



Паспорт продукта
«Валютный Форвард»

Кострома
2021

СОДЕРЖАНИЕ

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ.....	3
2. СТАНДАРТЫ ПРОДУКТА.....	3

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящий документ описывает технические параметры и характеристики продукта «Валютный Форвард», условия его оформления и предоставления Клиенту.

2. СТАНДАРТЫ ПРОДУКТА

2.1 Основные положения		
2.1.1	Продукт	Валютный форвард
2.1.2	Цель продукта	Хеджирование валютного риска
2.2 Параметры продукта		
2.2.1	Виды валютных форвардов	<p>Поставочный валютный форвард (FWD) – внебиржевой форвардный договор, по которому на условиях, согласованных сторонами, одна сторона обязуется купить у другой стороны сумму в одной валюте и продать другой стороне сумму в другой валюте с осуществлением обеими сторонами переводов указанных сумм в дату платежа, наступающую не ранее третьего рабочего дня после даты заключения сделки;</p> <p>Расчетный валютный форвард (NDF) – внебиржевой форвардный договор, по которому на условиях, согласованных сторонами, одна сторона обязуется периодически и (или) единовременно уплачивать другой стороне в каждую согласованную дату платежа, сумму платежа в зависимости от изменения обменного курса расчетной валюты по отношению к форвардному курсу, согласованному сторонами в дату заключения сделки.</p>
2.2.2	Существенные условия сделок	<p>Поставочный валютный форвард:</p> <ul style="list-style-type: none">– валютная пара;– сумма валюты, подлежащая уплате одной стороной;– сумма валюты, подлежащая уплате другой стороной, или форвардный курс (в этом случае валюта, подлежащая уплате первой стороной, признается расчетной валютой);– дата платежа;– иные существенные условия, подлежащие согласованию по требованию одной из сторон. <p>Расчетный валютный форвард:</p> <ul style="list-style-type: none">– расчетная валюта;– базовая валюта;– продавец расчетной валюты;– покупатель расчетной валюты;

		<ul style="list-style-type: none"> – номинальная сумма в базовой валюте и номинальная сумма в расчетной валюте или форвардный курс и либо номинальная сумма в базовой валюте, либо номинальная сумма в расчетной валюте; – способ определения курса спот; – дата платежа; – иные существенные условия, подлежащие согласованию по требованию одной из сторон. 									
2.2.3	Порядок исполнения валютного форварда	<p>Поставочный валютный форвард:</p> <p>В дату платежа каждая сторона обязана уплатить сумму валюты, согласованную сторонами применительно к сделке.</p> <p>Расчетный валютный форвард:</p> <p>В дату оценки (фиксинга) в зависимости от соотношения курса спот и форвардного курса определяется сторона-плательщик по сделке и рассчитывается сумма платежа по сделке с использованием следующей формулы, если в отношении сделки сторонами не согласовано иное:</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">Соотношение курса спот и форвардного курса</th> <th style="text-align: center;">Сумма платежа по сделке</th> <th style="text-align: center;">Сторона плательщик в дату платежа (валютирования)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">$R_{spot} > R_{fwd}$</td> <td style="text-align: center;">$S = N \times (R_{spot} - R_{fwd})$</td> <td style="text-align: center;">Сторона – «покупатель расчетной валюты»</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">$R_{spot} < R_{fwd}$</td> <td style="text-align: center;">$S = N \times (R_{fwd} - R_{spot})$</td> <td style="text-align: center;">Сторона – «продавец расчетной валюты»</td> </tr> </tbody> </table> <p>где: N – величина номинального обязательства; Rspot – фактическое значение курса спот (в виде десятичной дроби); Rfwd – форвардный курс (в виде десятичной дроби).</p> <p>Сторона, являющаяся расчетным агентом по условиям генерального соглашения/сделки, направляет другой стороне уведомление с информацией о стороне-плательщике и сумме платежа.</p> <p>В дату платежа сторона-плательщик перечисляет другой стороне сумму платежных обязательств по сделке.</p>	Соотношение курса спот и форвардного курса	Сумма платежа по сделке	Сторона плательщик в дату платежа (валютирования)	$R_{spot} > R_{fwd}$	$S = N \times (R_{spot} - R_{fwd})$	Сторона – «покупатель расчетной валюты»	$R_{spot} < R_{fwd}$	$S = N \times (R_{fwd} - R_{spot})$	Сторона – «продавец расчетной валюты»
Соотношение курса спот и форвардного курса	Сумма платежа по сделке	Сторона плательщик в дату платежа (валютирования)									
$R_{spot} > R_{fwd}$	$S = N \times (R_{spot} - R_{fwd})$	Сторона – «покупатель расчетной валюты»									
$R_{spot} < R_{fwd}$	$S = N \times (R_{fwd} - R_{spot})$	Сторона – «продавец расчетной валюты»									
2.3 Общие требования к клиентам											
2.3.1	Типы Клиентов	Российские и иностранные юридические лица (в т.ч. кредитные организации)									
2.3.2	Особые условия	При заключении сделок на внебиржевом рынке должны одновременно соблюдаться следующие условия:									

		<ul style="list-style-type: none"> – прохождение контрагентом процедур KYC, FATCA перед заключением ISDA/ISDA, CSA; – наличие подписанного ISDA/ISDA, CSA; – соблюдение установленных лимитов рыночного риска; <p>наличие достаточного свободного остатка лимита кредитного риска, установленного на контрагента (за исключением случаев заключения сделки на условиях предоплаты со стороны контрагента или под обеспечение в виде вариационной маржи).</p>
2.4 Перечень документов для присоединения Клиента к продукту		
2.4.1	Документация	ISDA/ISDA, CSA
2.5 Ограничения по продукту		
2.5.1	Прочие условия	<p>Информация о Генеральных соглашениях о срочных сделках (ISDA/ISDA) подлежит предоставлению в репозиторий в установленном порядке.</p> <p>Крупные сделки и сделки, в совершении которых имеется заинтересованность, определяемые в соответствии с критериями, установленными Законом от 26.12.1995 № 208-ФЗ «Об акционерных обществах», Законом от 08.02.1998 N 14-ФЗ "Об обществах с ограниченной ответственностью", подлежат одобрению в установленном порядке</p>