

УТВЕРЖДЕНА

решением Правления НКО НКЦ (АО)

«25» июля 2023 года (Протокол № 60)

**Маркетинговая программа по внебиржевым сделкам СПФИ в отношении
процентных (IRS, OIS) и валютно-процентных (ХССУ) свопов**

г. Москва

2023 г.

1. Термины и определения

Клиринговый центр – Небанковская кредитная организация-центральный контрагент «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество), (НКО НКЦ (АО)).

Сделки (инструмент(-ы)) – внебиржевые Договоры СПФИ в отношении процентных (IRS, OIS) и валютно-процентных (ХССУ) инструментов, условия которых определены в соответствующих спецификациях, (за исключением сделок, заключенных на аукционах ликвидации, закрывающих и балансирующих сделок, и опционных Договоров СПФИ).

Срок действия Программы – 5 (пять) лет с даты начала исполнения обязательств по Программе, определенной в соответствии с п. 2.2. Программы, для каждого Участника.

Участник Программы (Участник) – присоединившийся к настоящей Программе в порядке, определенном п. 2 Программы, Участник клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ (рынке СПФИ).

Отчетный год – первый год с даты начала исполнения обязательств по Программе, определенной в соответствии с п. 2.2 Программы, и каждые последующие годы в пределах Срока действия Программы.

Программа – настоящая Маркетинговая программа по внебиржевым сделкам СПФИ в отношении процентных (IRS, OIS) и валютно-процентных (ХССУ) свопов.

Термины, не определённые в настоящей Программе, используются в значениях, установленных внутренними документами Клирингового центра, в том числе Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) (далее – Правила клиринга), а при отсутствии таковых – в соответствии с законодательством Российской Федерации и нормативными актами Банка России.

2. Общие положения

2.1. В настоящей Программе закреплены права и обязанности Участников и Клирингового центра, порядок их взаимодействия, условия исполнения Участниками обязательств по Программе, порядок расчета и выплаты Клиринговым центром вознаграждения (Премии) Участникам за исполнение обязательств, предусмотренных Программой, являющиеся условиями договора между Участником и Клиринговым центром, заключаемого путем присоединения в соответствии со ст. 428 Гражданского кодекса Российской Федерации (далее – Договор).

2.2. Участник клиринга считается заключившим Договор/присоединившимся к настоящей Программе и безусловно принявшим ее условия в полном объеме в следующих случаях:

2.2.1 Принятия Клиринговым центром поданного таким Участником клиринга заявления (далее – Заявление), оформленного им в соответствии с Приложением № 1 к Программе, в бумажной или электронной форме, подписанного руководителем Участника или иным уполномоченным лицом, скрепленного печатью Участника (при наличии) в случае предоставления Заявления на бумажном носителе. Датой начала исполнения обязательств по Программе является первый торговый день месяца, следующего за месяцем, в который Клиринговым центром было получено Заявление Участника.

2.2.2 Участник клиринга, участвовавший в ранее действовавшей Маркетинговой программе по внебиржевым сделкам СПФИ, выполнявший ее условия и не уведомивший

Клиринговый центр об отказе от участия в настоящей Программе в течение первого месяца её действия в порядке, предусмотренном п. 5.3. Программы, такой Участник считается присоединившимся к настоящей Программе и заключившим Договор с Клиринговым центром на условиях, определенных Программой с даты начала её действия.

Выполнение таким Участником обязательств по настоящей Программе учитывается по Расчетному коду, указанному им в заявлении об участии в Маркетинговой программе по внебиржевым сделкам СПФИ.

Все споры и разногласия, возникающие в связи с исполнением обязательств по настоящей Программе между Клиринговым центром и таким Участником, подлежат рассмотрению и разрешению в порядке арбитража (третейского разбирательства) администрируемого Арбитражным центром при Российском союзе промышленников и предпринимателей (РСПП) (далее – Арбитражный центр) в соответствии с его Регламентом и правилами, действующими на момент подачи искового заявления, с соблюдением претензионного порядка и условий арбитражной оговорки, указанных Участником в заявлении об участии в Маркетинговой программе по внебиржевым сделкам СПФИ.

- 2.3. Целью данной Программы является повышение ликвидности рынка Стандартизированных производных финансовых инструментов (далее - СПФИ), а именно, процентных (IRS, OIS) и валютно-процентных (ХССУ) свопов. При исполнении условий Программы Участники должны следовать целям Программы и предпринимать все возможные меры для предотвращения недобросовестного исполнения обязательств участника клиринга перед Клиринговым центром, в соответствии с Правилами клиринга.
- 2.4. При подаче Заявления Участник указывает Расчетный код Участника Программы на рынке СПФИ (далее – Расчетный код), по которому будет учитываться информация об обязательствах по Сделкам, заключаемым Участником в рамках Программы.
- 2.5. Клиринговым центром определено, что максимальное количество Участников по настоящей Программе не может быть более 5 (пяти).

3. Обязательства Участника по Программе, их параметры и условия исполнения обязательств.

3.1. Участник Программы в течение каждого Отчетного года в период действия Программы обязан:

3.1.1. Участник в течение не менее 90 % Торговых дней каждого календарного месяца соответствующего Отчетного года совершать операции (выставлять разнонаправленные (на покупку/продажу) Предложения, оформляемые в соответствии со Спецификацией инструмента по образцам, указанным в Приложении №3 к Программе, и содержащие Плавающую и Фиксированные ставки (в одинаковой валюте)) на рынке СПФИ в отношении следующих инструментов, (с учетом сроков Договоров СПФИ¹):

- IRS KEYRATE 1Y – 10Y с соблюдением следующих параметров:

¹Под сроком Договора СПФИ понимается определенный в соответствии со Спецификацией инструмента максимальный срок между ближайшим Рабочим днем для платежей в Валюте номинальной суммы, следующим за Датой договора, и Датой истечения срока.

Таблица № 1

№	Параметры обязательств	Коды инструментов									
		IRS KEYRATE									
		1Y	2Y	3Y	4Y	5Y	6Y	7Y	8Y	9Y	10Y
1	Максимальная разница между ценой Предложения на покупку инструмента и ценой Предложения на продажу инструмента, каждая из которых выражена в доходности в % годовых	Max (100bps 4%*KR)	Max (100bps 5%*KR)	Max (100bps 5%*KR)	Max (100bps 5%*KR)	Max (100bps 5%*KR)	Max (100bps; 10%*KR)	Max (100bps; 10%*KR)	Max (100bps; 10%*KR)	Max (100bps; 10%*KR)	Max (100bps; 10%*KR)
2	Минимально допустимый объем Предложения на продажу и покупку, в валюте инструмента (млн.руб.)	200	200	200	200	160	100	90	50	50	48
3	Период времени в ходе Торговой сессии Торгового дня, в течение которого участник Программы должен выполнять обязательства в отношении инструмента	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%

где bps - одна сотая часть процентного пункта (то есть 1 базисный пункт = 0,01 процентного пункта, что эквивалентно одной десятитысячной доли)

KR - ключевая ставка Банка России, действующая на дату выставления Предложения в клиринговую систему

- OIS RUONIA 1W, 2W, 1M, 2M, 3M, 6M, 9M, 1Y, 2Y – 10Y с соблюдением следующих параметров:

Таблица № 2

№	Параметры обязательств	Коды инструментов																
		OIS RUONIA																
		1W	2W	1M	2M	3M	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y	6Y	7Y	8Y	9Y	10Y
1	Максимальная разница между ценой Предложения на покупку инструмента и ценой Предложения на продажу инструмента, каждая из которых выражена в доходности в % годовых	max (100 bps; 3%*KR)	max (100 bps; 4%*KR)	max (100 bps; 5%*KR)	max (100 bps; 10%*KR)													
2	Минимально допустимый объем Предложения на продажу и покупку, в валюте инструмента (млн.руб.)	200	200	200	200	200	200	200	200	200	200	200	160	100	90	50	50	48
3	Период времени в ходе Торговой сессии Торгового дня, в течение которого участник Программы должен выполнять обязательства в отношении инструмента	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%	80%

где bps - одна сотая часть процентного пункта (то есть 1 базисный пункт = 0,01 процентного пункта, что эквивалентно одной десятитысячной доли)

KR - ключевая ставка Банка России, действующая на дату выставления Предложения в клиринговую систему

3.1.2. Участвовать во всех аукционах ликвидации, проводимых Клиринговым центром на рынке СПФИ в каждом Отчетном году в период действия Программы путем выставления обеспеченных Предложений.

3.1.3. Выполнять требования по объему заключённых на рынке СПФИ Сделок, указанные в Таблице № 3.

3.2. Выполнять требования по объему заключённых на рынке СПФИ Сделок, указанные в Таблице № 3. В случае, если объем по всем Сделкам, заключенным в Отчетном году, учитываемых на Расчетном коде, указанном в Заявлении Участника согласно п. 2.4 Программы, удовлетворяет требованиям, указанным ниже в Таблице № 3, осуществляется расчет суммы (Comm) по следующей формуле:

$$Comm = \sum_{j=1}^q k_i * n_j * N_j / 1\,000\,000, \text{ где}$$

Q – количество Сделок, заключенных в Отчетном году;
 j – номер Сделки, заключенной в Отчетном году;
 n_j – срок Сделки в днях;
 N_j – номинальная сумма Сделки, на основании которой рассчитывается комиссионное вознаграждение Клирингового центра;
 k_i – значение, определяемое в соответствии с условиями, указанными в Таблице № 3:

Суммирование осуществляется по всем Сделкам, заключенным Участником в Отчетном году. Значение $k_i * n_j * N_j / 1\,000\,000$ округляется с точностью до сотых долей по правилам математического округления.

Таблица № 3

Номер строки	Требования к Участникам Программы	k_i
1	Участник Программы в течение каждого Отчетного года выполняет обязательства по 13 инструментам рынка СПФИ в соответствии с условиями, указанными в Таблице № 1 и Таблице № 2.	0,31
2	Участник Программы в течение каждого Отчетного года выполняет обязательства по 13 инструментам рынка СПФИ в соответствии с условиями, указанными в Таблице № 1 и Таблице № 2 и выполняет требования по объему торгов по Сделкам в объёме (приведенном к году) не меньше 150 млрд. руб..	0,271
3	Участник Программы в течение каждого Отчетного года выполняет обязательства по 23 инструментам рынка СПФИ в соответствии условиями, указанными в Таблице № 1 и Таблице № 2 и выполняет требования по объему торгов по Сделкам в объёме (приведенном к году) не меньше 150 млрд. руб.	0,248
4	Участник Программы в течение каждого Отчетного года выполняет обязательства по 13 инструментам рынка СПФИ в соответствии условиями, указанными в Таблице № 1 и Таблице № 2 и выполняет требования по объему торгов по Сделкам в объёме (приведенном к году) не меньше 400 млрд. руб.	0,215
5	Участник Программы в течение каждого Отчетного года выполняет обязательства по 23 инструментам рынка СПФИ в соответствии условиями, указанными в Таблице № 1 и Таблице № 2 и выполняет требования по объему торгов по Сделкам в объёме (приведенном к году) не меньше 400 млрд. руб.	0,192

Объем Сделок приведенный к году рассчитывается в порядке, указанном в п. 3.4. Программы.

3.3. При невыполнении Участником Программы хотя бы одного из условий, предусмотренных подпунктами 3.1.1, 3.1.2 и 3.1.3 Программы, обязательства Участника по Программе в данный Отчетный год считаются не выполненными и вознаграждение (Премия), предусмотренное

Программой, Участнику не выплачивается, за исключением случая, предусмотренного п. 3.5. Программы.

3.4. Для определения исполнения годовых (по каждому Отчетному году) обязательств Участника по Программе определяются пороговые суммы в следующем порядке:

Объем Сделок, приведенный к году (V , руб.) рассчитывается по формуле:

$$V = \sum_j \frac{N_j}{365} * n_j, \text{ где}$$

V – объем заключенных Участником Программы Сделок, приведенный к году;

n_j – срок Сделки в днях;

N_j – номинальная сумма Сделки, на основании которой рассчитывается комиссионное вознаграждение Клирингового центра;

- 1-ая пороговая сумма устанавливается равной 150 млрд. руб., которая является объемом торгов (выраженным в руб.) по процентным (IRS, OIS) и валютно-процентным инструментам (ХССУ) на рынке СПФИ приведенным к году;
- 2-ая пороговая сумма устанавливается равной 400 млрд. руб., которая является объемом торгов (выраженным в руб.) по процентным (IRS, OIS) и валютно-процентным инструментам (ХССУ) на рынке СПФИ приведенным к году.

3.5. В случае невыполнения Участником в полном объеме обязательств, предусмотренных Программой, по причине действия обстоятельств непреодолимой силы, то расчет вознаграждения (Премии) за каждый Отчетный год периода действия Программы осуществляется Участнику при условии выполнения таким Участником требований, определенных в строке 1 Таблицы № 3, без учета времени действия обстоятельств непреодолимой силы.

В рамках данной Программы под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются стихийные бедствия (землетрясение, наводнение, ураган), пожар, массовые заболевания (эпидемии), забастовки, военные действия, теракты, диверсии, ограничения перевозок, запретительные меры государств (в том числе недружественные действия иностранных государств и международных организаций, связанные с введением ограничительных мер в отношении российских юридических лиц) и другие обстоятельства, не зависящие от воли Клирингового центра и Участников Программы. При наступлении данных обстоятельств Участник Программы должен незамедлительно официально известить о них Клиринговый центр. Извещение должно содержать данные о характере обстоятельств и их влиянии на исполнение Участником обязательств по Программе. Клиринговый центр и Участник осуществляют взаимодействие для выявления способов предотвращения действия обстоятельств непреодолимой силы на возможность выполнения Участником обязательств по Программе.

4. Порядок расчета и выплаты вознаграждения Участника за исполнение обязательств по Программе.

4.1. Вознаграждение Участника (Премия, R) за исполнение обязательств по Программе за каждый Отчетный год периода действия Программы рассчитывается как разность между комиссионным вознаграждением Клирингового центра за клиринг по Договорам СПФИ, являющимся Сделками, заключенными с Участником в рамках Программы в данном Отчетном году, определяемым в соответствии с Тарифами клирингового центра на рынке Стандартизированных ПФИ, без учета показателя $S_{\text{бор}_{\text{min}}}$ ($TComm$), и значением $Comm$ (определенном по п. 3.2. Программы) в следующем порядке:

1) в случае если $Comm > 10\,000\,000$ (10 миллионов) рублей, то вознаграждение (Премия) Участника рассчитывается по формуле:

$$R = TComm - Comm$$

2) в случае если $Comm \leq 10\,000\,000$ (10 миллионов) рублей, то вознаграждение (Премия) Участника рассчитывается по формуле:

$$R = 7Comm - 10\,000\,000$$

Вознаграждение (Премия) за исполнение обязательств по Программе за каждый Отчетный год периода действия Программы выплачивается Участнику Клиринговым центром, только в случае если рассчитанное в порядке, предусмотренным настоящим пунктом Программы значение $R > 0$.

- 4.2. В случае, предусмотренном п. 3.3 Программы, вознаграждение (Премия) за соответствующий Отчетный год, в котором Участником не были исполнены обязательства по Программе, не рассчитывается.
- 4.3. При условии исполнения Участником обязательств, предусмотренных в п. 3.1 Программы, Клиринговый центр после завершения Отчетного года выплачивает Участнику вознаграждение (Премия) в размере, рассчитанном в соответствии с условиями Программы.
- 4.4. В случае исполнения Участником обязательств, предусмотренных Программой в течение неполного Отчетного года, Клиринговый центр выплачивает Участнику вознаграждение (Премия) в порядке, предусмотренном Программой и Правилами клиринга, в следующих случаях:
- приостановление или прекращение действия Программы/расторжение Договора по инициативе Клирингового центра в день, не являющийся последним днем Отчетного года, за исключением случаев, указанных в п. 4.6 Программы;
 - отказ Участника от Программы/исполнения Договора в связи с внесением Клиринговым центром изменений в Программу.
- 4.5. Если исполнение обязательств Участника по Программе завершится досрочно в случаях, предусмотренных п. 4.4 Программы, Клиринговый центр выплачивает Участнику вознаграждение (Премия), которое рассчитывается исходя из уменьшения параметров обязательств Участника, предусмотренных п. 3.1 Программы пропорционально отношению количества календарных дней Отчетного года к количеству календарных дней действия Договора с таким Участником в данном Отчетном году.
- 4.6. Клиринговый центр не выплачивает вознаграждение (Премия) Участнику в случае расторжения/прекращения действия Договора по инициативе Клирингового центра в отношении Участника в связи с неисполнением или ненадлежащим исполнением им обязательств по Программе.
- 4.7. В случае внесения Клиринговым центром в одностороннем порядке изменений в Программу в соответствии с п. 5.1 Программы для целей расчета вознаграждения Участника за текущий Отчетный год (определяемый для каждого Участника) применяются условия Программы, действующие на дату расчета с соответствующим Участником.
- 4.8. В случае принятия Клиринговым центром решения о прекращении действия Программы, вознаграждение (Премия), выплачиваемые Клиринговым центром Участнику, рассчитываются исходя из параметров обязательств, выполненных Участником в соответствии с условиями Программы, пропорционально периоду их действия в текущем Отчетном году (определяется для каждого Участника Программы).

5. Внесение изменений в Программу. Прекращение Программы/Договора.

- 5.1. Клиринговый центр вправе в одностороннем порядке вносить изменения в Программу, а также принять решение о приостановлении или прекращении действия Программы.

Изменения в Программу, решения Клирингового центра о приостановлении или прекращении действия Программы вступают в силу в срок, определённый Клиринговым центром.

Текст Программы, изменения в Программу, а также информация о приостановлении или прекращении действия Программы раскрываются на сайте Клирингового центра в сети Интернет по адресу: <https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/0204> не позднее, чем за 5 (пять) дней до даты вступления в силу Программы/изменений Программы/приостановления или прекращения Программы.

Участник в одностороннем порядке может изменить Расчетный код Участника Программы на рынке СПФИ. Такие изменения оформляются путём направления Участником в адрес Клирингового центра соответствующего уведомления, оформленного в соответствии с Приложением № 2 к Программе, и вступают в силу не позже 5 (пяти) рабочих дней с даты получения Клиринговым центром такого уведомления (если иной срок не согласован Клиринговым центром и Участником).

- 5.2. В случае несогласия Участника с внесенными Клиринговым центром изменениями в Программу Участник вправе отказаться от участия в Программе, направив Клиринговому центру уведомление по форме, предусмотренной в Приложении № 4 к Программе, (далее – Уведомление) при этом исполнение Участником обязательств по Программе/Договору прекращается с установленной Клиринговым центром даты вступления в силу изменений в Программу. Уведомление должно быть направлено Участником в Клиринговый центр в течение 5 (пяти) рабочих дней с даты вступления в силу изменений в Программу.
- 5.3. Участник вправе в одностороннем порядке отказаться от участия в Программе, направив в Клиринговый центр Уведомление не позднее чем за 5 (пять) рабочих дней до предполагаемой даты прекращения исполнения обязательств по Программе, указанной в Уведомлении. В случае, если указанное Уведомление направлено с нарушением срока, то исполнение обязательств по Программе прекращается на 5 (пятый) рабочий день с даты получения такого Уведомления Клиринговым центром, если иная дата не согласована Клиринговым центром и Участником Программы.²

Предусмотренные в пунктах 5.2 и 5.3 Программы Уведомления направляются Участником Клиринговому центру путем направления документа в бумажной форме, или в форме электронного документа в соответствии с Порядком ЭДО Клирингового центра.

- 5.4. Клиринговый центр вправе в одностороннем порядке досрочно расторгнуть Договор, направив в бумажной форме, или в форме электронного документа соответствующее уведомление Участнику не позднее, чем за 5 (пять) рабочих дней до предполагаемой даты расторжения Договора, указанной в уведомлении.
- 5.5. При выявлении факта ненадлежащего исполнения или неисполнения Участником обязательств участника клиринга перед Клиринговым центром, а также в случаях введения Режимы закрытия позиций/приостановления/прекращения допуска Участника к клиринговому обслуживанию, Клиринговый центр вправе в одностороннем порядке

² Предусмотренный п. 5.3 Программы порядок прекращения обязательств по Программе не применяется в случае отказа Участника от Программы в порядке, предусмотренном в п. 5.2 Программы.

расторгнуть Договор, направив Участнику соответствующее уведомление в бумажной форме, или в форме электронного документа.

6. Прочие условия

- 6.1. Участник и Клиринговый центр незамедлительно информируют друг друга об изменении своих реквизитов и полностью несут риск убытков, которые могут возникнуть в отсутствие такого информирования.
- 6.2. Участник и Клиринговый центр несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение своих обязательств в порядке, предусмотренном законодательством Российской Федерации, Программой и Правилами клиринга.
- 6.3. Споры и разногласия, возникающие в связи с исполнением обязательств по Программе или в связи с ней, Участник и Клиринговый центр будут стремиться разрешить путем переговоров.
- 6.4. В случае невозможности достижения согласия путем переговоров споры подлежат разрешению в третейском суде, предусмотренном в Заявлении.
- 6.5. Взаимодействие между Участником и Клиринговым центром осуществляется путем обмена документами в бумажной форме или в форме электронного документа в соответствии с Порядком ЭДО Клирингового центра.

Заявление об участии в Маркетинговой программе по внебиржевым сделкам СПФИ в отношении процентных (IRS, OIS) и валютно-процентных (ХССУ) свопов

Исх. № _____

В НКО НКЦ (АО)

«__» _____ 20__ г.

Участник Программы	<i>Указывается полное наименование Участника Программы</i>
--------------------	--

Настоящим заявляю, что в соответствии со статьей 428 Гражданского кодекса Российской Федерации ознакомлен и полностью согласен с условиями Маркетинговой программы по внебиржевым сделкам СПФИ в отношении процентных (IRS, OIS) и валютно-процентных (ХССУ) свопов (далее – Программа).

Подписание и передача настоящего Заявления в НКО НКЦ (АО) являются присоединением к Программе, и подтверждением заключения Участником Программы договора (далее – Договор) на условиях, определенных Программой.

Расчетный код Участника Программы на рынке СПФИ

Все споры и разногласия, возникающие в связи с исполнением обязательств по Программе, подлежат рассмотрению и разрешению в порядке арбитража (третейского разбирательства), администрируемого Арбитражным центром при Российском союзе промышленников и предпринимателей (РСПП) (далее – Арбитражный центр) в соответствии с его Регламентом и правилами, действующими на момент подачи искового заявления.

Передача споров на разрешение в Арбитражный центр возможно только после соблюдения предварительного претензионного порядка урегулирования споров. В случае полного или частичного отказа в удовлетворении претензии или неполучения ответа в течение 7 (семи) дней с момента получения претензии заявитель вправе предъявить иск в Арбитражный центр.

Решения Арбитражного центра являются для спорящих сторон окончательными и обязательными для исполнения.

Неисполненное добровольно решение Арбитражного центра подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством страны места принудительного исполнения и международными соглашениями.

Подпись руководителя/ уполномоченного лица _____

Приложение № 2 к Маркетинговой программе по
внебиржевым сделкам СПФИ в отношении процентных (IRS,
OIS) и валютно-процентных (ХССУ) свопов

Форма Заявления об изменении Расчетного кода Участника Маркетинговой программы по
внебиржевым сделкам СПФИ в отношении процентных (IRS, OIS) и валютно-процентных (ХССУ)
свопов.

Исх. № _____

В НКО НКЦ (АО)

« ___ » _____ 20__ г.

Участник Программы	<i>Указывается полное наименование Участника Программы</i>
--------------------	--

Настоящим уведомляю об изменении Расчетного кода Участника Маркетинговой программы по внебиржевым сделкам СПФИ в отношении процентных (IRS, OIS) и валютно-процентных (ХССУ) свопов (далее – Программа) на: [*указывается новый Расчетный код Участника Программы на рынке СПФИ*].

Подпись руководителя/ уполномоченного лица _____

Приложение №3 к Маркетинговой программе по
внебиржевым сделкам СПФИ в отношении
процентных (IRS, OIS) и валютно-процентных
(ХССУ) свопов

Образцы оформления Предложений в отношении инструментов Заявления об участии в Маркетинговой программе по внебиржевым сделкам СПФИ в отношении процентных (IRS, OIS) и валютно-процентных (ХССУ) свопов:

1. OIS Ruonia

Заявка	Безадресная
Календарь сделки	Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)
CSA	RUB
Валюта	RUB
Срок	[Участником указывается одно из следующих значений: 1w, 2w, 1m, 2m, 3m, 6m, 9m, 1y, 2y, 3y, 4y, 5y, 6y, 7y, 8y, 9y, 10y]
Смещение	Tom
Fixed	
валюта	RUB
Номинальная сумма	[Заполняется Участником]
Конвенция дней	Act/act (ISDA)
Периодичность выплат	В конце периода/ежегодно, если срок более 1 года
Ставка	[Заполняется Участником]
Float	
валюта	RUB
Номинальная сумма	[Заполняется Участником]
Конвенция дней	Act/act (ISDA)
Периодичность выплат	В конце периода /ежегодно, если срок более 1 года
Индекс ставок	Ruonia Comp.
Капитализация	Ежедневно
Смена ставки	Ежедневно
Календари Pay	
Платежи	Moscow, SPFI/Following (недоступно для изменения)
Процентные периоды	Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)
Количество дней	Пусто
Календари Receive	
Платежи	Moscow, SPFI/Following (недоступно для изменения)
Процентные периоды	Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)
Календарь фиксинга	RUONIA/Following
Количество дней	Пусто
Дополнительные параметры	
Спрэд	0
Сдвиг (Lookback/Shift)	Без сдвига
Конвенция Stub	Short initial
Доп платеж (премия)	0 (без премии)
Дата начала первого периода	Не указана
Ставка первого периода	Не указана

2. IRS Key Rate

Заявка	Безадресная
Календарь сделки	(синхронизирован с Процентными периодами) Moscow, SPFI/Modified Following
CSA	RUB
Валюта	RUB
Срок	[Участником указывается одно из следующих значений: 1y, 2y, 3y, 4y, 5y, 6y, 7y, 8y, 9y, 10y]
Смещение	Tom
Fixed	
Валюта	RUB
Номинальная сумма	[Заполняется Участником]
Конвенция дней	Act/Act (ISDA)
Периодичность выплат	Ежегодно
Ставка	[Заполняется Участником]
Float	
валюта	RUB
Номинальная сумма	[Заполняется Участником]
Конвенция дней	Act/Act (ISDA)
Периодичность выплат	Ежеквартально
Период капитализации	Ежеквартально
Индекс ставок	RUB KeyRate
Смена ставки	Ежедневно
Средняя ставка	Weighted
Спред (б.п.)	0
Фиксинг	0B
Reset	At end
Календари Pay	
Платежи	(синхронизирован с Процентными периодами) Moscow, SPFI/Modified Following
Процентные периоды	Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)
Количество дней	Пусто
Календари Receive	
Платежи	(синхронизирован с Процентными периодами) Moscow, SPFI/Modified Following
Процентные периоды	Moscow, SPFI/Modified Following (по ум.)
Календарь фиксинга	Moscow, SPFI/Preceding
Количество дней	Пусто
Дополнительные параметры	
Спрэд	0
Сдвиг (Lookback/Shift)	Без сдвига
Конвенция Stub	Short initial
Доп платеж (премия)	0 (без премии)
Дата начала первого периода	Не указана
Ставка первого периода	Не указана

Уведомление
об отказе от участия в Маркетинговой программе по внебиржевым сделкам СПФИ в отношении процентных (IRS, OIS) и валютно-процентных (ХССУ) свопов

Исх. № _____

В НКО НКЦ (АО)

«__» _____ 20__ г.

Участник Программы	<i>Указывается полное наименование Участника Программы</i>
Расчетный код Участника Программы на рынке СПФИ	<i>Указывается Расчетный код Участника Программы</i>

Настоящим информируем об отказе от участия в Маркетинговой программе по внебиржевым сделкам СПФИ в отношении процентных (IRS, OIS) и валютно-процентных (ХССУ) свопов с (даты) в связи с [указывается основание отказа от участия в Программе].

Подпись руководителя/ уполномоченного лица _____