
**СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ
СРОЧНЫХ СДЕЛОК НА ПРОЦЕНТНЫЕ СТАВКИ, СДЕЛОК
ВАЛЮТНО-ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП И СДЕЛОК СВОПЦИОН**

2011 г.

This 2011 Standard Terms of Interest Rate and Swaption Transactions is based, in part, on selected provisions of the 2006 ISDA Definitions, © 2006 International Swaps and Derivatives Association, Inc., ("ISDA®"); 1998 FX and Currency Option Definitions, © 1998 International Swaps and Derivatives Association, Inc., Emerging Markets Traders Association, ("EMTA®") and The Foreign Exchange Committee; 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 Interest Rate and Swaption Transactions' suitability for use in any particular transaction. Prospective users should seek independent legal advice before using this instrument.

**СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ СРОЧНЫХ СДЕЛОК
НА ПРОЦЕНТНЫЕ СТАВКИ И СДЕЛОК СВОПЦИОН**

2011 г.

Настоящие Стандартные условия срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион (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 6 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 срочных сделок на процентные ставки и сделок опцион 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. *Генеральное соглашение* означает Генеральное соглашение в значении, определенном в Примерных условиях договора.
- 1.2. *Дата изменения плавающей ставки* означает применительно к Сделке каждый день, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, в который Расчетный агент определяет Плавающую ставку применительно к соответствующему Процентному периоду, с учетом применимого Условия об окончании срока в нерабочий день. При этом, если Условие об окончании срока в нерабочий день не определено применительно к Дате изменения плавающей ставки, применяется Условие об окончании срока в нерабочий день, установленное для Дат платежа Плавающих сумм по этой Сделке, за исключением случаев, когда применение такого Условия об окончании срока в нерабочий день приведет к совпадению Даты изменения плавающей ставки и Даты платежа применительно к Процентному периоду, к которому относится Дата изменения плавающей ставки. В последнем случае применяется Условие об окончании срока в нерабочий день «Предшествующий рабочий день».
- 1.3. *Дата истечения срока* означает применительно к Сделке последний день срока Сделки, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке. Дата истечения срока не подлежит переносу в соответствии с применимым к Сделке Условием об окончании срока в нерабочий день, если иное не согласовано сторонами.
- 1.4. *Дата калькуляции* означает применительно к Дате платежа или Процентному периоду наиболее ранний день, когда Расчетный агент с учетом сложившихся обстоятельств может направить требуемое уведомление применительно к этой Дате платежа или Процентному периоду. Дата калькуляции должна наступить не позднее окончания Рабочего дня, непосредственно предшествующего Дате платежа, кроме случаев, когда этот предшествующий Рабочий день является Датой изменения плавающей ставки. В этом случае Датой калькуляции является день, который позволит осуществить платеж в Дату платежа.
- 1.5. *Дата начала срока* означает применительно к Сделке 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. Дата начала срока не подлежит переносу в соответствии с применимым к Сделке Условием об окончании срока в нерабочий день, если иное не согласовано сторонами.
- 1.6. *Дата платежа* означает применительно к Сделке день, в который стороны обязаны исполнить свои обязательства по Сделке, указанные в пункте 3.3, 4.3, 5.5 или 6.4 Стандартных условий, указанный в качестве Даты платежа в Подтверждении или определяемый в соответствии с ним либо иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке.
- 1.7. *Дата сделки* означает применительно к Сделке Дату сделки в значении, определенном в Генеральном соглашении.
- 1.8. *Номинальная сумма* означает:
 - (а) применительно к Срочной сделке на процентные ставки:
 - (А) не являющейся Сделкой валютно-процентный своп – сумму в валюте, и

- (Б) являющейся Сделкой валютно-процентный своп – сумму в каждой из валют, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке в целях расчета сумм платежей по Сделке;
- (б) применительно к Сделке свопцион – Номинальную сумму по Основной сделке, или, применительно к Сделке свопцион, Основной сделкой по которой является Сделка валютно-процентный своп - Номинальную сумму, установленную в отношении Продавца.
- 1.9. **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 конверсионных сделок, сделок валютный форвард, валютный опцион и валютный своп 2011 г., разработанным и утвержденным Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованным в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков.
- 1.10. **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.
- 1.11. **Плавающая ставка** означает процентную ставку, определяемую Расчетным агентом в Дату изменения плавающей ставки применительно к соответствующему Процентному периоду в соответствии с согласованным Способом определения плавающей ставки.
- 1.12. **Подтверждение** означает Подтверждение в значении, определенном в Генеральном соглашении, которое может быть составлено по форме, установленной в приложениях 1–7 к Стандартным условиям в зависимости от вида Сделки, или иной форме, согласованной сторонами.
- 1.13. **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, опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков.
- 1.14. **Рабочий день** означает:
- (а) для целей осуществления платежей в Дату платежа/Дату уплаты премии и/или применительно к Дате изменения плавающей ставки и Способу определения плавающей ставки – любой день, являющийся Рабочим днем в значении, определенном в Генеральном соглашении, и:
- (А) днем, когда кредитные организации осуществляют банковские операции и другие сделки (в том числе на валютном рынке 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:
- (аа) если евро является валютой, в которой должен быть осуществлен платеж, и/или применительно к Дате изменения плавающей ставки и Способу определения плавающей ставки сумма выражена в евро – днем, когда открыта Транс'европейская автоматическая система валовых расчетов и экспресс-переводов в режиме реального времени (Система TARGET);
- (бб) если другая иностранная валюта является валютой, в которой должен быть осуществлен платеж, и/или применительно к Дате изменения плавающей ставки и Способу определения плавающей ставки сумма выражена в такой другой иностранной валюте, – днем, когда кредитные организации осуществляют 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;

- (вв) если несколько видов иностранных валют подлежат уплате, и/или применительно к Дате изменения плавающей ставки и Способу определения плавающей ставки суммы выражены в нескольких видах иностранных валют, – 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.
- 1.15. **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 ставок, 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.
- Расчетный агент, в частности, направляет необходимое уведомление другой стороне или сторонам (если Расчетный агент является третьим лицом) в Дату калькуляции применительно к каждой Дате платежа, в котором указывает:
- (а) Дату платежа;
- (б) сторону или стороны, с которых причитается платеж в указанную Дату платежа;
- (в) сумму или суммы соответствующих платежей;
- (г) информацию в разумном объеме о том, каким образом указанная сумма или суммы платежей были определены.
- 1.16. **Сделка** для целей настоящих Стандартных условий означает заключаемую на основе Примерных условий договора Срочную сделку на процентные ставки, как она определена в пункте 2.1 Стандартных условий, и Сделку свопцион, как она определена в пункте 9.1 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.
- 1.17. **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) настоящего пункта 1.17, если иное не предусмотрено другими положениями Стандартных условий, Подтверждением или иным образом не согласовано сторонами применительно к какому-либо сроку или в целом.
- 1.18. **Фиксированная ставка** означает процентную ставку, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к соответствующему Процентному периоду.

2. СРОЧНЫЕ СДЕЛКИ НА ПРОЦЕНТНЫЕ СТАВКИ. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

- 2.1. **Срочная сделка на процентные ставки** означает Сделку процентный своп, как она определена в пункте 3.1 Стандартных условий, Сделку процентный форвард, как она определена в пункте 4.1 Стандартных условий, Сделку фиксации максимума процентной ставки, как она определена в пункте 5.1 Стандартных условий, Сделку фиксации минимума процентной ставки, как она определена в пункте 5.2 Стандартных условий, Сделку фиксации максимума и минимума процентной ставки, как она определена в пункте 5.3 Стандартных условий, а также Сделку валютно-процентный своп, как она определена в пункте 6.1. Стандартных условий..

- 2.2. Срок Срочной сделки на процентные ставки может состоять из одного или нескольких периодов начисления процентов (далее – «**Процентный период**»).
- (а) Первый Процентный период начинается в Дату начала срока (включительно) и оканчивается в день (исключая его), согласованный сторонами (день, в который оканчивается Процентный период, именуется в настоящих Стандартных условиях «**Дата окончания периода**»).
 - (б) Каждый последующий Процентный период начинается в Дату окончания периода предшествующего Процентного периода (включительно) и оканчивается в Дату окончания периода (исключая ее) или применительно к последнему Процентному периоду – в Дату истечения срока (исключая ее).
 - (в) Если в Подтверждении не установлены Даты окончания периода, Датами окончания периода являются каждая из установленных сторонами Дат платежа.
- 2.3. Применительно к Срочным сделкам на процентные ставки все процентные ставки выражаются целым числом или десятичной дробью в виде ставки процентов годовых.
- 2.4. Расчеты по Срочным сделкам на процентные ставки могут осуществляться в следующем порядке.
- (а) Если по Срочной сделке на процентные ставки в какую-либо Дату платежа сторона обязана уплатить сумму в иностранной валюте, такая сумма может быть уплачена в рублях в случае, если это предусмотрено условиями Сделки. При этом пересчет суммы в иностранной валюте в рубли осуществляется по обменному курсу, согласованному сторонами применительно к этой Дате платежа.
 - (б) Если в результате пересчета в рубли суммы в иностранной валюте, причитающейся от одной стороны или обеих сторон, в соответствии с подпунктом (а) настоящего пункта 2.4, обе стороны обязаны уплатить в соответствующую Дату платежа суммы в рублях, к этим обязательствам сторон применяются положения о платежном неттинге пунктов 3.5 и 3.6 статьи 3 Примерных условий договора, если иное не предусмотрено Генеральным соглашением или иным образом не согласовано сторонами.

3. СДЕЛКИ ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП

- 3.1. **Сделка процентный своп** означает своп договор, (контракт) по которому на условиях, согласованных сторонами, одна сторона одновременно или периодически уплачивает другой стороне сумму в согласованной валюте, рассчитанную на основе Номинальной суммы в этой валюте и Плавающей ставки (далее – «**Плавающая сумма**»), а другая сторона одновременно или периодически уплачивает первой стороне либо (i) сумму в той же валюте, рассчитанную на основе той же Номинальной суммы и Фиксированной ставки (далее – «**Фиксированная сумма**»), либо (ii) Плавающую сумму в той же валюте, рассчитанную на основе той же Номинальной суммы и другой Плавающей ставки (такая Сделка процентный своп также именуется «сделка базисный своп»).

3.2. Существенные условия Сделки процентный своп.

- (а) Существенными условиями Сделки процентный своп, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Номинальная сумма;
 - (Б) Дата истечения срока;
 - (В) Плательщик плавающей суммы;
 - (Г) Даты платежа Плавающих сумм;
 - (Д) Способ определения плавающей ставки;
 - (Е) срок кредитования или иной аналогичный период, в отношении которого публикуется Плавающая ставка (далее – «**Период плавающей ставки**»);
 - (Ж) Даты изменения плавающей ставки.
- (б) Если по условиям Сделки одна из сторон уплачивает Фиксированные суммы, существенными условиями также являются:
 - (А) Плательщик фиксированной суммы;
 - (Б) Даты платежа Фиксированных сумм;

- (В) Фиксированная ставка.
 - (в) Если по условиям Сделки обе стороны уплачивают Плавающие суммы, в отношении второй стороны согласуются существенные условия, указанные в пунктах 3.2(а)(В)-3.2(а)(Ж) Стандартных условий.
 - (г) Другие условия подлежат согласованию в качестве существенных условий Сделки процентный своп по требованию одной из сторон.
- 3.3. **Порядок осуществления расчетов по Сделке процентный своп.**
- (а) В каждую Дату платежа, согласованную в отношении Плавающей суммы, сторона, обязанная уплатить такую сумму (далее – «*Плательщик плавающей суммы*»), уплачивает Плавающую сумму другой стороне.
 - (б) В каждую Дату платежа, согласованную в отношении Фиксированной суммы, сторона, обязанная уплатить такую сумму (далее – «*Плательщик фиксированной суммы*»), уплачивает Фиксированную сумму другой стороне.

4. СДЕЛКИ ПРОЦЕНТНЫЙ ФОРВАРД

- 4.1. **Сделка процентный форвард** означает расчетный внебиржевой форвардный договор (контракт), по которому на условиях, согласованных сторонами, одна сторона (далее – «*Плательщик положительной разницы*») одновременно уплачивает другой стороне Плавающую сумму в согласованной валюте, рассчитанную на основе Номинальной суммы в этой валюте и разницы между Плавающей ставкой и Фиксированной ставкой, если эта разница имеет положительное значение, либо другая сторона (далее – «*Плательщик отрицательной разницы*») одновременно уплачивает первой стороне Плавающую сумму в согласованной валюте, рассчитанную на основе Номинальной суммы в этой валюте и разницы между Плавающей ставкой и Фиксированной ставкой, если эта разница имеет отрицательное значение.

4.2. Существенные условия Сделки процентный форвард.

- (а) Существенными условиями Сделки процентный форвард, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Номинальная сумма;
 - (Б) Дата истечения срока;
 - (В) Плательщик положительной разницы;
 - (Г) Плательщик отрицательной разницы;
 - (Д) Дата платежа;
 - (Е) Фиксированная ставка;
 - (Ж) Способ определения плавающей ставки;
 - (З) Период плавающей ставки;
 - (И) Дата изменения плавающей ставки.
- (б) Другие условия подлежат согласованию в качестве существенных условий Сделки процентный форвард по требованию одной из сторон.

4.3. Порядок осуществления расчетов по Сделке процентный форвард. В Дату платежа, согласованную в отношении Плавающей суммы:

- (а) если она имеет положительное значение – Плательщик положительной разницы обязан уплатить Плавающую сумму;
- (б) если она имеет отрицательное значение – Плательщик отрицательной разницы обязан уплатить абсолютную величину Плавающей суммы.

5. **СДЕЛКИ ФИКСАЦИИ МАКСИМУМА ПРОЦЕНТНОЙ СТАВКИ. СДЕЛКИ ФИКСАЦИИ МИНИМУМА ПРОЦЕНТНОЙ СТАВКИ. СДЕЛКИ ФИКСАЦИИ МАКСИМУМА И МИНИМУМА ПРОЦЕНТНОЙ СТАВКИ**
- 5.1. **Сделка фиксации максимума процентной ставки** или **Сделка кэп** означает расчетный внебиржевой форвардный договор (контракт), по которому, на условиях, согласованных сторонами, одна сторона единовременно или периодически уплачивает другой стороне Фиксированные суммы в согласованной валюте, а другая сторона единовременно или периодически уплачивает первой стороне Плавающие суммы в той же валюте, рассчитанные на основе Номинальной суммы в этой валюте и разницы между Плавающей ставкой и максимальным значением процентной ставки, согласованным сторонами (далее – **«Максимальная ставка»**), если эта разница имеет положительное значение.
- 5.2. **Сделка фиксации минимума процентной ставки** или **Сделка флор** означает расчетный внебиржевой форвардный договор (контракт), по которому, на условиях, согласованных сторонами, одна сторона единовременно или периодически уплачивает другой стороне Фиксированные суммы в согласованной валюте, а другая сторона единовременно или периодически уплачивает первой стороне Плавающие суммы в той же валюте, рассчитанные на основе Номинальной суммы в этой валюте и разницы между Плавающей ставкой и минимальным значением процентной ставки, согласованным сторонами (далее – **«Минимальная ставка»**), если эта разница имеет отрицательное значение.
- 5.3. **Сделка фиксации максимума и минимума процентной ставки** или **Сделка кóллар** означает расчетный внебиржевой форвардный договор (контракт), по которому, на условиях, согласованных сторонами, одна сторона единовременно или периодически уплачивает другой стороне Плавающую сумму при превышении Плавающей ставкой Максимальной ставки, а другая сторона единовременно или периодически уплачивает первой стороне Плавающую сумму, если Плавающая ставка становится ниже Минимальной ставки.
- 5.4. **Существенные условия Сделки фиксации максимума процентной ставки, Сделки фиксации минимума процентной ставки и Сделки фиксации максимума и минимума процентной ставки.**
- (а) Общими существенными условиями Сделки фиксации максимума процентной ставки, Сделки фиксации минимума процентной ставки и Сделки фиксации максимума и минимума процентной ставки, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки в отношении каждой из этих Сделок, являются:
- (А) Номинальная сумма;
 - (Б) Дата истечения срока;
 - (В) Способ определения плавающей ставки;
 - (Г) Период плавающей ставки;
 - (Д) Даты изменения плавающей ставки.
- (б) Существенными условиями Сделки фиксации максимума процентной ставки, также подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
- (А) Плательщик фиксированной суммы;
 - (Б) Дата или Даты платежа Фиксированных сумм;
 - (В) Фиксированная сумма;
 - (Г) Плательщик плавающей суммы;
 - (Д) Максимальная ставка;
 - (Е) Дата или Даты платежа Плавающих сумм.
- (в) Существенными условиями Сделки фиксации минимума процентной ставки, также подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
- (А) Плательщик фиксированной суммы;
 - (Б) Дата или Даты платежа Фиксированных сумм;
 - (В) Фиксированная сумма;
 - (Г) Плательщик плавающей суммы;
 - (Д) Минимальная ставка;

- (Е) Дата или Даты платежа Плавающих сумм.
- (г) Существенными условиями Сделки фиксации максимума и минимума процентной ставки, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
 - (А) Плательщик плавающей суммы при превышении Плавающей ставкой Максимальной ставки;
 - (Б) Максимальная ставка;
 - (В) Плательщик плавающей суммы при превышении Минимальной ставкой Плавающей ставки;
 - (Г) Минимальная ставка;
 - (Д) Дата или Даты платежа.
- (д) Другие условия подлежат согласованию в качестве существенных условий Сделки фиксации максимума процентной ставки, Сделки фиксации минимума процентной ставки и Сделки фиксации максимума и минимума процентной ставки по требованию одной из сторон.

5.5. Порядок осуществления расчетов по Сделке фиксации максимума процентной ставки, Сделке фиксации минимума процентной ставки и Сделке фиксации максимума и минимума процентной ставки.

- (а) По Сделке фиксации максимума процентной ставки и Сделке фиксации минимума процентной ставки в каждую Дату платежа, согласованную в отношении Фиксированных сумм, Плательщик фиксированной суммы обязан уплатить Плательщику плавающей суммы Фиксированную сумму. В каждую Дату платежа, согласованную в отношении Плавающей суммы, Плательщик плавающей суммы обязан уплатить Плательщику фиксированной суммы:
 - (А) Плавающую сумму, если по Сделке фиксации максимума процентной ставки такая сумма имеет положительное значение (если она равна нулю или имеет отрицательное значение, платежа не производится);
 - (Б) абсолютное значение Плавающей суммы, если по Сделке фиксации минимума процентной ставки такая сумма имеет отрицательное значение (если она равна нулю или имеет положительное значение, платежа не производится).
- (б) По Сделке фиксации максимума и минимума процентной ставки в каждую Дату платежа Плавающая сумма уплачивается одной из сторон, если Плавающая ставка превышает Максимальную ставку или становится ниже Минимальной ставки. Если в какую-либо Дату платежа Плавающая ставка как не превышает Максимальную ставку, так и не становится ниже Минимальной ставки, Плавающая сумма не уплачивается.

6. СДЕЛКИ ВАЛЮТНО-ПРОЦЕНТНЫЙ СВОП

6.1. *Сделка валютно-процентный своп* означает своп-договор (контракт), предусматривающий (если иного не предусмотрено условиями Сделки) (i) обязанность одной стороны передать валюту в собственность второй стороне в размере Номинальной суммы, установленной для второй стороны, и обязанность второй стороны уплатить первой стороне Номинальную сумму, установленную для первой стороны, (ii) обязанность второй стороны не ранее третьего Рабочего дня после Даты сделки передать валюту в собственность первой стороне в размере Номинальной суммы, установленной для второй стороны, и обязанность первой стороны уплатить второй стороне Номинальную сумму, установленную для первой стороны, и (iii) обязанность стороны или сторон уплачивать друг другу одновременно или периодически Фиксированные суммы и/или Плавающие суммы, рассчитанные на основе Номинальных сумм, установленных для соответствующей стороны. Сделка валютно-процентный своп является производным финансовым инструментом.

6.2. Отдельные определения для Сделок валютно-процентный своп.

- (а) *Дата окончательного платежа* означает Дату истечения срока или иной день, указанный в этом качестве в Подтверждении.
- (б) *Дата первоначального платежа* означает Дату начала срока или иной день, указанный в этом качестве в Подтверждении.
- (в) *Дата промежуточного платежа* означает каждую из Дат платежа между Датой начала срока и Датой окончательного платежа, если срок Сделки валютно-процентный своп состоит из двух или более Процентных периодов.
- (г) Для целей Стандартных условий Дата первоначального платежа, каждая из Дат промежуточного платежа и Дата окончательного платежа являются Датami платежа.

6.3. Существенные условия Сделки валютно-процентный своп.

- (а) Существенными условиями Сделки валютно-процентный своп являются:
- (А) Номинальная сумма и валюта для одной стороны;
 - (Б) Номинальная сумма и валюта для другой стороны;
 - (Г) Дата истечения срока;
- (б) Если по условиям Сделки валютно-процентный своп одна из сторон уплачивает Плавающие суммы, существенными условиями также являются:
- (А) указание стороны, являющейся Плательщиком плавающей суммы;
 - (Б) Дата или Даты платежа Плавающих сумм;
 - (В) Способ определения плавающей ставки;
 - (Г) Период плавающей ставки;
 - (Д) Дата или Даты изменения плавающей ставки.
- Если по условиям Сделки валютно-процентный своп обе Стороны уплачивают Плавающие суммы, условия, указанные в настоящем подпункте (б), согласовываются в отношении каждой из Сторон.
- (в) Если по условиям Сделки валютно-процентный своп одна из сторон уплачивает Фиксированные суммы, существенными условиями также являются:
- (А) указание стороны, являющейся Плательщиком фиксированной суммы;
 - (Б) Дата или Даты платежа Фиксированных сумм;
 - (В) Фиксированная ставка.
- Если по условиям Сделки валютно-процентный своп обе стороны уплачивают Фиксированные суммы, условия, указанные в настоящем подпункте (в), согласовываются в отношении каждой из сторон.
- (г) Другие условия подлежат согласованию в качестве существенных условий Сделок валютно-процентный своп по требованию одной из сторон.

6.4. Порядок осуществления расчетов по Сделкам валютно-процентный своп.

- (а) Стороны уплачивают друг другу Фиксированные суммы или Плавающие суммы, указанные в этом качестве в Подтверждении или определяемые в соответствии с ним, в Дату окончательного платежа и в каждую из Дат промежуточного платежа, если срок Сделки состоит из двух или более Процентных периодов.
- (б) Фиксированные суммы по Сделкам валютно-процентный своп рассчитываются в порядке, установленном пунктом 7.2 Стандартных условий. Плавающие суммы по Сделкам валютно-процентный своп рассчитываются в порядке, установленном пунктами 7.3(а) и 7.3(д) Стандартных условий, в зависимости от условий Сделки валютно-процентный своп.
- (в) Если предусмотрено условиями Сделки, в Дату первоначального платежа каждая из сторон уплачивает другой стороне Номинальную сумму, определенную для этой стороны в Подтверждении (далее – «Сумма первоначального платежа»).
- (г) Если предусмотрено условиями Сделки, в Дату окончательного платежа каждая из сторон уплачивает другой стороне сумму в размере Суммы первоначального платежа, полученной от другой стороны в Дату первоначального платежа, или в ином размере, предусмотренном в Подтверждении (далее – «Сумма окончательного платежа»).
- (д) Стороны вправе предусмотреть, что Суммы окончательного платежа уплачиваются в рассрочку, то есть по частям (далее каждая такая часть - «Сумма промежуточного платежа») в каждую Дату

промежуточного платежа с выплатой остатка Суммы окончательного платежа в Дату окончательного платежа. При этом Фиксированные суммы или Плавающие суммы для каждого последующего Процентного периода рассчитываются на основе Номинальных сумм за вычетом уплаченных соответствующей стороной Сумм промежуточного платежа.

7. РАСЧЕТ ФИКСИРОВАННЫХ СУММ И ПЛАВАЮЩИХ СУММ

7.1. Фиксированная сумма или Плавающая сумма применительно к какой-либо Дате платежа рассчитывается по Фиксированной ставке или Плавающей ставке, применимой к Процентному периоду, оканчивающемуся в такую Дату платежа или, если Дата платежа не является Датой окончания периода, ближайшую к этой Дате платежа Дату окончания периода.

Фиксированные суммы

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

- (а) сумму, указанную в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к этой Дате платежа;
- (б) при отсутствии такого указания сумму, равную произведению Номинальной суммы, Фиксированной ставки и Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбранного сторонами для расчета Фиксированных сумм:

$$\text{Фиксированная сумма} = \text{Номинальная сумма} \times \text{Фиксированная ставка} \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}$$

Плавающие суммы

7.3. Плавающая сумма, подлежащая уплате в Дату платежа Плавающей суммы, равна:

- (а) применительно к *Сделке процентный своп* и *Сделке валютно-процентный своп*, если в отношении Сделки не установлено условия о капитализации, – произведению Номинальной суммы, Плавающей ставки (с добавлением спреда) и Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбранного сторонами для расчета Плавающих сумм:

$$\text{Плавающая сумма} = \text{Номинальная сумма} \times (\text{Плавающая ставка} + \text{спред}) \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}$$

при этом (здесь и далее) под спредом понимается процентная надбавка в виде ставки процентов годовых (которая может быть выражена отрицательным числом), указанная в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованная сторонами применительно к Срочной сделке на процентные ставки или стороне;

- (б) применительно к *Сделке процентный форвард*:
 - (А) если в отношении Сделки процентный форвард не установлено условия о капитализации и не применяется дисконтирование (далее – «*Дисконтирование*»), – произведению Номинальной суммы, Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбранного сторонами для расчета Плавающих сумм, и разности Плавающей ставки (с добавлением спреда) и Фиксированной ставки:

$$\text{Плавающая сумма} = \text{Номинальная сумма} \times (\text{Плавающая ставка} + \text{спред} - \text{Фиксированная ставка}) \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}$$

- (Б) если к Сделке процентный форвард применяется Дисконтирование, – сумме, рассчитываемой по формуле, указанной в пункте 7.6. Стандартных условий;
- (в) применительно к *Сделке фиксации максимума процентной ставки* и *Сделке фиксации минимума процентной ставки*, если в отношении Сделки не установлено условия о капитализации, – произведению Номинальной суммы, Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбран-

ного сторонами для расчета Плавающих сумм, и разности Плавающей ставки (с добавлением спреда) и Максимальной ставки:

$$\text{Плавающая сумма} = \text{Номинальная сумма} \times \frac{(\text{Плавающая ставка} + \text{спред}) - \text{Максимальная ставка}}{\text{Максимальная ставка}} \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}$$

- (г) применительно к *Сделке фиксации минимума процентной ставки* и *Сделке фиксации максимума и минимума процентной ставки*, если в отношении Сделки не установлено условия о капитализации, – произведению Номинальной суммы, Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбранного сторонами для расчета Плавающих сумм, и разности Плавающей ставки (с добавлением спреда) и Минимальной ставки:

$$\text{Плавающая сумма} = \text{Номинальная сумма} \times \frac{(\text{Плавающая ставка} + \text{спред}) - \text{Минимальная ставка}}{\text{Минимальная ставка}} \times \text{Коэффициент для расчета дней в процентном периоде}$$

- (д) если в отношении Сделки установлено условие о капитализации, – сумме Сумм периодов капитализации, рассчитанных в порядке, установленном пунктом 7.8 Стандартных условий, за каждый Период капитализации в Процентном периоде применительно к Дате платежа.

Коэффициент для расчета дней в процентном периоде

7.4. В целях расчета Фиксированных сумм, Плавающих сумм или Сумм периода капитализации стороны вправе выбрать один из следующих коэффициентов для расчета количества дней в Процентном периоде или Периоде капитализации, исходя из которого начисляются Фиксированные суммы, Плавающие суммы или Суммы периода капитализации (далее – «*Коэффициент для расчета дней в процентном периоде*»):

- (а) *1/1* означает 1;
- (б) *30E/360* означает количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, которое условно рассчитывается на основе года, состоящего из 12 месяцев продолжительностью 30 дней каждый, разделенное на 360. В случае если последний день Процентного периода или Периода капитализации приходится на последний день февраля, за количество дней, истекшее в этом месяце, принимается фактическое количество дней);
- (в) *30/360* определяется как количество дней, истекшее в процентном периоде, которое условно рассчитывается на основе года, состоящего из 12 месяцев, каждый такой месяц - продолжительностью 30 дней, разделенное на 360.
- (г) *Фактическое/360* означает фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на 360;
- (д) *Фактическое/365* означает фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на 365;
- (е) *Фактическое/Фактическое* означает:
- (А) фактическое количество дней, истекшее в Процентном периоде или Периоде капитализации, разделенное на действительное число календарных дней в году (365 или 366 дней соответственно);
- (Б) если части Процентного периода или Периода капитализации приходятся на календарные годы с различным количеством дней (365 и 366 дней соответственно), то начисление процентов за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 365, производится из расчета 365 календарных дней в году, а за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 366, производится из расчета 366 календарных дней в году.

7.5. Стороны вправе применительно к Сделке согласовать иной Коэффициент для расчета дней в процентном периоде. Если стороны не определили Коэффициент для расчета дней в процентном периоде, применяется Коэффициент для расчета дней в процентном периоде «Фактическое/Фактическое».

Дисконтирование

7.6. К Сделке процентный форвард может быть применено Дисконтирование в отношении Процентного периода, не превышающего одного года. В этом случае Плавающая сумма рассчитывается по следующей формуле:

$$\begin{array}{l}
 \text{Плавающая} \\
 \text{сумма}
 \end{array}
 = \frac{
 \begin{array}{l}
 \text{Номинальная} \\
 \text{сумма}
 \end{array}
 \times
 \begin{array}{l}
 (\text{Плавающая ставка} + \\
 \text{спред} - \text{Фиксированная} \\
 \text{ставка})
 \end{array}
 \times
 \begin{array}{l}
 \text{Коэффициент для расчета дней} \\
 \text{в процентном периоде}
 \end{array}
 }{
 \begin{array}{l}
 1 \\
 + \text{Ставка дисконтирования}
 \end{array}
 \times
 \begin{array}{l}
 \text{Коэффициент для расчета дней} \\
 \text{в процентном периоде для дис-} \\
 \text{контирования}
 \end{array}
 }$$

7.7. Для целей расчета Плавающей суммы в случае применения к Сделке процентный форвард Дисконтирования:

- (а) **Ставка дисконтирования** означает процентную ставку, указанную в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованную сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон – Плавающую ставку (с добавлением спреда), применимую к соответствующему Процентному периоду;
- (б) **Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для дисконтирования** означает Коэффициент для расчета дней в процентном периоде, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке, а при отсутствии такого указания или иного соглашения сторон – Коэффициент для расчета дней в процентном периоде, выбранный сторонами для расчета Плавающих сумм.

Капитализация

7.8. Для целей расчета Плавающей суммы в случае, когда в отношении Сделки установлено условие о капитализации:

- (а) **Период капитализации** означает применительно к Процентному периоду каждый период времени начиная с (включительно) Даты начала или Даты капитализации по (исключая) следующую Дату капитализации или Дату истечения срока;
- (б) **Дата капитализации** означает каждый день в течение срока соответствующей Сделки, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке;
- (в) **Сумма периода капитализации** означает применительно к каждому Периоду капитализации сумму, равную произведению Уточненной номинальной суммы, Плавающей ставки (с добавлением спреда) и Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбранного сторонами для расчета Плавающих сумм:

$$\begin{array}{l}
 \text{Сумма периода капита-} \\
 \text{лизации}
 \end{array}
 = \begin{array}{l}
 \text{Уточненная номи-} \\
 \text{нальная сумма}
 \end{array}
 \times
 \begin{array}{l}
 (\text{Плавающая ставка} + \\
 \text{спред})^*
 \end{array}
 \times
 \begin{array}{l}
 \text{Коэффициент для рас-} \\
 \text{чета дней в процент-} \\
 \text{ном периоде}
 \end{array}$$

* Применительно к Сделке процентный форвард, Сделке фиксации максимума процентной ставки, Сделке фиксации минимума процентной ставки и Сделке фиксации максимума и минимума процентной ставки из Плавающей ставки (с добавлением спреда) также вычитается Фиксированная ставка, Максимальная ставка или Минимальная ставка, соответственно.

- (г) **Уточненная номинальная сумма** означает:
 - (А) применительно к первому Периоду капитализации в Процентном периоде - Номинальную сумму для этого Процентного периода;
 - (Б) применительно к каждому последующему Периоду капитализации в этом Процентном периоде – сумму Номинальной суммы для этого Процентного периода и Сумм периодов капитализации за каждый предшествующий Период капитализации в этом Процентном периоде.

Амортизация и иное изменение Номинальной суммы

7.9. При заключении Сделки Стороны могут договориться о возможности:

- (а) амортизации (последовательного уменьшения) Номинальной суммы (или Номинальных сумм) по Сделке;
- (б) изменения Номинальной суммы (или Номинальных сумм) по Сделке в сторону как уменьшения, так и увеличения, -

в каждом очередном Процентном периоде, в одном из Процентных периодов или в нескольких Процентных периодах.

- 7.10. При включении в Сделку условия об амортизации и (или) ином изменении Номинальной суммы, в Подтверждение включаются положения о порядке такой амортизации и (или) иного изменения.
- 7.11. Фиксированные суммы или Плавающие суммы для каждого последующего Процентного периода рассчитываются на основе Номинальной суммы с учетом амортизации и (или) иного изменения за все предшествующие Процентные периоды.

8. СПОСОБЫ ОПРЕДЕЛЕНИЯ ПЛАВАЮЩЕЙ СТАВКИ

- 8.1. Для целей расчета Плавающих сумм по Сделке стороны согласовывают способ определения Плавающей ставки (далее – «*Способ определения плавающей ставки*»). В Подтверждении Способ определения плавающей ставки может быть установлен путем ссылки на наименование любого из способов, указанных в настоящей статье 7, или путем включения самостоятельного определения Способа определения плавающей ставки.
- 8.2. Сторонами могут быть использованы следующие Способы определения плавающей ставки:

По суммам, выраженным в рублях

- (а) **MosIBOR**, или **Moscow InterBank Offered Rate** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является индикативная ставка предоставления кредитов (депозитов) в рублях на московском межбанковском рынке на срок, равный Периоду плавающей ставки, формируемая Национальной валютной ассоциацией (далее – «**НБА**») и публикуемая в Дату изменения плавающей ставки примерно в 12 часов 30 минут по московскому времени на странице MOSIBOR= в системе Reuters и/или на сайте НБА. Если указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters и/или на сайте НБА, Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется, как если бы стороны установили в качестве Способа определения плавающей ставки «RUB-MOSPRIME-банки-ориентир».
- (б) **RUB-MOSPRIME-NFEA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является предлагаемая ставка по депозитам в рублях на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая на странице MOSPRIME1 в системе Reuters в 12 часов 30 минут по московскому времени в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки. Если указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters, Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется, как если бы стороны установили в качестве Способа определения плавающей ставки «RUB-MOSPRIME-банки-ориентир».
- (в) **RUB-MOSPRIME-банки-ориентир** означает, что Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется на основе ставок по депозитам в рублях на срок, равный Периоду плавающей ставки, начинающийся в эту Дату изменения плавающей ставки, предлагаемых на московском межбанковском рынке первоклассным банкам пятью ведущими банками московского межбанковского рынка, примерно в 12 часов 30 минут по московскому времени в Рабочий день, предшествующий Дате изменения плавающей ставки, в отношении суммы, которая является показательной для единичной сделки на этом рынке в соответствующее время.

Расчетный агент запрашивает у головного офиса каждого банка, указанного в первом абзаце настоящего подпункта (в), в г. Москве котировку его ставки.

Если предоставлено пять котировок, то Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки будет 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). Если предоставлено менее пяти, но не менее двух котировок, Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки будет среднее арифметическое предоставленных котировок. Если предоставлено менее двух котировок, Плавающую ставку для Даты изменения плавающей ставки определяет Расчетный агент.

- (г) **RUONIA** или **Ruble OverNight Index Average** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является индикативная взвешенная ставка однодневных рублевых кредитов (депозитов) в рублях на московском межбанковском рынке, рассчитываемая Банком России по методике, разработанной Национальной валютной ассоциацией (далее – «**НБА**») совместно с Банком России, и публикуемая в Дату изменения плавающей ставки около 17:00 по московскому времени на странице RUONIA= в системе Reuters и/или в Интернет на официальном сайте Банка России и/или на странице <http://www.ruonia.ru>. Если указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters и/или в Интернет на официальном сайте Банка России и/или на странице <http://www.ruonia.ru>, Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется, как если бы стороны установили в качестве Способа определения плавающей ставки «RUB-MOSPRIME-банки-ориентир».

По суммам, выраженным в долларах США

- (д) **USD-LIBOR BBA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам в долларах США на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая в 11 часов по лондонскому времени на странице LIBOR01 в системе Reuters в день, наступающий за два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, до Даты изменения плавающей ставки. Если указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters, Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется, как если бы стороны установили в качестве Способа определения плавающей ставки «USD-LIBOR-банки-ориентир».
- (е) **USD-Federal Funds-H.15** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, установленная в еженедельном выпуске H.15(519) Федеральной резервной системы США на соответствующую дату под заголовком «EFFECT», публикуемая на странице FEDFUNDS1 в системе Reuters. Если к 17 часам по нью-йоркскому времени на следующий Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты изменения плавающей ставки указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters и не опубликована в выпуске H.15(519), Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, установленная в Ежедневном обновлении выпуска H.15 или ином признанном электронном источнике, используемом для публикации такой ставки, по состоянию на указанный день напротив заголовка «Federal funds (effective)». Если к 17 часам по нью-йоркскому времени указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters и не опубликована в выпуске H.15(519), Ежедневном обновлении выпуска H.15 или ином признанном электронном источнике, Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка, установленная в ближайший предшествующий день в выпуске H.15(519) напротив заголовка «Federal funds (effective)» на странице FEDFUNDS1 в системе Reuters.
- (ж) **USD-LIBOR-банки-ориентир** означает, что Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется на основе ставок по депозитам в долларах США на срок, равный Периоду плавающей ставки, начинающийся в эту Дату изменения плавающей ставки, предлагаемых на лондонском межбанковском рынке первоклассным банкам четырьмя ведущими банками на лондонском межбанковском рынке, примерно в 11 часов по лондонскому времени в день, наступающий за два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, до Даты изменения плавающей ставки, в отношении суммы, которая является показательной для единичной сделки на этом рынке в соответствующее время. Расчетный агент обязан запросить котировки у подразделения в г. Лондоне (Великобритания) каждого из банков-ориентиров. Если предоставлено не менее двух котировок, Плавающая ставка определяется как среднее арифметическое этих котировок. Если предоставлено менее двух котировок, Плавающая ставка определяется как среднее арифметическое ставок по кредитам в долларах США ведущим европейским банкам на срок, равный Периоду плавающей ставки, начинающийся в Дату изменения плавающей ставки, прокотированных примерно в 11 часов по нью-йоркскому времени в эту Дату изменения плавающей ставки крупнейшими банками в г. Нью-Йорк (США), выбранными Расчетным агентом, в отношении суммы, которая является показательной для единичной сделки на этом рынке в соответствующее время.

По суммам, выраженным в евро

- (з) **EUR-EURIBOR-Reuters** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по депозитам в евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая в 11 часов по брюссельскому времени на странице EURIBOR01 в системе Reuters в день, наступающий за два дня, являющихся рабочими днями для системы TARGET до Даты изменения плавающей ставки. Если указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters, Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется, как если бы стороны установили в качестве Способа определения плавающей ставки «EUR-EURIBOR-банки-ориентир».
- (и) **EUR-EURIBOR-банки-ориентир** означает, что Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется на основе ставок по депозитам в евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, начинающийся в эту Дату изменения плавающей ставки, предлагаемых на межбанковском рынке стран еврозоны первоклассным банкам четырьмя ведущими банками на межбанковском рынке стран еврозоны, примерно в 11 часов по брюссельскому времени в день, наступающий за два дня, являющихся рабочими днями для системы TARGET до Даты изменения плавающей ставки, в отношении суммы, которая является показательной для единичной сделки на этом рынке в соответствующее время, с учетом Коэффициента для расчета дней в процентном периоде «Фактическое/360». Расчетный агент обязан запросить котировки у основного подразделения в еврозоне каждого из банков-ориентиров. Если предоставлено не менее двух котировок, Плавающая ставка определяется как среднее арифметическое этих котировок. Если предоставлено менее двух котировок, Плавающая ставка определяется как среднее арифметическое ставок по кредитам в евро ведущим европейским банкам на срок, равный Периоду плавающей ставки, начинающийся в Дату изменения плавающей ставки, прокотированных примерно в 11 часов по брюссельскому времени в эту Дату изменения плавающей ставки крупнейшими банками стран еврозоны, выбранными Расчетным агентом, в отношении суммы, которая является показательной для единичной сделки на этом рынке в соответствующее время.

- 8.3. Если применимая к Срочной сделке на процентные ставки публикуемая процентная ставка, указанная в Способе определения плавающей ставки, или источник ее опубликования официально меняется на иную публикуемую процентную ставку или источник ее опубликования, такое событие не является Сбоем публикации. В этом случае Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки будет определяться так, как если бы в Способе определения плавающей ставки была указана новая публикуемая процентная ставка или источник ее опубликования.

9. СДЕЛКИ СВОПЦИОН

- 9.1. **Сделка свопцион** означает опционный договор (контракт), по которому на условиях, согласованных сторонами, одна сторона (далее – «**Покупатель**») уплачивает другой стороне (далее – «**Продавец**») Премию (если условия Сделки свопцион предусматривают уплату Премии) и приобретает право (при условии его осуществления в порядке, установленном пунктом 9.4 Стандартных условий), но не обязанность, предъявить требование об исполнении (далее – «**Право на исполнение**») лежащей в ее основе Срочной сделки на процентные ставки (далее – «**Основная сделка**»). Основная сделка считается заключенной в дату предъявления требования об исполнении, если иное не согласовано Сторонами.

9.2. Стили свопционов.

- (а) **Американский свопцион** означает вид Сделки свопцион, 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 свопцион** означает вид Сделки свопцион, 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 свопцион** означает вид Сделки свопцион, по которому Право на исполнение может быть осуществлено только в Дату истечения срока.

9.3. Существенные условия Сделки свопцион.

- (а) Существенными условиями Сделки свопцион, подлежащими согласованию сторонами в Дату сделки, являются:
- (А) Покупатель;
 - (Б) Продавец;
 - (В) Стилль свопциона;
 - (Г) Время закрытия;
 - (Д) Дата истечения срока;
 - (Е) Даты осуществления права на исполнение по Бермудскому свопциону (применительно к Бермудскому свопциону);
 - (Ж) Существенные условия Основной сделки, указанные в пункте 3.2, 4.2 или 5.4 Стандартных условий в зависимости от вида Основной сделки.
- (б) Другие условия Сделки свопцион подлежат согласованию в качестве существенных условий по требованию одной из сторон.

9.4. Порядок осуществления Права на исполнение.

- (а) Применительно к порядку осуществления Права на исполнение по Сделке свопцион 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 свопцион осуществлено в порядке, установленном настоящим пунктом 9.4.
 - (В) **Срок осуществления права на исполнение** означает:

- (aa) в Американском свопционе – 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;
 - (bb) в Европейском свопционе – Дату истечения срока в период с 9 часов по московскому времени до Времени закрытия;
 - (vv) в Бермудском свопционе – 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.
- (б) Покупатель осуществляет свое Право на исполнение по Сделке свопцион путем направления Продавцу Требования об исполнении в течение Срока осуществления права на исполнение. Если Требование об исполнении не получено Продавцом до или во Время закрытия в Дату истечения срока, права и обязанности сторон по Сделке свопцион прекращаются. Сделка свопцион не подлежит частичному исполнению, если в Подтверждении не установлено иное.
- (в) Если Покупатель осуществляет свое Право на исполнение по Сделке свопцион, Датой осуществления права на исполнение по этой Сделке свопцион будет считаться:
- (А) применительно к Американскому свопциону:
 - (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 свопциону – 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;
 - (В) применительно к Европейскому свопциону – Дата истечения срока, если Продавец получил Требование об исполнении не позднее Времени закрытия в эту Дату истечения срока.

9.5. Порядок расчетов по Сделке свопцион.

Уплата Премии

- (а) Если условия Сделки свопцион 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 Номинальной суммы.

Расчеты по Основной сделке

- (в) В случае осуществления Покупателем Права на исполнение по Сделке свопцион стороны осуществляют расчеты по Основной сделке в соответствии с условиями Основной сделки, установленными в Подтверждении по Сделке свопцион.

10. БАРЬЕРЫ В СДЕЛКАХ

10.1. 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 согласованная сторонами Плавающая ставка достигла уровня Барьерной ставки или преодолела его по состоянию на Контрольное время в Контрольную дату.

10.2. **Барьерная ставка** означает применительно к Сделке, совершенной под Барьерным отлагательным условием или Барьерным отменительным условием, значение Плавающей ставки, указанный в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованный сторонами применительно к Сделке в целях определения наступления Барьерного отлагательного условия или Барьерного отменительного условия.

10.3. **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.

10.4. **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 – время публикации соответствующей Плавающей ставки (как указано в пункте 8.2 Стандартных условий) в Контрольную дату.

10.5. 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) Барьерная ставка (или Диапазон целевых значений);
- (в) Способ определения плавающей ставки.

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

11. Сбой публикации

11.1. **Сбой публикации** означает невозможность получить информацию о процентной ставке из источника информации о процентных ставках, указанного в согласованном сторонами Способе определения плавающей ставки, или любую иную информацию, необходимую для определения Плавающей ставки на Дату изменения плавающей ставки.

11.2. Если в отношении Сделки наступает Сбой публикации:

- (а) и если Сбой публикации происходит в Дату изменения плавающей ставки Дата изменения плавающей ставки переносится на ближайший Рабочий день после того, как Сбой публикации перестанет иметь место. Если Сбой публикации, затронувший соответствующий Способ определения плавающей ставки, продолжается в течение пяти Рабочих дней, следующих за Датой изменения плавающей ставки, и в течение этого времени стороны не согласовали новый Способ определения плавающей ставки, у каждой из сторон возникает право прекратить обязательства по Сделке в порядке, установленном подпунктом (б) настоящего пункта 11.2;
- (б) в иных случаях стороны должны согласовать новый Способ определения плавающей ставки. Если стороны не согласуют новый Способ определения плавающей ставки в течение пяти Рабочих дней (и Сбой публикации при этом продолжает иметь место), любая из сторон вправе, уведомив другую сторону, прекратить обязательства по Сделке в соответствии с применимыми положениями статьи 7 Примерных условий договора, как если бы:
 - (А) Сбой публикации был определен 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 истек срок, установленный в абзаце первом настоящего пункта 11.2(б) для согласования нового Способа определения плавающей ставки;

(Г) обе стороны были бы Затронутыми сторонами;

(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.

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

к Стандартным условиям срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г.

Форма Подтверждения для Сделки процентный 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 срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 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:

Номинальная сумма:

Дата сделки:

[Дата начала срока:]¹

Дата истечения срока:

[●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]²

¹ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.5 Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

² Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

- (б) [Фиксированные суммы:]
- [Плательщик фиксированной суммы:] [Сторона А] [Сторона Б]
- [Даты платежа Фиксированных сумм:] [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]³
- [Фиксированная сумма [или Фиксированная ставка и Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Фиксированной ставки]:]
- (в) Плавающие суммы:
- Плательщик плавающей суммы: [Сторона Б] [Сторона А]
- Даты платежа Плавающих сумм: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]⁴
- [Плавающая ставка для первого Процентного периода:]
- Способ определения плавающей ставки:
- Период плавающей ставки:
- Спред: [плюс/минус [●] %] [Отсутствует]
- Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки:
- Даты изменения плавающей ставки: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]⁵
- (г) Капитализация:
- Условие о капитализации: [Применимо] [Не применимо]
- Даты капитализации:
- [(д) Иные условия:]
4. Расчетный агент: [Сторона А]
5. Банковские реквизиты:
- Счет для платежей в пользу Стороны А:
- Счет для платежей в пользу Стороны Б:
- [6. Рабочий день:]
- [7. Условие об окончании срока в нерабочий день:]

³ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

⁴ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

⁵ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий 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 2

к Стандартным условиям срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011

Форма Подтверждения для Сделки процентный форвард

[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 срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 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:
 - Номинальная сумма:
 - Дата сделки:
 - [Дата начала срока:]⁶
 - Дата истечения срока: [●], [с учетом Условия окончания срока в нерабочий день: [●]]⁷

⁶ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.5 Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

⁷ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

Платательщик положительной разницы: [Сторона А] [Сторона Б]

Платательщик отрицательной разницы: [Сторона Б] [Сторона А]

Дата платежа: [● -ый/-ой/-ий] Рабочий день после
Даты изменения плавающей ставки,
[с учетом Условия об окончании срока
в нерабочий день: [●]]⁸

Фиксированная ставка:

Способ определения плавающей ставки:

Период плавающей ставки:

Спред: [плюс/минус [●] %] [Отсутствует]

Коэффициент для расчета дней в
процентном периоде для Плавающей
ставки:

Дата изменения плавающей ставки: [●], [с учетом Условия об
окончании срока в нерабочий день:
[●]]⁹

[Дисконтирование:] [Применимо] [Не применимо]

[Ставка дисконтирования:]¹⁰

[Коэффициент для расчета дней
в процентном периоде для
дисконтирования:]¹¹

[(б) Иные условия:]

4. Расчетный агент: [Сторона А]

5. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[6. Рабочий день:]

[7. Условие об окончании 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).

⁸ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

⁹ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

¹⁰ Стороны должны указать эту информацию, если они хотят изменить правило о применении по умолчанию Плавающей ставки.

¹¹ Стороны должны указать эту информацию, если они хотят изменить правило о применении по умолчанию Коэффициента для расчета дней в процентном периоде, выбранного сторонами для Плавающей ставки.

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 3

к Стандартным условиям срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г.

Форма Подтверждения для Сделок фиксации максимума процентной ставки

[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 срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011г. (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:

Номинальная сумма:

Дата сделки:

[Дата начала срока:]¹²

Дата истечения срока:

[●], [с учетом Условия об
окончании срока в нерабочий день:
[●]]¹³

¹² Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.5 Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

¹³ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

- (б) Фиксированные суммы:
- Плательщик фиксированной суммы: [Сторона А] [Сторона Б]
- Дата или Даты платежа Фиксированных сумм: [•], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [•]]¹⁴
- Фиксированная сумма:
- (в) Плавающие суммы:
- Плательщик плавающей суммы: [Сторона Б] [Сторона А]
- Максимальная ставка: [•] %
- Дата или Даты платежа Плавающих сумм: [•], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [•]]¹⁵
- [Плавающая ставка для первого Процентного периода:]
- Способ определения плавающей ставки:
- Период плавающей ставки:
- Спред: [плюс/минус [•] %] [Отсутствует]
- Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки:
- Даты изменения плавающей ставки: [•], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [•]]¹⁶
- [(г) Капитализация:
- Условие о капитализации: [Применимо] [Не применимо]
- Даты капитализации:]
- [(д) Иные условия:]
4. Расчетный агент: [Сторона А]
5. Банковские реквизиты:
- Счет для платежей в пользу Стороны А:
- Счет для платежей в пользу Стороны Б:
- [б. Рабочий день:
- [7. Условие об окончании срока в нерабочий день:]

¹⁴ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

¹⁵ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

¹⁶ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий 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:

- (б) Фиксированные суммы:
- Плательщик фиксированной суммы: [Сторона А] [Сторона Б]
- Дата или Даты платежа Фиксированных сумм: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]¹⁹
- Фиксированная сумма:
- (в) Плавающие суммы:
- Плательщик плавающей суммы: [Сторона Б] [Сторона А]
- Минимальная ставка: [●] %
- Дата или Даты платежа Плавающих сумм: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]²⁰
- [Плавающая ставка для первого Процентного периода:]
- Способ определения плавающей ставки:
- Период плавающей ставки:
- Спред: [плюс/минус [●] %] [Отсутствует]
- Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки:
- Даты изменения плавающей ставки: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]²¹
- (г) Капитализация:
- Условие о капитализации: [Применимо] [Не применимо]
- Даты капитализации:
- [(д) Иные условия:]
4. Расчетный агент: [Сторона А]
5. Банковские реквизиты:
- Счет для платежей в пользу Стороны А:
- Счет для платежей в пользу Стороны Б:
- [6. Рабочий день:
- [7. Условие об окончании 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).

¹⁹ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

²⁰ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

²¹ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

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 5

к Стандартным условиям срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г.

Форма Подтверждения для Сделок фиксации максимума и минимума процентной ставки

[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 срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 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:
 - (a) Общие условия:
 - Номинальная сумма:
 - Дата сделки:
 - [Дата начала срока:]²²
 - Дата истечения срока: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]²³

²² Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.5 Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

²³ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

- Платательщик плавающей суммы при превышении Плавающей ставкой Максимальной ставки: [Сторона А] [Сторона Б]
- Максимальная ставка: [●] %
- Платательщик плавающей суммы при превышении Минимальной ставкой Плавающей ставки: [Сторона Б] [Сторона А]
- Минимальная ставка: [●] %
- Дата или Даты платежа: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]²⁴
- [Плавающая ставка для первого Процентного периода:]
- Способ определения плавающей ставки:
- Период плавающей ставки:
- Спред: [плюс/минус [●] %] [Отсутствует]
- Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки:
- Даты изменения плавающей ставки: [●], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [●]]²⁵
- (г) Капитализация:
- Условие о капитализации: [Применимо] [Не применимо]
- Даты капитализации:
- [(д) Иные условия:]
4. Расчетный агент: [Сторона А]
5. Банковские реквизиты:
- Счет для платежей в пользу Стороны А:
- Счет для платежей в пользу Стороны Б:
- [6. Рабочий день:
- [7. Условие об окончании 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).

²⁴ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

²⁵ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

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:

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

(а) Общие условия:

Номинальная сумма и валюта для Стороны А:²⁶

Номинальная сумма и валюта для Стороны Б:²⁷

Дата сделки:

[Дата начала срока:]²⁸

Дата истечения срока:

[•], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день:
[•]]²⁹

(б) [Фиксированные суммы:]

[Плательщик фиксированной суммы:]

[Сторона А] [Сторона Б]

[Даты платежа Фиксированных сумм:]

[•], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день:
[•]]³⁰

[Фиксированная сумма [или Фиксированная ставка и Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Фиксированной ставки]:]

(в) Плавающие суммы:

Плательщик плавающей суммы:

[Сторона Б] [Сторона А]

Даты платежа Плавающих сумм:

[•], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день:
[•]]³¹

[Плавающая ставка для первого Процентного периода:]

Способ определения плавающей ставки:

Период плавающей ставки:

Спред:

[плюс/минус [•] %] [Отсутствует]

²⁶ Номинальной суммой для Стороны А является сумма, используемая для расчета Фиксированных/Плавающих сумм Стороны А, то есть Сумма первоначального платежа, установленная для Стороны Б, если к Сделке применяется условие о совершении первоначального платежа.

²⁷ Номинальной суммой для Стороны Б является сумма, используемая для расчета Фиксированных/Плавающих сумм Стороны Б, то есть Сумма первоначального платежа, установленная для Стороны А, если к Сделке применяется условие о совершении первоначального платежа.

²⁸ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.2 Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

²⁹ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

³⁰ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

³¹ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

	Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для Плавающей ставки:	
	Даты изменения плавающей ставки:	[•], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [•]] ³²
[(г)	Капитализация:	
	Условие о капитализации:	[Применимо] [Не применимо]
	Даты капитализации:]	
[(д)	Первоначальный платеж:	[Применимо] [Не применимо]
	[Дата первоначального платежа:]	[•], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [•]] ³³
	[Сумма первоначального платежа для Стороны А:]	
	[Сумма первоначального платежа для Стороны Б:]	
[(е)	Промежуточные платежи:	
	Дата или Даты промежуточного платежа:	[•], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [•]] ³⁴
	Сумма промежуточного платежа для Стороны А:	
	Сумма промежуточного платежа для Стороны Б:] ³⁵	
[(ж)	Окончательный платеж:	
	[Дата окончательного платежа:]	[•], [с учетом Условия об окончании срока в нерабочий день: [•]] ³⁶
	[Сумма окончательного платежа для Стороны А:]	
	[Сумма окончательного платежа для Стороны Б:]	
[(з)	Амортизация или иное изменение Номинальной суммы:]	[Согласно прилагаемому графику]

³² Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

³³ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

³⁴ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

³⁵ Стороны должны включить положения о промежуточных платежах, если они хотят предусмотреть амортизацию Номинальных сумм в соответствии с пунктом 3`3 (г) Стандартных условий.

³⁶ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.13 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

[(и) Иные условия:]

4. Расчетный агент: [Сторона А]

5. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[6. Рабочий день:

для [первой валюты]³⁷:

для [второй валюты]³⁸.]

[7. Условие об окончании 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 страни-
це:

[СТОРОНА А]

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:

Ф. И. О.:

Должность:

Должность:»

³⁷ Укажите наименование первой из двух валют, в которых заключается Сделка валютно-процентный своп.

³⁸ Укажите наименование второй из двух валют, в которых заключается Сделка валютно-процентный своп.

ПРИЛОЖЕНИЕ 7

к Стандартным условиям срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г.

Форма Подтверждения для Сделки свопцион

[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 срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 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:

Стиль Сделки свопцион: [Американский/Бермудский/Европейский]

Покупатель: [Сторона А] [Сторона Б]

Продавец: [Сторона Б] [Сторона А]

[Дата начала срока:]³⁹

³⁹ Стороны должны указать такую дату, если они намерены изменить правило пункта 1.5 Стандартных условий о том, что Датой начала срока является Дата сделки.

[Срок осуществления права
на исполнение:]⁴⁰

[Даты осуществления права
на исполнение по Бермудскому
свопциону:]⁴¹

Дата истечения срока:

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

[Премия:]⁴²

[Дата уплаты премии:]⁴³ [●], [с учетом Условия об окончании
срока в нерабочий день: [●]]⁴⁴

[(б) Иные условия:]

4. Условия Основной сделки:

*[Включаются условия, указанные в пункте 3 приложений 1–6 к Стандартным условиям в зависимости от вида Основ-
ной сделки.]*

5. Расчетный агент: [Сторона А]

6. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

[7. Рабочий день:]

[8. Условие об окончании 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:

⁴⁰ При желании стороны могут изменить Срок осуществления прав, предусмотренный для Американского свопциона. Например, при наличии нескольких Сроков осуществления прав необходимы дополнительные ссылки.

⁴¹ Стороны обязаны указать данную информацию для Бермудского свопциона.

⁴² 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 Номинальной суммы.

⁴³ Данное условие может быть включено в Подтверждение если Стороны договорятся об уплате Премии.

⁴⁴ Стороны должны указать правило окончания срока в нерабочий день, если они намерены изменить правило пункта 1.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется правило «Следующий рабочий день».

ПРИЛОЖЕНИЕ 7

к Стандартным условиям срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г.

Форма Требования об исполнении по Сделке свопцион

[На бланке Покупателя]

[Дата]

[Наименование и адрес Продавца]

Кас.: Требование об исполнении [наименование Сделки свопцион]

Уважаемые господа!

Мы ссылаемся на Сделку свопцион, 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 9.4 Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 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
1/1	7.4(а)
30E/360	7.4(б)
EUR-EURIBOR-Reuters	8.2(з)
EUR-EURIBOR-банки-ориентеры	8.2(и)
Moscow InterBank Offered Rate	8.2(а)
MosIBOR	8.2(а)
RUB-MOSPRIME-банки-ориентеры	8.2(в)
RUB-MOSPRIME-NFEA	8.2(б)
USD-Federal Funds-H.15	8.2(е)
USD-LIBOR BBA	8.2(д)
USD-LIBOR-банки-ориентеры	8.2(ж)
Американский свопцион	9.2(а)
Бермудский свопцион	9.2(б)
Время закрытия	9.4(а)(А)
Генеральное соглашение	1.1
Дата истечения срока	1.3
Дата калькуляции	1.4
Дата капитализации	7.8(б)
Дата начала срока	1.5
Дата окончания периода	2.2(а)
Дата осуществления права на исполнение	9.4(а)(Б)
Дата платежа	1.66
Дата сделки	1.77
Дата уплаты премии	9.5(а)
Дата изменения плавающей ставки	1.2
Дисконтирование	7.3(б)(А)
Европейский свопцион	9.2(в)
Коэффициент для расчета дней в процентном периоде	7.4
Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для дисконтирования	7.7(б)
Максимальная ставка	5.1
Минимальная ставка	5.2
НВА	8.2(а)
Номинальная сумма	1.88
Округление	1.1010
Основная сделка	9.1
Основной финансовый центр	1.99
Период капитализации	7.8(а)
Период плавающей ставки	3.2(а)(Е)
Плавающая ставка	1.11
Плавающая сумма	3.1
Плательщик отрицательной разницы	4.1
Плательщик плавающей суммы	3.3(а)
Плательщик положительной разницы	4.1
Плательщик фиксированной суммы	3.3(б)
Подтверждение	1.12
Покупатель	9.1
Право на исполнение	9.1
Предшествующий рабочий день	1.17(б)
Премия	9.5(а)

Продавец	9.1
Процентный период	2.2
Рабочий день	1.14
Рабочий день в отчетном периоде	1.17(в)
Расчетный агент	1.15
Сбой публикации	11.1
Расчетный агент, в частности, направляет необходимое уведомление другой стороне или сторонам (если Расчетный агент является третьим лицом) в Дату калькуляции применительно к каждой Дате платежа, в котором указывает:	0
(а) Дату платежа;	
(б) сторону или стороны, с которых причитается платеж в указанную Дату платежа;	
(в) сумму или суммы соответствующих платежей;	
(г) информацию в разумном объеме о том, каким образом указанная сумма или суммы платежей были определены.	
<i>Сделка</i> для целей настоящих Стандартных условий	
Сделка процентный форвард	4.1
Сделка кóллар	5.3
Сделка кэп	5.1
Сделка процентный своп	3.1
Сделка процентный форвард	4.1
Сделка свопцион	9.1
Сделка фиксации максимума и минимума процентной ставки	5.3
Сделка фиксации максимума процентной ставки	5.1
Сделка фиксации минимума процентной ставки	5.2
Сделка флор	5.2
Следующий рабочий день	1.17(а)
Способ определения плавающей ставки	8.1
Срок осуществления права на исполнение	9.4(а)(В)
Срочная сделка на процентные ставки	2.1
Ставка дисконтирования	7.7(а)
Стандартные условия	Преамбула
Сумма периода капитализации	7.8(в)
Требование об исполнении	9.4(а)(Г)
Уточненная номинальная сумма	7.8(г)
Условие об окончании срока в нерабочий день	1.17
Фактическое/360	7.4(г)
Фактическое/365	7.4(д)
Фактическое/Фактическое	7.4(е)
Фиксированная ставка	1.18
Фиксированная сумма	3.1