
**СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ КОНВЕРСИОННЫХ СДЕЛОК,
СДЕЛОК ВАЛЮТНЫЙ ФОРВАРД,
ВАЛЮТНЫЙ ОПЦИОН
И ВАЛЮТНЫЙ СВОП**

2011 г.

С ИЗМЕНЕНИЯМИ ОТ 05 ИЮЛЯ 2016 г.

This 2011 Standard Terms of FX, Currency Option and FX Swap Transactions is based, in part, on selected provisions of the 1998 FX and Currency Option Definitions, © 1998 International Swaps and Derivatives Association, Inc., ("ISDA®"), Emerging Markets Traders Association, ("EMTA®") and The Foreign Exchange Committee; the 1998 Annex A to the 1998 FX and Currency Option Definitions, © 1998 International Swaps and Derivatives Association, Inc., Emerging Markets Traders Association and The Foreign Exchange Committee; the 2006 ISDA Definitions, © 2006 International Swaps and Derivatives Association, Inc.; and the 2002 ISDA Equity Derivatives Definitions, 2002 International Swaps and Derivatives Association, Inc., and are used with its permission. ISDA takes no position as to this Russian-version 2011 Standard Terms of FX, Currency Option and FX Swap Transactions' suitability for use in any particular transaction. Prospective users should seek independent legal advice before using this instrument.

СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ КОНВЕРСИОННЫХ СДЕЛОК, СДЕЛОК ВАЛЮТНЫЙ ФОРВАРД, ВАЛЮТНЫЙ ОПЦИОН И ВАЛЮТНЫЙ СВОП

2011 г.

Настоящие Стандартные условия конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков, устанавливают особенности заключения, исполнения и прекращения Сделок, как они определены в пункте 1.23 Стандартных условий. Настоящие Стандартные условия применяются к Сделке, (а) если они полностью или частично включены в Подтверждение по Сделке путем указания в нем о применении Стандартных условий конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г. полностью или в соответствующей части; (б) по умолчанию при отсутствии Подтверждения применительно к Сделкам, заключенным после даты согласования Примерных условий договора (как они определены в Стандартных условиях) федеральным органом исполнительной власти по рынку ценных бумаг. Если какой-либо термин настоящих Стандартных условий употребляется в Подтверждении наряду с указанием стороны, он применяется исключительно к этой стороне.

1. ОБЩИЕ ОПРЕДЕЛЕНИЯ

- 1.1. **Базовая валюта** означает применительно к Расчетной сделке валюту, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — доллары США или иную валюту из Валютной пары, по отношению к одной единице (или иному числу, кратному десяти), которой выражается обменный курс в соответствии с практикой на рынке соответствующей Валютной пары.
- 1.2. **Валюта платежа** означает применительно к Расчетной сделке валюту, в которой проводятся расчеты по указанной Сделке в порядке, установленном пунктами 2.4(в) и 3.8(в) Стандартных условий, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — рубли.
- 1.3. **Валютная пара** означает:
 - (а) применительно к Конверсионной сделке, Сделке поставочный валютный форвард и Сделке валютный своп — валюты, определенные в Подтверждении в качестве подлежащих уплате сторонами по Сделке;
 - (б) применительно к Сделке расчетный валютный форвард — Расчетную валюту и Базовую валюту;
 - (в) применительно к Сделке валютный опцион — Валюту на покупку и Валюту на продажу.
- 1.4. **Генеральное соглашение** означает Генеральное соглашение в значении, определенном в Примерных условиях договора.
- 1.5. **Государственный орган** означает орган государственной власти Российской Федерации, включая Банк России.
- 1.6. **Дата оценки** означает применительно к Расчетной сделке Рабочий день, по состоянию на который определяется значение Курса спот, указанный в качестве Даты оценки в Подтверждении или определяемый в соответствии с ним либо иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке. При определении Даты оценки применяется Условие об окончании срока в нерабочий день «Предшествующий рабочий день», если иное не согласовано сторонами.

Если иное не предусмотрено Подтверждением или иным образом не согласовано сторонами, Дата оценки наступает:

 - (а) по Сделке расчетный валютный форвард — за два Рабочих дня до Даты платежа;
 - (б) по Сделке расчетный валютный опцион — в Дату осуществления права на исполнение.
- 1.7. **Дата платежа** означает применительно к Сделке день, в который стороны обязаны исполнить свои обязательства по Сделке, предусмотренные пунктами 2.4, 3.8 или 5.1 Стандартных условий, указанный в качестве Даты платежа или иным образом определяемый в соответствии с Подтверждением либо иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.

Для целей настоящих Стандартных условий каждая из Дат первоначального платежа и Дат окончательного платежа является Датой платежа.

- 1.8. **Дата сделки** означает применительно к Сделке Дату сделки в значении, определенном в Генеральном соглашении.
- 1.9. **Курс спот** означает применительно к Расчетной сделке и Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, — обменный курс валюты на Дату оценки, определенный в соответствии с согласованным Способом определения курса спот или применимой Альтернативой на случай, препятствующий исполнению.
- 1.10. **Номинальная сумма в базовой валюте** означает применительно к Расчетной сделке сумму в Базовой валюте, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке в целях расчета платежей по Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон:
- (а) применительно к Сделке расчетный валютный форвард — сумму в Базовой валюте, равную результату деления Номинальной суммы в расчетной валюте на Форвардный курс;
 - (б) применительно к Сделке расчетный валютный опцион — Сумму валюты на покупку или Сумму валюты на продажу, в зависимости от того, какая из них выражена в Базовой валюте.
- 1.11. **Номинальная сумма в расчетной валюте** означает применительно к Расчетной сделке сумму в Расчетной валюте, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон:
- (а) применительно к Сделке расчетный валютный форвард — сумму в Расчетной валюте, равную произведению Номинальной суммы в базовой валюте и Форвардного курса;
 - (б) применительно к Сделке расчетный валютный опцион — Сумму валюты на покупку или Сумму валюты на продажу в зависимости от того, какая из них выражена в Расчетной валюте.
- 1.12. **Основной финансовый центр** означает применительно к Сделке или валюте финансовый центр или центры, указанные в Подтверждении или иным образом согласованные сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — финансовый центр или центры, перечисленные по каждому виду валют в приложении 7 к Стандартным условиям.
- 1.13. **Округление** означает для целей любых расчетов, производимых в соответствии с настоящими Стандартными условиями:
- (а) округление любых сумм, выраженных в процентах, до пятого знака после запятой (включительно) по математическому методу;
 - (б) округление любых сумм в валюте до четвертого знака после запятой (включительно) по математическому методу, если иной порядок округления не используется в соответствии со сложившейся рыночной практикой на рынке соответствующей валюты.
- 1.14. **Подтверждение** означает Подтверждение в значении, определенном в Генеральном соглашении, которое может быть составлено по форме, установленной в приложениях 1–6 к Стандартным условиям в зависимости от вида Сделки, или иной форме, согласованной сторонами.
- 1.15. **Покупатель расчетной валюты** означает сторону Сделки расчетный валютный форвард, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — сторону, которой в Дату платежа подлежала бы уплата Расчетная валюта, если бы расчеты по данной Сделке производились в порядке, предусмотренном для Поставочных сделок.
- 1.16. **Поставочная сделка** означает Конверсионную сделку, Сделку поставочный валютный форвард, Сделку поставочный валютный опцион или Сделку валютный своп.
- Расчеты по Сделке осуществляются в порядке, установленном для Поставочной сделки, если стороны прямо не предусмотрели иное.
- 1.17. **Примерные условия договора** означает Примерные условия договора о срочных сделках на финансовых рынках 2011 г., разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой

(некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков.

- 1.18. **Продавец расчетной валюты** означает сторону Сделки расчетный валютный форвард, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — сторону, которая должна была бы уплатить Расчетную валюту в Дату платежа, если бы расчеты по Сделке проводились в порядке, установленном для Поставочной сделки.
- 1.19. **Рабочий день** означает:
- (а) для целей осуществления платежей в Дату платежа/Дату уплаты премии, Даты оценки и/или Способа определения курса спот — любой день, являющийся Рабочим днем в значении, определенном в Генеральном соглашении, и:
 - (А) днем, когда кредитные организации осуществляют (или, если бы не наступление События, препятствующего исполнению, осуществляли бы) банковские операции и другие сделки (в том числе операции по переводу валют, расчеты в которых предусмотрены Сделкой, в соответствии со сложившейся на нем практикой) в месте или местах, указанных в Подтверждении или иным образом согласованных сторонами применительно к Сделке для целей определения Рабочего дня;
 - (Б) при отсутствии такого указания:
 - (aa) если евро является валютой, в которой должен быть осуществлен платеж, или одной из валют в Валютной паре для целей Даты оценки и/или Способа определения курса спот — днем, когда открыта Трансъевропейская автоматическая система валовых расчетов и экспресс-переводов в режиме реального времени (Система TARGET);
 - (bb) если другая иностранная валюта является валютой, в которой должен быть осуществлен платеж, или одной из валют в Валютной паре для целей Даты оценки и/или Способа определения курса спот — днем, когда кредитные организации осуществляют (или, если бы не наступление События, препятствующего исполнению, осуществляли бы) банковские операции и другие сделки (в том числе на валютном рынке в соответствии со сложившейся на нем практикой) в Основном финансовом центре этой иностранной валюты;
 - (vv) если несколько видов иностранных валют подлежат уплате или обе валюты Валютной пары являются иностранными валютами — Рабочим днем в соответствии с настоящим определением для каждой валюты соответственно (если практикой, сложившейся на соответствующем валютном рынке, не установлено иное);
 - (б) для целей остальных положений настоящих Стандартных условий или Подтверждения — Рабочий день в значении, определенном в Генеральном соглашении.
- 1.20. **Расчетная валюта** означает применительно к Расчетной сделке валюту, указанную в качестве Расчетной валюты в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке; при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон в отношении Расчетной сделки, по которой в состав Валютной пары входят рубли, Расчетной валютой применительно к такой Сделке являются рубли.
- 1.21. **Расчетная сделка** (или **Беспоставочная сделка**) для целей настоящих Стандартных условий означает Сделку расчетный валютный форвард или Сделку расчетный валютный опцион.
- 1.22. **Расчетный агент** означает лицо, указанное в этом качестве в Генеральном соглашении, если иное лицо не назначено в этом качестве по Сделке в Подтверждении или иным образом не согласовано сторонами применительно к Сделке. Расчетный агент определяет значения курсов, суммы и иные значения, а также выполняет другие действия в соответствии с настоящими Стандартными условиями. Расчетный агент обязан действовать разумно и добросовестно при любых обстоятельствах. Расчет (калькуляция), произведенный Расчетным агентом, является обязательным для сторон, кроме случаев очевидной ошибки.
- 1.23. **Сделка** для целей настоящих Стандартных условий означает заключаемую на основе Примерных условий договора Сделку спот, как она определена в пункте 2.1 Стандартных условий, Сделку валютный форвард, как она определена в пункте 2.2 Стандартных условий, Сделку валютный опцион, как она определена в пункте 3.1 Стандартных условий, Сделку валютный своп, как она определена в пункте 5.1 Стандартных условий, любое сочетание названных Сделок или иную сделку, в отношении которой в Подтверждении стороны указали о том, что к ней применяются настоящие Стандартные условия.

- 1.24. **Сумма платежа** означает применительно к Расчетной сделке сумму, определяемую в Дату оценки по формулам, указанным в пунктах 2.4(б) и 3.8(б) Стандартных условий, и подлежащую уплате в Дату платежа в порядке, установленном пунктами 2.4(в) и 3.8(в) Стандартных условий соответственно.
- 1.25. **Твердая котировка** означает предложение участником рынка обменного курса валюты с обязательством этого участника рынка купить или продать эту валюту по предложенному обменному курсу.
- 1.26. **Условие об окончании срока в нерабочий день** означает условие, в соответствии с которым определяется день окончания срока, если последний день срока приходится на нерабочий день. В Подтверждении стороны могут указать в качестве Условия об окончании срока в нерабочий день:
- (а) **«Следующий рабочий день»** — в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день;
 - (б) **«Предшествующий рабочий день»** — в этом случае днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день;
 - (в) **«Рабочий день в отчетном периоде»** — в этом случае днем окончания срока считается ближайший следующий Рабочий день, а если этот ближайший следующий Рабочий день является днем следующего месяца, то днем окончания срока считается ближайший предшествующий Рабочий день.

Если последний день срока в соответствии с настоящими Стандартными условиями приходится на нерабочий день, день окончания срока определяется по правилу «Следующий рабочий день», указанному в подпункте (а) выше, если иное не предусмотрено другими положениями Стандартных условий, Подтверждением или иным образом не согласовано сторонами применительно к какому-либо сроку или в целом.

- 1.27. **Форвардный курс** означает:
- (а) применительно к Сделке поставочный валютный форвард — обменный курс валюты, выраженный в порядке, указанном в Подтверждении или иным образом согласованном сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого порядка — в соответствии с практикой на рынке соответствующей Валютной пары;
 - (б) применительно к Сделке расчетный валютный форвард — обменный курс валюты, выраженный как отношение количества Расчетной валюты к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Базовой валюты, указанный в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — обменный курс валюты, полученный в результате деления Номинальной суммы в расчетной валюте на Номинальную сумму в базовой валюте.

2. КОНВЕРСИОННЫЕ СДЕЛКИ И СДЕЛКИ ВАЛЮТНЫЙ ФОРВАРД

- 2.1. **Конверсионная сделка** (или **Сделка спот**) означает сделку, по которой одна сторона обязуется купить у другой стороны сумму в одной валюте и продать другой стороне сумму в другой валюте на условиях, согласованных сторонами, с осуществлением обеими сторонами переводов указанных сумм в Дату платежа, наступающую не позднее второго Рабочего дня после Даты сделки.
- 2.2. **Сделка валютный форвард** означает внебиржевой форвардный договор (контракт), по которому на условиях, согласованных сторонами:
- (а) одна сторона обязуется купить у другой стороны сумму в одной валюте и продать другой стороне сумму в другой валюте с осуществлением обеими сторонами переводов указанных сумм в Дату платежа, наступающую не ранее третьего Рабочего дня после Даты сделки (далее - **«Сделка поставочный валютный форвард»**);
 - (б) одна сторона обязуется периодически и (или) одновременно уплачивать другой стороне в каждую согласованную Дату платежа, Сумму платежа в зависимости от изменения обменного курса Расчетной валюты по отношению к Форвардному курсу, согласованному сторонами в Дату сделки (далее - **«Сделка расчетный валютный форвард»**).
- 2.3. **Существенные условия Конверсионной сделки.**
- (а) Существенными условиями Сделки спот, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:

- (А) Валютная пара;
 - (Б) Сумма валюты, подлежащая уплате одной стороной;
 - (В) Сумма валюты, подлежащая уплате другой стороной, или обменный курс;
 - (Г) Дата платежа.
- (б) Существенными условиями Сделки поставочный валютный форвард, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
- (А) Валютная пара;
 - (Б) Сумма валюты, подлежащая уплате одной стороной;
 - (В) Сумма валюты, подлежащая уплате другой стороной, или Форвардный курс (в этом случае валюта, указанная в подпункте (Б) выше, признается Расчетной валютой);
 - (Г) Дата платежа.
- (в) Существенными условиями Сделки расчетный валютный форвард, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
- (А) Расчетная валюта;
 - (Б) Базовая валюта;
 - (В) Продавец расчетной валюты;
 - (Г) Покупатель расчетной валюты;
 - (Д) Номинальная сумма в базовой валюте и Номинальная сумма в расчетной валюте или Форвардный курс и либо Номинальная сумма в базовой валюте, либо Номинальная сумма в расчетной валюте;
 - (Е) Способ определения курса спот;
 - (Ж) Дата платежа.
- (г) Другие условия подлежат согласованию в качестве существенных условий Конверсионной сделки или Сделки валютный форвард по требованию одной из сторон.

2.4. Порядок осуществления расчетов по Конверсионным сделкам и Сделкам валютный форвард.

Конверсионные сделки и Сделки поставочный валютный форвард

- (а) В Дату платежа по Конверсионной сделке или Сделке поставочный валютный форвард каждая сторона обязана уплатить сумму валюты, указанную для нее в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке.

Сделки расчетный валютный форвард

- (б) Сумма платежа применительно к Сделке расчетный валютный форвард, если в отношении Сделки сторонами не согласовано иное, рассчитывается по следующей формуле:

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

При этом Курс спот выражается как отношение количества Расчетной валюты к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Базовой валюты.

- (в) В Дату платежа по Сделке расчетный валютный форвард:

- (А) если Сумма платежа имеет положительное значение, Покупатель расчетной валюты обязан уплатить Продавцу расчетной валюты:
 - (аа) эту сумму в Базовой валюте (если Базовая валюта является Валютой платежа);
 - (бб) эквивалент этой суммы в Валюте платежа по Курсу спот (если Расчетная валюта является Валютой платежа) или по обменному курсу, способ определения которого указан для этих целей в Подтверждении (если Валютой платежа является валюта, не входящая в Валютную пару);
- (Б) если Сумма платежа имеет отрицательное значение, Продавец расчетной валюты обязан уплатить Покупателю расчетной валюты абсолютную величину:
 - (аа) этой суммы в Базовой валюте (если Базовая валюта является Валютой платежа);
 - (бб) эквивалент этой суммы в Валюте платежа по Курсу спот (если Расчетная валюта является Валютой платежа) или по обменному курсу, способ определения которого указан для этих целей в Подтверждении (если Валютой платежа является валюта, не входящая в Валютную пару).

3. СДЕЛКИ ВАЛЮТНЫЙ ОПЦИОН

3.1. **Сделка валютный опцион** означает опционный договор (контракт), по которому на условиях, согласованных сторонами:

- (а) одна сторона (далее - «**Покупатель**») уплачивает другой стороне (далее - «**Продавец**») Премию (если условия Сделки валютный опцион предусматривают уплату Премии) и приобретает право (при условии его осуществления в порядке, установленном пунктом 3.7 Стандартных условий), но не обязанность купить у Продавца по Цене исполнения определенное количество Валюты на покупку и продать Продавцу по Цене исполнения определенное количество Валюты на продажу, а Продавец обязуется купить у Покупателя по Цене исполнения определенное количество Валюты на продажу и продать Покупателю по Цене исполнения определенное количество Валюты на покупку, с осуществлением обеими сторонами переводов указанных сумм в Дату платежа, в том числе путем заключения договора купли-продажи иностранной валюты (далее - «**Сделка поставочный валютный опцион**»);
- (б) Покупатель уплачивает Продавцу Премию (если условия Сделки валютный опцион предусматривают уплату Премии) и приобретает право (при условии его осуществления в порядке, установленном пунктом 3.7 Стандартных условий), но не обязанность периодически и (или) одновременно требовать от Продавца выплаты Суммы платежа (при ее положительном значении) в Дату платежа, а Продавец обязуется в этом случае выплатить Покупателю Сумму платежа (при ее положительном значении) в Дату платежа (далее - «**Сделка расчетный валютный опцион**»).

3.2. Применительно к Сделке валютный опцион следующие термины имеют следующие значения:

- (а) **Валюта на покупку** означает валюту, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — валюту, которая должна быть куплена Покупателем.
- (б) **Валюта на продажу** означает валюту, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — валюту, которая должна быть продана Покупателем.
- (в) **Дата истечения срока** означает последний день Срока осуществления права на исполнение, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.
- (г) **Дата начала срока** означает день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — Дату сделки.
- (д) **Право на исполнение** означает право Покупателя требовать от Продавца уплаты в Дату платежа:
 - (аа) по Сделке поставочный валютный опцион — Суммы валюты на покупку;

- (бб) по Сделке расчетный валютный опцион — Суммы платежа (при ее положительном значении).

Применительно к порядку осуществления Права на исполнение по Сделке валютный опцион следующие термины имеют следующие значения:

- (А) **Время закрытия** означает время в течение Рабочего дня, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, не позднее которого должно быть получено Требование об исполнении, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — 16 часов по московскому времени.
- (Б) **Дата осуществления права на исполнение** означает Рабочий день в течение Срока осуществления права на исполнение, когда Право на исполнение по Сделке валютный опцион осуществлено в порядке, установленном пунктом 3.7 Стандартных условий.
- (В) **Срок осуществления права на исполнение** означает:
 - (аа) в Американском опционе — все Рабочие дни с Даты начала срока до Даты истечения срока (обе даты включительно) в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия;
 - (бб) в Европейском опционе — Дату истечения срока в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия;
 - (вв) в Бермудском опционе — каждую Дату осуществления права на исполнение, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами, с Даты начала срока до Даты истечения срока (обе даты включительно) в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия.
- (Г) **Требование об исполнении** означает безотзывное требование, которое может быть составлено Покупателем по форме, установленной в приложении 8 к Стандартным условиям, или иной форме, согласованной Сторонами. Требование об исполнении может быть доставлено по факсу, если стороны не договорились об ином.
- (е) **Сумма валюты на покупку** означает общую сумму в Валюте на покупку, которая должна быть куплена в соответствии с Подтверждением при осуществлении Права на исполнение по Сделке валютный опцион, а при отсутствии в Подтверждении указания на эту сумму — результат умножения Суммы валюты на продажу на Цену исполнения (где Цена исполнения выражается как отношение подлежащего уплате количества Валюты на покупку к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Валюты на продажу).
- (ж) **Сумма валюты на продажу** означает общую сумму в Валюте на продажу, которая должна быть продана в соответствии с Подтверждением при осуществлении Права на исполнение по Сделке валютный опцион, а при отсутствии в Подтверждении указания на эту сумму — результат деления Суммы валюты на покупку на Цену исполнения (где Цена исполнения выражается как отношение подлежащего уплате количества Валюты на покупку к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Валюты на продажу).
- (з) **Цена исполнения** означает обменный курс валюты, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, по которому Валютная пара будет обменена при осуществлении Права на исполнение по Сделке валютный опцион.

3.3. Стили опционов.

- (а) **Американский опцион** означает вид Сделки валютный опцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено в любой Рабочий день в течение Срока осуществления права на исполнение, состоящего из двух и более дней.
- (б) **Бермудский опцион** означает вид Сделки валютный опцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено исключительно в одну из Дат осуществления права на исполнение, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами, и в Дату истечения срока.
- (в) **Европейский опцион** означает вид Сделки валютный опцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено только в Дату истечения срока.

- (г) Стороны могут договориться о заключении Сделки валютный опцион иного стиля, определив его в Подтверждении.

3.4. Типы опционов.

- (а) **Опцион на покупку (колл)** означает тип Сделки валютный опцион, по которому Покупатель вправе при осуществлении Права на исполнение:

- (А) по Сделке поставочный валютный опцион купить у Продавца Сумму валюты на покупку по Цене исполнения;
- (Б) по Сделке расчетный валютный опцион получить от Продавца Сумму платежа (при ее положительном значении), рассчитанную в соответствии с пунктом 3.8(б) Стандартных условий,

в обоих случаях с учетом того, что предусмотрено в Подтверждении.

- (б) **Опцион на продажу (пут)** означает тип Сделки валютный опцион, по которому Покупатель вправе при осуществлении Права на исполнение:

- (А) по Сделке поставочный валютный опцион продать Продавцу Сумму валюты на продажу по Цене исполнения;
- (Б) по Сделке расчетный валютный опцион получить от Продавца Сумму платежа (при ее положительном значении), рассчитанную в соответствии с пунктом 3.8(б) Стандартных условий,

в обоих случаях с учетом того, что предусмотрено в Подтверждении.

- (в) Стороны могут заключать Сделки, которые сочетают в себе оба типа Сделок валютный опцион. Стороны также могут договориться о заключении Сделки валютный опцион иного типа, определив его в Подтверждении.

3.5. Уплата Премии.

- (а) Если условия Сделки валютный опцион предусматривают уплату Премии, в одну или в каждую из дат, согласованных сторонами (далее - «**Дата уплаты премии**»), Покупатель обязан уплатить Продавцу премию (далее - «**Премия**»), указанную в Подтверждении, иным образом определяемую в соответствии с ним или иным образом согласованную сторонами.

- (б) Стороны могут установить Премию в виде твердой суммы или процента от Суммы валюты на покупку или Суммы валюты на продажу.

3.6. Существенные условия Сделки валютный опцион.

- (а) Общими существенными условиями Сделок валютный опцион, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки в отношении каждой из этих Сделок, являются:

- (А) Покупатель;
- (Б) Продавец;
- (В) Стиль опциона;
- (Г) Тип опциона;
- (Д) Валюта на покупку;
- (Е) Валюта на продажу;
- (Ж) Время закрытия;
- (З) Дата истечения срока;
- (И) Даты осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону (применительно к Бермудскому опциону);

- (К) Дата платежа;
- (б) Существенными условиями Сделки поставочный валютный опцион, также подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Сумма валюты на покупку и Сумма валюты на продажу или Цена исполнения и либо Сумма валюты на покупку, либо Сумма валюты на продажу.
- (в) Существенными условиями Сделки расчетный валютный опцион, также подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Цена исполнения и Сумма валюты на покупку или Сумма валюты на продажу;
 - (Б) Способ определения курса спот.
- (г) Другие условия Сделки валютный опцион подлежат согласованию в качестве существенных условий по требованию одной из сторон.

3.7. Порядок осуществления Права на исполнение.

- (а) Право на исполнение осуществляется автоматически во Время закрытия в Дату истечения срока при условии, что Право на исполнение не было осуществлено ранее и в это Время закрытия:
 - (А) по Сделке расчетный валютный опцион — Сумма платежа равна или превышает произведение одного процента от Цены исполнения и Суммы валюты на покупку или Суммы валюты на продажу в зависимости от типа Сделки валютный опцион;
 - (Б) по Сделке поставочный валютный опцион — сумма, рассчитанная как Сумма платежа в соответствии с пунктом 3.8(б)(А) или 3.8(б)(Б) Стандартных условий, как если бы это была Сделка расчетный валютный опцион, равна или превышает произведение одного процента от Цены исполнения и Суммы валюты на покупку или Суммы валюты на продажу в зависимости от типа Сделки валютный опцион.

При этом если стороны направляют какие-либо уведомления или иные сообщения с напоминанием о наступлении срока исполнения обязательств по Сделке валютный опцион, по которой Право на исполнение осуществляется автоматически в соответствии с настоящим пунктом 3.7(а), в том числе, если они направляются в форме, установленной для Требования об исполнении, такие уведомления или иные сообщения носят исключительно уведомительный характер и не направлены на возникновение, изменение или прекращение прав и обязанностей сторон по Сделке валютный опцион.

Если Право на исполнение осуществляется автоматически по Сделке поставочный валютный опцион, Продавец вправе выбрать порядок расчетов по такой Сделке в соответствии с пунктом 3.8(а) или 3.8(б) Стандартных условий, уведомив об этом Покупателя незамедлительно после наступления Времени закрытия.

Право на исполнение не осуществляется автоматически, если до наступления Времени закрытия Покупатель уведомит Продавца о том, что Покупатель не будет осуществлять Право на исполнение по Сделке валютный опцион.

Правила настоящего пункта об автоматическом осуществлении Права на исполнение применяются, если в Подтверждении стороны не предусмотрели иное.

- (б) Если Право на исполнение не осуществляется автоматически в соответствии с пунктом 3.7(а) Стандартных условий, Покупатель осуществляет свое Право на исполнение по Сделке валютный опцион путем направления Продавцу Требования об исполнении в течение Срока осуществления права на исполнение.
- (в) Если Требование об исполнении не получено Продавцом до или во Время закрытия в Дату истечения срока (и Право на исполнение не осуществляется автоматически в соответствии с пунктом 3.7(а) Стандартных условий), права и обязанности сторон по Сделке валютный опцион прекращаются.
- (г) Сделка валютный опцион не подлежит частичному исполнению, если в Подтверждении не установлено иное.
- (д) Если Покупатель осуществляет свое Право на исполнение по Сделке валютный опцион в порядке, установленном пунктом 3.7(б) Стандартных условий, Датой осуществления права на исполнение по этой Сделке валютный опцион будет считаться:

- (A) применительно к Американскому опциону:
 - (aa) Рабочий день в пределах Срока осуществления права на исполнение, в который Продавец получил Требование об исполнении не позднее Времени закрытия;
 - (bb) следующий Рабочий день в пределах Срока осуществления права на исполнение, если Требование об исполнении получено Продавцом после Времени закрытия;
- (Б) применительно к Бермудскому опциону — любая из Дат осуществления права на исполнение, указанная в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованная сторонами, в которую Продавец получил Требование об исполнении не позднее Времени закрытия;
- (B) применительно к Европейскому опциону — Дата истечения срока, если Продавец получил Требование об исполнении не позднее Времени закрытия в эту Дату истечения срока.

3.8. Порядок расчетов по Сделкам валютный опцион.

Сделки поставочный валютный опцион

- (a) В случае осуществления Права на исполнение по Сделке поставочный валютный опцион, в Дату платежа Покупатель обязан уплатить Продавцу Сумму валюты на продажу, а Продавец обязан уплатить Покупателю Сумму валюты на покупку.

Сделки расчетный валютный опцион

- (б) Сумма платежа применительно к Сделке расчетный валютный опцион, если в отношении Сделки сторонами не согласовано иное, рассчитывается по следующим формулам:

- (A) применительно к Сделке расчетный валютный опцион, где Валюта на покупку является Расчетной валютой, а Валюта на продажу — Базовой валютой:

$$\text{Сумма платежа} = \left[\begin{array}{c} \text{Сумма валюты} \\ \text{на продажу} \end{array} \times \left(\frac{\text{Цена исполнения} - \text{Курс спот}}{\text{Курс спот}} \right) \right]$$

- (B) применительно к Сделке расчетный валютный опцион, где Валюта на покупку является Базовой валютой, а Валюта на продажу — Расчетной валютой:

$$\text{Сумма платежа} = \left[\begin{array}{c} \text{Сумма валюты} \\ \text{на покупку} \end{array} \times \left(\frac{\text{Курс спот} - \text{Цена исполнения}}{\text{Курс спот}} \right) \right]$$

- (B) при этом применительно к пунктам 3.8(б)(A) и 3.8(б)(B) Стандартных условий Базовой валютой признается валюта, являющаяся Базовой валютой для целей выражения обменного курса соответствующей Валютной пары, другая валюта в Валютной паре признается Расчетной валютой.
- (в) В случае осуществления Права на исполнение по Сделке расчетный валютный опцион, если Сумма платежа имеет положительное значение, Продавец обязан уплатить Покупателю в Дату платежа:
 - (A) эту сумму в Базовой валюте (если Базовая валюта является Валютой платежа);
 - (B) эквивалент этой суммы в Валюте платежа по Курсу спот (если Расчетная валюта является Валютой платежа) или по обменному курсу, способ определения которого указан для этих целей в Подтверждении (если Валютой платежа является валюта, не входящая в Валютную пару).

4. СПОСОБЫ ОПРЕДЕЛЕНИЯ КУРСА СПОТ

- 4.1. Применительно к Расчетной сделке для целей расчета Суммы платежа и Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, стороны согласовывают способ определения Курса спот (далее «*Способ определения курса спот*»). В Подтверждении Способ определения курса спот может быть установлен путем ссылки на любое из положений настоящей статьи 4 или путем включения самостоятельного определения Способа определения курса спот.
- 4.2. Для целей определения Курса спот применительно к соответствующему Способу определения курса спот сторонами может быть использован любой из следующих обменных курсов, указанный в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке (далее — «*Применимый курс*»): (i) курс покупки Расчетной валюты, (ii) курс продажи Расчетной валюты, (iii) среднее арифметическое курсов покупки и продажи Расчетной валюты, (iv) курс покупки Базовой валюты, (v) курс продажи Базовой валюты, (vi) среднее арифметическое курсов покупки и продажи Базовой валюты, (vii) иной обменный курс валюты, указанный в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке. При отсутствии такого указания Применимым курсом считается среднее арифметическое курсов покупки и продажи Расчетной валюты.
- 4.3. Сторонами могут быть использованы следующие Способы определения курса спот:

Публикуемые рыночные обменные курсы валюты

- (а) **RUB MICEXFRX**, или **RUB01**, означает, что Курсом спот для Даты оценки является Применимый курс рубля к доллару США, выраженный как количество рублей за один доллар, для расчетов в ту же дату, объявляемый ЗАО «Московская межбанковская валютная биржа» (далее — «**ММВБ**») на странице MICEXFRX в системе Reuters в 10 часов 30 минут по московскому времени в Дату оценки;
- (б) **RUB MMVB**, или **RUB02**, означает, что Курсом спот для Даты оценки является Применимый курс рубля к доллару США, выраженный как количество рублей за один доллар, для расчетов в ту же дату, объявляемый ММВБ на странице MMVB в системе Reuters в 10 часов 30 минут по московскому времени в Дату оценки;
- (в) **RUB CME-EMTA**, или **RUB03**, означает, что Курсом спот для Даты оценки является Применимый курс рубля к доллару США, выраженный как количество рублей за один доллар, для расчетов на следующий Рабочий день, рассчитанный Чикагской товарной биржей (Chicago Mercantile Exchange) и объявляемый Ассоциацией трейдеров развивающихся рынков (далее — «**EMTA**») на странице EMTA в системе Reuters, а если такая страница недоступна — на другой странице системы Reuters или иной системе, на которой публикуется такая информация, примерно в 13 часов 30 минут по московскому времени в Дату оценки, а применительно к любой Дате оценки, наступающей после 17 июля 2016 года (в том числе по Сделкам, совершенным до такой даты), означает **RUB MOEX** или **RUB05**;
- (в¹) **RUB MOEX**, или **RUB05**, означает что Курсом спот для Даты оценки является курс рубля к доллару США, выраженный как количество рублей за один доллар, для расчетов на следующий Рабочий день, объявляемый ПАО Московская Биржа (MOEX) на странице moex.com/en/fixing как MOEX USD/RUB FX Fixing примерно в 12 часов 35 минут по московскому времени в Дату оценки;
- (г) **EMTA RUB INDICATIVE SURVEY RATE**, или **RUB04**, означает, что Курсом спот для Даты оценки является Применимый курс рубля к доллару США, выраженный как количество рублей за один доллар, для расчетов на следующий рабочий день, публикуемый на странице EMTA в сети Интернет (www.emta.org) примерно в 14 часов 45 минут по московскому времени либо вскоре после указанного времени. Курс спот рассчитывается EMTA (или иным лицом по исключительному выбору EMTA) в соответствии с EMTA RUB Indicative Survey Methodology (под которой понимается методология от 18 июля 2016 года, с учетом последующих изменений или дополнений, централизованного коллективного опроса финансовых институтов из числа ведущих участников на рынке по паре валют рубль/доллар США для целей расчета EMTA RUB INDICATIVE SURVEY RATE);
- (д) **ECB37** означает применительно

(А) к паре валют рубль/евро – обменный курс российского рубля к евро, устанавливаемый Европейским центральным банком (ЕЦБ) и публикуемый на странице ECB37 в системе Reuters примерно в 14 часов 30 минут по центральноевропейскому времени;

(Б) к паре валют иностранная валюта/иностранная валюта – обменный курс соответствующей пары валют (иностранной валюты к евро, если евро – одна из валют пары, или, в остальных случаях, иностранной валюты к другой иностранной валюте через кросс-курс этих иностранных валют к евро), ус-

танавливаемый ЕЦБ и публикуемый на странице Reuters «ЕСВ37» в 14 часов 30 минут по центрально-европейскому времени;

(В) к паре валют иностранная валюта (кроме долларов США и евро)/российский рубль – обменный курс, рассчитанный как кросс-курс на основе курса доллара США к российскому рублю RUB CME EMTA и курса доллара США к соответствующей иностранной валюте, определяемого в порядке, указанном в подпункте (б) выше).

(е)

Котировки банков-ориентиров

(ж) **«Котировки банков-ориентиров»** означает, что Курс спот для Даты оценки может определяться на основе котировок Применимого курса (выраженного как отношение количества Расчетной валюты к одной единице (или иному числу, кратному десяти) Базовой валюты) на Дату оценки для расчетов в Дату платежа, запрошенных у банков, указанных в Подтверждении или иным образом согласованных сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — у не менее чем четырех банков, выбранных Расчетным агентом из числа ведущих на рынке соответствующих валют (далее — **«Банки-ориентеры»**). Банки-ориентеры являются Дилерами-ориентерами для целей Генерального соглашения.

(А) Если Котировки банков-ориентиров являются первичным Способом определения курса спот, Расчетный агент обязан запросить у Банков-ориентиров Твердые котировки Применимого курса в отношении суммы в Расчетной валюте, указанной в Подтверждении в качестве котировочной суммы или иным образом согласованной сторонами применительно к Сделке (далее — **«Котировочная сумма»**), а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — в отношении стандартной суммы по сделкам с Расчетной валютой (то есть суммы, которая является обычной для конверсионных сделок спот на рынке соответствующей валюты на Дату оценки). Котировки, используемые для определения Курса спот на Дату оценки, должны определяться в каждом конкретном случае во время дня (далее — **«Котировочное время»**), указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, в эту Дату оценки, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — во время дня, выбранное Расчетным агентом.

(Б) Если Котировки банков-ориентиров являются Альтернативным способом определения курса спот, Расчетный агент обязан запросить у Банков-ориентиров котировку того, что могло бы составлять Применимый курс в соответствии с первичным Способом, определения курса спот, если бы он был опубликован в Дату оценки, исходя из опыта каждого Банка-ориентера на валютном рынке Расчетной валюты и общей ситуации на этом рынке в Дату оценки. Котировки, используемые для определения Курса спот на Дату оценки, должны определяться в каждом конкретном случае для этой Даты оценки и запрашиваться в Котировочное время или в возможно короткий срок после того, как стало известно об отсутствии или невозможности определения Применимого курса в соответствии с первичным Способом определения курса спот.

(В) При этом Курс спот будет определяться, (А) если предоставлено не менее четырех котировок, как среднее арифметическое котировок, без учета самого высокого и самого низкого значений (если более одной котировки имеют одинаковое самое высокое или низкое значения, не учитывается только одна из этих котировок); (Б) если предоставлены две или три котировки, как среднее арифметическое предоставленных котировок. Если предоставлено менее двух котировок, считается, что определить Курс спот на эту Дату оценки в соответствии с настоящим Способом определения курса спот невозможно.

Официальные курсы валют

(з) **«Официальный курс»** означает, что Курс спот для Даты оценки определяется на основе официального курса соответствующей иностранной валюты по отношению к рублю, установленного Банком России в Дату оценки для расчетов на следующий рабочий день (или кросс-курса с использованием официального курса Банка России).

4.4. Если применимый к Сделке 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.

5. СДЕЛКИ ВАЛЮТНЫЙ СВОП

5.1. Сделка валютный своп означает поставочный 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 в настоящем пункте — «Первая валюта»), а другая сторона уплачивает первой стороне Сумму первоначального платежа в другой согласованной валюте (далее в настоящем пункте — «Вторая валюта»), а в Дату окончательного платежа, наступающую не ранее третьего Рабочего дня после Даты сделки, 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.

5.2. Применительно к Сделке валютный своп следующие термины имеют следующие значения:

- (а) *Дата окончательного платежа* означает применительно к Сделке валютный своп день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.
- (б) *Дата первоначального платежа* означает применительно к Сделке валютный своп день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон — следующий Рабочий день после Даты сделки.

5.3. **Существенные условия Сделки валютный своп.**

- (а) Существенными условиями Сделки валютный своп, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Сумма первоначального платежа и валюта для первой стороны;
 - (Б) Сумма первоначального платежа и валюта для второй стороны;
 - (В) Сумма окончательного платежа для первой стороны;
 - (Г) Сумма окончательного платежа для второй стороны;
 - (Д) Дата окончательного платежа.
- (б) Другие условия подлежат согласованию в качестве существенных условий Сделки валютный своп по требованию одной из сторон.

6. БАРЬЕРЫ В СДЕЛКАХ

6.1. Сделка может быть совершена под отлагательным или отменительным условием, в соответствии с которым Право на исполнение, право на получение платежа либо обязанность совершить платеж в соответствии с условиями Сделки, если условиями Сделки не предусмотрено иное:

- (а) возникает (такое условие Сделки именуется «*Барьерное отлагательное условие*») или
- (б) прекращается (такое условие Сделки именуется «*Барьерное отменительное условие*»)

у соответствующей стороны, если Курс спот согласованной сторонами Валютной пары достиг уровня Барьерного курса или преодолел его по состоянию на Контрольное время в Контрольную дату.

Условия Сделки могут предусматривать одно или более значений Барьерного курса. Интервал между парными значениями Барьерного курса (верхним и нижним значениями Барьерного курса) именуется «*Диапазон целевых значений*». При установлении Диапазона целевых значений (одного или более), возникновение или прекращение прав и обязанностей сторон, а также размер платежа по Сделке, как указано в пункте 6.1 Стандартных условий, может зависеть от нахождения или изменения значения Курса спот внутри и (или) за пределами Диапазона целевых значений.

6.2. *Барьерный курс* означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, значение обменного курса Валютной пары, указанное в этом качестве в

Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке в целях определения наступления Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

- 6.3. **Контрольная дата** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, каждый из Рабочих дней, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.

Если в Подтверждении не указано Контрольных дат, Контрольной датой является каждый из Рабочих дней в течение периода начиная с Даты сделки (включительно) по (включая) последнюю Дату оценки, Дату истечения срока или в случае их отсутствия Рабочий день, предшествующий Дате платежа (либо последней Дате платежа, если условиями Сделки предусмотрено несколько Дат платежа) или Дате окончательного платежа по Сделке.

- 6.4. **Контрольное время** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, время дня в Контрольную дату, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания и иного соглашения сторон — фактическое время закрытия торгов в режиме основных торгов на ММВБ в отношении Валютной пары в Контрольную дату.

- 6.5. Существенными условиями Сделки, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки помимо существенных условий соответствующего вида Сделок, предусмотренных Стандартными условиями, являются:

- (а) Тип условия о барьере (отлагательное или отменительное);
- (б) Барьерный курс (или, если применимо, Диапазон целевых значений);
- (в) Способ определения курса спот.

- 6.6. В случае возникновения у сторон разногласий по вопросу о наступлении Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия Расчетный агент определяет, наступило ли соответствующее условие.

7. СОБЫТИЯ, ПРЕПЯТСТВУЮЩИЕ ИСПОЛНЕНИЮ, И АЛЬТЕРНАТИВЫ НА СЛУЧАЙ, ПРЕПЯТСТВУЮЩИЙ ИСПОЛНЕНИЮ

События, препятствующие исполнению

- 7.1. Если в отношении Сделки наступает и продолжает иметь место одно из следующих событий (каждое из которых именуется в настоящих Стандартных условиях «**Событие, препятствующее исполнению**»), согласованных Сторонами в качестве применимых к такой Сделке, Сделка подлежит исполнению или прекращению в соответствии с одним из способов (каждый из которых именуется в настоящих Стандартных условиях «**Альтернатива на случай, препятствующий исполнению**»), перечисленных в пункте 7.4 Стандартных условий.

- (а) **Валютные ограничения** означает принятие Государственным органом нормативно-правового или иного акта общего характера:

- (А) запрещающего или существенно ограничивающего конверсию рублей в иностранную валюту и/или конверсию иностранной валюты в рубли;
- (Б) запрещающего или существенно ограничивающего ведение счетов резидентов, как они определены в валютном законодательстве Российской Федерации, в иностранной валюте и требующего проведения принудительной конверсии иностранной валюты в рубли;
- (В) вводящего мораторий на операции с иностранной валютой,

если одно или несколько вышеуказанных ограничений имеет место на Дату платежа.

- (б) **Двойной курс валюты** означает применительно к Расчетной сделке возникновение на Дату оценки двух и более различных числовых значений у обменного курса валюты, указанного в Способе определения курса спот по Сделке.

- (в) **Сбой публикации** означает применительно к Расчетной сделке невозможность получить информацию о Курсе спот из источника информации об обменных курсах, указанного в согласованном сторонами Способе определения курса спот, на Дату оценки.

- (г) Стороны могут предусмотреть в Подтверждении применительно к Сделке иные События, препятствующие исполнению.

- 7.2. Если какое-либо событие составляет Юридическое ограничение или действие Непреодолимой силы, как они определены в Генеральном соглашении, и одновременно представляет собой Событие, препятствующее исполнению, для целей настоящих Стандартных условий и Генерального соглашения к такому событию применяются последствия, установленные для События, препятствующего исполнению.
- 7.3. В Подтверждении может быть предусмотрено «Определение События, препятствующего исполнению, Расчетным агентом». В этом случае Расчетный агент после консультаций с обеими сторонами (или другой стороной, если Расчетный агент является одной из сторон) должен добросовестно определить, наступило ли в отношении Сделки Событие, препятствующее исполнению.

Альтернативы на случай, препятствующий исполнению

- 7.4. Если в отношении Сделки наступает Событие, препятствующее исполнению, Сделка подлежит исполнению или прекращению в соответствии с одной из следующих Альтернатив на случай, препятствующий исполнению, если это установлено в Подтверждении или следует из пункта 7.4(з) Стандартных условий.

- (а) **Альтернативный способ определения курса спот** означает применительно к Двойному курсу валюты или Сбою публикации, что Расчетный агент определяет Курс спот по Сделке на соответствующую Дату оценки в соответствии с иными Способами определения курса спот в последовательности, указанной в Подтверждении или иным образом согласованной сторонами применительно к Сделке.

При отсутствии такого указания в Подтверждении Альтернативные способы определения курса спот для соответствующей Валютной пары применяются в последовательности, указанной в пункте 4.3 Стандартных условий, начиная со Способа определения курса спот, следующего за первичным Способом определения курса спот, согласованным сторонами.

- (б) **Выплата эквивалента в рублях** означает применительно к Расчетным сделкам, что обязательство уплатить Сумму платежа в иностранной валюте заменяется обязательством уплатить эквивалент Суммы платежа в рублях по Курсу спот (если одной из валют Валютной пары является рубль) или обменному курсу, определяемому Расчетным агентом, в иных случаях.

- (в) **Замена на расчетную сделку** означает, что в Сделке поставочный валютный форвард, Сделке поставочный валютный опцион и Сделке валютный своп (в части уплаты сторонами Сумм окончательного платежа) в отношении Валютной пары, в которой одной из валют является рубль, обязательства стороны по платежам заменяются обязательством одной из сторон уплатить сумму (или ее эквивалент в рублях по Курсу спот), которая подлежала бы выплате в соответствии с настоящими Стандартными условиями, если бы расчеты по такой Сделке поставочный валютный форвард, или Сделке валютный своп (в части уплаты сторонами Сумм окончательного платежа) осуществлялись в порядке, установленном для Сделки расчетный валютный форвард, а расчеты по Сделке поставочный валютный опцион — в порядке, установленном для Сделки расчетный валютный опцион.

Для целей настоящего пункта, если иное не установлено в Подтверждении:

- (А) Датой оценки будет день, который, если бы не Событие, препятствующее исполнению, был бы Датой платежа;

- (Б) Курс спот будет определяться:

- (аа) применительно к Валютной паре, включающей рубли и доллары США — как если бы Способом определения курса спот был EMTA RUB INDICATIVE SURVEY RATE;

- (бб) применительно к другим случаям — как если бы Способом определения курса спот были Котировки банков-ориентиров,

и выражаться как отношение суммы в рублях к одной единице (или иному числу, кратному десяти) иностранной валюты;

- (В) Датой платежа будет второй Рабочий день после Даты оценки, указанной выше;

- (Г) Расчетной валютой будут рубли;

- (Д) Базовой валютой будет иностранная валюта;

- (Е) Номинальная сумма в расчетной валюте будет равна сумме, которая подлежала бы уплате по Сделке поставочный валютный форвард и Сделке поставочный валютный опцион (если бы

не Событие, препятствующее исполнению), или Сумме окончательного платежа в рублях по Сделке валютный своп;

(Ж) Номинальная сумма в базовой валюте будет равна сумме в иностранной валюте, которая подлежала бы уплате по Сделке поставочный валютный форвард и Сделке поставочный валютный опцион (если бы не Событие, препятствующее исполнению), или Сумме окончательного платежа в иностранной валюте по Сделке валютный своп;

(З) в Сделке поставочный валютный форвард и Сделке валютный своп (в части уплаты сторонами Сумм окончательного платежа) Форвардным курсом будет обменный курс валюты, выраженный как отношение суммы в рублях к одной единице (или иному числу, кратному десяти) иностранной валюты, полученный путем деления суммы в рублях, которая подлежала бы платежу по Сделке поставочный валютный форвард или Сделке валютный своп (если бы не Событие, препятствующее исполнению), на сумму в иностранной валюте, которая подлежала бы платежу по Сделке поставочный валютный форвард или Сделке валютный своп (если бы не Событие, препятствующее исполнению);

(И) Сумма платежа по Сделке расчетный валютный форвард будет определяться по следующей формуле:

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

(К) Сумма платежа по Сделке расчетный валютный опцион будет определяться по следующим формулам, если в отношении Сделки сторонами не согласовано иное:

(аа) Если Валютой на продажу являются рубли, а Валютой на покупку — иностранная валюта:

$$\text{Сумма платежа} = \left[\frac{\text{Сумма валюты на покупку}}{\text{Сумма валюты на покупку}} \times \left(\frac{\text{Курс спот} - \text{Цена исполнения}}{\text{Курс спот}} \right) \right] \times \text{Курс спот}$$

(бб) Если Валютой на покупку являются рубли, а Валютой на продажу — иностранная валюта:

$$\text{Сумма платежа} = \left[\frac{\text{Сумма валюты на продажу}}{\text{Сумма валюты на продажу}} \times \left(\frac{\text{Цена исполнения} - \text{Курс спот}}{\text{Курс спот}} \right) \right] \times \text{Курс спот}$$

(г) **Определение курса спот расчетным агентом** означает, что Расчетный агент должен определить Курс спот (или метод определения Курса спот), принимая во внимание всю доступную информацию, которую он разумно и добросовестно посчитает уместной.

(д) **Отсрочка исполнения** означает, что Датой платежа по Сделке будет считаться первый Рабочий день после дня, когда Событие, препятствующее исполнению, прекратило действие, если только Событие, препятствующее исполнению, не продолжает иметь место (начиная со дня, который, если бы не Событие, препятствующее исполнению, был бы Датой платежа) в течение максимального количества Рабочих дней подряд, установленного в Подтверждении (далее — «**Максимальный срок события, препятствующего исполнению**»). В этом случае последний из таких Рабочих дней будет Датой платежа, и соответствующие Альтернативы на случай, препятствующий исполнению, подлежат применению к этой Сделке.

(е) **Прекращение** означает, что обязательства по Сделке прекращаются в соответствии с применимыми положениями статьи 6 Примерных условий договора, как если бы:

(А) Событие, препятствующее исполнению, было определено как Дополнительное основание прекращения;

- (Б) все применимые Льготные периоды истекли;
- (В) все уведомления, необходимые для возникновения права на прекращение обязательств по Сделке, были получены в день, когда Прекращение стало применимой Альтернативой на случай, препятствующий исполнению;
- (Г) были две Затронутые стороны;
- (Д) Сделка являлась единственной Затронутой сделкой.

Термины «Дополнительное основание прекращения», «Льготный период», «Затронутые стороны» и «Затронутая сделка» имеют значение, указанное в Примерных условиях договора, если Генеральным соглашением не предусмотрено иное.

- (ж) Стороны могут установить в Подтверждении иные Альтернативы на случай, препятствующий исполнению, которые будут применяться к Сделке.
 - (з) Если стороны не указали в Подтверждении Альтернатив на случай, препятствующий исполнению, Альтернативы на случай, препятствующий исполнению, применяются в следующей последовательности:
 - (и) при Валютных ограничениях:
 - (А) в Поставочной сделке, где Валютная пара включает рубли, — Замена на расчетную сделку, а в других случаях Поставочных сделок — Отсрочка исполнения;
 - (Б) в Расчетной сделке — Выплата эквивалента в рублях;
 - (к) при Двойном курсе валюты — применимый Альтернативный способ определения курса спот, а при его отсутствии — Определение курса спот расчетным агентом;
 - (л) при Сбое публикации:
 - (А) применимый Альтернативный способ определения курса спот из публикуемых рыночных обменных курсов валют, а при его отсутствии — Котировки банков-ориентиров;
 - (Б) Определение курса спот расчетным агентом.
- 7.5. Кроме случаев, указанных в подпункте 7.6 Стандартных условий, если в Подтверждении предусмотрена одна или более Альтернатив на случай, препятствующий исполнению, к Сделке применяются только эти Альтернативы на случай, препятствующий исполнению, в последовательности, установленной Подтверждением.
- 7.6. Если иное не установлено в Подтверждении, в случае когда ни одна из применимых Альтернатив на случай, препятствующий исполнению, не позволяет сторонам определить Курс спот или порядок исполнения Сделки, обязательства по Сделке подлежат прекращению в соответствии с положениями о Прекращении.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

к Стандартным условиям конверсионных сделок,
сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г.

Форма Подтверждения для Конверсионной сделке

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — «*Подтверждение*») является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — «*Сторона А*») и [●] (далее — «*Сторона Б*») от [●] (далее — «*Генеральное соглашение*»).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.
3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:
 - (а) Общие условия:

Дата сделки:
[Сумма и валюта, подлежащая уплате Стороной А:]
[Сумма и]¹ валюта, подлежащая уплате Стороной Б:
[Обменный курс:]²
Дата платежа: [Сегодня/Завтра/Послезавтра]
 - (б) Иные условия:]

¹ Для Сделок спот стороны обязаны указать (а) сумму и валюту, подлежащую уплате Стороной Б, или (б) Курс спот и валюту, подлежащую уплате Стороной Б.

² Для Сделок спот стороны обязаны указать (а) сумму и валюту, подлежащую уплате Стороной Б, или (б) Курс спот и валюту, подлежащую уплате Стороной Б.

[4][5]. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[[5][6]. Рабочий день:]

[[6][7]. [Условие окончания срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Должность:

Ф. И. О.:

Должность:

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

[Сумма и валюта, подлежащая уплате Стороной А:]

[Сумма и]³ валюта, подлежащая уплате Стороной Б:

[Форвардный курс]⁴

Дата платежа:

Расчеты в порядке, установленном Применимо
для Поставочной сделки

[(б) Иные условия:]

4. Правила о Событиях, препятствующих исполнению, и Альтернативах на случай, препятствующий исполнению:

[Иные События, препятствующие исполнению:]

[Определение События, препятствующего исполнению, Применимо
Расчетным агентом:]

[Альтернативы на случай, препятствующий исполнению:]

[Альтернативный способ определения курса спот:⁵

Двойной курс валюты: [Способ определения курса спот:]

Сбой публикации: [Способ определения курса спот:]

[Отсрочка исполнения:

Максимальный срок события,
препятствующего исполнению:]

[Иные Альтернативы на случай, препятствующий
исполнению:]

[4][5]. Расчетный агент: [Сторона А].

[5][6]. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

³ Для Поставочных конверсионных сделок стороны обязаны указать (а) сумму и валюту, подлежащую уплате Стороной Б, или (б) Форвардный курс и валюту, подлежащую уплате Стороной Б.

⁴ Для Поставочных конверсионных сделок стороны обязаны указать (а) сумму и валюту, подлежащую уплате Стороной Б, или (б) Форвардный курс и валюту, подлежащие уплате Стороной Б.

⁵ Применяется, если Стороны при Замене на расчетную сделку намерены изменить порядок определения Курса спот, установленный пунктом 7.4(в)(Б) Стандартных условий. Если стороны выбирают в качестве Способа определения курса спот «Котировки банков-ориентиров» и намерены изменить правила пункта 4.3(ж) Стандартных условий, установленные для такого Способа определения курса спот, они должны указать следующую информацию: (i) Банки-ориентеры (по умолчанию используются четыре ведущих банка, выбранных Расчетным агентом), (ii) Применимый курс (по умолчанию используется среднее арифметическое курса покупки и продажи Расчетной валюты), (iii) Котировочную сумму (по умолчанию используется сумма, равная Номинальной сумме в расчетной валюте) и (iv) Котировочное время.

[[6][7]. Рабочий день:]

[[7][8]. [Условие окончания срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Должность:

Ф. И. О.:

Должность:

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:

Расчетная валюта:

[Номинальная сумма в расчетной валюте:]⁶

[Номинальная сумма в базовой валюте:]⁶

[Форвардный курс:]⁶

Покупатель расчетной валюты: [Сторона А]/[Сторона Б]

Продавец расчетной валюты: [Сторона Б]/[Сторона А]

[Валюта платежа]⁷ [и способ определения обменного курса для целей расчета суммы в Валюте платежа]⁸:

Дата платежа:

Расчеты в порядке, установленном для Расчетной сделки: Применимо⁹

Способ определения курса спот:

[Дата оценки:]¹⁰

[(б) Иные условия:]

4. Правила о Событиях, препятствующих исполнению, и Альтернативах на случай, препятствующий исполнению:

[Иные События, препятствующие исполнению:]

[Определение События, препятствующего исполнению, Расчетным агентом: Применимо]

[Альтернативы на случай, препятствующий исполнению:]

[Альтернативный способ определения курса спот:]¹¹

⁶ Для Расчетных конверсионных сделок стороны обязаны указать (а) Номинальную сумму в расчетной валюте и Номинальную сумму в базовой валюте; или (б) Форвардный курс и либо Номинальную сумму в расчетной валюте, либо Номинальную сумму в базовой валюте.

⁷ Стороны обязаны указать данную информацию, если они хотят, чтобы расчеты по Сделке осуществлялись в валюте, отличной от Базовой валюты.

⁸ Стороны обязаны указать способ определения обменного курса для пересчета Суммы платежа в Валюту платежа, если Валюта платежа отличается как от Базовой валюты, так и от Расчетной валюты.

⁹ Стороны должны специально указать, что расчеты по соответствующей Сделке осуществляются в порядке, установленном для Расчетной сделки, поскольку по умолчанию расчеты по Сделке осуществляются в порядке, установленном для Поставочной сделки.

¹⁰ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.6 Стандартных условий о том, что Дата оценки наступает за два Рабочих дня до Даты платежа.

¹¹ Если стороны выбирают в качестве Способа определения курса спот «Котировки банков-ориентиров» и намерены изменить правила пункта 4.3(ж) Стандартных условий, установленные для такого Способа определения курса спот, они должны указать следующую информацию: (i) Банки-ориентеры (по умолчанию используются четыре ведущих банка, выбранных Расчетным агентом), (ii) Применимый курс (по умолчанию используется среднее арифметическое курса покупки и продажи Расчетной валюты),

Двойной курс валюты:

[Способ определения курса спот:]

Сбой публикации:

[Способ определения курса спот:]

[Отсрочка исполнения:

Максимальный срок события,
препятствующего исполнению:]

[Иные Альтернативы на случай, препятствующий
исполнению:]

[4][5]. Расчетный агент: [Сторона А].

[5][6]. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[[6][7]. Рабочий день:]

[[7][8]. [Условие окончания срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

[Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,]

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

(iii) Котировочную сумму (по умолчанию используется сумма, равная Номинальной сумме в расчетной валюте) и
(iv) Котировочное время.

3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(a) Общие условия:

Дата сделки:

Покупатель: [Сторона А]/[Сторона Б]

Продавец: [Сторона Б]/[Сторона А]

Стиль валютного опциона: [Американский/Бермудский/
Европейский]

Тип валютного опциона:¹² [Опцион на продажу (пут) [●]¹³ /
Опцион на покупку (колл) [●]¹⁴]

Валюта на покупку [и Сумма валюты
на покупку]:¹⁵

Валюта на продажу [и Сумма валюты
на продажу]:¹⁵

[Цена исполнения]:¹⁵

[Дата начала срока]:¹⁶

[Срок осуществления права на исполнение]:¹⁷

[Даты осуществления права на исполнение
по Бермудскому опциону]:¹⁸

Дата истечения срока:

Время закрытия: [●] ч. [●] мин.
по московскому времени

Расчеты в порядке, установленном для Поста-
вочной сделки Применимо

Дата платежа:¹⁹ [[●] Рабочий день, следующий
за Датой осуществления права
на исполнение.]/[указать дату]

[Премия]:²⁰

[Дата уплаты премии]:²¹

¹² Стороны должны определить свою сделку как Опцион на продажу (пут) и/или Опцион на покупку (колл) в отношении соответствующей валюты.

¹³ Стороны должны указать соответствующую валюту, идентичную Валюте на продажу.

¹⁴ Стороны должны указать соответствующую валюту, идентичную Валюте на покупку.

¹⁵ Для Сделок поставочный валютный опцион стороны обязаны определить (а) Сумму валюты на покупку и Сумму валюты на продажу; или (б) Цену исполнения и либо Сумму валюты на покупку, либо Сумму валюты на продажу.

¹⁶ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 3.2(г) Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

¹⁷ При желании стороны могут изменить Срок осуществления прав, предусмотренный для Американского опциона. Например, при наличии нескольких Сроков осуществления прав необходимы дополнительные ссылки.

¹⁸ Стороны обязаны указать данную информацию для Бермудского опциона.

¹⁹ При желании стороны могут указать Дату платежа в отношении Даты истечения срока.

²⁰ Данное условие может быть включено в Подтверждение если Стороны договорятся об уплате Премии. Стороны могут указать размер Премии в виде твердой суммы или процента от Суммы валюты на покупку или Суммы валюты на продажу.

²¹ Данное условие может быть включено в Подтверждение если Стороны договорятся об уплате Премии.

[Барьерное отлагательное условие: [Применимо]²²

Барьерный курс:

Способ определения курса спот для Барьерного отлагательного условия:²³

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]²⁴

[Барьерное отменительное условие: [Применимо]²⁵

Барьерный курс:

Способ определения курса спот для Барьерного отменительного условия:²⁶

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]²⁷

[(б) Иные условия:]²⁸

4. Правила о Событиях, препятствующих исполнению, и Альтернативах на случай, препятствующий исполнению:

[Иные События, препятствующие исполнению:]

[Определение События, препятствующего исполнению, Расчетным агентом: Применимо]

[Альтернативы на случай, препятствующий исполнению:]

[Альтернативный способ определения курса спот:²⁹

Двойной курс валюты: [Способ определения курса спот:]

Сбой публикации: [Способ определения курса спот:]

[Отложение исполнения:

²² Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

²³ Стороны должны указать Способ определения курса спот, если в строке выше они указали на применимость Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

²⁴ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

²⁵ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

²⁶ Стороны должны указать Способ определения курса спот, если в строке выше они указали на применимость Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

²⁷ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

²⁸ Например, такие условия могут включать возможность частичного исполнения Сделки валютный опцион.

²⁹ Если стороны выбирают в качестве Способа определения курса спот «Котировки банков-ориентиров» и намерены изменить правила пункта 4.3(ж) Стандартных условий, установленные для такого Способа определения курса спот, они должны указать следующую информацию: (i) Банки-ориентеры (по умолчанию используются четыре ведущих банка, выбранных Расчетным агентом), (ii) Применимый курс (по умолчанию используется среднее арифметическое курса покупки и продажи Расчетной валюты), (iii) Котировочную сумму (по умолчанию используется сумма, равная Номинальной сумме в расчетной валюте) и (iv) Котировочное время.

Максимальный срок события,
препятствующего исполнению:]

[Иные Альтернативы на случай, препятствующий
исполнению:]

[4][5]. Расчетный агент: [Сторона А]

[5][6]. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[[6][7]. Рабочий день:]

[[7][8]. [Условие окончания срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

Валюта на покупку [и Сумма валюты на покупку]:^{33]}

Валюта на продажу [и Сумма валюты на продажу]:^{34]}

Цена исполнения:

[Валюта платежа]^{35]} [и способ определения обменного курса для целей расчета суммы в Валюте платежа]^{36]}:

Способ определения курса спот:

[Дата начала срока]:^{37]}

[Срок осуществления права на исполнение]:^{38]}

[Даты осуществления права на исполнение по Бермудскому опциону]:^{39]}

Дата истечения срока:

Время закрытия: [●] ч. [●] мин.
по московскому времени

[Дата оценки]:^{40]}

Расчеты в порядке, установленном для Расчетной сделки: Применимо^{41]}

Дата платежа:^{42]} [[●] Рабочий день, следующий за Датой осуществления права на исполнение.]/[указать дату]

[Премия]:^{43]}

³¹ Стороны должны указать соответствующую валюту, идентичную Валюте на продажу.

³² Стороны должны указать соответствующую валюту, идентичную Валюте на покупку.

³³ Для Сделок расчетный валютный опцион стороны обязаны определить Цену исполнения и либо Сумму валюты на покупку, либо Сумму валюты на продажу.

³⁴ Для Сделок расчетный валютный опцион стороны обязаны определить Цену исполнения и либо Сумму валюты на покупку, либо Сумму валюты на продажу.

³⁵ Стороны обязаны указать данную информацию, если они хотят, чтобы расчеты по Сделке осуществлялись в валюте, отличной от Базовой валюты.

³⁶ Стороны обязаны указать способ определения обменного курса для пересчета Суммы платежа в Валюте платежа, если Валюта платежа отличается как от Базовой валюты, так и от Расчетной валюты.

³⁷ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 3.2(г) Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

³⁸ Стороны могут изменить Срок осуществления прав, предусмотренный для Американского опциона. Например, при наличии нескольких Сроков осуществления прав необходимы дополнительные ссылки.

³⁹ Стороны обязаны указать данную информацию для Бермудского опциона.

⁴⁰ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.6 Стандартных условий о том, что Датой оценки будет Дата осуществления прав.

⁴¹ Стороны должны специально указать, что расчеты по соответствующей Сделке осуществляются в порядке, установленном для Расчетной сделки, поскольку по умолчанию расчеты по Сделке осуществляются в порядке, установленном для Поставочной сделки.

⁴² Стороны могут указать Дату платежа в отношении Даты истечения срока.

⁴³ Данное условие может быть включено в Подтверждение если Стороны договорятся об уплате Премии. Стороны могут указать размер Премии в виде твердой суммы или процента от Суммы валюты на покупку или Суммы валюты на продажу.

[Дата уплаты премии:]⁴⁴

[Барьерное отлагательное условие:

[Применимо]⁴⁵

Барьерный курс:

Способ определения курса спот для Барьерного отлагательного условия:⁴⁶

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]⁴⁷

[Барьерное отменительное условие:

[Применимо]⁴⁸

Барьерный курс:

Способ определения курса спот для Барьерного отменительного условия:⁴⁹

Контрольная дата (даты):

Контрольное время:]⁵⁰

[(б) Иные условия:]⁵¹

4. Правила о Событиях, препятствующих исполнению, и Альтернативах на случай, препятствующий исполнению:

[Иные События, препятствующие исполнению:]

[Определение События, препятствующего исполнению, Расчетным агентом:

Применимо]

[Альтернативы на случай, препятствующий исполнению:]

[Альтернативный способ определения курса спот:]⁵²

Двойной курс валюты:

[Способ определения курса спот:]

⁴⁴ Данное условие может быть включено в Подтверждение если Стороны договорятся об уплате Премии.

⁴⁵ Если Барьерное отлагательное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отлагательное условие. Стороны также должны указать, возникновение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отлагательного условия.

⁴⁶ Стороны должны указать Способ определения курса спот, если в строке выше они указали на применимость Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

⁴⁷ Включить, если Барьерное отлагательное условие применимо.

⁴⁸ Если Барьерное отменительное условие применимо, необходимо указать обстоятельство (-а), составляющее (-ие) Барьерное отменительное условие. Стороны также должны указать, прекращение каких прав и/или обязанностей по Сделке обусловлено наступлением Барьерного отменительного условия.

⁴⁹ Стороны должны указать Способ определения курса спот, если в строке выше они указали на применимость Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

⁵⁰ Включить, если Барьерное отменительное условие применимо.

⁵¹ Такие условия могут включать, в частности, возможность частичного исполнения Сделки валютный опцион.

⁵² Если стороны выбирают в качестве Способа определения курса спот «Котировки банков-ориентиров» и намерены изменить правила пункта 4.3(ж) Стандартных условий, установленные для такого Способа определения курса спот, они должны указать следующую информацию: (i) Банки-ориентеры (по умолчанию используются четыре ведущих банка, выбранных Расчетным агентом), (ii) Применимый курс (по умолчанию используется среднее арифметическое курса покупки и продажи Расчетной валюты), (iii) Котировочную сумму (по умолчанию используется сумма, равная Номинальной сумме в расчетной валюте) и (iv) Котировочное время.

Сбой публикации:

[Способ определения
курса спот:]

[Отложение исполнения:

Максимальный срок события,
препятствующего исполнению:]

[Иные Альтернативы на случай, препятствующий
исполнению:]

[4][5]. Расчетный агент: [Сторона А].

[5][6]. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[[6][7]. Рабочий день:]

[[7][8]. [Условие окончания срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

ПРИЛОЖЕНИЕ 6

к Стандартным условиям конверсионных сделок,
сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г.

Форма Подтверждения для Сделки валютный своп

[На бланке Стороны А]

[Дата]

[Наименование и адрес Стороны Б]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — «*Подтверждение*») является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — «*Сторона А*») и [●] (далее — «*Сторона Б*») от [●] (далее — «*Генеральное соглашение*»).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.
3. Условия Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, составляют:
 - (а) Общие условия:

Дата сделки:

[Дата первоначального платежа:]⁵³ [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]⁵⁴

Сумма первоначального платежа и валюта для Стороны А:

Сумма первоначального платежа и валюта

⁵³ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 5.2(б) Стандартных условий о том, что Датой первоначального платежа является следующий Рабочий день после Даты сделки.

⁵⁴ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.17 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

для Стороны Б:

Дата окончательного платежа: [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]⁵⁵

Сумма окончательного платежа для Стороны А:

Сумма окончательного платежа для Стороны Б:

[(б) Иные условия:]

4. Правила о Событиях, препятствующих исполнению, и Альтернативах на случай, препятствующий исполнению:

[Иные События, препятствующие исполнению:]

[Определение События, препятствующего исполнению, Расчетным агентом: Применимо]

[Альтернативы на случай, препятствующий исполнению:]

[Отсрочка исполнения:

Максимальный срок события,
препятствующего исполнению:]

[Иные Альтернативы на случай,
препятствующий исполнению:]

5. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

6. Рабочий день:

для [первой валюты]⁵⁶:

для [второй валюты]⁵⁷;

7. Условие окончания срока в нерабочий день:]

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Подтверждено по состоянию на дату,
указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:

⁵⁵ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.17 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

⁵⁶ Укажите наименование первой из двух валют, в которых заключается Сделка валютный своп.

⁵⁷ Укажите наименование второй из двух валют, в которых заключается Сделка валютный своп.

ПРИЛОЖЕНИЕ 7

к Стандартным условиям конверсионных сделок,
валютных опционов и сделок валютный своп 2011 г.

Основные финансовые центры

Валюта	Основной финансовый центр
<i>Австралийский доллар</i>	Сидней и Мельбурн
<i>Датская крона</i>	Копенгаген
<i>Доллар США</i>	Нью-Йорк
<i>Исландская крона</i>	Рейкьявик
<i>Иена</i>	Токио
<i>Канадский доллар</i>	Торонто
<i>Норвежская крона</i>	Осло
<i>Российский рубль</i>	Москва
<i>Сингапурский доллар</i>	Сингапур
<i>Турецкая лира</i>	Анкара
<i>Фунт стерлингов</i>	Лондон
<i>Шведская крона</i>	Стокгольм
<i>Швейцарский франк</i>	Цюрих

ПРИЛОЖЕНИЕ 8

к Стандартным условиям конверсионных сделок,
сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г.

Форма Требования об исполнении по Сделке валютный опцион

[На бланке Покупателя]

[Дата]

[Наименование и адрес Продавца]

Кас.: Требование об исполнении [наименование Сделки валютный опцион]

Уважаемые господа!

Мы ссылаемся на Сделку валютный опцион, заключенную между нами [дата], [регистрационный номер Сделки] (далее — «Сделка»), на основании Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] и [●] от [●].

Настоящее Требование об исполнении направляется вам в порядке и в целях осуществления нами Права на исполнение по Сделке в соответствии с пунктом 3.7 Стандартных условий конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков, применяемых в соответствии с Подтверждением по Сделке.

Все термины, использованные в настоящем Требовании об исполнении с заглавной буквы, имеют значение, определенное в Стандартных условиях.

С уважением,

[Покупатель]

Ф. И. О.:

Должность:

АЛФАВИТНО-ПРЕДМЕТНЫЙ УКАЗАТЕЛЬ

Термин	Пункт
ECB37	4.3(д)
EMTA	4.3(в)
EMTA RUB INDICATIVE SURVEY RATE	4.3(г)
RUB01	4.3(а)
RUB02	4.3(б)
RUB03	4.3(в)
RUB04	4.3(г)
RUB SME-EMTA	4.3(в)
RUB MICEXFRX,	4.3(а)
RUB MMVB	4.3(б)
Альтернатива на случай, препятствующий исполнению	7.1
Альтернативный способ определения курса спот	7.4(а)
Американский опцион	3.3(а)
Базовая валюта	1.1
Банки-ориентиры	4.3(ж)
Барьерный курс	6.2
Барьерное отлагательное условие	6.1(а)
Барьерное отменительное условие	6.1(б)
Бермудский опцион	3.3(б)
Беспоставочная сделка	1.21
Валюта на покупку	3.2(а)
Валюта на продажу	3.2(б)
Валюта платежа	1.2
Валютная пара	1.3
Валютные ограничения	7.1(а)
Время закрытия	3.2(д)(А)
Выплата эквивалента в рублях	7.4(б)
Генеральное соглашение	1.4
Государственный орган	1.5
Дата истечения срока	3.2(в)
Дата начала срока	3.2(г)
Дата окончательного платежа	5.2(а)
Дата осуществления права на исполнение	3.2(д)(Б)
Дата оценки	1.6
Дата первоначального платежа	5.2(б)
Дата платежа	1.7
Дата сделки	1.8
Дата уплаты премии	3.5(а)
Двойной курс валюты	7.1(б)
Европейский опцион	3.3(в)
Замена на расчетную сделку	7.4(в)
Конверсионная сделка	2.1
Контрольная дата	6.3
Контрольное время	6.4
Котировки банков-ориентиров	4.3(ж)
Котировочная сумма	4.3(ж)(А)
Котировочное время	4.3(ж)(А)
Курс спот	1.9
Максимальный срок события, препятствующего исполнению	7.4(д)
ММВБ	4.3(а)
Номинальная сумма в базовой валюте	1.10

Номинальная сумма в расчетной валюте	1.11
Округление	1.13
Определение курса спот расчетным агентом	7.4(г)
Опцион на покупку (колл)	3.4(а)
Опцион на продажу (пут)	3.4(б)
Основной финансовый центр	1.12
Отсрочка исполнения	7.4(д)
Официальный курс	4.3(з)
Подтверждение	1.14
Покупатель	3.1(а)
Покупатель расчетной валюты	1.15
Поставочная сделка	1.16
Право на исполнение	3.2(д)
Предшествующий рабочий день	1.26(б)
Прекращение	7.4(е)
Премия	3.5(а)
Применимый курс	4.2
Примерные условия договора	1.17
Продавец	3.1(а)
Продавец расчетной валюты	1.18
Рабочий день	1.19
Рабочий день в отчетном периоде	1.26(в)
Расчетная валюта	1.20
Расчетная сделка (или Беспоставочная сделка) для целей настоящих Стандартных условий означает Сделку расчетный валютный форвард или Сделку расчетный валютный опцион.	1.21 1.22
Расчетный агент	
Сбой публикации	7.1(в)
Сделка для целей настоящих Стандартных условий	1.23
Сделка валютный форвард	2.2
Сделка валютный опцион	3.1
Сделка валютный своп	5.1
Сделка поставочный валютный опцион	3.1(а)
Сделка поставочный валютный форвард	2.2(а)
Сделка расчетный валютный опцион	3.1(б)
Сделка расчетный валютный форвард	2.2(б)
Конверсионная сделка (или Сделка спот)	2.1
Следующий рабочий день	1.26(а)
Событие, препятствующее исполнению	7.1
Способ определения курса спот	4.1
Срок осуществления права на исполнение	3.2(д)(В)
Сумма валюты на покупку	3.2(е)
Сумма валюты на продажу	3.2(ж)
Сумма окончательного платежа	5.1
Сумма первоначального платежа	5.1
Сумма платежа	1.24
Твердая котировка	1.25
Требование об исполнении	3.2(д)(Г)
Условие об окончании срока в нерабочий день	1.26
Форвардный курс	1.27
Цена исполнения	3.2(з)