

ПРИЛОЖЕНИЕ

к Стандартным условиям кредитных производных сделок

Форма Подтверждения для Кредитной производной сделки

[на бланке Стороны А]

[Дата]

Кас.: [Наименование Сделки]

Уважаемый []!

Целью настоящего письма (далее — «*Подтверждение*») является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между [●] (далее — «*Сторона А*») и [●] (далее — «*Сторона Б*») от [●] (далее — «*Генеральное соглашение*»).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий кредитных производных сделок 2015 г. (далее — «*Стандартные условия*»), разработанные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованные в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков. В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.
3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

а) Общие условия:

Дата сделки:	[]
Дата начала срока:	[]
Дата прекращения:	[]
Плательщик плавающей ставки:	[Сторона А][Сторона Б] («Продавец»)
Плательщик фиксированной ставки:	[Сторона А][Сторона Б] («Покупатель»)
Расчетный агент ¹ :	
Местонахождение расчетного агента:	[]
Рабочий день ² :	[]
Условие об окончании срока в нерабочий день:	[Следующий][Предшествующий][Рабочий день в отчетном периоде][Ближайший] (подлежит применению с учетом пунктов

¹ Стороны должны указать лицо, которое будет выступать в качестве Расчетного агента, если они намерены изменить правило пункта 1.29 Стандартных условий о том, что по умолчанию Расчетным агентом выступает Продавец.

² Стороны должны указать город, в котором любой день, в который банки осуществляют банковские операции и другие сделки (в том числе на валютном рынке в соответствии со сложившейся на нем практикой), является Рабочим днем для целей Сделки если они намерены изменить правило пункта 1.27 Стандартных условий о том, что по умолчанию Рабочим днем для целей Сделки является любой Рабочий день в центре валюты, в которой выражена Номинальная сумма для плательщика плавающей ставки.

1.4 и 1.6 Стандартных условий к любой указанной в настоящем Подтверждении дате, которая приходится на день, не являющийся Рабочим днем)³

Контрольное лицо(-а): []

Контрольное обязательство(-а)⁴: []

Обязательство(-а) определяется следующим образом.

Основной должник: []
Гарант/Поручитель: []
Срок погашения: []
Купон: []
CUSIP/ISIN: []

Любые гарантии: [Применимо][Не применимо]

Контрольная цена: [_____ %]⁵

б) Платежи по фиксированной ставке:

Номинальная сумма для плательщика фиксированной ставки: []⁶

Дата окончания расчетного периода фиксированной ставки: []⁷

Дата(-ы) платежа фиксированной суммы: [], [] и [].

Фиксированная ставка: []

Коэффициент для расчета дней в расчетном периоде фиксированной ставки: []⁸

Фиксированная сумма: []

в) Платеж по плавающей ставке

Номинальная сумма для плательщика плавающей ставки: []

Общие условия расчетов: Уведомление о наступлении кредитного события

Уведомляющая сторона: Покупатель [или Продавец]

[Уведомление о расчете поставкой]⁹

³ Стороны должны указать условие, в соответствии с которым определяется день окончания срока, если последний день срока приходится на день, не являющийся Рабочим днем, в случае, если они намерены изменить правило пункта 1.43 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется Условие об окончании срока в нерабочий день «Следующий».

⁴ Указать, если применимо. Контрольное обязательство указывается обязательно, если к Сделке применяется Денежный расчет. Если Контрольное обязательство указано применительно к Сделке, в отношении которой применяется Расчет поставкой, то с учетом второго параграфа пункта 2.19(2)(i) и пункта 2.31(a) и 2.32(a) такое Контрольное обязательство относится к Поставляемому обязательству, даже если в момент Поставки такое обязательство не подпадает под Категорию поставляемого обязательства или не отвечает какому-либо или всем Признакам поставляемых обязательств.

⁵ Стороны должны указать процентное соотношение, составляющее Контрольную цену, если они намерены изменить правило пункта 2.4 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется процентное соотношение, равное ста процентам.

⁶ Стороны должны указать сумму, составляющую Номинальную сумму для плательщика фиксированной ставки, если они намерены изменить правило пункта 2.7 Стандартных условий о том, что по умолчанию такой суммой является Номинальная сумма для плательщика плавающей ставки.

⁷ Стороны должны указать дату(-ы), которая(-ые) будет(-ут) являться Датой(-ами) окончания расчетного периода фиксированной ставки, если они намерены изменить правило пункта 2.8 Стандартных условий о том, что по умолчанию такой датой является каждая Дата платежа фиксированной суммы.

⁸ Стороны должны указать применимый Коэффициент для расчета дней в расчетном периоде фиксированной ставки, если они намерены изменить правило пункта 5.3 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется Коэффициент для расчета дней в расчетном периоде фиксированной ставки «Фактическое/360»

⁹ Если к Сделке применяется Расчет поставкой, Уведомление о расчете поставкой является обязательным Основанием проведения расчетов. Если к Сделке применяется Денежный расчет, Уведомление о расчете поставкой не применяется.

[Уведомление об общедоступной информации]

Источник(-и) общедоступной информации: []¹⁰

Минимальное количество источников: []¹¹

Кредитные события: К Сделке применяются следующие Кредитные события:

[Банкротство]

[[Неплатеж]

[Дата продления на льготный период]

[Льготный период]

[Пороговая сумма неплатежа]]¹²

[Дефолт по обязательству]

[Требование досрочного исполнения обязательства]

[Отказ от исполнения обязательства / мораторий]

[Реструктуризация обязательства]

[Ограничение по сроку до погашения при реструктуризации и Уступаемое обязательство: [Применимо]]¹³

[Модифицированное ограничение по сроку до погашения при реструктуризации и Обязательство с ограничением на уступку]¹⁴:
[Применимо]]

[Обязательство с множественностью кредиторов: ¹⁵ Применимо]]

[Пороговая сумма дефолта: []¹⁶

¹⁰ Стороны должны указать источники Общедоступной информации, если они намерены изменить правило статьи 3.7 Стандартных условий о том, что по умолчанию Источниками общедоступной информации являются: Bloomberg Service, Dow Jones Telerate Service, Reuter Monitor Money Rates Services, Dow Jones News Wire, Wall Street Journal, New York Times, Nihon Keizai Shinbun, Asahi Shinbun, Yomiuri Shinbun, Financial Times, La Tribune, Les Echos and The Australian Financial Review или их правопреемники, основной(ые) источник(и) деловых новостей в стране учреждения Контрольного лица, а также иные международно-признанные печатные или электронные службы новостей. При этом применительно к Контрольному лицу, учрежденному в Российской Федерации, или Обязательству такого Контрольного лица, Источником общедоступной информации в любом случае также является источник официального опубликования информации или официальное издание государственного органа в соответствии с законодательством Российской Федерации.

¹¹ Стороны должны указать количество Общедоступных источников информации (при этом такое количество не может быть менее двух), если они намерены изменить правило пункта 3.8 Стандартных условий о том, что по умолчанию такое количество равняется двум.

¹² Пороговая сумма неплатежа относится к Неплатежу. Стороны должны определить Пороговую сумму неплатежа, если они намерены изменить правило пункта 4.8 Стандартных условий о том, что по умолчанию такой суммой является 1 000 000,00 (один миллион) долларов США или эквивалент указанной суммы в Валюте обязательства по состоянию на дату наступления Неплатежа или (если применимо) Потенциального неплатежа.

¹³ Стороны не могут указать, что к Сделке применяются «Ограничение по сроку до погашения при реструктуризации и Уступаемое обязательство» и «Модифицированное ограничение по сроку до погашения при реструктуризации и Обязательство с ограничением на уступку».

¹⁴ Стороны не могут указать, что к Сделке применяются «Ограничение по сроку до погашения при реструктуризации и Уступаемое обязательство» и «Модифицированное ограничение по сроку до погашения при реструктуризации и Обязательство с ограничением на уступку».

¹⁵ Кроме случаев, когда условие «Обязательство с множественностью кредиторов» в Подтверждении указано как неприменимое, наступление события, предусмотренного подпунктами (i) – (v) подпункта 4.7.1 пункта 4.7 статьи 4 Стандартных условий, составляет Реструктуризацию обязательства только в случае, если Обязательство, в отношении которого наступает такое событие, является Обязательством с множественностью кредиторов.

¹⁶ Пороговая сумма дефолта относится к Требованию досрочного исполнения обязательства, Дефолту по обязательству, Отказу от исполнения обязательства / мораторию и Реструктуризации. Стороны должны указать сумму, составляющую Пороговую сумму дефолта, если они намерены изменить правило пункта 4.8 Стандартных условий о том, что по умолчанию такой суммой является 10 000 000,00 (десять миллионов) долларов США или эквивалент указанной суммы в Валюте обязательства по состоянию на дату наступления Кредитного события.

Обязательство(-а)

Категория обязательства (выбрать одну)	Признаки обязательства
<input type="checkbox"/> Платеж <input type="checkbox"/> Заемные денежные средства <input type="checkbox"/> Только контрольные обязательства <input type="checkbox"/> Облигация <input type="checkbox"/> Заем <input type="checkbox"/> Облигация или Заем	<input type="checkbox"/> Несубординированное <input type="checkbox"/> Поименованная валюта ¹⁷ <input type="checkbox"/> Негосударственный кредитор <input type="checkbox"/> Иностранная валюта [Местная валюта означает: []] ¹⁸ <input type="checkbox"/> Иностранное право <input type="checkbox"/> Листинг <input type="checkbox"/> Иностраннный выпуск

[и:]

[укажите любое другое обязательство Контрольного лица]

[Исключенные обязательства:]¹⁹ []

г) Условия проведения расчетов

Основной способ расчетов: [Денежный расчет] [Расчет поставкой]

[[Условия денежного расчета:]²⁰

[Дата оценки:]²¹

[Одна Дата оценки:

[] Рабочий день²²]

[Несколько Дат оценки]

[] Рабочий день²³ и каждый []

Рабочий день впоследствии²⁴

Количество Дат оценки: []]²⁵

[Время оценки:

]]²⁶

[Метод котировки:

[Цена покупки][Цена продажи][Среднее значение спреда]]²⁷

[Котировочная сумма:

[]] [Показательная сумма]

[Минимальная котировочная сумма:

]]²⁸

¹⁷ Если «Только контрольные обязательства» указаны в качестве Категории обязательства, Признаки поставляемых обязательств не указываются.

¹⁸ Стороны должны указать валюту, применяемую в качестве Местной валюты, если они намерены изменить правило пункта 2.28 Стандартных условий о том, что по умолчанию Местной валютой является официальная валюта (или валюта, введенная впоследствии в обращение взамен такой валюты) (а) Контрольного лица в случае, если Контрольное лицо является Публичным образованием, или (б) государства по месту учреждения Контрольного лица в случае, если Контрольное лицо не является Публичным образованием.

¹⁹ Контрольное обязательство является Обязательством за исключением случаев, когда оно указано в качестве Исключенного обязательства.

²⁰ Указать, если применяется Денежный расчет.

²¹ Указать, если Сумма денежного расчета не является фиксированной суммой. Если в Подтверждении не указано «Одна Дата оценки» или «Несколько Дат оценки», то по умолчанию применяется «Одна Дата оценки».

²² Стороны должны указать Рабочий день, являющийся Датой оценки, если они намерены изменить правило пункта 7.8 Стандартных условий о том, что по умолчанию такой датой является пятый Рабочий день после возникновения Оснований проведения расчетов.

²³ Стороны должны указать Рабочий день, являющийся Датой оценки, если они намерены изменить правило пункта 7.8 Стандартных условий о том, что по умолчанию такой датой является пятый Рабочий день после возникновения Оснований проведения расчетов.

²⁴ Стороны должны указать Рабочий день, являющийся Датой оценки, если они намерены изменить правило пункта 7.8 Стандартных условий о том, что по умолчанию такой датой является пятый Рабочий день после возникновения Оснований проведения расчетов.

²⁵ Стороны должны указать количество Дат оценки, если они намерены изменить правило пункта 7.8 Стандартных условий о том, что по умолчанию количество Дат оценки равно пяти.

²⁶ Стороны должны указать время, являющееся Временем оценки, если они намерены изменить правило статьи 7.14 Стандартных условий о том, что по умолчанию Временем оценки является 11 часов 00 минут в месте, являющемся основным местом проведения торгов Контрольным обязательством.

²⁷ Стороны должны указать Метод котировки, если они намерены изменить правило пункта 7.9 Стандартных условий о том, что по умолчанию применяется Метод котировки «Цена покупки (спроса)».

[Дилер(-ы):]²⁹

[Валюта расчетов:]³⁰

[Дата денежного расчета: [] Рабочий день]³¹

Сумма денежного расчета:]³²

[Котировки: [С учетом начисленных процентов][Без учета начисленных процентов]]³³

[Метод оценки:³⁴ [Рыночный][Наивысшая котировка]³⁵
 [Среднерыночный][Наивысшая котировка][Усредненная наивысшая котировка]³⁶
 [Смешанный рыночный][Смешанная наивысшая котировка]³⁷
 [Усредненный смешанный рыночный][Усредненная смешанная наивысшая котировка]³⁸]

[Условия поставки:]³⁹

[Срок поставки: [] Рабочий дней]⁴⁰

[Поставляемые обязательства: [С учетом начисленных процентов][Без учета начисленных процентов]⁴¹

²⁸ Стороны должны указать сумму, составляющую Минимальную котировочную сумму, если они намерены изменить правило пункта 7.3 Стандартных условий о том, что по умолчанию Котировочной суммой является наименьшая из: (а) суммы 1 000 000 долларов США (или ее эквивалента в соответствующей Валюте обязательства) или (б) Котировочной суммы.

²⁹ Если в Подтверждении не указано ни одного Дилера, то выбор Дилеров осуществляется Расчетным агентом после консультации с обеими сторонами.

³⁰ Стороны должны указать валюту, являющуюся Валютой расчетов, если они намерены изменить правило пункта 6.3 Стандартных условий о том, что по умолчанию Валютой расчетов является валюта, в которой выражена Номинальная сумма для плательщика плавающей ставки.

³¹ Стороны должны указать порядковый номер Рабочего дня после события, указанного в пункте 7.2, являющийся Датой денежного расчета, если они намерены изменить правило пункта 7.2 Стандартных условий о том, что по умолчанию такой датой является третий Рабочий день после определения Окончательной цены.

³² Стороны должны указать сумму, составляющую Сумму денежного расчета, если они намерены изменить правило пункта 7.3 Стандартных условий о том, что по умолчанию такая сумма равна произведению Номинальной суммы для плательщика плавающей ставки и разницы между Контрольной ценой и Окончательной ценой, если такая сумма больше нуля, или (iii) в остальных случаях, – нулю.

³³ Если в Подтверждении не указано «С учетом начисленных процентов» или «Без учета начисленных процентов», Расчетный агент (после консультации со сторонами) принимает решение о том, должны ли такие Котировки включать начисленные, но не уплаченные проценты, исходя из текущей рыночной практики, существующей на рынке соответствующего Контрольного обязательства.

³⁴ Указать, если Сумма денежного расчета не является фиксированной суммой.

³⁵ Только один из вышеуказанных Методов оценки может быть указан в отношении Сделки, условиями которой установлено одно Контрольное обязательство и одна Дата оценки. Если в таком случае ни один из вышеуказанных Методов оценки в Подтверждении не указан, в качестве Метода оценки применяется метод «Наивысшая котировка»

³⁶ Только один из вышеуказанных Методов оценки может быть указан в отношении Сделки, условиями которой установлено одно Контрольное обязательство и более одной Даты оценки. Если в таком случае ни один из вышеуказанных Методов оценки в Подтверждении не указан, в качестве Метода оценки применяется метод «Усредненная наивысшая котировка».

³⁷ Только один из вышеуказанных Методов оценки может быть указан в отношении Сделки, условиями которой установлено более одного Контрольного обязательства и одна Дата оценки. Если в таком случае ни один из вышеуказанных Методов оценки в Подтверждении не указан, в качестве Метода оценки применяется метод «Смешанная наивысшая котировка».

³⁸ Только один из вышеуказанных Методов оценки может быть указан в отношении Сделки, условиями которой установлено более одного Контрольного обязательства и более одной Даты оценки. Если в таком случае ни один из вышеуказанных Методов оценки в Подтверждении не указан, в качестве Метода оценки применяется метод «Усредненная смешанная наивысшая котировка».

³⁹ Включить, если применяется Расчет поставкой.

⁴⁰ Стороны должны указать количество Рабочих дней, составляющих Срок поставки, если они намерены изменить правило пункта 8.6 Стандартных условий о том, что по умолчанию Срок поставки составляет наибольшее количество Рабочих дней, которое по заключению Расчетного агента требуется для Поставки Поставляемых обязательств, указанных в Уведомлении о расчете поставкой или (если применимо) Уведомлении об изменении предмета поставки, в соответствии со сложившейся практикой на рынке таких обязательств.

⁴¹ Если в Подтверждении не указано «С учетом начисленных процентов» или «Без учета начисленных процентов», то по умолчанию такие Котировки не включают начисленные, но не уплаченные проценты.

[Поставляемые обязательства:

Категория обязательства (выбрать одну)	Признаки поставляемого обязательства (выбрать все применимые)
<input type="checkbox"/> Платеж <input type="checkbox"/> Заемные денежные средства <input type="checkbox"/> Только контрольные обязательства ⁴² <input type="checkbox"/> Облигация <input type="checkbox"/> Заем <input type="checkbox"/> Облигация или Заем	<input type="checkbox"/> Несубординированное <input type="checkbox"/> Поименованная валюта: [] ⁴³ <input type="checkbox"/> Негосударственный кредитор <input type="checkbox"/> Иностранная валюта [Местная валюта означает: []] <input type="checkbox"/> Иностранное право <input type="checkbox"/> Листинг <input type="checkbox"/> Безусловное <input type="checkbox"/> Внешний выпуск <input type="checkbox"/> Заем с правом уступки требования <input type="checkbox"/> Заем без права уступки требования <input type="checkbox"/> Прямое участие в займе ⁴⁴ Надлежащий продавец доли участия в займе: [] <input type="checkbox"/> Уступаемое <input type="checkbox"/> Предельный срок до погашения [] <input type="checkbox"/> Истребованное досрочно или срочное к исполнению <input type="checkbox"/> Не на предъявителя

[и:]

[укажите иное обязательство Контрольного лица]

[Исключенные Поставляемые обязательства:] []

[Частичный денежный расчет по Займам без права уступки требования]

[Частичный денежный расчет по Займам с правом уступки требования]

[Частичный денежный расчет по Прямому участию в займе]

Эскроу: [Применимо][Не применимо]

д) Уведомления и банковские реквизиты

Реквизиты для направления Подтверждений, уведомлений или иных сообщений:

Покупатель

Почтовый адрес:

Вниманию:

Телефон:

Факс:

Адрес электронной почты:

Особые указания:

⁴² Если «Только контрольные обязательства» указано в качестве Категории поставляемого обязательства, Признаки поставляемых обязательств не указываются.

⁴³ Если в Подтверждении такая валюта не указана, Местной валютой по умолчанию является официальная валюта (или валюта, введенная впоследствии в обращение взамен такой валюты) (а) Контрольного лица в случае, если Контрольное лицо является Публичным образованием, или (б) государства по месту учреждения Контрольного лица в случае, если Контрольное лицо не является Публичным образованием. При этом, если в обращение взамен Местной валюты вводится официальная валюта Канады, Японии, Швейцарии, Соединенного Королевства, Соединенных Штатов Америки или евро (или официальная валюта, введенная в обращение взамен таких валют), такая валюта не считается Местной валютой.

⁴⁴ Если «Прямое участие в займе» указано в качестве Признака поставляемого обязательства, указываются требования в отношении Надлежащего продавца доли участия в займе. Если такие требования не указаны, ни одно лицо не является Надлежащим продавцом доли участия в займе (кредите), и только соглашение об участии в займе (кредите), заключенное между Покупателем и Продавцом, будет означать Прямое участие в займе.

Продавец

Почтовый адрес:
Вниманию:
Телефон:
Факс:
Адрес электронной почты:
Особые указания:

Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Покупателя: []

Счет для платежей в пользу Продавца: []

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением, Подтверждено по состоянию на дату, указанную на первой странице:

[СТОРОНА А]

Ф. И. О.:
Должность:

[СТОРОНА Б]

Ф. И. О.:
Должность: