



**Паспорт продукта
«Процентный Своп»**

Кострома

2021

СОДЕРЖАНИЕ

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

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

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

2. СТАНДАРТЫ ПРОДУКТА

2.1 Основные положения		
2.1.1	Продукт	Процентный своп
2.1.2	Цель продукта	Хеджирование процентной ставки
2.2 Параметры продукта		
2.2.1	Особенности процентного свопа	Процентный своп – своп договор, 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, а другая сторона одновременно или периодически уплачивает первой стороне либо сумму в той же валюте, рассчитанную на основе той же номинальной суммы и фиксированной ставки, либо плавающую сумму в той же валюте, рассчитанную на основе той же номинальной суммы и другой плавающей ставки.
2.2.2	Существенные условия сделок	<ul style="list-style-type: none">– номинальная сумма;– дата истечения срока;– плательщик плавающей суммы;– даты платежа плавающих сумм;– способ определения плавающей ставки;– период плавающей ставки;– даты изменения плавающей ставки;– иные существенные условия, подлежащие согласованию по требованию одной из сторон. <p>Если по условиям сделки одна из сторон уплачивает фиксированные суммы, существенными условиями также являются:</p> <ul style="list-style-type: none">– плательщик фиксированной суммы;– даты платежа фиксированных сумм;– фиксированная ставка. <p>Если по условиям сделки обе стороны уплачивают плавающие суммы, в отношении второй стороны согласовываются существенные условия, необходимые для стороны-плательщика плавающих сумм.</p>

2.2.3	Порядок исполнения процентного свопа	<p>Расчет сумм процентов, причитающихся к уплате в дату платежа (валютирования) по сделке осуществляется по формуле простого процента. Количество дней в процентном периоде рассчитывается с использованием коэффициента, определенном в Генеральном соглашении/подтверждении сделки.</p> <p>В случае если дата платежа (валютирования) по сделке процентный своп не является рабочим днем, то платеж по подобной сделке осуществляется непосредственно на следующий рабочий день, если иное не определено в Генеральном соглашении/подтверждении соответствующей сделки. Перенос сроков платежа должен учитываться при расчете фактического количества дней для начисления процентов по сделке.</p> <p>В даты изменения (фиксинга) плавающей ставки определяется плавающая ставка применительно к соответствующему процентному периоду.</p> <p>В даты калькуляции сторона, являющаяся расчетным агентом по условиям генерального соглашения/сделки, рассчитывает сумму/суммы платежа по сделке и направляет другой стороне уведомление с информацией о платежных обязательствах каждой из сторон на предстоящую дату платежа.</p> <p>В даты платежа стороны осуществляют расчеты по сделке.</p>
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	<p>При заключении сделок на внебиржевом рынке должны одновременно соблюдаться следующие условия:</p> <ul style="list-style-type: none"> – прохождение контрагентом процедур KYC, FATCA перед заключением RISDA/ISDA, CSA; – наличие подписанного RISDA/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	RISDA/ISDA, CSA
2.5 Ограничения по продукту		

2.5.1	Прочие условия	<p>Информация о Генеральных соглашениях о срочных сделках (RISDA/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>
-------	----------------	--