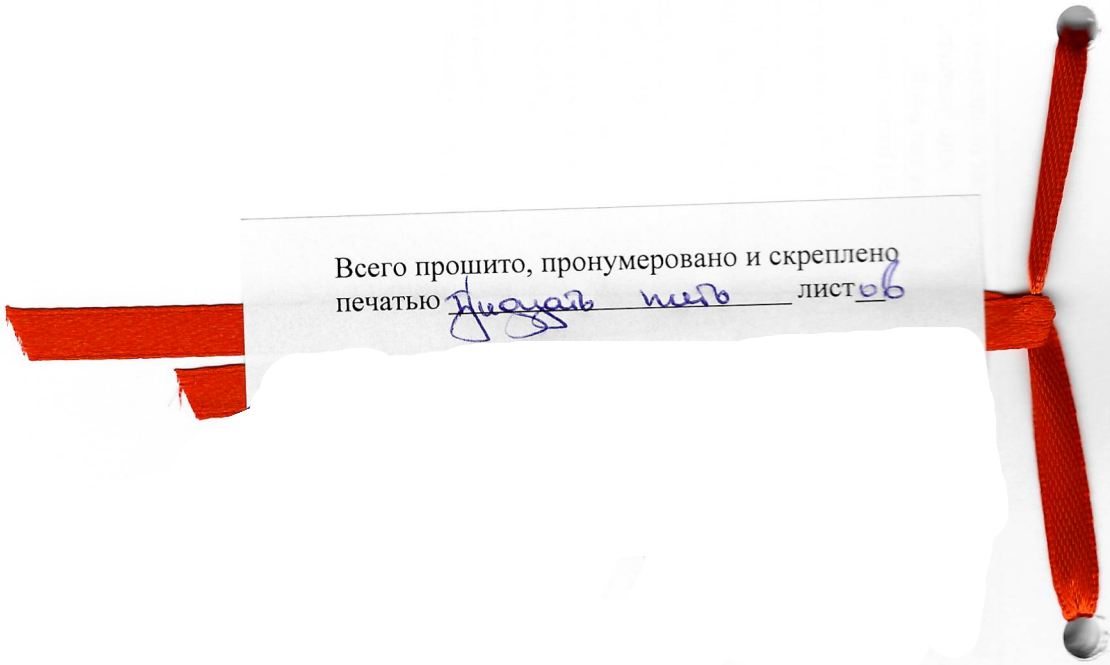
Таблица № 3

Таблица Коэффициентов для расчета количества дней в процентном периоде:

№	Обозначение Коэффициента для расчета количества дней в процентном периоде	Порядок определения количества дней в Процентном периоде или Периоде капитализации*
1	30E/360 (30/360 ISMA)	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
2	Фактическое/360 (Actual/360)	фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на 360
3	Фактическое/365 (Actual/365 (Fixed))	фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на 365
4	Фактическое/Фактическое (Actual/Actual (ISDA))	(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.

* в случае указания в Предложении Числа дней для первого Процентного периода, количество дней в первом Процентном периоде определяется так, как если бы первый Процентный период начинался в дату, предшествующую Дате начала срока на указанное Число дней для первого Процентного периода.


Всего прошито, пронумеровано и скреплено
печатью Двадцать пять листов