

Своп договор (контракт)

12. Своп договором (контрактом) признается:

1) договор, предусматривающий:

обязанность стороны или сторон договора периодически и (или) единовременно уплачивать денежные суммы в зависимости от изменения цены (цен) и (или) значения (значений) базисного (базового) актива и (или) наступления обстоятельства, являющегося базисным (базовым) активом; и

определение обязанности каждой из сторон договора уплачивать денежные суммы на основании различных базисных (базовых) активов или различных значений базисного (базового) актива (правил определения значений базисного (базового) актива). При этом обязанность стороны договора уплачивать денежные суммы может определяться на основании фиксированного значения базисного (базового) актива, установленного договором;

2) договор, предусматривающий:

обязанность одной стороны передать валюту в собственность второй стороне и обязанность второй стороны принять и оплатить валюту, а также обязанность второй стороны передать валюту в собственность первой стороне не ранее третьего дня после дня заключения договора и обязанность первой стороны принять и оплатить валюту; и

указание на то, что договор является производным финансовым инструментом; и

обязанность стороны или сторон договора периодически и (или) единовременно уплачивать денежные суммы в зависимости от изменения цены (цен) и (или) значения (значений) базисного (базового) актива и (или) наступления обстоятельства, являющегося базисным (базовым) активом, и (или) от фиксированных в договоре цены (цен) и (или) значения базисного (базового) актива. При этом определение обязанности каждой из сторон договора уплачивать денежные суммы осуществляется в соответствии с условиями договора на основании различных базисных (базовых) активов или различных значений базисного (базового) актива (правил определения значений базисного (базового) актива).

13. Своп договор (контракт), помимо условий, установленных пунктом 12 настоящего Положения, может также предусматривать:

обязанность сторон или стороны своп договора передать другой стороне ценные бумаги, валюту или товар, являющийся базисным (базовым) активом, в том числе путем заключения стороной (сторонами) своп договора и (или) лицом (лицами), в интересах которого (которых) был заключен своп договор, договора купли-продажи ценных бумаг, договора купли-продажи иностранной валюты или договора поставки товара; и (или)

обязанность сторон своп договора (контракта) заключить договор, являющийся производным финансовым инструментом и составляющий базисный (базовый) актив.

14. Своп договор (контракт), предусматривающий обязанности, установленные подпунктом 2 пункта 12 или пунктом 13 настоящего Положения, за исключением обязанности заключить договор, являющийся производным финансовым инструментом, который не предусматривает обязанности передать, купить (продать) или поставить ценные бумаги, валюту или товар, является поставочным договором. Иные своп договоры (контракты) являются расчетными договорами

Источник: Приказ ФСФР России от 04.03.2010 № 10-13/пз-н "Об утверждении Положения о видах производных финансовых инструментов" (Зарегистрировано в Минюсте России 14.04.2010 № 16898)