



Правління Національного банку України

ПОСТАНОВА

31 березня 2016 року

м. Київ

№ 222

Про затвердження Положення про проведення Національним банком України операцій з купівлі-продажу іноземної валюти на умовах “своп”

Відповідно до вимог статей 7, 15, 25, 42, 44, 45, 56, 71 і 73 Закону України “Про Національний банк України”, статті 6 Декрету Кабінету Міністрів України від 19 лютого 1993 року № 15-93 “Про систему валютного регулювання і валютного контролю”, Положення про порядок та умови торгівлі іноземною валютою, затвердженого постановою Правління Національного банку України від 10 серпня 2005 року № 281, зареєстрованого в Міністерстві юстиції України 29 серпня 2005 року за № 950/11230 (зі змінами), з метою удосконалення порядку застосування Національним банком України окремого інструменту регулювання ліквідності (рефінансування) банківської системи – операцій з купівлі-продажу іноземної валюти на умовах “своп” Правління Національного банку України **постановляє**:

1. Затвердити Положення про проведення Національним банком України операцій з купівлі-продажу іноземної валюти на умовах “своп” (далі – Положення), що додається.

2. Департаменту відкритих ринків (Пономаренко С. В.) довести зміст Положення до відома банків України для використання в роботі.

3. Департаменту відкритих ринків (Пономаренко С. В.), Юридичному департаменту (Заморський О. В.) доопрацювати додаткові угоди до генеральних угод про здійснення операцій на міжбанківському валютному ринку України з контрагентами Національного банку України для здійснення операцій з купівлі-продажу іноземної валюти на умовах “своп” відповідно до вимог Положення.

4. Контроль за виконанням цієї постанови покласти на заступника Голови Національного банку України Чурія О. Є.

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

Голова

В. О. Гонтарева

Інд. 40

ЗАТВЕРДЖЕНО
Постанова Правління
Національного банку України
31 березня 2016 року № 222

Положення про проведення Національним банком України
операцій з купівлі-продажу іноземної валюти на умовах “своп”

I. Загальні положення

1. Це Положення розроблено відповідно до статей 7, 15, 25, 42, 44, 45, 56, 71 і 73 Закону України “Про Національний банк України”, статті 6 Декрету Кабінету Міністрів України “Про систему валютного регулювання і валютного контролю”, Положення про порядок та умови торгівлі іноземною валютою, затвердженого постановою Правління Національного банку України від 10 серпня 2005 року № 281, зареєстрованого в Міністерстві юстиції України 29 серпня 2005 року за № 950/11230 (зі змінами), з метою застосування Національним банком України (далі – Національний банк) окремого інструменту регулювання ліквідності (рефінансування) банківської системи – операцій з купівлі-продажу іноземної валюти на умовах “своп” (далі – операції “своп”).

2. У цьому Положенні терміни вживаються в такому значенні:

1) аукціон “своп” – одна з форм проведення Національним банком операції “своп”;

2) “знижка за ризик (haircut)” – знижка, визначена Національним банком для операції “своп” залежно від терміну проведення операції та волатильності валютної пари, з метою мінімізації втрат Національного банку в разі реалізації кредитного та валютного ризиків. Розмір знижки (окремо за певними характеристиками) затверджується окремим розпорядчим актом Національного банку;

3) неттінг – взаємозалік зустрічних вимог Національного банку та банку по операціях “своп”, що виникають на визначену дату валютування в одній валюті. Розрахунки за неттінгом здійснюються на умовах попередньої оплати;

4) операція “своп” – операція з підтримки ліквідності (рефінансування) між Національним банком та уповноваженим банком з купівлі Національним банком іноземної валюти за гривні з одночасним зобов’язанням

уповноваженого банку здійснити зворотну купівлю цієї іноземної валюти з фіксацією умов цих операцій під час укладення договору;

5) попередня оплата – перерахування Національним банком іноземної валюти/гривні банку виключно після отримання гривні/іноземної валюти від банку.

Інші терміни вживаються в значеннях, визначених законодавством України.

3. Операції “своп” між Національним банком і уповноваженим банком (далі – банк) здійснюються з доларами США та євро.

4. Операція “своп” складається з двох частин: операції з купівлі Національним банком іноземної валюти на умовах “тод”, “том”, “спот” та операції з продажу Національним банком іноземної валюти на умовах “спот” або “форвард”.

5. Операції “своп” між Національним банком і банком здійснюються на строк, що не перевищує 30 календарних днів.

6. Національний банк здійснює з банками першу частину операцій “своп” за офіційним курсом гривні до відповідної іноземної валюти, установленим на день проведення операції, за мінусом “знижки на ризик (haircut)”.

7. Національний банк для здійснення з банками операцій “своп” за кожною заявкою банку розраховує різницю між процентними ставками за коштами в національній валюті та коштами в іноземній валюті [далі – різниця процентних ставок (diff)], яка не може бути нижчою, ніж облікова ставка Національного банку.

Різниця процентних ставок (diff) розраховується за такою формулою:

$$\text{DIFF} = \frac{\text{КФ} - \text{КП}}{\text{КП}} \cdot \frac{365}{\text{Д}} \cdot 100,$$

де КФ – курс “форвард”, запропонований у заявці банку;

КП – офіційний курс гривні до іноземної валюти, установлений Національним банком на день здійснення першої частини операції “своп”, за мінусом “знижки за ризик (haircut)”;

Д – кількість календарних днів між першою та другою частинами операції (перший і останній день операції вважаються одним днем).

8. Обов’язковою умовою для здійснення Національним банком із банком операції “своп” є укладання додаткової угоди про порядок укладання угод “своп” до Генеральної угоди про порядок проведення операцій на міжбанківському валютному ринку України.

9. Національний банк здійснює операції “своп” як шляхом проведення аукціону “своп”, так і за ініціативою банку.

10. Національний банк, ураховуючи ситуацію на грошово-кредитному ринку, може прийняти рішення про проведення операції “своп” шляхом проведення аукціону “своп”. Аукціони “своп” можуть проводитись у формі аукціону на курс “форвард”.

У разі прийняття рішення про проведення аукціону “своп” Національний банк засобами електронної пошти надсилає банкам повідомлення про проведення аукціону “своп” (далі – повідомлення). Умови проведення аукціону “своп” визначає Національний банк у повідомленні.

11. Банк, який має намір узяти участь в аукціоні “своп”, подає заявку на участь в цьому аукціоні на умовах, визначених у повідомленні.

Зазначена заявка подається засобами Системи підтвердження угод на міжбанківському валютному ринку України Національного банку України (далі – Система підтвердження угод) до визначеного в повідомленні часу.

12. Національний банк на підставі всіх поданих на аукціон “своп” заявок, що відповідають умовам проведення аукціону, визначеним у повідомленні, приймає рішення про курс відсікання.

13. На аукціоні “своп” заявки банків задовольняються Національним банком відповідно до зміни запропонованого в них курсу гривні до іноземної валюти (курс “форвард”), починаючи із заявки, в якій за одиницю іноземної валюти пропонується найбільша кількість гривень, і далі поступово до курсу відсікання.

14. Якщо серед заявок банків, які мають бути задоволені за результатами аукціону “своп”, є дві або кілька заявок з однаковим курсом, а обсяг аукціону “своп”, що залишився, недостатній для повного задоволення зазначених заявок, то ці заявки задовольняються пропорційно їх обсягам.

15. Національний банк повідомляє банкам, які брали участь в аукціоні “своп”, курс відсікання аукціону “своп” шляхом розміщення відповідної інформації в торгово-інформаційних системах у термін, визначений у повідомленні.

16. Банк, заявка якого обрана Національним банком для задоволення на аукціоні “своп”, зобов’язаний укласти угоду з Національним банком щодо проведення операції “своп” та підтвердити її засобами Системи підтвердження угод. Така заявка не може бути відкликана.

За порушення вимог цього пункту банк позбавляється права брати участь у трьох наступних аукціонах “своп”.

17. Національний банк здійснює розрахунки за результатами аукціону “своп” з банками, які брали в ньому участь, згідно з умовами повідомлення. Розрахунки здійснюються на умовах попередньої оплати.

18. Національний банк має право оголосити аукціон “своп” таким, що не відбувся.

19. Банк має право ініціювати перед Національним банком проведення операції “своп” шляхом надсилання відповідного звернення засобами електронної пошти, що має містити умови проведення операції “своп”.

Звернення банку, що надійшло до 10 години, розглядається Національним банком в цей самий день. Звернення, що надійшли пізніше зазначеного часу, розглядаються наступного робочого дня.

Національний банк під час прийняття рішення щодо задоволення або відмови в задоволенні такого звернення бере до уваги ситуацію на грошово-кредитному ринку України, стан ліквідності банків, монетарні можливості, інформацію банку щодо умов та необхідності проведення операції “своп”, а також інші чинники (за потреби).

Національний банк повідомляє банк про прийняте рішення засобами електронної пошти.

Банк, звернення якого задоволене Національним банком, укладає угоду з Національним банком щодо проведення операції “своп” та підтверджує її засобами Системи підтвердження угод.

20. Національний банк перераховує кошти в національній валюті за першою частиною операції “своп” виключно на умовах попередньої оплати.

21. Банк під час укладання з Національним банком операції “своп” може повідомити про намір здійснити неттінг за операціями “своп” у разі збігу дати (дат) валютування за укладеною (укладеними) раніше угодою (угодами) із датою валютування за угодою (угодами), яка (які) укладатиметься (укладатимуться).

II. Дострокове припинення операцій “своп”

22. Національний банк має право достроково припинити з банком операції “своп” на умовах, визначених Генеральною угодою про порядок проведення операцій на міжбанківському валютному ринку України.

Причинами дострокового припинення операції “своп” можуть бути:

1) погіршення фінансового стану банку та/або недотримання показників фінансової моделі розвитку банку, а також інша суттєва негативна інформація щодо діяльності банку, що несе загрозу невиконання зобов'язань перед Національним банком;

2) визнання Національним банком структури власності банку непрозорою;

3) виявлення ознак(и) здійснення банком ризикової діяльності у сфері фінансового моніторингу.

23. Національний банк у разі прийняття рішення про дострокове припинення операції “своп” надсилає банку повідомлення, у якому інформує про прийняте рішення та висуває вимогу щодо завершення операції “своп” протягом одного робочого дня.

24. Національний банк у разі дострокового припинення операції “своп” перераховує курс “форвард” за такою формулою:

$$КФ_{\text{новий}} = КП + \left[\frac{КФ - КП}{Д} \right] \cdot Д_{\text{факт}},$$

де КФ – курс “форвард”, що був визначений в укладеній між Національним банком та банком угоді про здійснення операції “своп”;

КП – офіційний курс гривні до іноземної валюти, установлений Національним банком на день здійснення першої частини операції “своп”, за мінусом “знижки за ризик (haircut)”;

Д – кількість календарних днів між першою та другою частинами операції “своп”, що була визначена в угоді про здійснення операції “своп”;

Д_{факт} – фактична кількість календарних днів між першою та другою частинами операції “своп” (перший і останній день операції вважаються одним днем).

25. Банк зобов’язаний наступного робочого дня після отримання повідомлення Національного банку про дострокове припинення операції “своп” внести відповідні зміни щодо цієї операції “своп” до Системи підтвердження угод.

III. Завершення операції “своп”

26. Операція “своп” вважається завершеною з дати:

1) зарахування повного обсягу коштів на рахунки Національного банку та банку відповідно до умов другої частини операції “своп”;

2) проведення нетінгу за другою частиною операції “своп” на умовах, визначених Генеральною угодою про порядок проведення операцій на міжбанківському валютному ринку України, та в разі потреби здійснення розрахунків за результатами такого нетінгу. Для проведення нетінгу банк має

повідомити про те, за якими угодами з Національним банком про проведення операції “своп” на визначену дату валютування пропонується здійснити нетінг.

27. Національний банк перераховує кошти в іноземній валюті за другою частиною операції “своп” виключно на умовах попередньої оплати.

28. Якщо банк не виконує умов операції “своп” більше ніж один робочий день (у тому числі в разі дострокового припинення операції “своп”), то Національний банк має право задовольнити свої вимоги за рахунок коштів в іноземній валюті, що перебувають на його рахунку відповідно до умов першої частини операції “своп”, шляхом зарахування зустрічних однорідних вимог. Національний банк задовольняє свої вимоги за офіційним курсом гривні до іноземної валюти, який діятиме на другий робочий день після дня направлення Національним банком повідомлення про дострокове припинення операції “своп”.

29. Якщо сума коштів в іноземній валюті, які перебувають на рахунку Національного банку відповідно до умов операції “своп” (у гривневому еквіваленті за офіційним валютним курсом, який діятиме на другий робочий день після дня направлення Національним банком повідомлення про дострокове припинення операції “своп”), перевищує суму коштів, необхідних для задоволення вимог Національного банку, то Національний банк перераховує суму перевищення (у гривнях) на кореспондентський рахунок банку.

30. У разі нестачі коштів для завершення операції “своп” Національний банк, керуючись статтею 73 Закону України “Про Національний банк України” застосовує переважне і безумовне право щодо списання коштів в безспірному порядку з рахунків банку.

Директор
Департаменту відкритих ринків

С. В. Пономаренко

ПОГОДЖЕНО
Заступник Голови
Національного банку України
_____ О. Є. Чурій
(підпис)

_____ 2016 року