

**ЗАРЕЄСТРОВАНО**  
постановою Національної комісії  
зінних паперів та фондового  
ринку від 10 червня 2024  
№ 34/21/729/К01

**ЗАТВЕРДЖЕНО**  
рішенням Біржової ради  
АТ «ФОНДОВА БІРЖА ПФТС»  
Протокол № 102 від 18 грудня 2023 р.

Голова Комісії

Виконуючий обов'язки Голови  
Наглядової ради

\_\_\_\_\_ Р.С. Магомедов

\_\_\_\_\_ Р.А. Осипенко

## СПЕЦИФІКАЦІЯ ВАЛЮТНОГО СВОПУ

### 1. Терміни та визначення

<b>Оператор</b>	Акціонерне товариство «ФОНДОВА БІРЖА ПФТС»
<b>Правила торгівлі</b>	Правила функціонування багатостороннього торговельного майданчика деривативних контрактів Акціонерного товариства «ФОНДОВА БІРЖА ПФТС»
<b>Правила клірингу</b>	Правила провадження клірингової діяльності публічного акціонерного товариства «Розрахунковий центр з обслуговування договорів на фінансових ринках» та Регламент провадження клірингової діяльності публічного акціонерного товариства «Розрахунковий центр з обслуговування договорів на фінансових ринках»
<b>Специфікація</b>	Ця специфікація валютного свопу
<b>Контракт</b>	Валютний своп – поставний деривативний контракт грошового ринку, базовими активами якого є іноземна валюта та гривні, умови якого визначаються Специфікацією, законодавством України, Правилами торгівлі та Правилами клірингу, в частині яка не суперечить вимогам законодавства України
<b>Основний базовий актив</b>	Базовий актив деривативного контракту, кількість якого є однаковою в обох частинах деривативного контракту. Основним базовим активом Контракту виступає іноземна валюта відповідно до встановленого Центральним контрагентом переліку основних базових активів деривативних контрактів.
<b>Розрахунковий базовий актив</b>	Базовий актив деривативного контракту, в кількості якого визначається ціна одиниці основного базового активу деривативного контракту. Розрахунковим базовим активом Контракту виступає гривня.
<b>Учасник</b>	Учасник торгів, який допущений Оператором до укладання Контрактів та допущений Центральним контрагентом до клірингових операцій за Контрактами
<b>Продавець</b>	Сторона Контракту, яка за цим Контрактом передає основний базовий актив, виражений в іноземній валюті
<b>Покупець</b>	Сторона Контракту, яка за цим Контрактом передає розрахунковий базовий актив, виражений у гривнях
<b>Центральний контрагент</b>	Публічне акціонерне товариство «РОЗРАХУНКОВИЙ ЦЕНТР З ОБСЛУГОВУВАННЯ ДОГОВОРІВ НА ФІНАНСОВИХ РИНКАХ»

Терміни, прямо не вказані в цій Специфікації, розуміються відповідно до законодавства України, Правил торгівлі та Правил клірингу.

## **2. Загальні положення**

- 2.1. Ця Специфікація є типовими умовами договору відповідно до частини 1 статті 630 Цивільного кодексу України та підлягає оприлюдненню на Веб сайті Оператора.
- 2.2. Контракт складається з двох взаємопов'язаних частин: першої частини Контракту та другої частини Контракту:
  - за першою частиною у день укладення Контракту Продавець зобов'язаний передати Покупцю визначену Контрактом кількість основного базового активу, вираженого в іноземній валюті, а Покупець – передати Продавцю визначену першою частиною Контракту кількість розрахункового базового активу, вираженого у гривнях;
  - за другою частиною у визначений Контрактом день Продавець зобов'язаний передати Покупцю ту саму кількість основного базового активу, вираженого в іноземній валюті, яка була передана за першою частиною Контракту, а Покупець зобов'язаний передати Продавцю визначену другою частиною Контракту кількість розрахункового базового активу, вираженого у гривнях.
- 2.3. Контракт укладається Сторонами у порядку, визначеному Правилами торгівлі, з дотриманням вимог валютного законодавства, зокрема з урахуванням обмежень, встановлених Національним банком України. Центральний контрагент відповідно до Закону України «Про валюту та валютні операції» здійснює безпосередній нагляд за виконанням вимог валютного законодавства під час проведення ним валютних операцій при укладенні та виконанні Контракту.
- 2.4. Реквізити Учасника торгів, що уклав Контракт, містяться в Переліку членів Оператора, який веде Оператор.
- 2.5. Тип Контракту – поставний.
- 2.6. Базові активи Контракту – іноземна валюта та гривні.
- 2.7. Контракт укладається відповідно до параметрів Контракту, список яких затверджений Оператором перед запровадженням Торгів (надалі - Список параметрів) у відповідності до затверджених Центральним контрагентом параметрів Системи управління ризиками згідно з Правилами клірингу.

У Списку параметрів Контракту визначена іноземна валюта, яка є основним базовим активом відповідно до встановленого Центральним контрагентом переліку іноземних валют, які можуть бути основним базовим активом деривативного контракту.
- 2.8. Сторони Контракту мають право за взаємною згодою сторін розірвати укладений Контракт до виконання першої частини Контракту, а також змінити дату виконання та суму другої частини Контракту.
- 2.9. Ціною Контракту є відповідність кількості базового активу, вираженого у гривнях, одиниці базового активу, вираженого в іноземній валюті. Ціна першої та другої частин Контракту вказується в гривнях за одиницю іноземної валюти.

## **3. Зобов'язання за Контрактом**

- 3.1. Сторони Контракту зобов'язані дотримуватись Правил клірингу.
- 3.2. Порядок виконання (припинення) зобов'язань за Контрактом визначається Правилами клірингу.

- 3.3. Часткове виконання зобов'язань за Контрактом не допускається.
- 3.4. Для виконання своїх зобов'язань за Контрактом станом на момент, визначений Правилами клірингу, кожна зі Сторін Контракту зобов'язана забезпечити наявність на відповідному кліринговому рахунку / субрахунку визначеної відповідно до Правил клірингу кількості клірингових активів щодо коштів:
- за першою частиною Контракту у день укладення Контракту;
  - за другою частиною Контракту – у визначений Контрактом день.
- 3.5. Зобов'язання сторін за Контрактом припиняються одним з наступних шляхів:
- відповідно до статті 599 Цивільного кодексу України виконанням сторонами своїх зобов'язань за Контрактом, або
  - відповідно до статті 604 Цивільного кодексу України стягненням Центральним контрагентом штрафу (у вигляді коштів та/або цінних паперів) з Гарантійного забезпечення винної сторони Контракту на користь Центрального контрагента, або
  - відповідно до статті 604 Цивільного кодексу України сплатою Центральним контрагентом штрафу (у вигляді коштів та/або цінних паперів) на користь добросовісної сторони Контракту.
- 3.6. Центральний контрагент виконує свої зобов'язання за Контрактом перед добросовісною стороною відповідно до умов такого Контракту або передає їй активи в якості штрафу в розмірі, строки, порядку та за рахунок активів, що визначені Правилами клірингу.
- 3.7. Винною стороною є Сторона Контракту, яка не виконала свої зобов'язання за Контрактом або яка не виконала маржинальну вимогу Центрального контрагента, або яка є неплатоспроможною, або якщо неплатоспроможним є клієнт сторони Контракту, в інтересах якого укладений Контракт. Центральний контрагент припиняє зобов'язання сторін Контракту, в тому числі добросовісної сторони, та сплачує добросовісній стороні штраф, в розмірі, визначеному Правилами клірингу.
- 3.8. У разі припинення Центральним контрагентом зобов'язань за першою та другою частинами Контракту в результаті процедури примусового припинення зобов'язань та/або процедури ліквідаційного неттінгу з винної сторони стягується та сплачується добросовісній стороні штраф в розмірі, що дорівнює базовій частині забезпечення за Контрактом.
- У разі припинення Центральним контрагентом зобов'язань за другою частиною Контракту в результаті процедури примусового припинення зобов'язань та/або процедури ліквідаційного неттінгу розмір штрафу визначається наступним чином:
- 1) штраф, який стягується з винної сторони, яка є Продавцем за другою частиною Контракту, та сплачується добросовісній стороні, дорівнює базовій частині забезпечення, збільшеній на розмір додаткової частини забезпечення за Контрактом;
  - 2) штраф, який стягується з винної сторони, яка є Покупцем за другою частиною Контракту, та сплачується добросовісній стороні, дорівнює базовій частині забезпечення збільшеній на розмір модулю від'ємного значення додаткової частини забезпечення за відповідним Контрактом.
- При цьому, якщо визначений розмір штрафу є більшим за розмір штрафу, який був би визначений за припинення відповідного зобов'язання в попередній операційний день, то з винної сторони стягується та сплачується добросовісній стороні штраф у розмірі, визначеному для попереднього операційного дня.

#### **4. Відповідальність сторін**

- 4.1. Сторони несуть відповідальність за невиконання або неналежне виконання зобов'язань за Контрактом відповідно до Правил торгівлі та Правил клірингу.
- 4.2. У разі припинення Центральним контрагентом зобов'язань за Контрактом шляхом стягнення штрафу з Гарантійного забезпечення винної сторони на користь Центрального контрагента або сплати Центральним контрагентом штрафу на користь добросовісної сторони, сторони Контракту не мають права на відшкодування будь-яких збитків, завданих таким припиненням зобов'язань сторін Контракту.

#### **5. Внесення змін та доповнень до Специфікації**

- 5.1. Для внесення змін та доповнення до цієї Специфікації Оператор зобов'язаний погодити зміни з Центральним контрагентом та Національним банком України, а також зареєструвати такі зміни в Національній комісії з цінних паперів та фондового ринку.
- 5.2. Зміни та доповнення до Специфікації набирають чинності після погодження з Центральним контрагентом та Національним банком України, а також реєстрації в Національній комісії з цінних паперів та фондового ринку з моменту вступу в дію Специфікації, що містить вказані зміни та доповнення.
- 5.3. Інформація про вступ в дію Специфікації, що містить зміни та доповнення, оприлюднюється шляхом публікації на Веб-сайті Оператора не менш ніж за 1 (один) Торговельний день до вступу її в дію.
- 5.4. З моменту вступу в дію Специфікації, що містить зміни та доповнення, умови існуючих зобов'язань за раніше укладеними Контрактами вважаються зміненими з врахуванням таких змін та доповнень.