

УТВЕРЖДЕНА
решением Правления НКО НКЦ (АО)
от «10» сентября 2020 г. (Протокол № 40)

СПЕЦИФИКАЦИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ ДОГОВОРОВ

ВАЛЮТНЫЙ СВОП

СПЕЦИФИКАЦИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ ДОГОВОРОВ (КОНТРАКТОВ)

ВАЛЮТНЫЙ СВОП

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

1. ОБЩИЕ ОПРЕДЕЛЕНИЯ

- 1.1. **Базисный (базовый) актив** применительно к Договору означает каждую из валют Валютной пары.
- 1.2. **Валютная пара** означает применительно к Договору Первую валюту и Вторую валюту.
- 1.3. **Дата договора** означает применительно к Договору дату Рабочего дня, в который заключен Договор.
- 1.4. **Дата окончательного платежа** означает применительно к Договору день, в который стороны обязаны исполнить свои обязательства по Договору, указанные в подпункте (б) пункта 3.3 Спецификации, с учетом применимого Условия об окончании срока в нерабочий день.
- 1.5. **Дата первоначального платежа** означает применительно к Договору день, в который стороны обязаны исполнить свои обязательства по Договору, указанные в подпункте (а) пункта 3.3 Спецификации, с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день «Следующий рабочий день».
- 1.6. **Договор валютный своп (Договор)** означает Договор валютный своп, как он определен в пункте 3.1 Спецификации.
- 1.7. **Клиринговый центр** означает Небанковскую кредитную организацию – центрального контрагента "Национальный Клиринговый Центр" (Акционерное общество).
- 1.8. **Курс спот** означает применительно к Договору обменный курс, указанный в Предложении, выраженный как отношение количества Второй валюты к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Первой валюты.
- 1.9. **Направление** означает условие Договора, указанное в Предложении (покупка или продажа), в отношении Первой валюты при первоначальном платеже в целях определения обязательств (сумм платежей и сторон) для проведения расчетов по Договору при первоначальном и окончательном платежах.
- 1.10. **Правила клиринга** означают правила клиринга, утвержденные Клиринговым центром, регулирующие порядок оказания клиринговых услуг на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 1.11. **Рабочий день** означает:

- (а) для целей уплаты депозитной маржи, возврата накопленной депозитной маржи, за исключением возврата при изменении валюты депозитной маржи, уплаты процентов на накопленную депозитную маржу, уплаты компенсации при досрочном прекращении Договора в определенной валюте – любой день, являющийся Расчетным днем по такой валюте согласно Правилам клиринга, в который Клиринговый центр, проводит клиринговую сессию на рынке Стандартизированных ПФИ;
- (б) для целей осуществления платежей, предусмотренных пунктом 3.3 Спецификации – любой день, являющийся одновременно:
 - (i) Рабочим днем для целей уплаты депозитной маржи согласно подпункту (а) настоящего пункта Спецификации, и
 - (ii) Расчетным днем по обоим соответствующим валютам (валютам Валютной пары) согласно Правилам клиринга;
- (в) для целей возврата накопленной депозитной маржи и уплаты накопленной депозитной маржи, предусмотренных пунктом 3.5 Спецификации, при изменении валюты уплаты депозитной маржи – любой день, являющийся одновременно:
 - (i) Рабочим днем для целей уплаты депозитной маржи согласно подпункту (а) настоящего пункта Спецификации в валюте до изменения, и
 - (ii) Рабочим днем для целей уплаты депозитной маржи согласно подпункту (а) настоящего пункта Спецификации в валюте после изменения;
- (г) для целей осуществления иных платежей в определенной валюте – любой день, являющийся одновременно:
 - (i) Рабочим днем для целей уплаты депозитной маржи согласно подпункту (а) настоящего пункта Спецификации, и
 - (ii) Расчетным днем по такой валюте согласно Правилам клиринга;
- (д) для целей остальных положений настоящей Спецификации или Предложения – день, являющийся Рабочим днем для целей уплаты депозитной маржи в российских рублях согласно подпункту (а) настоящего пункта Спецификации.

1.12. **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.

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

2. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

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

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

С момента вступления в силу изменений и дополнений в Спецификацию условия существующих обязательств по ранее заключенным Договорам считаются измененными с учетом таких изменений и дополнений.

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

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

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

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

- 2.10. Валюта исполнения обязательств, возникающих в случае, если сторонами Договора согласована уплата дополнительного платежа, обязательств, возникающих при изменении условий Договора, за исключением обязательств, возникающих при изменении валюты уплаты депозитной маржи согласно пункту 3.5 Спецификации, и (или) обязательств, возникающих при досрочном прекращении Договора, указывается в Приложении 2 к Спецификации.
- 2.11. При изменении валюты уплаты депозитной маржи исполнение обязательств, предусмотренных пунктом 3.5 Спецификации, осуществляется в дату такого изменения с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день «Следующий рабочий день». Если при изменении валюты уплаты депозитной маржи сторонами Договора был согласован платеж, исполнение обязательства по его уплате осуществляется в дату указанного исполнения обязательств, предусмотренных пунктом 3.5 Спецификации, с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день «Следующий рабочий день». Начиная со дня указанного исполнения обязательств, предусмотренных пунктом 3.5 Спецификации, расчет и уплата депозитной маржи осуществляется в валюте уплаты депозитной маржи после ее изменения.

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

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

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

- 2.12. Обязательства по Договору полностью прекращаются их надлежащим исполнением, если иное не установлено Правилами клиринга.
- 2.13. Стороны несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по Договору в соответствии с законодательством Российской Федерации и Правилами клиринга.
- 2.14. Стороны указывают в Предложении условия Договора, исходя из возможных условий, указанных в Приложении 2 к Спецификации

3. ДОГОВОР ВАЛЮТНЫЙ СВОП

- 3.1. *Договор валютный своп (Договор)* означает поставочный валютный своп договор (контракт), по которому на условиях, согласованных сторонами, в Дату первоначального платежа одна сторона уплачивает другой стороне сумму (далее — «**Сумма первоначального платежа**») в одной согласованной валюте (далее — «**Первая валюта**»), а другая сторона уплачивает первой стороне Сумму первоначального платежа в другой

согласованной валюте (далее — «**Вторая валюта**»), а в Дату окончательного платежа, наступающую не ранее третьего Рабочего дня после Даты договора, первая сторона уплачивает другой стороне сумму (далее — «**Сумма окончательного платежа**») во Второй валюте, а другая сторона уплачивает первой стороне Сумму окончательного платежа в Первой валюте.

Договор является производным финансовым инструментом.

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

3.3. Порядок осуществления расчетов по Договору.

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

- (i) Валюта суммы платежа, которая является неизменной для первоначального платежа и окончательного платежа, устанавливается в Предложении (далее – Валюта фиксированной суммы);
- (ii) Сумма первоначального платежа в Валюте фиксированной суммы устанавливается в Предложении (далее – Фиксированная сумма);
- (iii) Сумма первоначального платежа в валюте, не являющейся Валютой фиксированной суммы, определяется (А) как произведение Фиксированной суммы и Курса спот, если Валюта фиксированной суммы является Первой валютой, либо (Б) как частное от деления Фиксированной суммы на Курс спот, если Валюта фиксированной суммы является Второй валютой
- (iv) Сторона, для которой в Предложении Направлением является покупка Первой валюты при первоначальном платеже, должен уплатить Сумму первоначального платежа во Второй валюте. Сторона, для которой в Предложении Направлением является продажа Первой валюты при первоначальном платеже, должен уплатить Сумму первоначального платежа в Первой валюте.

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

- (i) Сумма окончательного платежа в Валюте фиксированной суммы устанавливается равной Фиксированной сумме;
- (ii) Сумма окончательного платежа в другой валюте определяется (А) как произведение Фиксированной суммы и суммы Курса спот и цены Договора, установленной в своп-пунктах, если Валюта фиксированной суммы является Первой валютой, либо (Б) как частное от деления Фиксированной суммы платежа на сумму Курса спот и цены Договора, установленной в своп-пунктах, если Валюта фиксированной суммы является Второй валютой. Своп-пункт - курс, выраженный как отношение 0.0001 (одной

десятитысячной) Второй валюты к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Первой валюты.

- (iii) Сторона, уплатившая Сумму первоначального платежа в Первой валюте, должна уплатить Сумму окончательного платежа во Второй валюте. Сторона, уплатившая Сумму первоначального платежа во Второй валюте, должна уплатить Сумму окончательного платежа в Первой валюте.

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

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

4. ОКРУГЛЕНИЕ

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

- (a) округление любых сумм, подлежащих уплате в соответствии с пунктом **Ошибка! Источник ссылки не найден.** 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.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

к Спецификации внебиржевых договоров (контрактов) валютный своп

Форма Предложения для внебиржевого договора валютный своп

Условиями Договора, к которому относится настоящее Предложение, являются:

(а) Общие условия:

Валюта уплаты депозитной маржи (Валюта ДМ):¹

Валютная пара (Первая валюта / Вторая валюта)²

Направление

Покупка (Buy/Sell) / Продажа (Sell/Buy)

Конвенция Даты окончательного платежа:

Цена договора (Цена (своп-пункты)):

[плюс/минус [●] с.п.]

(б) Первоначальный платеж:

Дата первоначального платежа:

Фиксированная сумма (Buy / Sell)

Валюта фиксированной суммы

Первая валюта / Вторая валюта

Курс спот (Спот):

(в) Окончательный платеж:

Дата окончательного платежа:

(г) [Иные условия:]

[Дополнительный платеж]

Получение / Уплата

[Сумма дополнительного платежа (Сумма)]

[Валюта дополнительного платежа (Валюта)]¹

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

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

ПРИЛОЖЕНИЕ 2

к Спецификации внебиржевых договоров (контрактов) валютный своп

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

Базисный актив (Валютная пара): Первая валюта/ Вторая валюта	Валюта уплаты депозитной маржи	Валюта уплаты дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора	Максимальный срок между ближайшим Рабочим днем для платежей в каждой из валют Валютной пары, следующим за Датой договора, и Датой окончательного платежа
Доллар США/ Российский рубль	Российский рубль Доллар США Евро	Российский рубль Доллар США Евро Швейцарский франк	10 лет
Евро/ Российский рубль	Российский рубль Доллар США Евро	Российский рубль Доллар США Евро Швейцарский франк	10 лет
Евро/Доллар США	Российский рубль Доллар США Евро	Российский рубль Доллар США Евро Швейцарский франк	10 лет
Швейцарский франк/ Российский рубль	Российский рубль Швейцарский франк	Российский рубль Доллар США Евро Швейцарский франк	10 лет