



Правління Національного банку України
ПОСТАНОВА

18 червня 2020 року

м. Київ

№ 76

Про внесення 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, статті 27, статті 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 22 травня 2020 року № 67, що додаються.

2. Департаменту відкритих ринків (Сергій Пономаренко) після офіційного опублікування довести до відома банків України інформацію про прийняття цієї постанови.

3. Контроль за виконанням цієї постанови покласти на заступника Голови Національного банку України Олега Чурія.

4. Постанова набирає чинності з дня, наступного за днем її офіційного опублікування.

Голова

Яків СМОЛІЙ

Інд. 40

ЗАТВЕРДЖЕНО
Постанова Правління
Національного банку України
18 червня 2020 року № 76

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

1. Пункт 2 доповнити словами “, які є похідними фінансовими інструментами (деривативами)”.

2. У підпункті 10 пункту 3 слова та літери “Українського індексу міжбанківських ставок за категорією “кредити та депозити” зі строком овернайт (далі – UIR)” замінити відповідно словами та літерами “Українського індексу міжбанківських ставок овернайт (далі – UONIA)”.

3. Абзац другий пункту 8 замінити двома новими абзацами такого змісту:
“Документи, що подаються до Національного банку в електронній формі засобами електронної пошти Національного банку, підписуються кваліфікованими електронними підписами осіб, які уповноважені на підписання цих документів від імені банку. Документи в електронній формі, підписані кваліфікованим електронним підписом, до переходу банку на єдиний формат електронної взаємодії можуть подаватися засобами програмного комплексу АРМ-НБУ-інформаційний без необхідності додаткового подання таких документів у паперовій формі.

Документи, що подаються до Національного банку в електронній формі за допомогою програмно-технологічного забезпечення, підписуються електронними підписами Національного банку осіб, які уповноважені на підписання цих документів від імені банку. Банк під час обміну повідомленнями з використанням електронних торговельних систем та/або надсилання до Національного банку SWIFT-повідомлення є відповідальним за те, що відправлення таких повідомлень здійснюється виключно уповноваженими банком особами.”.

4. У підпункті 1 пункту 14 слово “технічний” виключити.

5. У пункті 52 літери “UIR” замінити літерами “UONIA”.

6. У додатку 2:

1) пункт 6 доповнити новим абзацом такого змісту:

“З метою визначення повноважень представників Сторін за цим договором Сторони визначили, що максимальна умовна сума за цим договором містить (крім загальної суми умовних сум операції своп процентної ставки за

всіма діючими та невиконаними угодами з Національним банком) загальну суму активів (майна), включених до гарантійного фонду.”;

2) пункт 31 викласти в такій редакції:

“31. Плаваюча процентна ставка протягом строку операції змінюється відповідно до змін UONIA та розраховується за такою формулою:

$$I_t = \left(\prod_{i=1}^n \left[1 + \frac{UONIA_i \cdot d_i}{365 \cdot 100\%} \right] - 1 \right) \cdot \frac{365}{n} \cdot 100\%$$

де: I_t – плаваюча процентна ставка;

$i=1$ – дата аукціону або попередня дата розрахунку платежу;

$UONIA_i$ – значення UONIA, розраховане за день (i);

d_i – кількість календарних днів від дня (i) до наступного робочого дня, визначена таким чином, щоб сума d_i для (i) від 1 до n_0 дорівнювала n;

n_0 – кількість робочих днів від дати аукціону (або попередньої дати розрахунку платежу) до дати розрахунку платежу за операцією своп процентної ставки (дата розрахунку платежу не включається);

n – кількість календарних днів від дати аукціону (або попередньої дати розрахунку платежу) до дати розрахунку платежу за операцією своп процентної ставки (дата розрахунку платежу не включається).

Плаваюча процентна ставка розраховується у відсотках з точністю до двох знаків після коми.”;

3) додаток після пункту 50 доповнити новим пунктом 50¹ такого змісту:

“50¹. Банк подає Національному банку список осіб, уповноважених на підписання повідомлень та заявок за операціями своп процентної ставки, оформлений відповідно до таблиці додатка 2, та оформлені в установленому законодавством України порядку документи, що підтверджують їх повноваження.

Банк на постійній основі у разі будь-яких змін щодо повноважень та підписів уповноважених осіб для підписання повідомлень та заявок Банку не пізніше наступного робочого дня після таких змін, а також щороку протягом місяця після затвердження річної фінансової звітності, забезпечує оновлення списку уповноважених осіб та оформлених у встановленому законодавством України порядку документів, що підтверджують їх повноваження.

Документи, що підтверджують повноваження осіб на підписання повідомлень та заявок за операціями своп процентної ставки, подані до Національного банку, мають містити інформацію щодо обмеження/відсутності обмеження для кожної уповноваженої особи на окрему та/або загальну суму правочинів, що можуть укладатися з Національним банком за операціями своп процентної ставки в межах цього договору.”;

4) додаток доповнити таблицею такого змісту:

“Таблиця

Інформація щодо повноважень підписантів документів банку

№ з/п	Інформація щодо обмежень на укладення 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...)							
3		... рішення, протокол							
4	Посада, прізвище,	Довіреність № ____ від ____ .2020 р.							

Продовження додатка 2
Продовження таблиці

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
	ім'я, по батькові особи								
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, поле не заповнюється.

2. У рядку 7 зазначається 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, поле не заповнюється.”.

7. Додаток 10 викласти в такій редакції:

“Додаток 10
до Положення про проведення
Національним банком України
на міжбанківському ринку операцій
своп процентної ставки
(у редакції постанови Правління
Національного банку України

(пункт 52)

Формула розрахунку плаваючої процентної ставки

$$I_t = \left(\prod_{i=1}^n \left[1 + \frac{UONIA_i \cdot d_i}{365 \cdot 100\%} \right] - 1 \right) \cdot \frac{365}{n} \cdot 100\%$$

де: I_t – плаваюча процентна ставка;

$i=1$ – дата аукціону або попередня дата розрахунку платежу;

$UONIA_i$ – значення UONIA, розраховане за день (i);

d_i – кількість календарних днів від дня (i) до наступного робочого дня, визначена таким чином, щоб сума d_i для (i) від 1 до n_0 дорівнювала n;

n_0 – кількість робочих днів від дати аукціону (або попередньої дати розрахунку платежу) до дати розрахунку платежу за операцією своп процентної ставки (дата розрахунку платежу не включається);

n – кількість календарних днів від дати аукціону (або попередньої дати розрахунку платежу) до дати розрахунку платежу за операцією своп процентної ставки (дата розрахунку платежу не включається).

Плаваюча процентна ставка розраховується у відсотках з точністю до двох знаків після коми.”.

Директор Департаменту
відкритих ринків

Сергій ПОНОМАРЕНКО

ПОГОДЖЕНО

Заступник Голови

Національного банку України

О. ЧУРІЙ

_____ (підпис)

_____ 2020 року

_____ (дата)