



Правління Національного банку України

ПОСТАНОВА

28 травня 2020 року

м. Київ

№ 67

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

Відповідно до частини четвертої статті 6, пункту 3 статті 7, пунктів 1 та 2 частини першої статті 9, частини другої статті 13, статті 15, пункту 1 частини першої статті 42, статті 56 Закону України “Про Національний банк України”, пункту 4 частини другої статті 66 Закону України “Про банки і банківську діяльність”, з метою сприяння розвитку фінансових ринків для поглиблення механізму монетарної трансмісії та підтримки процесів економічного розвитку через розвиток ринку похідних фінансових інструментів (деривативів) та стимулювання на цій основі довгострокового кредитування Правління Національного банку України **постановляє**:

1. Затвердити Положення про проведення Національним банком України на міжбанківському ринку операцій своп процентної ставки, що додається.

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
28 травня 2020 року № 67

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

1. Це Положення розроблено відповідно до частини четвертої статті 6, пункту 3 статті 7, пунктів 1 та 2 частини першої статті 9, частини другої статті 13, статті 15, пункту 1 частини першої статті 42, статті 56 Закону України “Про Національний банк України”, пункту 4 частини другої статті 66 Закону України “Про банки і банківську діяльність”, з метою сприяння розвитку фінансових ринків для поглиблення механізму монетарної трансмісії та підтримки процесів економічного розвитку через розвиток ринку похідних фінансових інструментів (деривативів) та стимулювання на цій основі довгострокового кредитування.

2. Це Положення визначає умови проведення Національним банком України (далі – Національний банк) з банками на міжбанківському ринку операцій своп процентної ставки.

3. Терміни в цьому Положенні вживаються в такому значенні:

1) аукціон з проведення операції своп процентної ставки (далі – аукціон) – комплекс дій, пов’язаних з отриманням Національним банком від банків заявок на проведення операцій своп процентної ставки та подальшим визначенням Національним банком заявок, що підлягають задоволенню згідно з правилами, визначеними у цьому Положенні;

2) гарантійний фонд – сукупність активів (майна), що надаються банком як застава/гарантійне покриття з метою забезпечення ризиків невиконання та/або несвоєчасного виконання зобов’язань за всіма операціями своп процентної ставки;

3) гранична процентна ставка – ставка, яку самостійно визначає Національний банк на підставі заявок банків на участь у ціновому аукціоні операцій своп процентної ставки;

4) дати платежів – наступні робочі дні після дат розрахунку платежів, у які фактично виконуються розрахунки за операцією своп процентної ставки;

5) дати розрахунку платежів – визначені умовами проведення операції своп процентної ставки дати розрахунку суми платежів за такою операцією;

6) електронні торговельні системи (ETC) – Refinitiv, Bloomberg, інші електронні торговельні системи, функціонал яких дає змогу проводити аукціони своп процентної ставки;

7) кількісний аукціон – аукціон, на якому Національний банк пропонує проводити з банками операції своп процентної ставки за оголошеною Національним банком фіксованою процентною ставкою;

8) коригуючий коефіцієнт – коефіцієнт, який визначається Національним банком для кожного активу (майна), що надається банком як застава/гарантійне покриття за операціями своп процентної ставки;

9) операція своп процентної ставки – операція між Національним банком та банком на умовну суму, на визначений період, умови якої передбачають сплату у визначені дати платежів різниці процентних платежів, розрахованих на підставі умовної суми, але за різними процентними ставками, де один платіж розраховується за фіксованою ставкою, а інший – за плаваючою;

10) плаваюча процентна ставка – процентна ставка, яка розраховується залежно від значень Українського індексу міжбанківських ставок за категорією “кредити та депозити” зі строком овернайт (далі – UIR);

11) умовна сума (сума операції) – номінальна сума в національній валюті операції своп процентної ставки, що є основою операції своп процентної ставки для кожного правочину та використовується для розрахунку платежів;

12) фіксована процентна ставка – процентна ставка, яка є незмінною протягом строку операції;

13) ціновий аукціон – аукціон, під час проведення якого банки у своїх заявках до Національного банку зазначають фіксовану процентну ставку, за якою вони погоджуються здійснити операцію своп процентної ставки.

4. Інші терміни та поняття, які вживаються в цьому Положенні, застосовуються в значеннях, визначених законодавством України.

5. Національний банк проводить операції своп процентної ставки з банками шляхом оголошення аукціонів за допомогою власного програмно-технологічного забезпечення (далі – програмно-технологічне забезпечення) або з використанням електронних торговельних систем.

6. Правління Національного банку визначає періодичність, строк, мінімальний/максимальний рівень граничної ставки, обсяги проведення операцій своп процентної ставки та додаткові умови щодо проведення операцій своп процентної ставки після розгляду зазначеного питання Комітетом з монетарної політики Національного банку.

7. Національний банк надсилає банкам повідомлення про проведення аукціону своп процентної ставки (додаток 1) за допомогою електронної пошти Національного банку або програмно-технологічного забезпечення, або з використанням електронних торговельних систем та розміщує таке повідомлення на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку України (далі – Інтернет-представництво).

8. Документи, що подаються банком до Національного банку відповідно до цього Положення, підписуються керівником банку та/або уповноваженою особою банку.

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

9. Умовою для подання банком заявки(ок) на проведення операцій своп процентної ставки є:

1) укладення банком із Національним банком Генерального договору про проведення операцій своп процентної ставки (додаток 2);

2) сформований банком гарантійний фонд, який має забезпечувати всі операції своп процентної ставки, включаючи всі надані заявки на проведення операцій своп процентної ставки.

10. До гарантійного фонду можуть включатися облігації внутрішніх державних позик України та/або національна валюта, та/або іноземна валюта (долари США).

Вартість гарантійного фонду визначається як сума добутків справедливої вартості активів (майна), що формують гарантійний фонд, порядок визначення якої встановлюється Національним банком, та коригуючих коефіцієнтів,

установлених розпорядчим актом Національного банку, що ураховують можливу зміну справедливої вартості активів (майна).

11. Вартість гарантійного фонду повинна бути не меншою, ніж мінімальна вартість гарантійного фонду, збільшена на сумарну справедливу вартість усіх операцій своп процентної ставки, якщо сумарна справедлива вартість усіх операцій своп процентної ставки, розрахована з позиції Національного банку, є позитивною.

12. Сумарна справедлива вартість усіх операцій своп процентної ставки розраховується Національним банком як сума справедливої вартості діючих між банком та Національним банком операцій своп процентної ставки, розрахована із позиції Національного банку відповідно до порядку, який встановлюється Національним банком.

13. Мінімальна вартість гарантійного фонду розраховується як сума добутків умовних сум усіх операцій своп процентної ставки (з урахуванням поданих заявок) та встановленого в процентному співвідношенні розміру покриття операцій своп процентної ставки гарантійним фондом.

14. Національний банк розпорядчими актами має право встановлювати:

1) технічний порядок проведення операцій своп процентної ставки з банками, який передбачає порядок взаємодії підрозділів Національного банку;

2) розмір коригуючих коефіцієнтів за активами (майном), що формують гарантійний фонд;

3) розмір покриття операцій своп процентної ставки гарантійним фондом.

15. Розмір коригуючих коефіцієнтів, який застосовується для активів (майна), що формують гарантійний фонд, змінюється щодня.

16. Банк, що має намір провести операцію своп процентної ставки, має сформувати гарантійний фонд шляхом подання до Національного банку 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 (додаток 3).

17. Банк, що має намір провести операцію своп процентної ставки та планує формувати гарантійний фонд із використанням облігацій внутрішніх державних позик України, зобов'язаний відкрити рахунок у цінних паперах власника (депонента) у Національному банку, що провадить депозитарну

діяльність депозитарної установи (далі – депозитарна установа Національного банку).

18. Облігації внутрішніх державних позик України, що використовуються для формування гарантійного фонду, мають перебувати у власності банку на рахунку в цінних паперах, відкритому в депозитарній установі Національного банку, та на момент їх врахування до гарантійного фонду не бути обтяженими будь-якими зобов'язаннями.

19. Обслуговування операцій з облігаціями внутрішніх державних позик України, які включаються до гарантійного фонду, а також їх облік здійснюється виключно депозитарною установою Національного банку в порядку, визначеному нормативно-правовими та розпорядчими актами Національного банку з питань депозитарної та клірингової діяльності.

20. Національна та іноземна валюти, що формують гарантійний фонд, розміщуються на рахунках Національного банку як гарантійне покриття без сплати процентів за таким гарантійним покриттям.

Підтвердженням перерахування банком коштів в іноземній валюті є отримане Національним банком SWIFT-повідомлення, на підставі якого Національний банк зараховує іноземну валюту на рахунок Національного банку.

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

1) обтяження облігацій внутрішніх державних позик України в Державному реєстрі обтяжень рухомого майна та їх блокування на користь Національного банку в системі депозитарного обліку депозитарної установи Національного банку;

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 всіма операціями своєї процентної ставки.

22. Блокування/обтяження облігацій внутрішніх державних позик України на користь Національного банку в системі депозитарного обліку депозитарної установи Національного банку здійснюється на підставі розпорядження банку, Генерального договору про проведення операцій своєї процентної ставки, 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 (додаток 3) та повідомлення про задоволення/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 (додаток 4).

23. Облігації внутрішніх державних позик України за 10 робочих днів до настання строку їх погашення не враховуються у вартості гарантійного фонду.

24. Облігації внутрішніх державних позик України, погашення номінальної вартості яких здійснюється окремими частинами згідно з графіком їх погашення, за 10 робочих днів до погашення наступної частини номінальної вартості починають враховуватись у вартості гарантійного фонду за справедливою вартістю з урахуванням коригуючих коефіцієнтів без урахування тієї частини номінальної вартості, яка сплачуватиметься емітентом у найближчу дату погашення згідно з умовами їх випуску.

25. Національний банк виключає облігації внутрішніх державних позик України з гарантійного фонду в день їх погашення.

26. Банк один раз на день має право здійснювати включення та/або виключення, та/або заміну активів (майна), що формують гарантійний фонд.

27. Національний банк перевіряє запропоновані банком активи (майно) щодо їх відповідності вимогам цього Положення в разі отримання пропозиції банку на включення активів (майна) до гарантійного фонду та надсилає банку повідомлення про задоволення/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 (додаток 4).

28. Банк здійснює переказ облігацій внутрішніх державних позик України на завчасно відкритий рахунок у депозитарній установі Національного банку в разі отримання повідомлення про задоволення заявки на включення активів (майна), що є предметом застави/гарантійного покриття, до гарантійного фонду.

29. Банк має право протягом дня подати іншу заявку з пропозицією включення інших активів (майна), що є предметом застави/гарантійного покриття, до гарантійного фонду в разі відхилення заявки банку з пропозицією на включення активів (майна), що є предметом застави/гарантійного покриття, до гарантійного фонду.

30. Банк має право виключати з гарантійного фонду активи (майно), що є предметом застави/гарантійного покриття, якщо вартість гарантійного фонду є більшою, ніж мінімальна вартість гарантійного фонду, збільшена на сумарну вартість усіх операцій своп процентної ставки, якщо сумарна вартість усіх

операцій своп процентної ставки, розрахована з позиції Національного банку, є позитивною (у сумі перевищення над мінімальною вартістю гарантійного фонду, збільшеною на позитивну сумарну вартість усіх операцій своп процентної ставки) шляхом подання до Національного банку 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 та відповідних депозитарних розпоряджень.

31. Розблокування/зняття обтяження облігацій внутрішніх державних позик України, що були заблоковані на користь Національного банку, здійснюється в системі депозитарного обліку депозитарної установи Національного банку у випадках, передбачених цим Положенням, на підставі розпорядження Національного банку, Генерального договору про проведення операцій своп процентної ставки та 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 (додаток 3) та повідомлення про задоволення/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 (додаток 4). Водночас банк надає згоду на розблокування/зняття обтяження облігацій внутрішніх державних позик України в системі депозитарного обліку депозитарною установою Національного банку за розпорядженням Національного банку як заставодержателя без надання окремого розпорядження банком.

32. Національний банк приймає 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 будь-якого робочого дня тижня до 15.00 (у п'ятницю та передсвяткові дні – до 14.00). Заявки, подані до встановленого пунктом 32 цього Положення часу, опрацьовуються в цей робочий день. Заявки, подані після визначеного часу, опрацьовуються не пізніше наступного робочого дня. Перевірка поданих заявок у такому разі здійснюється за справедливою вартістю, коригуючими коефіцієнтами та курсами валют, що встановлені на день опрацювання заявки.

33. Національний банк щодня розраховує справедливу вартість кожної операції своп процентної ставки, укладеної відповідно до норм цього Положення, з позиції Національного банку відповідно до розпорядчих актів Національного банку з питань визначення справедливої вартості.

Національний банк доводить до відома банків інформацію щодо справедливої вартості кожної операції своп щодня за допомогою засобів електронної пошти Національного банку або програмно-технологічного

забезпечення, або шляхом її розміщення на сторінці офіційного Інтернет-представництва.

Розрахована з позиції Національного банку справедлива вартість операції своп процентної ставки може бути як негативною (від'ємною), так і позитивною (додатною).

34. Національний банк виставляє вимогу до банку щодо поповнення гарантійного фонду, якщо вартість гарантійного фонду не відповідає вимогам пункту 11 цього Положення. Банк протягом трьох робочих днів із дня отримання такої вимоги зобов'язаний поповнити гарантійний фонд.

35. Національний банк здійснює з банками операції своп процентної ставки шляхом проведення кількісного або цінового аукціону.

36. Банк у день проведення аукціону подає заявку на участь в аукціоні своп процентної ставки (додаток 5) з використанням засобів проведення цього аукціону (програмно-технологічного забезпечення або електронної торговельної системи).

Банк має право подати декілька заявок на участь у ціновому аукціоні своп процентної ставки із зазначенням різних процентних ставок.

37. Заявки банків на участь в аукціоні не приймаються до розгляду, якщо банк на момент подання такої заявки не сформував (не поповнив) гарантійний фонд у достатній вартості для забезпечення виконання своїх зобов'язань за всіма операціями своп процентної ставки з урахуванням поданої заявки.

Заявки, які надійшли пізніше визначеного в повідомленні про проведення аукціону своп процентної ставки часу, не приймаються. У разі виникнення в Національному банку причин технічного характеру, що унеможливають подання заявок банками, Національний банк продовжує час прийому заявок.

38. Загальна сума умовних сум операції своп процентної ставки за всіма діючими та невиконаними угодами з Національним банком не може перевищувати розміру максимальної умовної суми операції своп процентної ставки, що визначений Генеральним договором про проведення операцій своп процентної ставки (додаток 2).

39. Національний банк у разі проведення кількісного аукціону без оголошення загального обсягу умовних сум розглядає заявки банків у міру їх надходження.

40. Національний банк у разі проведення кількісного аукціону з оголошенням загального обсягу умовних сум, задовольняє заявки банків:

1) у повному обсязі, якщо оголошений загальний обсяг умовних сум є більшим, ніж загальний обсяг умовних сум, зазначений у заявках банків;

2) пропорційно до поданих банками заявок, якщо оголошений загальний обсяг умовних сум є меншим, ніж загальний обсяг умовних сум, зазначений у заявках банків.

41. Банки в разі проведення цінового аукціону самостійно пропонують фіксовану процентну ставку у відсотках із точністю до двох знаків після коми, за якою вони погоджуються здійснити операцію своп процентної ставки.

Банк, подаючи заявку на участь у ціновому аукціоні, дає згоду на використання для розрахунку платежу фіксованої процентної ставки, яка зазначена в заявці, або нижчої – якщо банк є платником за фіксованою ставкою. Банк дає згоду на використання для розрахунку платежу фіксованої процентної ставки, яка зазначена в заявці, або вищої – якщо банк є отримувачем за фіксованою процентною ставкою.

42. Національний банк на підставі заявок банків на участь у ціновому аукціоні визначає граничну фіксовану процентну ставку для проведення операції своп процентної ставки, порядок визначення якої встановлюється Національним банком, та задовольняє подані заявки банків за одним із методів:

1) за фіксованими процентними ставками, що пропонуються банками (але не вищими/не нижчими, ніж гранична фіксована процентна ставка, залежно від того, платником чи отримувачем фіксованої процентної ставки є Національний банк);

2) за граничною фіксованою процентною ставкою, яка визначається Національним банком під час проведення цінового аукціону та зазначається в повідомленні Національного банку про результати проведення цього аукціону.

43. Задоволення заявок банків за методом фіксованих процентних ставок, що пропонуються банками, здійснюється Національним банком за запропонованими банками фіксованими процентними ставками. Заявки задовольняються, починаючи з найвищої запропонованої банками фіксованої процентної ставки, якщо Національний банк є отримувачем фіксованої процентної ставки, або з найнижчої запропонованої банками фіксованої процентної ставки, якщо Національний банк є платником фіксованої процентної ставки.

44. Задоволення заявок банків за методом граничної фіксованої процентної ставки здійснюється за визначеною Національним банком граничною фіксованою процентною ставкою, починаючи із заявки з найнижчою запропонованою банками фіксованою процентною ставкою, якщо

Національний банк є платником фіксованої процентної ставки або починаючи із заявки з найвищою запропонованою банками фіксованою процентною ставкою, якщо Національний банк є отримувачем фіксованої процентної ставки.

45. Заявки банків не задовольняються, якщо банк запропонував фіксовану процентну ставку, яка є:

1) вищою, ніж гранична фіксована процентна ставка, якщо Національний банк є платником фіксованої процентної ставки;

2) нижчою, ніж гранична фіксована процентна ставка, якщо Національний банк є отримувачем фіксованої процентної ставки.

46. Заявки банків у разі проведення цінового аукціону з оголошенням загального обсягу умовних сум задовольняються Національним банком до вичерпання оголошеного загального обсягу умовних сум та/або досягнення граничної фіксованої процентної ставки.

47. Заявки банків, які подані на участь у ціновому аукціоні без оголошення загального обсягу умовних сум, задовольняються Національним банком у повному обсязі за фіксованою процентною ставкою, яка є:

1) нижчою або дорівнює граничній фіксованій процентній ставці, якщо Національний банк є платником фіксованої процентної ставки;

2) вищою або дорівнює граничній фіксованій процентній ставці, якщо Національний банк є отримувачем фіксованої процентної ставки.

48. Задоволення заявок на участь у ціновому аукціоні з однаковою фіксованою процентною ставкою або граничною фіксованою процентною ставкою здійснюється Національним банком пропорційно до поданих банками заявок, якщо оголошений Національним банком обсяг умовних сум менший, ніж обсяг умовних сум, зазначених у заявках банків.

49. Національний банк надсилає банкам повідомлення про результати розгляду заявок на участь в аукціоні своп процентної ставки (додаток б).

Результати проведеного аукціону своп процентної ставки розміщуються на сторінці офіційного Інтернет-представництва.

50. Національний банк та банк у разі проведення операції своп процентної ставки з використанням електронних торговельних систем обмінюються повідомленнями, які підтверджують укладення угоди своп процентної ставки. Банк надсилає до Національного банку повідомлення про

укладення угоди своп процентної ставки (додаток 7), а Національний банк надсилає до банку повідомлення про підтвердження укладення угоди своп процентної ставки (додаток 8). Обмін повідомленнями відбувається у спосіб, передбачений у Генеральному договорі про проведення операцій своп процентної ставки.

51. Суми платежів розраховуються у визначені дати розрахунку платежів за формулою розрахунку суми платежів, що наведена в додатку 9 до цього Положення.

52. Плаваюча процентна ставка змінюється відповідно до змін UPR та розраховується за формулою розрахунку плаваючої процентної ставки, що наведена в додатку 10 до цього Положення.

53. Розрахунки проводяться в національній валюті України на дати платежів. Якщо дата розрахунку платежу припадає на неробочий/вихідний день, то вона переноситься на наступний робочий день.

54. Національний банк або банк як сторона Генерального договору про проведення операцій своп процентної ставки (додаток 2), яка є платником за фіксованою ставкою, на дату платежу сплачує на користь іншої сторони суму платежу, якщо сума, розрахована відповідно до пункту 51 цього Положення, має додатне значення.

55. Національний банк або банк як сторона Генерального договору про проведення операцій своп процентної ставки (додаток 2), яка є отримувачем за фіксованою ставкою, на дату платежу сплачує на користь іншої сторони суму платежу, якщо сума, розрахована відповідно до пункту 51 цього Положення, має від'ємне значення.

56. Сплата платежу не відбувається, якщо сума платежу, розрахована відповідно до пункту 51 цього Положення, дорівнює нулю.

57. Банк має право звернутися до Національного банку щодо дострокового припинення операції своп процентної ставки за згодою сторін. Розрахунки за операцією своп процентної ставки в разі дострокового її припинення здійснюються за домовленістю сторін відповідно до рішення, прийнятого Правлінням Національного банку після розгляду Комітетом з управління активами і пасивами Національного банку.

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 розблокування облігацій внутрішніх державних позик України в системі депозитарного обліку).

59. Національний банк у разі несплати банком платежу за операцією своп процентної ставки протягом трьох робочих днів після дати платежу або невиконання банком вимоги Національного банку щодо поповнення гарантійного фонду протягом трьох робочих днів із дня отримання такої вимоги:

- 1) достроково припиняє всі діючі операції своп процентної ставки;
- 2) нараховує пеню від суми невиконаного банком за кожен день невиконання зобов'язання в розмірі подвійної облікової ставки Національного банку, що діяла в період її нарахування;
- 3) розраховує справедливую вартість усіх діючих операцій своп процентної ставки з урахуванням штрафних санкцій, що застосовуються до банку відповідно до підпункту 2 пункту 59 цього Положення;
- 4) повертає/розблоковує банку активи (майно), що формують гарантійний фонд, якщо сума справедливої вартості діючих операцій своп процентної ставки є негативною (від'ємною) з позиції Національного банку. Сплата цієї суми на користь банку не відбувається;
- 5) має право за рахунок активів (майна), що формують гарантійний фонд, у розмірі суми справедливої вартості діючих операцій своп процентної ставки, включаючи невиконанні банком зобов'язання та нараховані штрафні санкції, якщо ця сума є позитивною (додатною) з позиції Національного банку:
 - за національною валютою – залишити таку суму за собою;
 - за іноземною валютою – продати або залишити таку суму за собою за офіційним курсом гривні до іноземних валют (з округленням до більшого цілого);
 - за облігаціями внутрішніх державних позик України – здійснити звернення стягнення на облігації внутрішніх державних позик України, які є предметом застави, у позасудовому порядку шляхом надання Національним банком як застагодержателем розпорядження депозитарній установі Національного банку та/або здійснення інших заходів із реалізації та/або переведення у власність, та/або отримання виплат за ними (купон, погашення номінальної, індексованої вартості, інші виплати, передбачені умовами випуску облігацій внутрішніх державних позик України) та/або залишення їх за собою з

дотриманням вимог законодавства України з питань провадження депозитарної та клірингової діяльності;

б) не допускає банк до участі в аукціонах протягом наступних шести календарних місяців.

60. Національний банк має право в разі погіршення фінансового стану банку, а також отримання іншої суттєвої негативної інформації щодо діяльності банку, що несе загрозу невиконання зобов'язань перед Національним банком, ужити заходів, передбачених підпунктами 1, 3–5 пункту 59 цього Положення, та розірвати в односторонньому порядку Генеральний договір про проведення операцій своп процентної ставки після вжиття заходів, передбачених підпунктами 1, 3–5 пункту 59 цього Положення.

61. Національний банк має право в разі віднесення банку до категорії неплатоспроможних розірвати в односторонньому порядку Генеральний договір про проведення операцій своп процентної ставки та вжити заходів, передбачених підпунктами 1, 3, 4 пункту 59 цього Положення.

62. Банк є відповідальним за достовірність наданої банком відповідно до цього Положення інформації та відповідність її вимогам законодавства України, а також за повноваження осіб, які підписують усі документи, що подаються банком до Національного банку відповідно до цього Положення.

Директор Департаменту
відкритих ринків

Сергій ПОНОМАРЕНКО

ПОГОДЖЕНО

Заступник Голови

Національного банку України

О.ЧУРІЙ

_____ (підпис)

_____ 2020 року

_____ (дата)

Додаток 1
до Положення про проведення
Національним банком України на
міжбанківському ринку операцій своп
процентної ставки
(пункт 7)

Система “ _____ ”

Повідомлення № ____ від _____ 20 ____ року
про проведення аукціону своп процентної ставки

Відповідно до Положення про проведення Національним банком України на міжбанківському ринку операцій своп процентної ставки від _____ 20 ____ року № ____ Національний банк України оголошує проведення _____ аукціону своп процентної ставки (далі – аукціон).
(порядковий номер)

1. Вид аукціону (кількісний або ціновий) _____.
2. Остання дата розрахунку платежів _____.
3. Дати розрахунку платежів _____.
4. Метод задоволення заявок банків _____
(за фіксованими процентними ставками, що пропонуються банками/за граничною фіксованою процентною ставкою)¹.
5. Фіксована процентна ставка _____ %².
6. Мінімальна умовна сума операції _____ грн.
7. Загальний обсяг умовної суми _____ грн³.
8. Національний банк є _____ фіксованої процентної ставки.
(платник чи отримувач)
9. Додаткові умови _____.
10. Розмір фіксованої процентної ставки має пропонуватися банком у відсотках із точністю до двох знаків після коми⁴.
11. Заявки на участь у проведенні цього аукціону потрібно подати в електронному вигляді за допомогою програмно-технологічного забезпечення

або з використанням електронних торговельних систем до ____ години _____ 20__.

12. Повідомлення про задоволення заявок із зазначенням умовної суми операції надсилається в міру розгляду та перевірки заявок банків⁵.

13. Повідомлення про результати розгляду заявок буде надіслано до ____ години _____ 20__⁶.

14. Це повідомлення є невід'ємною частиною Генерального договору про проведення операцій своп процентної ставки № _____ від _____ 20__ року.

¹ Заповнюється в разі проведення цінового аукціону.

² Заповнюється в разі проведення кількісного аукціону.

³ Заповнюється в разі її оголошення.

⁴ Зазначається в разі проведення цінового аукціону.

⁵ Зазначається в разі проведення кількісного аукціону без оголошення загального обсягу.

⁶ Зазначається в разі проведення кількісного аукціону з оголошенням загального обсягу та цінового аукціону.

Додаток 2
до Положення про проведення
Національним банком України на
міжбанківському ринку операцій своп
процентної ставки
(підпункт 1 пункту 9)

Генеральний договір
про проведення операцій своп процентної ставки¹

м. _____

Національний банк України в особі _____
(посада, прізвище, ім'я, по батькові)
(далі – Національний банк), який діє на підставі _____,
(назва документа, який засвідчує право підпису)

та банк _____
(найменування банку)

в особі _____ (далі – Банк), який діє на
підставі _____ (посада, прізвище, ім'я, по батькові)

підставі _____ (далі – Сторони), з метою
встановлення взаємовідносин Сторін щодо проведення операцій своп процентної
ставки відповідно до Положення про проведення Національним банком України
на міжбанківському ринку операцій своп процентної ставки (далі – Положення)
уклали цей Генеральний договір про проведення операцій своп процентної
ставки (далі – договір) про таке.

Національний банк за цим договором діє як сторона операцій своп
процентної ставки, заставодержателя та депозитарної установи, що здійснює
обслуговування депозитарних операцій за цим договором.

I. Предмет договору

1. Предметом цього договору є загальні умови здійснення Національним
банком на міжбанківському ринку операцій своп процентної ставки з банками.

2. Сторони проводять операції своп процентної ставки за допомогою
програмно-технологічного забезпечення Національного банку (далі –
програмно-технологічне забезпечення) або з використанням електронних
торговельних систем, функціонал яких дає змогу проводити аукціони своп
процентної ставки.

3. Національний банк у разі проведення аукціонів своп процентної ставки за допомогою засобів програмно-технологічного забезпечення в автоматизованому режимі використовує засоби захисту інформації Національного банку.

4. Сторони в разі проведення операції своп процентної ставки з використанням електронних торговельних систем обмінюються повідомленнями, які підтверджують укладення цього договору. Обмін повідомленнями відбувається за допомогою системи електронного документообігу Національного банку або системи SWIFT або інших міжбанківських систем передавання інформації.

5. Невід'ємними частинами цього договору є:

1) заявка 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 (додаток 3 до Положення);

2) повідомлення про задоволення/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 (додаток 4 до Положення);

3) повідомлення Національного банку про проведення аукціону своп процентної ставки (додаток 1 до Положення);

4) заявка Банку на участь в аукціоні своп процентної ставки (додаток 5 до Положення);

5) повідомлення Національного банку про результати розгляду заявок Банку на участь в аукціоні своп процентної ставки (додаток 6 до Положення);

6) повідомлення Банку про укладення угоди своп процентної ставки (додаток 7 до Положення);

7) повідомлення про підтвердження укладення угоди своп процентної ставки (додаток 8 до Положення).

6. Максимальна умовна сума за цим договором становить _____ грн.

Умовна сума є основою операції для кожного правочину.

Продовження додатка 2

Загальна сума умовних сум операції своп процентної ставки за всіма діючими та невиконаними угодами з Національним банком не може перевищувати розмір максимальної умовної суми операції своп процентної ставки, що визначений договором.

7. Відповідно до цього договору Банк бере участь у проведенні операцій своп процентної ставки згідно з вимогами законодавства України, нормативно-правових та розпорядчих актів Національного банку.

8. Документи, що подаються відповідно до цього договору, підписуються керівником Банку та/або уповноваженою особою.

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

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 внутрішніх державних позик України та/або національна валюта, та/або іноземна валюта (долари США)].

10. Вартість гарантійного фонду визначається як сума добутків справедливої вартості активів (майна), що формують гарантійний фонд, порядок визначення якої встановлюється Національним банком, та коригуючих коефіцієнтів, установлених розпорядчим актом Національного банку.

11. Вартість гарантійного фонду має забезпечувати всі операції своп процентної ставки з урахуванням усіх наданих заявок на участь в операціях своп процентної ставки.

Продовження додатка 2

12. Вартість гарантійного фонду повинна бути не меншою, ніж мінімальна вартість гарантійного фонду, збільшена на сумарну справедливу вартість всіх операцій своп процентної ставки, якщо сумарна справедлива вартість всіх операцій своп процентної ставки, розрахована з позиції Національного банку, є позитивною.

13. Сумарна справедлива вартість всіх операцій своп процентної ставки розраховується Національним банком як сума справедливої вартості діючих між Банком і Національним банком операцій своп процентної ставки, розрахованих з позиції Національного банку відповідно до порядку, який встановлюється Національним банком.

14. Мінімальна вартість гарантійного фонду розраховується як сума добутків умовних сум усіх операцій своп процентної ставки (з урахуванням поданих заявок) та встановленому в процентному співвідношенні розміру покриття операцій своп процентної ставки гарантійним фондом.

15. Національний банк розпорядчими актами встановлює:

1) розмір коригуючих коефіцієнтів за активами (майном), що формують гарантійний фонд;

2) розмір покриття операцій своп процентної ставки гарантійним фондом.

16. Розмір коригуючих коефіцієнтів, який застосовується для активів (майна), що формують гарантійний фонд, змінюється щодня.

17. Банк, що має намір провести операцію своп процентної ставки та планує формувати гарантійний фонд з використанням облігацій внутрішніх державних позик, повинен завчасно відкрити рахунок у цінних паперах власника (депонента) в Національному банку, що провадить депозитарну діяльність депозитарної установи (далі – депозитарна установа Національного банку).

18. Облігації внутрішніх державних позик України, що використовуються для формування гарантійного фонду, мають перебувати у власності Банку на рахунку в цінних паперах, відкритому в депозитарній установі Національного банку, та на момент їх врахування до гарантійного фонду не бути обтяженими будь-якими зобов'язаннями.

Продовження додатка 2

19. Обслуговування операцій з облігаціями внутрішніх державних позик України, які включаються до гарантійного фонду, а також їх облік, здійснюються виключно в депозитарній установі Національного банку в порядку, визначеному нормативно-правовими та розпорядчими актами з питань депозитарної та клірингової діяльності Національного банку.

20. Банк здійснює переказ облігацій внутрішніх державних позик України на завчасно відкритий рахунок у депозитарній установі Національного банку в разі отримання повідомлення про задоволення заявки на включення активів (майна), що є предметом застави/гарантійного покриття, до гарантійного фонду.

21. Національна валюта та іноземна валюта, що формують гарантійний фонд, розміщуються на рахунках Національного банку як гарантійне покриття без сплати процентів за таким гарантійним покриттям.

Підтвердженням перерахування Банком коштів в іноземній валюті є отримане Національним банком SWIFT-повідомлення, на підставі якого Національний банк зараховує іноземну валюту на рахунок Національного банку.

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

1) обтяження облігацій внутрішніх державних позик України в Державному реєстрі обтяжень рухомого майна та їх блокування на користь Національного банку в системі депозитарного обліку депозитарної установи Національного банку;

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 своєї процентної ставки.

23. Блокування/обтяження облігацій внутрішніх державних позик України на користь Національного банку в системі депозитарного обліку депозитарної установи Національного банку здійснюється на підставі розпорядження Банку, договору, 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

(додаток 3 до Положення) та повідомлення про задоволення/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 (додаток 4 до Положення).

24. Облігації внутрішніх державних позик України за 10 робочих днів до настання строку їх погашення не враховуються у вартості гарантійного фонду.

25. Облігації внутрішніх державних позик України, погашення номінальної вартості яких здійснюється окремими частинами згідно з графіком їх погашення, за 10 робочих днів до погашення наступної частини номінальної вартості починають враховуватись у вартості гарантійного фонду за справедливою вартістю з урахуванням коригуючих коефіцієнтів без урахування тієї частини номінальної вартості, яка сплачуватиметься емітентом у найближчу дату погашення згідно з умовами їх випуску.

26. Національний банк виключає облігації внутрішніх державних позик України з гарантійного фонду в день їх погашення.

27. Розблокування/зняття обтяження облігацій внутрішніх державних позик України, що були заблоковані на користь Національного банку за договором, здійснюється в системі депозитарного обліку депозитарної установи Національного банку у випадках, передбачених Положенням, на підставі розпорядження Національного банку, договору, 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 (додаток 3 до Положення) та повідомлення про задоволення/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 (додаток 4 до Положення). Водночас Банк цим договором надає згоду на розблокування/зняття обтяження облігацій внутрішніх державних позик України в системі депозитарного обліку депозитарною установою Національного банку за розпорядженням Національного банку як заставодержателя без надання окремого розпорядження Банком.

28. Національний банк щодня розраховує справедливу вартість кожної операції своп процентної ставки з позиції Національного банку та сумарну справедливу вартість діючих операцій своп процентної ставки для кожного Банку відповідно до розпорядчих актів Національного банку з питань визначення справедливої вартості.

29. Національний банк виставляє вимогу до Банку щодо поповнення гарантійного фонду, якщо вартість гарантійного фонду не відповідає вимогам пункту 11 цього договору.

30. Суми платежів розраховуються у визначені дати розрахунку платежів за такою формулою:

$$R = \frac{N \cdot (I_f - I_t) \cdot n}{365 \cdot 100\%},$$

де: R – сума платежу;

N – умовна сума операції своп процентної ставки;

I_f – фіксована процентна ставка (зазначається в заявці Банку на участь в аукціоні, визначається за результатами аукціону та повідомляється Банку в повідомленні про результати розгляду його заявки та оголошується Національним банком у повідомленні про проведення аукціону в разі проведення кількісного аукціону);

I_t – плаваюча процентна ставка (розрахована відповідно до пункту 31 цього договору);

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

31. Плаваюча процентна ставка протягом строку операції змінюється відповідно до змін українського індексу міжбанківських ставок (UIIR) та розраховується за такою формулою:

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

де: I_t – плаваюча процентна ставка;

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

$UIIR_i$ – Українській індекс міжбанківських ставок за категорією “кредити та депозити” зі строком овернайт, розрахований за день (i);

d_i – кількість календарних днів від дня (i) до наступного робочого дня, таким чином, щоб сума d_i для i від 1 до n_0 мала дорівнювати 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).

Якщо за день (i) UIR_i не був розрахований, то значення UIR_i для цього дня прирівнюється до попереднього розрахованого значення.

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

32. Розрахунки за операціями своп процентної ставки здійснюються у національній валюті України на дати платежів. Якщо дата розрахунку платежу припадає на неробочий/вихідний день, вона переноситься на наступний робочий день.

33. Сторона, яка є платником за фіксованою ставкою, на дату платежу сплачує на користь іншої Сторони суму платежу, якщо сума, розрахована відповідно до пункту 30 цього договору, має додатне значення.

34. Сторона, яка є отримувачем за фіксованою ставкою, на дату платежу сплачує на користь іншої Сторони суму платежу, якщо сума, розрахована відповідно до пункту 30 цього договору, має від'ємне значення.

35. Сплата платежу не відбувається, якщо сума платежу, розрахована відповідно до пункту 30 цього договору, дорівнює нулю.

II. Зобов'язання та права Сторін

36. Національний банк зобов'язується:

1) повідомляти Банк про проведення операцій своп процентної ставки шляхом розміщення відповідного повідомлення на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку України та за допомогою засобів програмно-технологічного забезпечення Національного банку (у разі проведення Національним банком аукціону своп процентної ставки) або з використанням електронних торговельних систем;

2) надсилати Банку повідомлення про результати розгляду його заявок на участь в аукціоні своп процентної ставки;

3) сплачувати на дати платежів на користь Банку суми платежів, розрахованих відповідно до умов цього договору;

Продовження додатка 2

4) повернути/розблокувати Банку активи (майно), що формують гарантійний фонд, якщо сума справедливої вартості діючих операцій своп є негативною (від'ємною) з позиції Національного банку, у разі несплати Банком платежу за операцією своп процентної ставки протягом трьох робочих днів після дати платежу або невиконання Банком вимоги Національного банку щодо поповнення гарантійного фонду протягом трьох робочих днів із дня отримання такої вимоги. При цьому сплата суми справедливої вартості на користь Банку не відбувається;

5) розміщувати на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку та підтримувати в актуальному стані анкету Національного банку як заставодержателя та картку зі зразками підписів заставодержателя, а також документи, що підтверджують повноваження осіб, які мають право підпису від імені заставодержателя, для використання зазначених документів заставодавцями та депозитарною установою Національного банку;

6) забезпечувати точне виконання своїх зобов'язань як депозитарної установи, передбачених цим договором та законодавством України.

37. Національний банк має право:

1) визначати в повідомленнях про проведення операцій своп процентної ставки умови їх проведення;

2) не приймати до розгляду заявки Банку на участь в аукціонах своп процентної ставки, якщо Банк на момент подання таких заявок не сформував (не поповнив) гарантійний фонд у достатній вартості для забезпечення виконання своїх зобов'язань за діючими операціями своп процентної ставки, з урахуванням наданих заявок;

3) виставляти Банку вимогу щодо поповнення гарантійного фонду, якщо різниця між вартістю гарантійного фонду та сумарною справедливою вартістю діючих операцій своп процентної ставки є меншою, ніж мінімальна вартість гарантійного фонду;

4) достроково припинити всі діючі операції своп процентної ставки, якщо Банк не виконав платіж за операцією своп процентної ставки протягом трьох робочих днів з дати платежу та/або вимогу Національного банку щодо поповнення гарантійного фонду протягом трьох робочих днів з дня отримання такої вимоги;

Продовження додатка 2

5) не допускати наступні шість календарних місяців Банк до участі в аукціонах своп процентної ставки, якщо Банк не виконав платіж за операцією своп процентної ставки протягом трьох робочих днів з дати платежу та/або вимогу Національного банку щодо поповнення гарантійного фонду протягом трьох робочих днів з дня отримання такої вимоги;

6) нарахувати пеню від суми невиконаного Банком за кожен день зобов'язання в розмірі подвійної облікової ставки Національного банку, що діяла в період її нарахування. Нарахування пені припиняється наступного дня після виконання Банком зобов'язання або після припинення операції своп процентної ставки;

7) у разі несплати Банком платежу за операцією своп процентної ставки протягом трьох робочих днів після дати платежу або невиконання Банком вимоги Національного банку щодо поповнення гарантійного фонду протягом трьох робочих днів з дня отримання такої вимоги за рахунок активів (майна), що формують гарантійний фонд, в розмірі суми справедливої вартості діючих операцій своп процентної ставки, включаючи невиконані Банком зобов'язання та нараховані штрафні санкції, якщо ця сума є позитивною (додатною) з позиції Національного банку:

за національною валютою – залишити таку суму за собою;

за іноземною валютою – продати або залишити таку суму за собою за офіційним курсом гривні до іноземних валют (з округленням до більшого цілого);

за облігаціями внутрішніх державних позик України – здійснити звернення стягнення на облігації внутрішніх державних позик України, які є предметом застави, у позасудовому порядку шляхом надання Національним банком як заставодержателем розпорядження депозитарній установі Національного банку та/або здійснення інших заходів із реалізації та/або переведення у власність, та/або отримання виплат за ними (купон, погашення номінальної, індексованої вартості, інші виплати, передбачені умовами випуску облігацій внутрішніх державних позик України), та/або залишення їх за собою з дотриманням вимог законодавства України з питань провадження депозитарної та клірингової діяльності;

8) повернути Банку активи (майно), що формують гарантійний фонд, та сплатити суму справедливої вартості діючих операцій своп процентної ставки, якщо ця сума є негативною (від'ємною) з позиції Національного банку;

9) достроково припинити операцію своп процентної ставки за згодою Сторін у разі звернення Банку та здійснити розрахунки за цією операцією за домовленістю Сторін;

10) ініціювати розірвання цього договору після виконання зобов'язань за всіма укладеними операціями своп процентної ставки;

11) розірвати цей договір в односторонньому порядку в разі погіршення фінансового стану Банку, а також отримання іншої суттєвої негативної інформації щодо діяльності Банку, що несе загрозу невиконання зобов'язань перед Національним банком, та після повного виконання Сторонами зобов'язань за всіма укладеними операціями своп процентної ставки та вжиття заходів, передбачених підпунктами 4–7 пункту 37 цього договору;

13) розірвати в односторонньому порядку цей договір у разі віднесення Банку до категорії неплатоспроможних та вжити заходів, передбачених підпунктами 4 та 8 пункту 37 цього договору.

38. Банк зобов'язується:

1) дотримуватись умов проведення аукціонів своп процентної ставки;

2) сплачувати в дати платежів на користь Національного банку на рахунок _____ суми платежів, розраховані відповідно до пункту 30 цього договору;

3) повідомити Національний банк після підписання цього договору номер рахунку для перерахування сум платежів;

4) поповнити гарантійний фонд протягом трьох робочих днів після отримання вимоги Національного банку щодо його поповнення, якщо вартість гарантійного фонду не відповідає вимогам пункту 12 цього договору;

5) сплатити пеню від суми невиконаного зобов'язання за кожен день невиконання платежу в розмірі подвійної облікової ставки Національного банку, що діяла в період її нарахування;

6) надавати депозитарній установі Національного банку всі документи та/або депозитарні розпорядження, що передбачені нормативно-правовими актами з депозитарної діяльності, та необхідні для виконання зобов'язань за цим договором;

7) не перешкоджати позасудовому зверненню стягнення на предмет застави за цим договором та/або виконанню інших зобов'язань, передбачених цим договором та нормативно-правовими актами Національного банку, не відкликати та не змінювати документи, подані за цим договором протягом строку дії цього договору, якщо тільки інше не передбачено цим договором;

8) на термін блокування облігацій внутрішніх державних позик не вчиняти будь-яких правочинів стосовно цих цінних паперів, які передбачають їх відчуження (оплатне чи безоплатне), передання цінних паперів у заставу, а також накладення будь-яких інших обтяжень.

39. Банк має право:

1) подавати заявки на участь в аукціонах своп процентної ставки;

2) виключати з гарантійного фонду активи (майно), якщо вартість гарантійного фонду є більшою, ніж мінімальна вартість гарантійного фонду, збільшена на сумарну вартість всіх операцій своп процентної ставки, якщо сумарна вартість усіх операцій своп процентної ставки є позитивною (у сумі перевищення над мінімальною вартістю гарантійного фонду, збільшеною на позитивну сумарну вартість усіх операцій своп процентної ставки);

3) здійснювати включення та/або виключення, та/або заміну активів (майна), що формують гарантійний фонд, один раз на день;

4) ініціювати дострокове припинення операції своп процентної ставки за згодою Сторін;

5) ініціювати розірвання цього договору після виконання зобов'язань за всіма укладеними операціями своп процентної ставки;

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 розблокування облігацій внутрішніх державних позик у системі депозитарного обліку).

III. Відповідальність Сторін

40. Відповідальність Сторін визначається законодавством України, Положенням та умовами цього договору.

41. Відповідальність за достовірність підписів та наявність повноважень осіб, які від імені Банку підписують документи, що є невід'ємними частинами цього договору, покладається на Банк.

42. Банк є відповідальним за достовірність наданої інформації та відповідність її вимогам законодавства України, нормативно-правовим актам Національного банку, а також за повноваження осіб, які підписують усі документи, що подаються банком до Національного банку відповідно до цього договору.

43. Депозитарна установа Національного банку не несе відповідальності за дії або бездіяльність, якщо вони були обумовлені виконанням вимог цього договору, за винятком випадків, коли такі претензії, вимоги, позови, рішення суду та зобов'язання будь-якого виду виникають внаслідок невиконання або неналежного виконання депозитарною установою Національного банку своїх зобов'язань за цим договором.

IV. Інші умови договору

44. Цей договір набирає чинності з дати його підписання уповноваженими представниками Сторін.

45. Кожна із Сторін може достроково розірвати цей договір шляхом надсилання про це письмового повідомлення, якщо на момент надсилання такого повідомлення немає невиконаних Сторонами зобов'язань за цим договором.

46. Спори, що виникають протягом дії цього договору, вирішуються шляхом переговорів, а в разі недосягнення згоди – у встановленому законодавством України порядку.

47. Договір може бути змінено за згодою обох Сторін шляхом укладення додаткового договору, що є невід'ємною частиною цього договору.

48. Взаємовідносини Сторін, не передбачені цим договором, регулюються законодавством України, нормативно-правовими та розпорядчими актами Національного банку.

49. Банк підтверджує, що йому зрозумілий порядок позасудового звернення стягнення на предмет застави у вигляді облігацій внутрішніх державних позик України, у тому числі шляхом набуття їх у власність Національного банку на підставі цього договору, і він погоджується з ним.

50. Кожна Сторона зобов'язується своєчасно вживати всіх заходів, надавати іншим Сторонам всі необхідні документи та інформацію (незважаючи на те, чи вони прямо передбачені або ні в цьому договорі), необхідні для виконання цього договору відповідно до його умов.

51. Кожна зі Сторін цим підтверджує, що:

1) вона має усі передбачені чинним законодавством країни її реєстрації та установчими документами Сторони повноваження укласти цей договір;

2) її представник(и), який(і) підписує(ють) цей договір, має(ють) усі необхідні повноваження відповідно до законодавства, установчих документів Сторони для того, щоб представляти Сторону та укласти від її імені цей договір;

3) не вимагається будь-яких попередніх/подальших схвалень для укладення цього договору; не існує будь-яких обмежень на укладення Стороною [підписання представником(ами) Сторони] цього договору.

52. Цей договір складено у двох оригінальних примірниках, що мають однакову юридичну силу: один – для Національного банку, другий – для Банку.

V. Місцезнаходження та банківські реквізити Сторін

Банк

Національний банк

¹ Цей договір є зразком.

Додаток 3
до Положення про проведення
Національним банком України на
міжбанківському ринку операцій своп
процентної ставки
(пункт 16)

Заявка на включення активів (майна), що є предметом застави/гарантійного покриття, до гарантійного фонду/виключення активів (майна), що є предметом застави/гарантійного покриття, з гарантійного фонду¹

1. Перелік інформації, яка має включатися до заявки:

1) найменування банку;

2) кореспондентський рахунок банку;

3) місцезнаходження банку;

4) перелік активів (майна), які банк надає до гарантійного фонду²:

для національної та іноземної валют зазначається сума, цифровий та літерний коди та номер рахунку банку для перерахування національної/іноземної валюти [у разі виключення активів (майна) з гарантійного фонду];

для облігацій внутрішніх державних позик України зазначаються міжнародний ідентифікаційний номер цінних паперів, кількість цінних паперів, номінальна вартість і дата погашення;

5) загальна сума активів (майна), яку пропонує банк для включення/виключення до/з гарантійного фонду;

6) запевнення щодо чинності документів, які уповноважують особу на підписання заявки;

7) підпис уповноваженої особи банку.

2. Заявка є невід'ємною частиною Генерального договору про проведення операцій своп процентної ставки № _____ від _____ 20__ року.

¹Подається в будь-який робочий день тижня до проведення операції своп процентної ставки.

²Зазначається залежно від виду активів (майна), що надані банком як гарантійне покриття до гарантійного фонду.

Додаток 4
до Положення про проведення
Національним банком України на
міжбанківському ринку операцій своп
процентної ставки
(пункт 22)

Повідомлення про задоволення/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

1. Перелік інформації, яка має включатися до повідомлення:

1) зазначається, яка саме заявка задоволена¹;

2) перелік активів (майна), які включено/виключено до/з гарантійного фонду за операціями своп процентної ставки²:

для національної та іноземної валют зазначається сума валюти, цифровий та літерний коди, коригуючий коефіцієнт та номер рахунку Національного банку для перерахування національної/іноземної валюти;

для облігацій внутрішніх державних позик України зазначаються міжнародний ідентифікаційний номер цінних паперів, кількість цінних паперів, номінальна вартість (валюта розміщення), справедлива вартість, коригуючий коефіцієнт і дата погашення;

3) загальна сума активів (майна), що формують гарантійний фонд банку після задоволення заявки на включення активів (майна) до гарантійного фонду/виключення активів (майна) з гарантійного фонду;

4) причина відмови зазначається в разі незадоволення заявки;

5) підпис уповноваженої особи банку.

2. Повідомлення є невід'ємною частиною Генерального договору про проведення операцій своп процентної ставки № _____ від _____ 20__ року.

¹Заповнюється залежно від прийнятого рішення.

²Зазначається залежно від виду активів (майна), що формують гарантійний фонд.

Додаток 5
до Положення про проведення
Національним банком України на
міжбанківському ринку операцій своп
процентної ставки
(пункт 36)

Заявка на участь в аукціоні своп процентної ставки

1. Перелік інформації, яка має включатися до заявки:

- 1) найменування банку;
- 2) номер заявки;
- 3) розмір умовної суми, яку пропонує банк;
- 4) розмір фіксованої процентної ставки, за якою банк погоджується здійснити операцію своп процентної ставки _____ % (із точністю до двох знаків після коми);
- 5) зазначається платником чи отримувачем фіксованої процентної ставки є банк;
- 6) згода банку на використання для розрахунку платежу фіксованої процентної ставки, яка зазначена в заявці, або нижчої¹;
- 7) згода банку на використання для розрахунку платежу фіксованої процентної ставки, яка зазначена в заявці, або вищої²;
- 8) номер та дата аукціону.

2. Заявка є невід'ємною частиною Генерального договору про проведення операцій своп процентної ставки № _____ від _____ 20__ року.

¹Зазначається в разі проведення цінового аукціону та якщо банк є платником за фіксованою ставкою.

²Зазначається в разі проведення цінового аукціону та якщо банк є отримувачем за фіксованою ставкою.

Додаток 6
до Положення про проведення
Національним банком України на
міжбанківському ринку операцій
своп процентної ставки
(пункт 49)

Повідомлення Національного банку України про результати розгляду
заявок банку на участь в аукціоні своп процентної ставки

1. Перелік інформації, яка має включатися до повідомлення:

- 1) зазначаються дата аукціону та його номер;
- 2) розмір граничної фіксованої процентної ставки, визначеної Національним банком України за результатами аукціону, %.¹;
- 3) перелік задоволених заявок [зазначаються дата аукціону, номер заявки, реєстраційний номер заявки, умовна сума (грн) і процентна ставка];
- 4) перелік частково незадоволених заявок [зазначаються дата аукціону, номер заявки, реєстраційний номер заявки, умовна сума (грн) і процентна ставка];
- 5) перелік незадоволених заявок [зазначаються дата аукціону, номер заявки, реєстраційний номер заявки, умовна сума (грн) і процентна ставка];
- 6) підпис уповноваженої особи банку.

2. Це повідомлення є невід'ємною частиною Генерального договору про проведення операцій своп процентної ставки №__ від _____ 20__ року.

¹Значається в разі задоволення заявок банків за методом граничної фіксованої процентної ставки.

Додаток 7
до Положення про проведення
Національним банком України на
міжбанківському ринку операцій своп
процентної ставки
(пункт 50)

Повідомлення банку про укладення угоди своп процентної ставки

1. Перелік інформації, яка має включатися до повідомлення:

- 1) зазначаються номер та дата аукціону своп процентної ставки;
- 2) умовна сума операції (грн);
- 3) дати розрахунку платежів;
- 4) остання дата розрахунку платежів;
- 5) дати платежів;
- 6) фіксована процентна ставка, %;
- 7) отримувач фіксованої процентної ставки;
- 8) платник фіксованої процентної ставки;
- 9) додаткові умови.

2. Це повідомлення є невід'ємною частиною Генерального договору про проведення операцій своп процентної ставки №__ від _____ 20__ року.

Додаток 8
до Положення про проведення
Національним банком України на
міжбанківському ринку операцій
своп процентної ставки
(пункт 50)

Повідомлення про підтвердження укладення угоди
своп процентної ставки

1. Перелік інформації, яка має бути включена до повідомлення:

- 1) зазначаються номер та дата аукціону своп процентної ставки;
- 2) зазначається номер заявки, яка була задоволена;
- 3) умовна сума операції (грн);
- 4) дати розрахунку платежів;
- 5) остання дата розрахунку платежів;
- 6) дати платежів;
- 7) фіксована процентна ставка, %;
- 8) отримувач фіксованої процентної ставки;
- 9) платник фіксованої процентної ставки;
- 10) додаткові умови.

2. Це повідомлення є невід'ємною частиною Генерального договору про проведення операцій своп процентної ставки №__ від _____ 20__ року.

Додаток 9
до Положення про проведення
Національним банком України
на міжбанківському ринку операцій
своп процентної ставки
(пункт 51)

Формула розрахунку суми платежів

$$R = \frac{N \cdot (If - It) \cdot n}{365 \cdot 100 \%},$$

де: R – сума платежу;

N – умовна сума операції своп процентної ставки;

If – фіксована процентна ставка (зазначається в заявці банку на участь в аукціоні, визначається за результатами аукціону та повідомляється банку в повідомленні про результати розгляду його заявки та оголошується Національним банком України в повідомленні про проведення аукціону в разі проведення кількісного аукціону);

It – плаваюча процентна ставка (розрахована відповідно до додатка 10 до Положення про проведення Національним банком України на міжбанківському ринку операцій своп процентної ставки);

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).

Додаток 10
до Положення про проведення
Національним банком України
на міжбанківському ринку операцій
своп процентної ставки
(пункт 52)

Формула розрахунку плаваючої процентної ставки

$$I_t = \left(\prod_{i=1}^{n_0} \left[1 + \frac{UIIR_i \cdot d_i}{365 \cdot 100\%} \right] - 1 \right) \cdot \frac{365}{n} \cdot 100\%$$

- де: I_t – плаваюча процентна ставка;
- $i=1$ – дата аукціону або попередня дата розрахунку платежу;
- $UIIR_i$ – Український індекс міжбанківських ставок за категорією “кредити та депозити” зі строком овернайт, розрахований за день (i);
- d_i – кількість календарних днів від дня (i) до наступного робочого дня, таким чином, щоб сума d_i для i від 1 до n_0 мала дорівнювати 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).
- Якщо за день (i) $UIIR_i$ не був розрахований, то значення $UIIR_i$ для цього дня прирівнюється до попереднього розрахованого значення.
- Плаваюча процентна ставка розраховується у відсотках з точністю до двох знаків після коми.