



Правління Національного банку України
ПОСТАНОВА

04 жовтня 2021 року

м. Київ

№ 99

Про затвердження Змін до Положення про проведення Національним банком України на міжбанківському ринку операцій своп процентної ставки

Відповідно до частини четвертої статті 6, пункту 1 статті 7, пунктів 1 та 2 частини першої статті 9, частини другої статті 13, статті 15, пункту 2 статті 25, статей 27, 56 Закону України “Про Національний банк України”, пункту 4 частини другої статті 66 Закону України “Про банки і банківську діяльність”, з метою вдосконалення механізму проведення операцій своп процентної ставки Правління Національного банку України **постановляє**:

1. Затвердити Зміни до Положення про проведення Національним банком України на міжбанківському ринку операцій своп процентної ставки, затвердженого постановою Правління Національного банку України від 28 травня 2020 року № 67 (зі змінами) (далі – Зміни), що додаються.

2. Банкам України до 15 лютого 2022 року забезпечити:

1) відкриття окремих рахунків банку в Національному банку України як рахунків для сплати доходу та інших виплат за облігаціями внутрішньої державної позики України (далі – окремі рахунки банку в Національному банку);

2) унесення до анкети рахунку в цінних паперах інформації про відкриті окремі рахунки банку в Національному банку;

3) приведення генеральних договорів про проведення операцій своп процентної ставки у відповідність до Змін шляхом укладання додаткових договорів до них. Операції своп процентної ставки, які були проведені до набрання чинності Змінами, уважати такими, що проведені з урахуванням Змін з моменту їх унесення до генеральних договорів про проведення операцій своп процентної ставки.

3. Департаменту відкритих ринків (Олексій Лупін) після офіційного опублікування довести до відома банків України інформацію про прийняття цієї постанови.

4. Постанова набирає чинності з дня, наступного за днем її офіційного опублікування, крім пунктів 6, 7, 9, 10, пункту 11, абзацу четвертого пункту 15, абзаців третього – одинадцятого, тринадцятого – двадцять четвертого, тридцять другого, тридцять третього, тридцять п'ятого – тридцять сьомого, сорокового – сорок третього підпункту 1, абзаців третього, четвертого підпункту 3 пункту 17 Змін, які набирають чинності з 15 лютого 2022 року.

Голова

Кирило ШЕВЧЕНКО

Інд. 40

ЗАТВЕРДЖЕНО
Постанова Правління
Національного банку України
04 жовтня 2021 року № 99

Зміни до Положення про проведення Національним банком України на міжбанківському ринку операцій своп процентної ставки

1. У підпункті 5 пункту 3 слова “розрахунку суми” замінити словами “обчислення суми”.

2. Друге речення абзацу другого пункту 8 виключити.

3. Пункт 9 після підпункту 1 доповнити новим підпунктом 1¹ такого змісту:
“1¹) подання Національному банку списку осіб, уповноважених на підписання повідомлень та заявок за операціями своп процентної ставки від імені банку, оформленого відповідно до інформації про повноваження підписантів документів банку (додаток 3), та оформлені в установленому законодавством України порядку документи, що підтверджують їх повноваження. Особам, уповноваженим подавати документи за допомогою засобів програмно-технологічного забезпечення Національного банку, присвоюються ідентифікатори ключів електронних підписів Національного банку;”.

4. Пункт 10 викласти в такій редакції:

“10. До гарантійного фонду можуть включатися:

1) облігації внутрішньої державної позики України, номіновані в гривні та доларах США (далі – облігації внутрішньої державної позики України), включаючи майнові права на майбутні надходження грошових коштів у національній та/або іноземній валюті як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України, що входять до складу гарантійного фонду, на окремі рахунки банку в Національному банку (далі – майнові права на майбутні надходження грошових коштів), та/або

2) національна валюта, та/або

3) іноземна валюта (долари США), та/або

4) грошові кошти в національній та/або іноземній валюті, що перераховані як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України, майнові права на майбутні надходження за якими були включені до гарантійного фонду відповідно до підпункту 1 пункту 10 цього Положення (далі – грошові надходження).”.

5. Пункт 16 після слів “Національного банку” доповнити словами “за допомогою програмно-технологічного забезпечення”.

6. Пункт 17 викласти в такій редакції:

“17. Банк, що має намір провести операцію своєї процентної ставки та планує формувати гарантійний фонд із використанням облігацій внутрішньої державної позики України, зобов’язаний відкрити:

1) рахунок у цінних паперах власника (депонента) у Національному банку (за умови, що такий рахунок не був відкритий раніше), що провадить депозитарну діяльність депозитарної установи (далі – депозитарна установа Національного банку);

2) окремі рахунки банку в Національному банку для зарахування грошових коштів у національній та/або іноземній валюті, що перераховані як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України (далі – окремі рахунки банку в Національному банку).

Банк уносить до анкети рахунку в цінних паперах інформацію про відкриті окремі рахунки банку в Національному банку як рахунки для сплати доходу та/або погашення за облігаціями внутрішньої державної позики України.

Банк надає згоду на перерахування коштів у національній та/або іноземній валюті як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України, що входять до гарантійного фонду, на окремі рахунки банку в Національному банку та на те, що зміна інформації про відкриті окремі рахунки банку в Національному банку, зазначеної в анкеті рахунку в цінних паперах, не допускається.”.

7. Положення після пункту 18 доповнити новим пунктом 18¹ такого змісту:

“18¹. Грошові надходження мають бути розміщені на окремих рахунках банку в Національному банку як забезпечення виконання зобов’язань перед Національним банком за операціями своєї процентної ставки без сплати процентів за розміщення таких коштів.”.

8. Пункт 21 викласти в такій редакції:

“21. Активи (майно), які формують гарантійний фонд, починають ураховуватися у вартості гарантійного покриття з моменту:

1) блокування облігацій внутрішньої державної позики України на користь Національного банку в системі депозитарного обліку депозитарної установи Національного банку та їх обтяження в Державному реєстрі обтяжень рухомого майна, включаючи майнові права на майбутні надходження грошових коштів;

2) розміщення банком національної та іноземної валюти на рахунках Національного банку як гарантійного покриття для забезпечення належного виконання зобов'язань банку перед Національним банком за операціями своп процентної ставки (без реєстрації обтяження в Державному реєстрі обтяжень рухомого майна);

3) розміщення грошових надходжень, що перераховані як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України, на окремих рахунках банку в Національному банку (без реєстрації обтяження в Державному реєстрі обтяжень рухомого майна).”.

9. У пункті 23 цифри і слово “10 робочих” замінити цифрами і словом “45 календарних”.

10. У пункті 24:

1) цифри і слово “10 робочих” замінити цифрами і словом “45 календарних”;

2) пункт доповнити новим абзацом такого змісту:

“Депозитарна установа Національного банку на підставі укладеного договору з банком до моменту розблокування облігацій внутрішньої державної позики України (припинення зобов'язань щодо застави майнових прав на майбутні надходження грошових коштів) забезпечує перерахування грошових надходжень на окремі рахунки банку в Національному банку.”.

11. Пункт 25 викласти в такій редакції:

“25. Національний банк виключає облігації внутрішньої державної позики України з гарантійного фонду в день їх погашення та зараховує кошти від їх погашення та/або дохід за ними на окремі рахунки банку в Національному банку.”.

12. Пункт 27 після слів “надсилає банку” доповнити словами “засобами програмно-технологічного забезпечення”.

13. Пункт 32 доповнити новим абзацом такого змісту:

“Банк має право протягом дня подати іншу заявку з пропозицією на включення/виключення активів (майна) та/або заміну активів (майна) у гарантійному фонді в разі автоматичного відхилення заявки на включення активів (майна), що є предметом застави/гарантійного покриття, до гарантійного фонду/виключення активів (майна), що є предметом застави/гарантійного покриття, з гарантійного фонду.”.

14. В абзаці першому пункту 42 слова “, порядок визначення якої встановлюється Національним банком,” виключити.

15. Пункти 51, 53, 58 викласти в такій редакції:

“51. Суми платежів обчислюються у визначені дати розрахунку платежів за формулою розрахунку суми платежів, що наведена в додатку 10 до цього Положення. Якщо дата розрахунку платежу припадає на неробочий/вихідний день, то вона переноситься на наступний робочий день.”;

“53. Розрахунки за обчисленими платежами проводяться в національній валюті України на дати платежів.”;

“58. Національний банк та банк мають право ініціювати розірвання Генерального договору про проведення операцій своп процентної ставки (додаток 2) після виконання банком та Національним банком зобов’язань за всіма укладеними операціями своп процентної ставки. Банк має право отримати активи (майно), що складають гарантійний фонд, після виконання ним зобов’язань за всіма укладеними операціями своп процентної ставки (шляхом отримання на свої рахунки національної валюти та/або іноземної валюти та/або грошових коштів у національній та/або іноземній валюті як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України, за якими майнові права на майбутні надходження грошових коштів були передані в заставу та включені до гарантійного фонду, та які надійшли на окремі рахунки банку в Національному банку та/або розблокування облігацій внутрішньої державної позики України в системі депозитарного обліку).”.

16. Абзац четвертий підпункту 5 пункту 59 викласти в такій редакції:

“за облігаціями внутрішньої державної позики України – звернути стягнення на облігації внутрішньої державної позики України, які є предметом застави, у судовому порядку та/або позасудовому порядку шляхом надання Національним банком як заставодержателем розпорядження депозитарній установі Національного банку та/або здійснення інших заходів із реалізації та/або набуття їх у власність з дотриманням вимог законодавства України, включаючи законодавство з питань провадження депозитарної та клірингової діяльності, та/або задовольнити вимоги за рахунок грошових надходжень;”.

17. У додатках до Положення:

1) у додатку 2:

у розділі I:

пункти 9, 17 викласти в такій редакції:

“9. Банк з метою зниження ризиків невиконання або несвоєчасного виконання зобов’язань за операціями своп процентної ставки до початку проведення такої операції формує/поповнює гарантійний фонд активами (майном), що надаються Банком як застава/гарантійне покриття: облігації

внутрішньої державної позики України, включаючи майнові права на майбутні надходження грошових коштів у національній та/або іноземній валюті як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України, що входять до складу гарантійного фонду, які зараховуються на окремі рахунки Банку в Національному банку, та/або національна валюта, та/або іноземна валюта (долари США).

Грошові кошти в національній та/або іноземній валюті, що перераховані як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України, майнові права на майбутні надходження за якими були включені/включаються до гарантійного фонду, що надаються Банком як застава/гарантійне покриття, розміщуються на окремому рахунку Банку в Національному банку № ____.

Майнові права Банку на майбутні надходження грошових коштів у національній та/або іноземній валюті, що перераховані як сплата доходу та/або погашення заставлених цінних паперів, виникають на підставі умов розміщення відповідних облігацій внутрішньої державної позики України. Боржником по відношенню до Банку за такими зобов'язаннями є Міністерство фінансів України.”;

“17. Банк, що має намір провести операцію своп процентної ставки та планує формувати гарантійний фонд з використанням облігацій внутрішньої державної позики України, повинен завчасно відкрити:

1) рахунок у цінних паперах власника (депонента) у Національному банку (за умови що такий рахунок не був відкритий раніше), що провадить депозитарну діяльність депозитарної установи (далі – депозитарна установа Національного банку);

2) окремі рахунки Банку в Національному банку для зарахування грошових коштів у національній та/або іноземній валюті, що перераховані як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України, майнові права на майбутні надходження за якими були включені до гарантійного фонду відповідно до абзацу другого пункту 10 Положення (далі – окремі рахунки Банку в Національному банку).

Банк уносить до анкети рахунку в цінних паперах інформацію про відкриті окремі рахунки Банку в Національному банку.

Банк надає згоду на перерахування коштів у національній та/або іноземній валюті як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України, що входять до гарантійного фонду, на окремі рахунки Банку в Національному банку та на те, що зміна інформації про відкриті окремі рахунки Банку в Національному банку, зазначеної в анкеті рахунку в цінних паперах, не допускається.”;

абзац перший пункту 21 після слова “розміщуються” доповнити словом “Банком”;

пункти 22, 24 викласти в такій редакції:

“22. Активи (майно), які формують гарантійний фонд, починають ураховуватись у вартості гарантійного покриття з моменту:

1) блокування облігацій внутрішньої державної позики України на користь Національного банку в системі депозитарного обліку депозитарної установи Національного банку та їх обтяження в Державному реєстрі обтяжень рухомого майна, включаючи майнові права на майбутні надходження грошових коштів;

2) розміщення Банком національної та іноземної валюти на рахунках Національного банку як гарантійне покриття для забезпечення належного виконання зобов'язань Банку перед Національним банком за всіма операціями своп процентної ставки (без реєстрації обтяження в Державному реєстрі обтяжень рухомого майна);

3) розміщення грошових надходжень, що перераховані як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України на окремих рахунках Банку в Національному банку (без реєстрації обтяження в Державному реєстрі обтяжень рухомого майна).”;

“24. Облігації внутрішньої державної позики України за 45 календарних днів до настання строку їх погашення не враховуються у вартості гарантійного фонду.”;

у пункті 25:

цифри і слово “10 робочих” замінити цифрами і словом “45 календарних”;

пункт доповнити новим абзацом такого змісту:

“Депозитарна установа Національного банку на підставі укладеного договору з Банком до моменту розблокування облігацій внутрішньої державної позики України (припинення зобов'язань щодо застави майнових прав на майбутні надходження грошових коштів) забезпечує перерахування грошових коштів у національній та/або іноземній валюті як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України, що входять до гарантійного фонду, на окремі рахунки Банку в Національному банку.”;

пункт 26 викласти в такій редакції:

“26. Національний банк виключає облігації внутрішньої державної позики України з гарантійного фонду в день їх погашення та направляє кошти від їх погашення та/або дохід за ними на окремі рахунки Банку в Національному банку.”;

у пункті 30:

в абзаці першому слово “розраховуються” замінити словом “обчислюються”;

в абзаці четвертому слово “цього договору” замінити словами “цього договору”;

у розділі II:

у пункті 36:

пункт після підпункту 2 доповнити трьома новими підпунктами 2¹–2³ такого змісту:

“2¹) забезпечити Банк доступом до програмно-технологічного забезпечення, яке супроводжуватиме проведення операцій своєї процентної ставки, відповідно до вимог цього договору, у тому числі здійснюватиме в автоматизованому режимі розрахунок справедливої вартості заставлених активів (майна), що формують гарантійний фонд, відповідно до розпорядчого акта Національного банку з питань визначення справедливої вартості активів (майна);

2²) відкрити Банку рахунок у цінних паперах у системі депозитарного обліку депозитарної установи Національного банку (за умови, що такий рахунок не був відкритий раніше), на підставі отриманих від Банку документів щодо відкриття рахунку в цінних паперах та укладеного договору про обслуговування рахунку в цінних паперах відповідно до вимог нормативно-правових актів Національного банку, у тому числі з питань депозитарної діяльності, та внести до анкети рахунку в цінних паперах інформацію про відкриті окремі рахунки Банку в Національному банку;

2³) відкрити окремі рахунки Банку в Національному банку для зарахування грошових коштів у національній та/або іноземній валюті як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України;”;

перше речення підпункту 4 після слова “розблокувати” доповнити словом “/переказати”;

у пункті 37:

абзац четвертий підпункту 7 викласти в такій редакції:

“за облігаціями внутрішньої державної позики України – здійснити звернення стягнення на облігації внутрішньої державної позики України, які є предметом застави, у судовому порядку та/або позасудовому порядку шляхом надання Національним банком як заставодержателем розпорядження депозитарній установі Національного банку та/або здійснення інших заходів із реалізації та/або набуття їх у власність з дотриманням вимог законодавства України, включаючи законодавство з питань провадження депозитарної та клірингової діяльності, та/або задоволення вимог за рахунок грошових коштів на окремих рахунках Банку в Національному банку;”;

пункт після підпункту 11 доповнити новим підпунктом 12 такого змісту:

“12) блокувати в автоматичному режимі та/або примусово повноваження, надані уповноваженим особам, у разі закінчення строку їх дії або їх дострокового припинення (відповідними правочинами за повідомленням Банку), або строку дії сертифіката ключа;”;

у пункті 38:

пункт після підпункту 1 доповнити двома новими підпунктами 1¹, 1² такого змісту:

“1¹) відкрити окремі рахунки Банку в Національному банку для зарахування грошових коштів у національній та/або іноземній валюті як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України;

1²) відкрити рахунок у цінних паперах власника (депонента) у Національному банку (за умови, що такий рахунок не був відкритий раніше), що провадить депозитарну діяльність депозитарної установи та внести до анкети рахунку в цінних паперах інформацію про відкриті окремі рахунки Банку в Національному банку та не ініціювати внесення змін щодо реквізитів цих рахунків протягом строку дії цього договору;”;

підпункти 3, 6 пункту 39 викласти в такій редакції:

“3) здійснювати за допомогою засобів програмно-технологічного забезпечення Національного банку включення та/або виключення, та/або заміну активів (майна), що формують гарантійний фонд, один раз на день. Заявки на включення та/або виключення, та/або заміну активів (майна), що формують гарантійний фонд, подані після визначеного в пункті 32 Положення часу, опрацьовуються не пізніше наступного робочого дня. Перевірка поданих заявок у такому разі здійснюється за справедливою вартістю коригуючими коефіцієнтами та курсом валюти, що встановлені на день опрацювання заявки;”;

“6) отримати активи (майно), що складають гарантійний фонд, після виконання ним зобов'язань за всіма укладеними операціями своп процентної ставки (шляхом отримання на свої рахунки національної валюти та/або іноземної валюти, та/або грошових коштів у національній та/або іноземній валюті як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України, за якими майнові права на майбутні надходження грошових коштів були передані в заставу/гарантійний фонд, та які надійшли на окремі рахунки Банку в Національному банку та/або розблокування облігацій внутрішньої державної позики України в системі депозитарного обліку).”;

абзац перший пункту 50¹ розділу IV викласти в такій редакції:

“50¹. Банк подає Національному банку список осіб, уповноважених на підписання повідомлень та заявок за операціями своп процентної ставки від імені Банку, оформлений за зразком, наведеним у додатку 3 до Положення, та оформлені в установленому законодавством України порядку документи, що підтверджують їх повноваження.”;

таблицю “Інформація щодо повноважень підписантів документів банку” та “Пояснення щодо заповнення таблиці” виключити;

2) Положення після додатка 2 доповнити новим додатком 3 такого змісту:

“Додаток 3

до Положення про проведення Національним банком України на міжбанківському ринку операцій своп процентної ставки (підпункт 1¹ пункту 9)

Інформація про повноваження підписантів документів банку

№ з/п	Інформація щодо обмежень на укладання правочинів представниками банку; документ (назва, номер і дата), згідно з яким накладено обмеження повноважень особи		Обмеження щодо суми правочину (сума операцій процентного свопу і сума гарантійного фонду)		Обмеження щодо суми правочину на операцію процентного свопу		Обмеження щодо суми правочину на формування гарантійного фонду		Строк дії повноважень на зазначені обмеження
			сума окремого правочину (валюта)	загальна сума правочинів (валюта)	сума окремого правочину (валюта)	загальна сума правочинів (валюта)	сума окремого правочину (валюта)	загальна сума правочинів (валюта)	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
1	Посада, прізвище, ім'я, по батькові особи	Довіреність № _____ від _____.2020 р.							
2		Статут (ост. ред. від...)							

Продовження додатка 3
Продовження таблиці

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
3		... рішення, протокол							
4	Посада, прізви- ще, ім'я, по батько- ві особи	Довіреність №_____від_____.2020 р.							
5		Статут (ост. ред. від...)							
6		... рішення, протокол							
7	Загальне обмеження щодо загальних сум правочинів з боку банку на всіх уповноважених осіб		X	...	X		X		X

Назва посади, найменування банку

Підпис

Ім'я ПРІЗВИЩЕ

Пояснення щодо заповнення таблиці

1. У колонках 4, 5, 6, 7, 8, 9 зазначаються обмеження відповідно до документів, що їх встановлюють (наприклад: 1 000 000,00 грн/інша валюта, або 10% статутного капіталу), без виокремлення видів активів у гарантійному фонді. Якщо немає обмеження, то поле не заповнюється.

2. У рядку 7 зазначається обмеження відповідно до документів, що їх установлюють (наприклад: 1 000 000,00 грн/інша валюта, або 10% статутного капіталу), без виокремлення видів активів у гарантійному фонді. Якщо немає обмеження, то поле не заповнюється.”.

У зв'язку з цим додатки 3–10 уважати відповідно додатками 4–11;

3) у додатку 4:

у пункті 1:

абзац третій підпункту 4 викласти в такій редакції:

“для облігацій внутрішньої державної позики України, включаючи майнові права на майбутні надходження грошових коштів у національній та/або іноземній валюті як сплата доходу та/або погашення заставлених облігацій внутрішньої державної позики України, що входять до складу гарантійного фонду, на окремі рахунки банку в Національному банку, зазначаються міжнародний ідентифікаційний номер цінних паперів, кількість цінних паперів, номінальна вартість (валюта розміщення), справедлива вартість, коригуючий коефіцієнт і дата погашення;”;

підпункт 5 доповнити словами “(цифрами та словами)”;

примітку 1 викласти в такій редакції:

“¹Подається в будь-який робочий день тижня до 15.00 (у п'ятницю та передсвяткові дні – до 14.00) за допомогою засобів програмно-технологічного забезпечення до проведення операції своп процентної ставки.”;

4) підпункт 2 пункту 1 додатка 6 викласти в такій редакції:

“2) номер заявки, якщо засоби проведення аукціону (програмно-технологічного забезпечення або електронної торговельної системи) надають можливість присвоєння заявці номера;”;

5) підпункти 3–5 пункту 1 додатка 7 після слів “ аукціону, номер заявки” доповнити словами “, якщо заявка банку мала такий номер;”;

6) підпункт 5 пункту 1 додатка 8 виключити;

7) підпункт 2 пункту 1 додатка 9 доповнити словами “, якщо заявка банку мала такий номер”;

8) в абзаці п'ятому додатка 10 цифри “10” замінити цифрами “11”.

18. У тексті Положення та додатках до Положення:

1) слова “внутрішніх державних позик” замінити словами “внутрішньої державної позики”;

2) посилання на додатки 3–10 замінити посиланнями відповідно на додатки 4–11.