

ИЗМЕНЕНИЯ № 1

**В СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ СРОЧНЫХ СДЕЛОК НА ПРОЦЕНТНЫЕ СТАВКИ
И СДЕЛОК СВОПЦИОН**

2011 г.

**ИЗМЕНЕНИЯ № 1
В СТАНДАРТНЫЕ УСЛОВИЯ СРОЧНЫХ СДЕЛОК НА ПРОЦЕНТНЫЕ СТАВКИ
И СДЕЛОК СВОПЦИОН 2011 Г.¹**

опубликованы «17» августа 2021 г.

Настоящие изменения от «17» августа 2021 г. (далее - "*Изменения*") разработаны Саморегулируемой организацией "Национальная финансовая ассоциация" (СРО НФА)², утверждены Саморегулируемой организацией "Национальная финансовая ассоциация" (СРО НФА), Ассоциацией российских банков (АРБ), Ассоциацией банков России (Ассоциацией "Россия") и Национальной ассоциацией участников фондового рынка (НАУФОР) и опубликованы в сети Интернет на страницах Саморегулируемой организации "Национальная финансовая ассоциация" (СРО НФА), Ассоциации российских банков (АРБ), Ассоциации банков России (Ассоциации "Россия") и Национальной ассоциации участников фондового рынка (НАУФОР), вносят изменения и дополнения в отдельные положения Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г., разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией "Национальная ассоциация участников фондового рынка" (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков и опубликованных в сети Интернет на страницах Саморегулируемой (некоммерческой) организации "Национальная ассоциация участников фондового рынка" (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков (далее - "*Стандартные условия*").

Термины, используемые по тексту Изменений с большой буквы и не имеющие определения, имеют значение, определенное для них в Стандартных условиях.

Если Стандартные условия применяются к Сделке, дата заключения которой (Дата сделки) приходится на любой день после даты опубликования Изменений, и если иное прямо не указано в Подтверждении по Сделке, то Стандартные условия применяются к такой Сделке с учетом Изменений, независимо от наличия ссылки на Изменения в Подтверждении или при отсутствии Подтверждения в соответствии с пунктом 1.3 статьи 1 Примерных условий договора.

1. Дополнить пункт 7.8 Стандартных условий подпунктом (д) в следующей редакции:

"(д) **Ретроспективный период** означает применительно к Процентному периоду количество календарных дней или Рабочих дней, указанное в этом качестве в Подтверждении или иным образом согласованное сторонами применительно к Процентному периоду. Если стороны указали Ретроспективный период в Подтверждении или иным образом согласовали Ретроспективный период применительно к Процентному периоду, то в отношении любого календарного дня или Рабочего дня (как применимо) в соответствующем Процентном периоде используется значение процентной ставки, опубликованное или действующее (как указано в Подтверждении или иным образом согласовано сторонами) в календарный день или Рабочий день (как применимо), наступивший за такое количество календарных дней или Рабочих дней (как применимо) до такого дня в соответствующем Процентном периоде, которое соответствует Ретроспективному периоду."

2. Пункты 8.2(а) и 8.2(б) Стандартных условий изложить в следующей редакции:

"(а) **RUSFAR** или **Russian Secured Funding Average Rate** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является Ставка денежного рынка Московской Биржи RUSFAR (ставка по сделкам РЕПО с центральным контрагентом с клиринговыми сертификатами участия имущественного пула GC Bonds, включающего все облигации указанного пула (КСУ облигации)) для типа расчета (дата исполнения первой и второй части сделок РЕПО с центральным контрагентом), равного Периоду плавающей ставки, и валюты расчетов: рубли РФ, рассчитываемая ПАО Московская Биржа по утвержденной им методике в 12:30 по московскому времени и публикуемая в Дату изменения плавающей ставки на Сайте ПАО Московская Биржа. Если указанная ставка отсутствует на Сайте ПАО Московская Биржа, Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является Ставка денежного рынка Московской Биржи RUSFAR (ставка по сделкам РЕПО с центральным контрагентом с клиринговыми сертификатами участия имущественного пула GC Bonds, включающего все облигации указанного пула (КСУ облигации)) для типа расчета (дата исполнения первой и второй части сделок РЕПО с центральным контрагентом), равного Периоду плавающей ставки, и валюты расчетов: рубли РФ, рассчитываемая ПАО Московская Биржа по утвержденной им методике в 12:30 по московскому времени и опубликованная в ближайший Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, предшествующий Дате изменения плавающей ставки, при условии, что такой ближайший Рабочий день, в который опубликована ставка, наступил в течение пяти Рабочих дней, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, предшествующих Дате изменения плавающей ставки.

¹ ISDA, whose registered trademark is "ISDA®," is not affiliated with National Association of Securities Market Participants, Self-regulatory organization "National Finance Association" or Association of Russian Banks and did not participate in drafting or reviewing these Amendments. While these Amendments are intended to be compatible with language of certain rate options as well as fallback language developed by ISDA and therefore include similar language and concepts, ISDA takes no position as to and makes no representations or warranty, express or implied, concerning this instrument's suitability for use in any particular transaction, and bears no responsibility or liability, whether in tort or in contract, for any use of information contained in this document.

² Саморегулируемая организация "Национальная финансовая ассоциация" (СРО НФА) является правопреемником Национальной Валютной Ассоциации в результате состоявшейся в апреле 2015 г. реорганизации в форме присоединения Национальной Валютной Ассоциации к Саморегулируемой организации "Национальная финансовая ассоциация" (СРО НФА).

(б) **RUB-MOSPRIME-NFEA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является предлагаемая ставка по депозитам в рублях на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая на странице MOSPRIME1 в системе Reuters в 12 часов 30 минут по московскому времени в Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, предшествующий Дате изменения плавающей ставки (далее такой Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, предшествующий Дате изменения плавающей ставки, для целей настоящего подпункта (б) именуется "**Дата опубликования**"). Если указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters, Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является предлагаемая ставка по депозитам в рублях на срок, равный Периоду плавающей ставки, опубликованная на странице MOSPRIME1 в системе Reuters в 12 часов 30 минут по московскому времени в ближайший Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, предшествующий Дате опубликования, при условии, что такой ближайший Рабочий день, в который опубликована ставка, наступил в течение пяти Рабочих дней, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, предшествующих Дате опубликования."

3. В пункте 8.2(в) Стандартных условий слова "в 12 часов 30 минут по московскому времени в Рабочий день," заменить словами "в 13:30 по московскому времени в Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве,".

4. Пункт 8.2(г) Стандартных условий изложить в следующей редакции:

"(г) **Ключевая ставка Банка России** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка по основным операциям Банка России по регулированию ликвидности банковского сектора, устанавливаемая Советом директоров Банка России, действующая по состоянию на Дату изменения плавающей ставки и публикуемая на Сайте Банка России."

5. Дополнить пункт 8.2 Стандартных условий перед словами "По суммам, выраженным в долларах США" подпунктами (г¹) и (г²) в следующей редакции:

"(г¹) **RUB Key Rate 1D AVG** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки применительно к Процентному периоду является ставка, рассчитываемая по следующей формуле как среднее арифметическое значение значений Ключевой ставки на каждый календарный день в Процентном периоде со дня, в который начинается Процентный период (включительно, если иное не согласовано сторонами), по Дату окончания процентного периода в отношении Процентного периода (исключая ее, если иное не согласовано сторонами):

$$\text{Плавающая ставка} = (\text{сумма значений Ключевой ставки на каждый календарный день в Процентном периоде}) / (\text{количество календарных дней в Процентном периоде})$$

Для целей Способа определения плавающей ставки "RUB Key Rate 1D AVG" **Ключевая ставка** означает:

(А) применительно к каждому календарному дню в Процентном периоде, являющемуся Рабочим днем, Ключевую ставку Банка России в значении, определенном в пункте 8.2(г) Стандартных условий, действующую по состоянию на каждый такой календарный день в Процентном периоде, являющийся Рабочим днем;

(Б) применительно к каждому календарному дню в Процентном периоде, не являющемуся Рабочим днем, Ключевую ставку Банка России в значении, определенном в пункте 8.2(г) Стандартных условий, действующую по состоянию на Рабочий день, предшествующий каждому такому календарному дню в Процентном периоде, не являющемуся Рабочим днем.

Для целей Способа определения плавающей ставки "RUB Key Rate 1D AVG" ссылки на Рабочий день являются ссылками на Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве.

(г²) **RUB Key Rate 1W CMP** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки применительно к Процентному периоду является ставка, рассчитываемая по следующей формуле на основе значений Ключевой ставки на день, в который начинается Период капитализации в Процентном периоде, со дня, в который начинается Процентный период (включительно, если иное не согласовано сторонами), по Дату окончания процентного периода в отношении Процентного периода (исключая ее, если иное не согласовано сторонами), с капитализацией процентов каждый Период капитализации в Процентном периоде:

$$\left[\prod_{i=1}^m \left(1 + \frac{r_i \times d_i}{YD} \right) - 1 \right] \times \frac{YD}{n}$$

Где:

m означает количество Периодов капитализации в Процентном периоде;

i означает последовательность целых чисел от одного до *m*, каждое из которых представляет собой соответствующий календарный день в хронологическом порядке в соответствующем Периоде капитализации;

r_i означает значение Ключевой ставки на день, в который начинается i -ый Период капитализации в Процентном периоде;

d_i означает фактическое количество календарных дней в i -ом Периоде капитализации в Процентном периоде;

YD означает фактическое число календарных дней в году (365 или 366 соответственно);

n означает фактическое количество календарных дней в Процентном периоде.

Для целей Способа определения плавающей ставки "RUB Key Rate 1W CMP":

(А) "Ключевая ставка" означает Ключевую ставку в значении, определенном в пункте 8.2(г¹) Стандартных условий;

(Б) ссылки на Рабочий день являются ссылками на Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве."

6. Удалить пункт 8.2(д) Стандартных условий без изменения нумерации иных положений Стандартных условий.

7. В пункте 8.2(е) Стандартных условий слова "в г. Лондоне" заменить словами "в г. Нью-Йорке".

8. В пункте 8.2(е) Стандартных условий слова "к 17 часам по нью-йоркскому времени" в десятой строке дополнить словами "на следующий Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Нью-Йорке, после Даты изменения плавающей ставки".

9. В пункте 8.2(е) Стандартных условий слова "в еженедельном выпуске H.15(519) Федеральной резервной системы США" заменить словами "в выпуске H.15(519)".

10. Дополнить пункт 8.2(е) Стандартных условий следующими положениями:

"**H.15(519)** означает еженедельный статистический выпуск, публикуемый Советом управляющих Федеральной резервной системы США или его правопреемником и доступный на сайте Совета управляющих Федеральной резервной системы США <https://www.federalreserve.gov/releases/h15/> или Сайте-преемнике.

Ежедневное обновление выпуска H.15 означает ежедневное обновление выпуска H.15(519), доступное на сайте Совета управляющих Федеральной резервной системы США <https://www.federalreserve.gov/releases/h15/> или Сайте-преемнике."

11. Удалить пункт 8.2(з) Стандартных условий без изменения нумерации иных положений Стандартных условий.

12. Пункт 8.3 Стандартных условий дополнить абзацем вторым в следующей редакции:

"Положения настоящего пункта 8.3 подлежат применению, если иное не установлено иными положениями Стандартных условий."

13. Дополнить статью 8 Стандартных условий пунктами 8.4-8.9 в следующей редакции:

"8.4. **Группа ставок овернайт.** Помимо Способов определения плавающей ставки, предусмотренных пунктом 8.2 Стандартных условий, сторонами могут быть использованы следующие Способы определения плавающей ставки:

По суммам, выраженным в рублях

(а) **RUONIA** или **Ruble OverNight Index Average** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является средневзвешенная процентная ставка, по которой кредитные организации из перечня, утвержденного Банком России, совершают между собой сделки необеспеченного рублевого кредитования на условиях овернайт, рассчитываемая Банком России и публикуемая не позднее 15:00 по московскому времени в Дату изменения плавающей ставки на Сайте Банка России и/или на Сайте www.ruonia.ru. Если указанная ставка отсутствует на Сайте Банка России и на Сайте www.ruonia.ru, Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является средневзвешенная процентная ставка, по которой кредитные организации из перечня, утвержденного Банком России, совершают между собой сделки необеспеченного рублевого кредитования на условиях овернайт, рассчитываемая Банком России и опубликованная на Сайте Банка России и/или на Сайте www.ruonia.ru в ближайший Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, предшествующий Дате изменения плавающей ставки, при условии, что такой ближайший Рабочий день, в который опубликована ставка, наступил в течение пяти Рабочих дней, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, предшествующих Дате изменения плавающей ставки. В случае несоответствия между значениями процентной ставки, опубликованными на Сайте Банка России и на Сайте www.ruonia.ru, преимущественную силу будет иметь процентная ставка, опубликованная на Сайте Банка России.

(б) **RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, рассчитываемой по формуле, указанной ниже, является ставка доходности на вложения с ежедневной

капитализацией процентов (при этом базисной ставкой для расчета процентов является средневзвешенная процентная ставка, по которой кредитные организации из перечня, утвержденного Банком России, совершают между собой сделки необеспеченного рублевого кредитования на условиях овернайт).

В соответствии со Способом определения плавающей ставки "RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND" Плавающая ставка рассчитывается по следующей формуле, при этом полученный результат в случае необходимости округляется в порядке, установленном в пункте 1.10(а) Стандартных условий, но до четвертого знака после запятой (например, 0,0001%):

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{RUONIA_i \times n_i}{Act} \right) - 1 \right] \times \frac{Act}{d}$$

Где:

d_0 означает для любого Процентного периода количество Рабочих дней, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, в соответствующем Процентном периоде;

i означает последовательность целых чисел от одного до d_0 , каждое из которых представляет собой соответствующий Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, в хронологическом порядке, начиная с первого Рабочего дня, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве (включительно), в соответствующем Процентном периоде;

$RUONIA_i$ означает для любого дня i в соответствующем Процентном периоде процентную ставку, равную средневзвешенной процентной ставке, по которой кредитные организации из перечня, утвержденного Банком России, совершают между собой сделки необеспеченного рублевого кредитования на условиях овернайт, рассчитываемой Банком России и публикуемой не позднее 15:00 по московскому времени в Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, следующий за днем i (далее такой Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, следующий за днем i , для целей настоящего подпункта (б) именуется "**Дата опубликования**"), на Сайте Банка России и/или на Сайте www.ruonia.ru. Если в отношении какого-либо дня i указанная ставка отсутствует на Сайте Банка России и на Сайте www.ruonia.ru, процентной ставкой для дня i является средневзвешенная процентная ставка, по которой кредитные организации из перечня, утвержденного Банком России, совершают между собой сделки необеспеченного рублевого кредитования на условиях овернайт, рассчитываемая Банком России и опубликованная на Сайте Банка России и/или на Сайте www.ruonia.ru в ближайший Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, предшествующий Дате опубликования, при условии, что такой ближайший Рабочий день, в который опубликована ставка, наступил в течение пяти Рабочих дней, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Москве, предшествующих Дате опубликования. В случае несоответствия между значениями процентной ставки, опубликованными на Сайте Банка России и на Сайте www.ruonia.ru, преимущественную силу будет иметь процентная ставка, опубликованная на Сайте Банка России;

Act означает 365 или, если какая-либо часть соответствующего Процентного периода попадает на високосный год, 366;

n_i означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде, в которые процентная ставка является ставкой $RUONIA_i$;

d означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде.

По суммам, выраженным в долларах США

- (в) **USD-Federal Funds-H.15-OIS-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, рассчитываемой по формуле, указанной ниже, является ставка доходности на вложения с ежедневной капитализацией процентов (при этом базисной ставкой для расчета процентов является ежедневная эффективная ставка по федеральным фондам, определяемая Федеральной резервной системой США как средневзвешенное значение всех ставок по заключенным сделкам).

В соответствии со Способом определения плавающей ставки "USD-Federal Funds-H.15-OIS-COMPOUND" Плавающая ставка рассчитывается по следующей формуле, при этом полученный результат в случае необходимости округляется в порядке, установленном в пункте 1.10(а) Стандартных условий:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{FEDFUND_i \times n_i}{360} \right) - 1 \right] \times \frac{360}{d}$$

Где:

d_0 означает для любого Процентного периода количество Рабочих дней, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Нью-Йорке, в соответствующем Процентном периоде;

i означает последовательность целых чисел от одного до d_0 , каждое из которых представляет собой соответствующий Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Нью-Йорке, в хронологическом порядке, начиная с первого Рабочего дня, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Нью-Йорке (включительно), в соответствующем Процентном периоде;

$FEDFUND_i$ означает для любого дня i в соответствующем Процентном периоде процентную ставку, равную ставке, установленной в выпуске H.15(519) на соответствующую дату под заголовком "EFFECT", публикуемой на странице FEDFUNDS1 в системе Reuters. Если в отношении какого-либо дня i указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters, то процентной ставкой для такого дня будет ставка, добросовестно и коммерчески разумно согласованная между сторонами. Если стороны не согласуют такую ставку, то процентной ставкой для такого дня будет ставка, опубликованная на странице FEDFUNDS1 в системе Reuters в отношении первого предшествующего Рабочего дня, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Нью-Йорке;

n_i означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде, в которые процентная ставка является ставкой $FEDFUND_i$;

d означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде.

По суммам, выраженным в евро

- (г) **EUR-EONIA-OIS-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, рассчитываемой по формуле, указанной ниже, является ставка доходности на вложения с ежедневной капитализацией процентов (при этом базисной ставкой для расчета процентов является средняя процентная ставка по необеспеченным межбанковским кредитам в евро на условиях овернайт (Euro Overnight Index Average, EONIA)). При этом Плавающая ставка для каждого дня в Процентном периоде, наступающем в Дату наступления события прекращения EONIA или после нее, будет определяться, как если бы ссылка на ставку $EONIA_i$ была ссылкой на ставку Модифицированная EuroSTR.

При наступлении События прекращения EuroSTR Плавающая ставка для каждого дня в Процентном периоде, наступающем в Дату наступления события прекращения EuroSTR или после нее, будет определяться, как если бы ссылка на ставку $EONIA_i$ была ссылкой на Рекомендуемую ЕЦБ ставку.

Если:

- (А) такая ставка не рекомендована до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET, следующего за днем наступления События прекращения EuroSTR, то Плавающая ставка для каждого дня в Процентном периоде, наступающем в Дату наступления события прекращения EuroSTR или после нее, будет определяться, как если бы ссылка на ставку $EONIA_i$ была ссылкой на ставку Модифицированная EDFR ($EONIA_i$); или
- (Б) впоследствии наступает Событие прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки, то Плавающая ставка для каждого дня в Процентном периоде, наступающем в Дату наступления события прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки или после нее, будет определяться, как если бы ссылка на ставку $EONIA_i$ была ссылкой на ставку Модифицированная EDFR ($EONIA_i$).

В соответствии со Способом определения плавающей ставки "EUR-EONIA-OIS-COMPOUND" Плавающая ставка рассчитывается по следующей формуле, при этом полученный результат в случае необходимости округляется в порядке, установленном в пункте 1.10(а) Стандартных условий, но до четвертого знака после запятой (например, 0,0001%):

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{EONIA_i \times n_i}{360} \right) - 1 \right] \times \frac{360}{d}$$

Где:

d_0 означает для любого Процентного периода количество Рабочих дней для Системы TARGET в соответствующем Процентном периоде;

i означает последовательность целых чисел от одного до d_0 , каждое из которых представляет собой соответствующий Рабочий день для Системы TARGET в хронологическом порядке, начиная с первого Рабочего дня для Системы TARGET (включительно) в соответствующем Процентном периоде;

$EONIA_i$ означает для любого дня i в соответствующем Процентном периоде процентную ставку, равную ставке овернайт, отображаемой на странице EONIA в системе Reuters в отношении такого дня;

n_i означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде, в которые процентная ставка является ставкой $EONIA_i$;

d означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде.

Помимо терминов, определенных выше, для целей Способа определения плавающей ставки "EUR-EONIA-OIS-COMPOUND" следующие термины имеют следующие значения.

Дата наступления события прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки означает в отношении События прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки первый день, на который Рекомендуемая ЕЦБ ставка перестает предоставляться.

Дата наступления события прекращения EONIA означает в отношении События прекращения EONIA первый день, на который ставка EONIA перестает предоставляться.

Дата наступления события прекращения EuroSTR означает в отношении События прекращения EuroSTR первый день, на который ставка EuroSTR перестает предоставляться.

Евросистема означает Европейский центральный банк и национальные центральные банки государств-членов Европейского союза, валютой которых является евро.

Модифицированная EDFR (EONIA) означает Ставку по депозитам Евросистемы, как опубликовано или предоставлено администратором такой ставки, увеличенную на Спред EDFR.

Модифицированная EDFR (EONIA)_i означает для любого дня *i* в соответствующем Процентном периоде процентную ставку, равную ставке Модифицированная EDFR (EONIA) в отношении этого дня плюс 0,085%.

Модифицированная EuroSTR_i означает для любого дня *i* в соответствующем Процентном периоде процентную ставку, равную ставке EuroSTR в отношении такого дня, как опубликовано на Сайте Европейского центрального банка, плюс 0,085%.

Рекомендуемая ЕЦБ ставка означает ставку (включая любые спреды или корректировки), рекомендованную в качестве замены ставки EuroSTR Европейским центральным банком (или администратором-правопреемником в отношении ставки EuroSTR) и/или комитетом, официально назначенным или созданным Европейским центральным банком (или администратором-правопреемником в отношении ставки EuroSTR) для целей рекомендации по замене ставки EuroSTR другой ставкой (такая другая ставка может быть установлена Европейским центральным банком или другим администратором ставки EuroSTR).

Рекомендуемая ЕЦБ ставка_i означает для любого дня *i* в соответствующем Процентном периоде процентную ставку, равную Рекомендуемой ЕЦБ ставке в отношении этого дня, как опубликовано или предоставлено администратором Рекомендуемой ЕЦБ ставки, плюс 0,085%.

Событие прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки означает наступление одного или нескольких следующих событий:

- (А) официальное заявление или публикация информации администратором Рекомендуемой ЕЦБ ставки или от его имени, где объявляется, что он на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять Рекомендуемую ЕЦБ ставку, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки, который мог бы продолжить предоставлять Рекомендуемую ЕЦБ ставку; или
- (Б) официальное заявление или публикация информации регулирующим органом, осуществляющим надзор в отношении администратора Рекомендуемой ЕЦБ ставки, центральным банком для валюты Рекомендуемой ЕЦБ ставки, официальным лицом, наделенным полномочиями по делу о несостоятельности в отношении администратора Рекомендуемой ЕЦБ ставки, органом по разрешению споров, обладающим юрисдикцией в отношении администратора Рекомендуемой ЕЦБ ставки, или судом, лицом или органом со схожими полномочиями в вопросах несостоятельности или разрешения споров в отношении администратора Рекомендуемой ЕЦБ ставки, которым устанавливается, что администратор Рекомендуемой ЕЦБ ставки на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять Рекомендуемую ЕЦБ ставку, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки, который мог бы продолжить предоставлять Рекомендуемую ЕЦБ ставку.

Событие прекращения EONIA означает:

- (А) объявление, сделанное 31 мая 2019 г. Европейским институтом денежных рынков (European Money Markets Institute), о том, что предоставление ставки EONIA будет прекращено 3 января 2022 г.; или
- (Б) наступление одного или нескольких следующих событий:
 - (aa) официальное заявление или публикация информации Европейским институтом денежных рынков (European Money Markets Institute) (или администратором-правопреемником в отношении ставки EONIA) или от его имени, где объявляется, что он на постоянной или

бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять ставку EONIA, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении ставки EONIA, который мог бы продолжить предоставлять ставку EONIA; или

- (бб) официальное заявление или публикация информации регулирующим органом, осуществляющим надзор в отношении администратора ставки EONIA, центральным банком для валюты ставки EONIA, официальным лицом, наделенным полномочиями по делу о несостоятельности в отношении администратора ставки EONIA, органом по разрешению споров, обладающим юрисдикцией в отношении администратора ставки EONIA, или судом, лицом или органом со схожими полномочиями в вопросах несостоятельности или разрешения споров в отношении администратора ставки EONIA, которым устанавливается, что администратор ставки EONIA на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять ставку EONIA, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении ставки EONIA, который мог бы продолжить предоставлять ставку EONIA.

Событие прекращения EuroSTR означает наступление одного или нескольких следующих событий:

- (А) официальное заявление или публикация информации Европейским центральным банком (или администратором-правопреемником в отношении ставки EuroSTR) или от его имени, где объявляется, что он на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять ставку EuroSTR, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении ставки EuroSTR, который мог бы продолжить предоставлять ставку EuroSTR; или
- (Б) официальное заявление или публикация информации регулирующим органом, осуществляющим надзор в отношении администратора ставки EuroSTR, центральным банком для валюты ставки EuroSTR, официальным лицом, наделенным полномочиями по делу о несостоятельности в отношении администратора ставки EuroSTR, органом по разрешению споров, обладающим юрисдикцией в отношении администратора ставки EuroSTR, или судом, лицом или органом со схожими полномочиями в вопросах несостоятельности или разрешения споров в отношении администратора ставки EuroSTR, которым устанавливается, что администратор ставки EuroSTR на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять ставку EuroSTR, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении ставки EuroSTR, который мог бы продолжить предоставлять ставку EuroSTR.

Сред EDFR означает:

- (А) если Рекомендуемая ЕЦБ ставка не будет рекомендована до конца первого Рабочего дня для Системы TARGET, следующего за днем, в который наступает Событие прекращения EuroSTR, среднее арифметическое значение ежедневной разницы между ставкой EuroSTR и Ставкой по депозитам Евросистемы за период наблюдения, равный 30 Рабочим дням для Системы TARGET, начинающийся за 30 Рабочих дней для Системы TARGET до дня, в который наступает Событие прекращения EuroSTR, и заканчивающийся в Рабочий день для Системы TARGET, непосредственно предшествующий дню, в который наступает Событие прекращения EuroSTR; или
- (Б) если наступает Событие прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки, среднее арифметическое значение ежедневной разницы между Рекомендуемой ЕЦБ ставкой и Ставкой по депозитам Евросистемы за период наблюдения, равный 30 Рабочим дням для Системы TARGET, начинающийся за 30 Рабочих дней для Системы TARGET до дня, в который наступает Событие прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки, и заканчивающийся в Рабочий день для Системы TARGET, непосредственно предшествующий дню, в который наступает Событие прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки.

Ставка по депозитам Евросистемы означает ставку по депозитам, которую банки могут использовать для размещения депозитов на условиях овернайт в Евросистеме и которая публикуется на Сайте Европейского центрального банка.

EuroSTR означает краткосрочную процентную ставку на денежном рынке в евро (€STR), публикуемую Европейским центральным банком в качестве администратора ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки) на Сайте Европейского центрального банка.

По суммам, выраженным в швейцарских франках

- (д) **CHF-SARON-OIS-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, рассчитываемой по формуле, указанной ниже, является ставка доходности на вложения с ежедневной капитализацией процентов (при этом базисной ставкой для расчета процентов является ежедневная ставка по операциям репо в швейцарских франках на условиях овернайт).

В соответствии со Способом определения плавающей ставки "CHF-SARON-OIS-COMPOUND" Плавающая ставка рассчитывается по следующей формуле, при этом полученный результат в случае необходимости

округляется в порядке, установленном в пункте 1.10(а) Стандартных условий, но до четвертого знака после запятой (например, 0,0001%):

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{SARON_i \times n_i}{360} \right) - 1 \right] \times \frac{360}{d}$$

Где:

d_0 означает для любого Процентного периода количество Рабочих дней, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Цюрихе, в соответствующем Процентном периоде;

i означает последовательность целых чисел от одного до d_0 , каждое из которых представляет собой соответствующий Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Цюрихе, в хронологическом порядке, начиная с первого Рабочего дня, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Цюрихе (включительно), в соответствующем Процентном периоде;

$SARON_i$ означает для любого дня i в соответствующем Процентном периоде процентную ставку, равную ставке по операциям репо в швейцарских франках на условиях овернайт, публикуемую под заголовком "CLSFIX" на странице SARON.S в системе Reuters в 18:00 по цюрихскому времени (или позднее) в отношении такого дня. Если указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters к 20 часам такого дня, то процентная ставка для такого дня будет определяться Расчетным агентом;

n_i означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде, в которые процентная ставка является ставкой $SARON_i$;

d означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде.

По суммам, выраженным в иенах

- (e) **JPY-TONA-OIS-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, рассчитываемой по формуле, указанной ниже, является ставка доходности на вложения с ежедневной капитализацией процентов (при этом базисной ставкой для расчета процентов является среднее арифметическое значений ежедневной ставки на регулярном межбанковском рынке иены в г. Токио).

В соответствии со Способом определения плавающей ставки "JPY-TONA-OIS-COMPOUND" Плавающая ставка рассчитывается по следующей формуле, при этом полученный результат в случае необходимости округляется в порядке, установленном в пункте 1.10(а) Стандартных условий:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{TONA_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \times \frac{365}{d}$$

Где:

d_0 означает для любого Процентного периода количество Рабочих дней, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Токио, в соответствующем Процентном периоде;

i означает последовательность целых чисел от одного до d_0 каждое из которых представляет собой соответствующий Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Токио, в хронологическом порядке, начиная с первого Рабочего дня, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Токио (включительно), в соответствующем Процентном периоде;

$TONA_i$ означает для любого дня i в соответствующем Процентном периоде процентную ставку, равную токийской средневзвешенной ставке овернайт (Tokyo OverNight Average, TONA), публикуемую Центральным банком Японии на странице TONAT в системе Reuters по состоянию примерно на 10:00 по токийскому времени в Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Токио, непосредственно следующий за таким днем i . Если в отношении какого-либо дня i указанная ставка отсутствует на указанной странице в системе Reuters, то процентной ставкой для такого дня будет ставка, добросовестно и коммерчески разумно согласованная между сторонами. Если стороны не согласуют такую ставку, то процентной ставкой для такого дня будет ставка, опубликованная на странице TONAT в системе Reuters в отношении первого предшествующего Рабочего дня, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Токио;

n_i означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде, в которые процентная ставка является ставкой $TONA_i$;

d означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде.

- 8.5. **Группа дополнительных ставок, предполагающих капитализацию процентов, в связи с реформой ставок группы IBOR.** Помимо Способов определения плавающей ставки, предусмотренных пунктами 8.2 и 8.4 Стандартных условий, сторонами могут быть использованы следующие Способы определения плавающей ставки.

По суммам, выраженным в долларах США

- (a) **USD-SOFR-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, рассчитываемой по формуле, указанной ниже, является ставка доходности на вложения с ежедневной капитализацией процентов (при этом базисной ставкой для расчета процентов является ставка SOFR). При наступлении События прекращения SOFR Плавающая ставка для каждого дня в Процентном периоде, наступающем в Дату наступления события прекращения SOFR или после нее, будет определяться, как если бы ссылка на ставку SOFR была ссылкой на ставку (включая любые спреды или корректировки), рекомендованную в качестве замены ставки SOFR Советом управляющих Федеральной резервной системы США и/или Федеральным резервным банком Нью-Йорка или комитетом, официально назначенным или созданным Советом управляющих Федеральной резервной системы США и/или Федеральным резервным банком Нью-Йорка для целей рекомендации по замене ставки SOFR другой ставкой (такая другая ставка может быть установлена Федеральным резервным банком Нью-Йорка или другим администратором ставки). Если такая ставка не рекомендована в течение одного Рабочего дня для торговли государственными ценными бумагами США после наступления События прекращения SOFR, то Плавающая ставка для каждого дня в Процентном периоде, наступающем в Дату наступления события прекращения SOFR или после нее, будет определяться, как если бы ссылка на ставку SOFR была ссылкой на ставку OBFR, ссылка на Рабочий день для торговли государственными ценными бумагами США была ссылкой на Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Нью-Йорке, а ссылка на Событие прекращения SOFR была ссылкой на Событие прекращения OBFR. Если такая ставка не рекомендована в течение одного Рабочего дня для торговли государственными ценными бумагами США после наступления События прекращения SOFR и произошло Событие прекращения OBFR, то Плавающая ставка для каждого дня в Процентном периоде, наступающем в Дату наступления события прекращения SOFR или после нее, будет определяться, как если бы ссылка на ставку SOFR была ссылкой на Целевую ставку FOMC, ссылка на Рабочий день для торговли государственными ценными бумагами США была ссылкой на Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Нью-Йорке, а ссылка на Сайт Федерального резервного банка Нью-Йорка была ссылкой на Сайт Федеральной резервной системы США.

В соответствии со Способом определения плавающей ставки "USD-SOFR-COMPOUND" Плавающая ставка рассчитывается по следующей формуле, при этом полученный результат в случае необходимости округляется в порядке, установленном в пункте 1.10(a) Стандартных условий:

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{SOFR_i \times n_i}{360} \right) - 1 \right] \times \frac{360}{d}$$

Где:

d_0 означает для любого Процентного периода количество Рабочих дней для торговли государственными ценными бумагами США в соответствующем Процентном периоде;

i означает последовательность целых чисел от одного до d_0 , каждое из которых представляет собой соответствующий Рабочий день для торговли государственными ценными бумагами США в хронологическом порядке, начиная с первого Рабочего дня для торговли государственными ценными бумагами США (включительно) в соответствующем Процентном периоде;

$SOFR$ означает ежедневную ставку по предоставлению обеспеченного финансирования на условиях овернайт (Secured Overnight Financing Rate, SOFR), публикуемую Федеральным резервным банком Нью-Йорка в качестве администратора ставки (или администратором-правопреемником в отношении ставки) на Сайте Федерального резервного банка Нью-Йорка;

$SOFR_i$ означает для любого дня i в соответствующем Процентном периоде процентную ставку, равную ставке SOFR в отношении этого дня, опубликованной примерно в 8:00 по нью-йоркскому времени в Рабочий день для торговли государственными ценными бумагами США, непосредственно следующий за днем i . Если до 17:00 по нью-йоркскому времени в Рабочий день для торговли государственными ценными бумагами США, непосредственно следующий за любым днем i , ставка SOFR в отношении такого дня i не опубликована и Событие прекращения SOFR не произошло, то ставкой $SOFR_i$ для такого дня i будет ставка SOFR, опубликованная в отношении первого предшествующего Рабочего дня для торговли государственными ценными бумагами США, для которого ставка SOFR была опубликована на Сайте Федерального резервного банка Нью-Йорка;

n_i означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде, в которые процентная ставка является ставкой $SOFR_i$;

d означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде.

Помимо терминов, определенных выше, для целей Способа определения плавающей ставки "USD-SOFR-COMPOUND" следующие термины имеют следующие значения.

Дата наступления события прекращения SOFR означает в отношении События прекращения SOFR день, на который Федеральный резервный банк Нью-Йорка (или администратор-правопреемник в отношении ставки SOFR) прекращает публиковать ставку SOFR или день, с которого ставка SOFR более не может использоваться.

Событие прекращения OBFR означает наступление одного или нескольких следующих событий:

- (A) официальное заявление Федерального резервного банка Нью-Йорка (или администратора-правопреемника в отношении ставки OBFR), где объявляется, что он на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять ставку OBFR, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении ставки OBFR, который мог бы продолжить предоставлять ставку OBFR;
- (B) публикация информации, которая обоснованно подтверждает, что Федеральный резервный банк Нью-Йорка (или администратор-правопреемник в отношении ставки OBFR) на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять ставку OBFR, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении ставки OBFR, который мог бы продолжить предоставлять ставку OBFR; или
- (B) официальное заявление регулирующего органа или другого официального лица в данном секторе рынка, устанавливающее запрет использования ставки OBFR, который применяется в том числе ко всем Сделкам, включая существующие Сделки.

Событие прекращения SOFR означает наступление одного или нескольких следующих событий:

- (A) официальное заявление Федерального резервного банка Нью-Йорка (или администратора-правопреемника в отношении ставки SOFR), где объявляется, что он на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять ставку SOFR, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении ставки SOFR, который мог бы продолжить предоставлять ставку SOFR;
- (B) публикация информации, которая обоснованно подтверждает, что Федеральный резервный банк Нью-Йорка (или администратор-правопреемник в отношении ставки SOFR) на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять ставку SOFR, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении ставки SOFR, который мог бы продолжить предоставлять ставку SOFR; или
- (B) официальное заявление регулирующего органа или другого официального лица в данном секторе рынка, устанавливающее запрет использования ставки SOFR, который применяется в том числе ко всем Сделкам, включая существующие Сделки.

Рабочий день для торговли государственными ценными бумагами США означает любой день, кроме субботы, воскресенья или дня, в который Ассоциация индустрии ценных бумаг и финансовых рынков (Securities Industry and Financial Markets Association, SIFMA) рекомендовала своим членам закрыть на весь день их отделы по проведению операций с инструментами с фиксированной доходностью для целей торговли государственными ценными бумагами США.

Целевая ставка FOMC означает целевую краткосрочную процентную ставку, которая устанавливается Федеральным комитетом открытого рынка Федеральной резервной системы США и публикуется на Сайте Федеральной резервной системы США, или, если Федеральный комитет открытого рынка Федеральной резервной системы США не устанавливает единую ставку, среднее значение краткосрочной процентной ставки в целевом диапазоне, устанавливаемом Федеральным комитетом открытого рынка Федеральной резервной системы США и публикуемом на Сайте Федеральной резервной системы США (рассчитываемое как среднее арифметическое значение верхней и нижней границы целевого диапазона с округлением, если необходимо, до двух знаков после запятой по математическому методу (например, 0,01%)).

OBFR означает ежедневную ставку фондирования банков на условиях овернайт (Overnight Bank Funding Rate, OBFR), публикуемую Федеральным резервным банком Нью-Йорка в качестве администратора ставки (или администратором-правопреемником в отношении ставки) на Сайте Федерального резервного банка Нью-Йорк.

По суммам, выраженным в евро

- (б) **EUR-EuroSTR-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, рассчитываемой по формуле, указанной ниже, является ставка доходности на вложения с ежедневной капитализацией процентов (при этом базисной ставкой для расчета процентов является краткосрочная процентная ставка на денежном рынке в евро (€STR)).

При наступлении События прекращения EuroSTR Плавающая ставка для каждого дня в Процентном периоде, наступающем в Дату наступления события прекращения EuroSTR или после нее, будет определяться, как если бы ссылка на ставку EuroSTR_i была ссылкой на Рекомендуемую ЕЦБ ставку_i.

Если:

- (А) такая ставка не рекомендована до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET, следующего за днем наступления События прекращения EuroSTR, то Плавающая ставка для каждого дня в Процентном периоде, наступающем в Дату наступления события прекращения EuroSTR или после нее, будет определяться, как если бы ссылка на ставку EuroSTR_i была ссылкой на ставку Модифицированная EDFR (EuroSTR)_i; или
- (Б) впоследствии происходит Событие прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки, то Плавающая ставка для каждого дня в Процентном периоде, наступающем в Дату наступления события прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки или после нее, будет определяться, как если бы ссылка на ставку EuroSTR_i была ссылкой на ставку Модифицированная EDFR (EuroSTR)_i.

В соответствии со Способом определения плавающей ставки "EUR-EuroSTR-COMPOUND" Плавающая ставка рассчитывается по следующей формуле, при этом полученный результат в случае необходимости округляется в порядке, установленном в пункте 1.10(a) Стандартных условий, но до четвертого знака после запятой (например, 0,0001%):

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left(1 + \frac{EuroSTR_i \times n_i}{360} \right) - 1 \right] \times \frac{360}{d}$$

Где:

d_0 означает для любого Процентного периода количество Рабочих дней для Системы TARGET в соответствующем Процентном периоде;

i означает последовательность целых чисел от одного до d_0 , каждое из которых представляет собой соответствующий Рабочий день для Системы TARGET в хронологическом порядке, начиная с первого Рабочего дня TARGET (включительно) в соответствующем Процентном периоде;

$EuroSTR_i$ означает для любого дня i в соответствующем Процентном периоде процентную ставку, равную ставке EuroSTR в отношении этого дня, как опубликовано на Сайте Европейского центрального банка;

$EuroSTR$ означает краткосрочную ставку на денежном рынке в евро (€STR), публикуемую Европейским центральным банком в качестве администратора ставки (или администратором-правопреемником в отношении ставки) на Сайте Европейского центрального банка;

n_i означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде, в которые процентная ставка является ставкой EuroSTR_i;

d означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде.

Помимо терминов, определенных выше, для целей Способа определения плавающей ставки "EUR-EuroSTR-COMPOUND" следующие термины имеют следующие значения.

Дата наступления события прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки означает в отношении События прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки первый день, в который Рекомендуемая ЕЦБ ставка перестает предоставляться.

Дата наступления события прекращения EuroSTR означает в отношении События прекращения EuroSTR первый день, на который ставка EuroSTR перестает предоставляться.

Евросистема означает Европейский центральный банк и национальные центральные банки государств-членов Европейского союза, валютой которых является евро.

Модифицированная EDFR (EuroSTR)_i означает для любого дня i в соответствующем Процентном периоде процентную ставку, равную Ставке по депозитам Евросистемы в отношении этого дня, увеличенной на Спред EDFR.

Рекомендуемая ЕЦБ ставка означает ставку (включая любые спреды или корректировки), рекомендованную в качестве замены ставки EuroSTR Европейским центральным банком (или администратором-правопреемником в отношении ставки EuroSTR) и/или комитетом, официально назначенным или созванным Европейским центральным банком (или администратором-правопреемником в отношении ставки EuroSTR) для целей рекомендации по замене ставки EuroSTR другой ставкой (такая другая ставка может быть установлена Европейским центральным банком или другим администратором ставки).

Рекомендуемая ЕЦБ ставка i означает для любого дня i в соответствующем Процентном периоде процентную ставку, равную Рекомендуемой ЕЦБ ставке в отношении этого дня, как опубликовано или предоставлено администратором Рекомендуемой ЕЦБ ставки.

Событие прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки означает наступление одного или нескольких следующих событий:

- (А) официальное заявление или публикация информации администратором Рекомендуемой ЕЦБ ставки или от его имени, где объявляется, что он на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять Рекомендуемую ЕЦБ ставку, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника Рекомендуемой ЕЦБ ставки, который мог бы продолжить предоставлять Рекомендуемую ЕЦБ ставку; или
- (Б) официальное заявление или публикация информации регулирующим органом, осуществляющим надзор в отношении администратора Рекомендуемой ЕЦБ ставки, центральным банком для валюты Рекомендуемой ЕЦБ ставки, официальным лицом, наделенным полномочиями по делу о несостоятельности в отношении администратора Рекомендуемой ЕЦБ ставки, органом по разрешению споров, обладающего юрисдикцией в отношении администратора Рекомендуемой ЕЦБ ставки, или судом, лицом или органом со схожими полномочиями в вопросах несостоятельности или разрешения споров в отношении администратора Рекомендуемой ЕЦБ ставки, где устанавливается, что администратор Рекомендуемой ЕЦБ ставки на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять Рекомендуемую ЕЦБ ставку, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки, который мог бы продолжить предоставлять Рекомендуемую ЕЦБ ставку.

Событие прекращения EuroSTR означает наступление одного или нескольких следующих событий:

- (А) официальное заявление или публикация информации Европейским центральным банком (или администратором-правопреемником в отношении ставки EuroSTR) или от его имени, где объявляется, что он на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять ставку EuroSTR, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении ставки EuroSTR, который мог бы продолжить предоставлять ставку EuroSTR; или
- (Б) официальное заявление или публикация информации регулирующим органом, осуществляющим надзор в отношении администратора ставки EuroSTR, центральным банком для валюты ставки EuroSTR, официальным лицом, наделенным полномочиями по делу о несостоятельности в отношении администратора ставки EuroSTR, органом по разрешению споров, обладающим юрисдикцией в отношении администратора ставки EuroSTR, или судом, лицом или органом со схожими полномочиями в вопросах несостоятельности или разрешения споров в отношении администратора ставки EuroSTR, где устанавливается, что администратор ставки EuroSTR на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять ставку EuroSTR, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении ставки EuroSTR, который мог бы продолжить предоставлять ставку EuroSTR.

Спред EDFR означает:

- (А) если Рекомендуемая ЕЦБ ставка не будет рекомендована до конца первого Рабочего дня для Системы TARGET, следующего за днем, в который наступает Событие прекращения EuroSTR, среднее арифметическое значение ежедневной разницы между ставкой EuroSTR и Ставкой по депозитам Евросистемы за период наблюдения, равный 30 Рабочим дням для Системы TARGET, начинающийся за 30 Рабочих дней для Системы TARGET до дня, в который наступает Событие прекращения EuroSTR, и заканчивающийся в Рабочий день для Системы TARGET, непосредственно предшествующий дню, в который наступает Событие прекращения EuroSTR; или
- (Б) если наступает Событие прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки, среднее арифметическое значение ежедневной разницы между Рекомендуемой ЕЦБ ставкой и Ставкой по депозитам Евросистемы за период наблюдения, равный 30 Рабочим дням для Системы TARGET, начинающийся за 30 Рабочих дней для Системы TARGET до дня, в который наступает Событие прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки, и заканчивающийся в Рабочий день для Системы TARGET, непосредственно предшествующий дню, в который наступает Событие прекращения Рекомендуемой ЕЦБ ставки.

Ставка по депозитам Евросистемы означает ставку по депозитам, которую банки могут использовать для размещения депозитов на условиях овернайт в Евросистеме и которая публикуется на Сайте Европейского центрального банка.

По суммам, выраженным в фунтах стерлингов

- (в) **GBP-SONIA-COMPOUND** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, рассчитываемой по формуле, указанной ниже, является ставка доходности на вложения с ежедневной

капитализацией процентов (при этом базисной ставкой для расчета процентов является ежедневная базисная ставка овернайт в фунтах стерлингов).

В соответствии со Способом определения плавающей ставки "GBP-SONIA-COMPOUND" Плавающая ставка рассчитывается по следующей формуле, при этом полученный результат в случае необходимости округляется в порядке, установленном в пункте 1.10(a) Стандартных условий, но до четвертого знака после запятой (например, 0,0001%):

$$\left[\prod_{i=1}^{d_o} \left(1 + \frac{SONIA_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \times \frac{365}{d}$$

Где:

d_o означает для любого Процентного периода количество Рабочих дней, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, в соответствующем Процентном периоде;

i означает последовательность целых чисел от одного до d_o , каждое из которых представляет собой соответствующий Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, в хронологическом порядке, начиная с первого Рабочего дня, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне (включительно), в соответствующем Процентном периоде;

$SONIA_i$ означает для любого дня i в соответствующем Процентном периоде процентную ставку, равную ежедневной средневзвешенной ставке овернайт в фунтах стерлингов (Sterling Overnight Index Average, SONIA), рассчитываемой администратором ставки SONIA и публикуемой официально уполномоченными дистрибьюторами такой ставки по состоянию на 9:00 по лондонскому времени в Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, непосредственно следующий за таким днем i ;

n_i означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде, в которые процентная ставка является ставкой $SONIA_i$;

d означает фактическое количество календарных дней в соответствующем Процентном периоде.

- 8.6. **Группа иных дополнительных ставок в связи с реформой ставок группы IBOR.** Помимо Способов определения плавающей ставки, предусмотренных пунктами 8.2, 8.4 и 8.5 Стандартных условий, сторонами могут быть использованы следующие Способы определения плавающей ставки.

По суммам, выраженным в долларах США

- (a) **USD-LIBOR-BBA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка LIBOR для доллара США на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая на странице LIBOR01 в системе Reuters в 11:55 по лондонскому времени (и отражающая публикацию по состоянию на 11:00 по лондонскому времени) (или публикуемая в любое другое (скорректированное) время, указанное администратором ставки LIBOR для доллара США в методике расчета ставки LIBOR для доллара США) в день, наступающий за два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, до Даты изменения плавающей ставки.

Ненаступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США

Если к 11:55 по лондонскому времени (или другому (скорректированному) времени опубликования ставки LIBOR для доллара США (при наличии такового), указанному администратором ставки LIBOR для доллара США в методике расчета ставки LIBOR для доллара США) в такую Дату изменения плавающей ставки ставка LIBOR для доллара США на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для доллара США не опубликована на странице LIBOR01 в системе Reuters и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться ставка LIBOR для доллара США на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для доллара США, предоставленная администратором ставки LIBOR для доллара США и опубликованная уполномоченным дистрибьютором или самим администратором ставки LIBOR для доллара США. Если к 16:00 по лондонскому времени (или ко времени, наступающему через четыре часа пять минут после другого (скорректированного) времени опубликования ставки LIBOR для доллара США) в такую Дату изменения плавающей ставки ни администратор ставки LIBOR для доллара США, ни уполномоченный дистрибьютор не предоставили и не опубликовали ставку LIBOR для доллара США на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для доллара США и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США не наступила, то, если иное не согласовано сторонами, Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться:

- (А) ставка, официально рекомендованная к использованию администратором ставки LIBOR для доллара США; или
- (Б) ставка, официально рекомендованная к использованию Советом управляющих Федеральной резервной системы США, Федеральным резервным банком Нью-Йорка, каким-либо иным лицом, ответственным за осуществление надзора в отношении ставки LIBOR для доллара США или администратора ставки LIBOR для доллара США,

в каждом случае в течение такого срока, пока не осуществляется публикация ставки LIBOR для доллара США и не наступила Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США. Если существует ставка, описанная в подпункте (А) выше, то применяется такая ставка. Если такая ставка отсутствует, но существует ставка, описанная в подпункте (Б) выше, то применяется ставка, описанная в подпункте (Б) выше. При отсутствии как ставки, описанной в подпункте (А) выше, так и ставки, описанной в подпункте (Б) выше, Расчетный агент определяет ставку, разумно (с коммерческой точки зрения) заменяющую ставку LIBOR для доллара США, принимая во внимание любые ставки, применяемые центральными контрагентами и/или биржами для торговли фьючерсами, в каждом случае обеспечивающими такой объем торгов фьючерсами или иными производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является ставка LIBOR для доллара США, который Расчетный агент посчитает достаточным, чтобы сделать вывод о том, что любая такая ставка является репрезентативной.

Наступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США

При наступлении События прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки, наступающей не менее чем через два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США, будет определяться, как если бы ссылка на USD-LIBOR-BBA была ссылкой на последнюю Резервную ставку (SOFR) для "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", соответствующей Первоначальной дате фиксации ставки для доллара США, предоставленную или опубликованную по состоянию на 10:30 по нью-йоркскому времени в соответствующую Резервную дату установления. Если компания Bloomberg Index Services Limited (или провайдер-правопреемник, утвержденный и/или назначенный ISDA) не предоставила, а уполномоченные дистрибьюторы не опубликовали Резервную ставку (SOFR) для такой "Первоначальной даты отображения ставки IBOR" в 10:30 по нью-йоркскому времени в соответствующую Резервную дату установления или ранее и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться последняя Резервная ставка (SOFR), предоставленная или опубликованная в соответствующий момент времени для последней "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", несмотря на то, что такая дата не соответствует Первоначальной дате фиксации ставки для доллара США.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR)

При наступлении События прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) или позднее, будет являться ставка по предоставлению обеспеченного финансирования на условиях овернайт (Secured Overnight Financing Rate, SOFR) (SOFR), администратором которой является Федеральный резервный банк Нью-Йорка (или администратор-правопреемник в отношении ставки), по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SOFR)", после внесения в ставку SOFR корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой SOFR и Резервной ставкой (SOFR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку SOFR и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется ставка SOFR, ссылка на ставку SOFR будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку SOFR.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR

При наступлении Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) и Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении

ставки SOFR) или позднее, будет являться Рекомендуемая ФРС ставка, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SOFR)", после внесения в Рекомендуемую ФРС ставку корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Рекомендуемой ФРС ставкой и Резервной ставкой (SOFR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ФРС ставки

Если Рекомендуемая ФРС ставка доступна до окончания первого Рабочего дня для торговли государственными ценными бумагами США после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня для торговли государственными ценными бумагами США после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR), но при этом ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали Рекомендуемую ФРС ставку, а Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ФРС ставки не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется Рекомендуемая ФРС ставка, ссылка на Рекомендуемую ФРС ставку будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную Рекомендуемую ФРС ставку.

Отсутствие Рекомендуемой ФРС ставки или наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ФРС ставки

Если:

- (А) Рекомендуемая ФРС ставка отсутствует до окончания первого Рабочего дня для торговли государственными ценными бумагами США после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня для торговли государственными ценными бумагами США после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR); или
- (Б) Рекомендуемая ФРС ставка существует, но впоследствии в отношении нее наступает Дата наступления события прекращения резервной ставки,

то Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR) или в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ФРС ставки (как применимо) или позднее, будет являться ставка фондирования банков на условиях овернайт (Overnight Bank Funding Rate, OBFR), опубликованная Федеральным резервным банком Нью-Йорка (или администратором-правопреемником в отношении ставки) на Сайте Федерального резервного банка Нью-Йорка (**OBFR**), или, если ставка OBFR не предоставлена Федеральным резервным банком Нью-Йорка (или администратором-правопреемником в отношении ставки), опубликованная уполномоченным дистрибьютором, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SOFR)", после внесения в ставку OBFR корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой OBFR и Резервной ставкой (SOFR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки OBFR

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку OBFR и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки OBFR не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется ставка OBFR, ссылка на ставку OBFR будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку OBFR.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки OBFR

Если:

- (А) Рекомендуемая ФРС ставка отсутствует или Рекомендуемая ФРС ставка существует, но впоследствии в отношении нее наступает Дата наступления события прекращения резервной ставки; и
- (Б) наступает Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки OBFR,

то Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого

Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки OBFR (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ФРС ставки, Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR или Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) (как применимо)) или позднее, будет являться целевая краткосрочная процентная ставка, которая устанавливается Федеральным комитетом открытого рынка Федеральной резервной системы США и публикуется на Сайте Федеральной резервной системы США, или, если Федеральный комитет открытого рынка Федеральной резервной системы США не устанавливает единую ставку, среднее арифметическое значение краткосрочной процентной ставки в целевом диапазоне, устанавливаемом Федеральным комитетом открытого рынка Федеральной резервной системы США и публикуемом на Сайте Федеральной резервной системы США (рассчитываемое как среднее арифметическое значение верхней и нижней границ целевого диапазона; при этом полученный результат в случае необходимости округляется в порядке, установленном в пункте 1.10(a) Стандартных условий, но до второго знака после запятой (например, 0,01%)) (*Целевая ставка FOMC*), по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SOFR)", после внесения в Целевую ставку FOMC корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Целевой ставкой FOMC и Резервной ставкой (SOFR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Целевой ставки FOMC

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали Целевую ставку FOMC и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Целевой ставки FOMC не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется Целевая ставка FOMC, ссылка на Целевую ставку FOMC будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную Целевую ставку FOMC.

Применительно к Способу определения плавающей ставки "USD-LIBOR-BBA" и ссылкам на Резервную дату установления в Способе определения плавающей ставки "USD-LIBOR-BBA", ссылки на "Рабочие дни" считаются ссылками на те Рабочие дни, которые применяются для целей обязательства по осуществлению платежа, рассчитываемого с использованием Способа определения плавающей ставки "USD-LIBOR-BBA", а ссылки на "Первоначальную дату отображения ставки IBOR" считаются ссылками на такую дату, как она отображается в Источнике резервной ставки (SOFR).

Помимо терминов, определенных выше, для целей Способа определения плавающей ставки "USD-LIBOR-BBA" следующие термины имеют следующие значения.

LIBOR для доллара США означает ставку фондирования в долларах США, известную как "ставка LIBOR для доллара США" (U.S. Dollar LIBOR) (лондонская межбанковская ставка предложения (London Interbank Offered Rate)), предоставляемую компанией ICE Benchmark Administration Limited как администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки).

Источник резервной ставки (SOFR) означает отображаемую на мониторе электронную страницу в системе Bloomberg, соответствующую тикеру Bloomberg для ставки, заменяющей ставку LIBOR для доллара США на срок, равный Периоду плавающей ставки, доступ к которой осуществляется с использованием страницы <FBAK> <GO> в системе Bloomberg (или, если применимо, с использованием страницы <HP> <GO> в системе Bloomberg), или любой иной источник опубликования, определенный компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA).

Первоначальная дата фиксации ставки для доллара США означает для любой Даты изменения плавающей ставки день, наступающий за два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, до такой Даты изменения плавающей ставки, если иное не согласовано сторонами.

Рабочий день для торговли государственными ценными бумагами США означает любой день, кроме субботы, воскресенья или дня, в который Ассоциация индустрии ценных бумаг и финансовых рынков (Securities Industry and Financial Markets Association, SIFMA) рекомендовала своим членам закрыть на весь день их отделы по проведению операций с инструментами с фиксированной доходностью для целей торговли государственными ценными бумагами США.

Резервная ставка (SOFR) означает скорректированную по сроку ставку SOFR, увеличенную на спред по отношению к ставке LIBOR для доллара США, в каждом случае применительно к сроку, равному Периоду плавающей ставки, которые предоставляются компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA), действующей(-им) в качестве провайдера скорректированной по сроку ставки SOFR и спреда, и публикуются в Источнике резервной ставки (SOFR) (либо в других источниках) или предоставляются уполномоченным дистрибьюторам и публикуются такими уполномоченными дистрибьюторами.

Рекомендуемая ФРС ставка означает ставку (включая любые спреды или корректировки), рекомендованную в качестве замены ставки SOFR Советом управляющих Федеральной резервной системы США, Федеральным резервным банком Нью-Йорка или каким-либо комитетом, официально назначенным или созданным Советом управляющих Федеральной резервной системы США или Федеральным резервным банком Нью-Йорка для целей рекомендации по замене ставки SOFR другой ставкой (такая другая ставка может быть установлена Федеральным резервным банком Нью-Йорка или другим администратором ставки), и предоставляемую администратором такой ставки или, если такая ставка не предоставляется администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки), публикуемую уполномоченным дистрибьютором.

- (б) **USD-LIBOR-BBA-Bloomberg** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка LIBOR для доллара США на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая под заголовком "LIBOR FIX BBAM<GO>" на странице BTMM в системе Bloomberg в 11:55 по лондонскому времени (и отражающая публикацию по состоянию на 11:00 по лондонскому времени) (или публикуемая в любое другое (скорректированное) время, указанное администратором ставки LIBOR для доллара США в методике расчета ставки LIBOR для доллара США) в день, наступающий за два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, до Даты изменения плавающей ставки.

Ненаступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США

Если к 11:55 по лондонскому времени (или другому (скорректированному) времени опубликования ставки LIBOR для доллара США (при наличии такового), указанному администратором ставки LIBOR для доллара США в методике расчета ставки LIBOR для доллара США) в такую Дату изменения плавающей ставки ставка LIBOR для доллара США на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для доллара США не опубликована под заголовком "LIBOR FIX BBAM<GO>" на странице BTMM в системе Bloomberg и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться ставка LIBOR для доллара США на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для доллара США, предоставленная администратором ставки LIBOR для доллара США и опубликованная уполномоченным дистрибьютором или самим администратором ставки LIBOR для доллара США. Если к 16:00 по лондонскому времени (или ко времени, наступающему через четыре часа пять минут после другого (скорректированного) времени опубликования ставки LIBOR для доллара США) в такую Дату изменения плавающей ставки ни администратор ставки LIBOR для доллара США, ни уполномоченный дистрибьютор не предоставили и не опубликовали ставку LIBOR для доллара США на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для доллара США и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США не наступила, то, если иное не согласовано сторонами, Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться:

- (А) ставка, официально рекомендованная к использованию администратором ставки LIBOR для доллара США; или
- (Б) ставка, официально рекомендованная к использованию Советом управляющих Федеральной резервной системы США, Федеральным резервным банком Нью-Йорка, каким-либо иным лицом, ответственным за осуществление надзора в отношении ставки LIBOR для доллара США или администратора ставки LIBOR для доллара США,

в каждом случае в течение такого срока, пока не осуществляется публикация ставки LIBOR для доллара США и не наступила Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США. Если существует ставка, описанная в подпункте (А) выше, то применяется такая ставка. Если такая ставка отсутствует, но существует ставка, описанная в подпункте (Б) выше, то применяется ставка, описанная в подпункте (Б) выше. При отсутствии как ставки, описанной в подпункте (А) выше, так и ставки, описанной в подпункте (Б) выше, Расчетный агент определяет ставку, разумно (с коммерческой точки зрения) заменяющую ставку LIBOR для доллара США, принимая во внимание любые ставки, применяемые центральными контрагентами и/или биржами для торговли фьючерсами, в каждом случае обеспечивающими такой объем торгов фьючерсами или иными производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является ставка LIBOR для доллара США, который Расчетный агент посчитает достаточным, чтобы сделать вывод о том, что любая такая ставка является репрезентативной.

Наступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США

При наступлении События прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки, наступающей не менее чем через два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для доллара США, будет определяться, как если бы ссылка на USD-LIBOR-BBA-Bloomberg была ссылкой на последнюю Резервную ставку (SOFR) для "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", соответствующей Первоначальной дате фиксации ставки для доллара США, предоставленную или опубликованную по состоянию на 10:30 по нью-йоркскому времени в соответствующую

Резервную дату установления. Если компания Bloomberg Index Services Limited (или провайдер-правопреемник, утвержденный и/или назначенный ISDA) не предоставила, а уполномоченные дистрибьюторы не опубликовали Резервную ставку (SOFR) для такой "Первоначальной даты отображения ставки IBOR" в 10:30 по нью-йоркскому времени в соответствующую Резервную дату установления или ранее и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться последняя Резервная ставка (SOFR), предоставленная или опубликованная в соответствующий момент времени для последней "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", несмотря на то, что такая дата не соответствует Первоначальной дате фиксации ставки для доллара США.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR)

При наступлении События прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) или позднее, будет являться ставка по предоставлению обеспеченного финансирования на условиях овернайт (Secured Overnight Financing Rate, **SOFR**) (**SOFR**), администратором которой является Федеральный резервный банк Нью-Йорка (или администратор-правопреемник в отношении ставки), по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SOFR)", после внесения в ставку SOFR корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой SOFR и Резервной ставкой (SOFR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку SOFR и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется ставка SOFR, ссылка на ставку SOFR будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку SOFR.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR

При наступлении Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) и Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR) или позднее, будет являться Рекомендуемая ФРС ставка, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SOFR)", после внесения в Рекомендуемую ФРС ставку корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Рекомендуемой ФРС ставкой и Резервной ставкой (SOFR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ФРС ставки

Если Рекомендуемая ФРС ставка доступна до окончания первого Рабочего дня для торговли государственными ценными бумагами США после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня для торговли государственными ценными бумагами США после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR), но при этом ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали Рекомендуемую ФРС ставку, а Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ФРС ставки не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется Рекомендуемая ФРС ставка, ссылка на Рекомендуемую ФРС ставку будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную Рекомендуемую ФРС ставку.

Отсутствие Рекомендуемой ФРС ставки или наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ФРС ставки

Если:

- (А) Рекомендуемая ФРС ставка отсутствует до окончания первого Рабочего дня для торговли государственными ценными бумагами США после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) (или, если позднее, до окончания первого

Рабочего дня для торговли государственными ценными бумагами США после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR); или

- (Б) Рекомендуемая ФРС ставка существует, но впоследствии в отношении нее наступает Дата наступления события прекращения резервной ставки,

то Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR) или в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ФРС ставки (как применимо) или позднее, будет являться ставка фондирования банков на условиях овернайт (Overnight Bank Funding Rate, OBFR), опубликованная Федеральным резервным банком Нью-Йорка (или администратором-правопреемником в отношении ставки) на Сайте Федерального резервного банка Нью-Йорка (**OBFR**), или, если ставка OBFR не предоставлена Федеральным резервным банком Нью-Йорка (или администратором-правопреемником в отношении ставки), опубликованная уполномоченным дистрибьютором, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SOFR)", после внесения в ставку OBFR корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой OBFR и Резервной ставкой (SOFR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки OBFR

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку OBFR и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки OBFR не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется ставка OBFR, ссылка на ставку OBFR будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку OBFR.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки OBFR

Если:

- (А) Рекомендуемая ФРС ставка отсутствует или Рекомендуемая ФРС ставка существует, но впоследствии в отношении нее наступает Дата наступления события прекращения резервной ставки; и
- (Б) наступает Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки OBFR,

то Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки OBFR (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ФРС ставки, Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SOFR или Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) (как применимо)) или позднее, будет являться целевая краткосрочная процентная ставка, которая устанавливается Федеральным комитетом открытого рынка Федеральной резервной системы США и публикуется на Сайте Федеральной резервной системы США, или, если Федеральный комитет открытого рынка Федеральной резервной системы США не устанавливает единую ставку, среднее арифметическое значение краткосрочной процентной ставки в целевом диапазоне, устанавливаемом Федеральным комитетом открытого рынка Федеральной резервной системы США и публикуемом на Сайте Федеральной резервной системы США (рассчитываемое как среднее арифметическое значение верхней и нижней границ целевого диапазона; при этом полученный результат в случае необходимости округляется в порядке, установленном в пункте 1.10(a) Стандартных условий, но до второго знака после запятой (например, 0,01%)) (**Целевая ставка FOMC**), по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SOFR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SOFR)", после внесения в Целевую ставку FOMC корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Целевой ставкой FOMC и Резервной ставкой (SOFR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Целевой ставки FOMC

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали Целевую ставку FOMC и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Целевой ставки FOMC не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется Целевая ставка FOMC, ссылка на Целевую ставку FOMC будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную Целевую ставку FOMC.

Применительно к Способу определения плавающей ставки "USD-LIBOR-BBA-Bloomberg" и ссылкам на Резервную дату установления в Способе определения плавающей ставки "USD-LIBOR-BBA-Bloomberg", ссылки на "Рабочие дни" считаются ссылками на те Рабочие дни, которые применяются для целей обязательства по осуществлению платежа, рассчитываемого с использованием Способа определения плавающей ставки "USD-LIBOR-BBA-Bloomberg", а ссылки на "Первоначальную дату отображения ставки IBOR" считаются ссылками на такую дату, как она отображается в Источнике резервной ставки (SOFR).

Помимо терминов, определенных выше, для целей Способа определения плавающей ставки "USD-LIBOR-BBA-Bloomberg" следующие термины имеют следующие значения.

LIBOR для доллара США означает ставку фондирования в долларах США, известную как "ставка LIBOR для доллара США" (U.S. Dollar LIBOR) (лондонская межбанковская ставка предложения (London Interbank Offered Rate)), предоставляемую компанией ICE Benchmark Administration Limited как администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки).

Источник резервной ставки (SOFR) означает отображаемую на мониторе электронную страницу в системе Bloomberg, соответствующую тикеру Bloomberg для ставки, заменяющей ставку LIBOR для доллара США на срок, равный Периоду плавающей ставки, доступ к которой осуществляется с использованием страницы <FBAK> <GO> в системе Bloomberg (или, если применимо, с использованием страницы <HP> <GO> в системе Bloomberg), или любой иной источник опубликования, определенный компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA).

Первоначальная дата фиксации ставки для доллара США означает для любой Даты изменения плавающей ставки день, наступающий за два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, до такой Даты изменения плавающей ставки, если иное не согласовано сторонами.

Рабочий день для торговли государственными ценными бумагами США означает любой день, кроме субботы, воскресенья или дня, в который Ассоциация индустрии ценных бумаг и финансовых рынков (Securities Industry and Financial Markets Association, SIFMA) рекомендовала своим членам закрыть на весь день их отделы по проведению операций с инструментами с фиксированной доходностью для целей торговли государственными ценными бумагами США.

Резервная ставка (SOFR) означает скорректированную по сроку ставку SOFR, увеличенную на спред по отношению к ставке LIBOR для доллара США, в каждом случае применительно к сроку, равному Периоду плавающей ставки, которые предоставляются компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA), действующей(-им) в качестве провайдера скорректированной по сроку ставки SOFR и спреда, и публикуются в Источнике резервной ставки (SOFR) (либо в других источниках) или предоставляются уполномоченным дистрибьюторам и публикуются такими уполномоченными дистрибьюторами.

Рекомендуемая ФРС ставка означает ставку (включая любые спреды или корректировки), рекомендованную в качестве замены ставки SOFR Советом управляющих Федеральной резервной системы США, Федеральным резервным банком Нью-Йорка или каким-либо комитетом, официально назначенным или созданным Советом управляющих Федеральной резервной системы США или Федеральным резервным банком Нью-Йорка для целей рекомендации по замене ставки SOFR другой ставкой (такая другая ставка может быть установлена Федеральным резервным банком Нью-Йорка или другим администратором ставки), и предоставляемую администратором такой ставки или, если такая ставка не предоставляется администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки), публикуемую уполномоченным дистрибьютором.

По суммам, выраженным в евро

- (в) **EUR-LIBOR-BBA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка LIBOR для евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая на странице LIBOR01 в системе Reuters в 11:55 по лондонскому времени (и отражающая публикацию по состоянию на 11:00 по лондонскому времени) (или публикуемая в любое другое (скорректированное) время, указанное администратором ставки LIBOR для евро в методике расчета ставки LIBOR для евро) в день, наступающий за два Рабочих дня для Системы TARGET до Даты изменения плавающей ставки.

Ненаступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро

Если к 11:55 по лондонскому времени (или другому (скорректированному) времени опубликования ставки LIBOR для евро (при наличии такового), указанному администратором ставки LIBOR для евро в методике расчета ставки LIBOR для евро) в такую Дату изменения плавающей ставки ставка LIBOR для евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для евро не опубликована на странице LIBOR01 в системе Reuters и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться ставка LIBOR для евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для евро, предоставленная администратором ставки LIBOR для евро и опубликованная уполномоченным дистрибьютором или самим администратором ставки LIBOR для евро.

евро. Если к 16:00 по лондонскому времени (или ко времени, наступающему через четыре часа пять минут после другого (скорректированного) времени опубликования ставки LIBOR для евро) в такую Дату изменения плавающей ставки ни администратор ставки LIBOR для евро, ни уполномоченный дистрибьютор не предоставили и не опубликовали ставку LIBOR для евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для евро и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро не наступила, то, если иное не согласовано сторонами, Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться:

- (А) ставка, официально рекомендованная к использованию администратором ставки LIBOR для евро; или
- (Б) ставка, официально рекомендованная к использованию лицом, ответственным за осуществление надзора в отношении ставки LIBOR для евро или администратором ставки LIBOR для евро,

в каждом случае в течение такого срока, пока не осуществляется публикация ставки LIBOR для евро и не наступила Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро. Если существует ставка, описанная в подпункте (А) выше, то применяется такая ставка. Если такая ставка отсутствует, но существует ставка, описанная в подпункте (Б) выше, то применяется ставка, описанная в подпункте (Б) выше. При отсутствии как ставки, описанной в подпункте (А) выше, так и ставки, описанной в подпункте (Б) выше, Расчетный агент определяет ставку, разумно (с коммерческой точки зрения) заменяющую ставку LIBOR для евро, принимая во внимание любые ставки, применяемые центральными контрагентами и/или биржами для торговли фьючерсами, в каждом случае обеспечивающими такой объем торгов фьючерсами или иными производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является ставка LIBOR для евро, который Расчетный агент посчитает достаточным, чтобы сделать вывод о том, что любая такая ставка является репрезентативной.

Наступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро

При наступлении События прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки, наступающей не менее чем через два Рабочих дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро, будет определяться, как если бы ссылка на EUR-LIBOR-BBA была ссылкой на последнюю Резервную ставку (EuroSTR) для "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", соответствующей Первоначальной дате фиксации ставки для евро, предоставленную или опубликованную по состоянию на 11:30 по франкфуртскому времени в соответствующую Резервную дату установления. Если компания Bloomberg Index Services Limited (или провайдер-правопреемник, утвержденный и/или назначенный ISDA) не предоставила, а уполномоченные дистрибьюторы не опубликовали Резервную ставку (EuroSTR) для такой "Первоначальной даты отображения ставки IBOR" в 11:30 по франкфуртскому времени в соответствующую Резервную дату установления или ранее и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться последняя Резервная ставка (EuroSTR), предоставленная или опубликованная в соответствующий момент времени для последней "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", несмотря на то, что такая дата не соответствует Первоначальной дате фиксации ставки для евро.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR)

При наступлении События прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) или позднее, будет являться краткосрочная процентная ставка на денежном рынке в евро (Euro Short-Term Rate, EuroSTR) (**EuroSTR**), администратором которой является Европейский центральный банк (или администратор-правопреемник в отношении ставки), по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (EuroSTR)", после внесения в ставку EuroSTR корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой EuroSTR и Резервной ставкой (EuroSTR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку EuroSTR и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется ставка EuroSTR, ссылка на ставку EuroSTR будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку EuroSTR.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR

При наступлении Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) и Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR) или позднее, будет являться Рекомендуемая ЕЦБ ставка, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (EuroSTR)", после внесения в Рекомендуемую ЕЦБ ставку корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Рекомендуемой ЕЦБ ставкой и Резервной ставкой (EuroSTR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки

Если Рекомендуемая ЕЦБ ставка доступна до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR), но при этом ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали Рекомендуемую ЕЦБ ставку, а Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется Рекомендуемая ЕЦБ ставка, ссылка на Рекомендуемую ЕЦБ ставку будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную Рекомендуемую ЕЦБ ставку.

Отсутствие Рекомендуемой ЕЦБ ставки или наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки

Если:

- (А) Рекомендуемая ЕЦБ ставка не рекомендована до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR); или
- (Б) впоследствии наступает Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки,

то Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR) или в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки (как применимо) или позднее, будет являться ставка Модифицированная EDFR, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (EuroSTR)", после внесения в ставку Модифицированная EDFR корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой Модифицированная EDFR и Резервной ставкой (EuroSTR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки Модифицированная EDFR

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку Модифицированная EDFR (или индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в определении термина "Модифицированная EDFR") и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении такой ставки не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется такая ставка, ссылка на такую ставку будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку Модифицированная EDFR (или последний предоставленный или опубликованный индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в определении термина "Модифицированная EDFR").

Применительно к Способу определения плавающей ставки "EUR-LIBOR-BBA" и ссылкам на Резервную дату установления в Способе определения плавающей ставки "EUR-LIBOR-BBA", ссылки на "Рабочие дни" считаются ссылками на те Рабочие дни, которые применяются для целей обязательства по осуществлению

платежа, рассчитываемого с использованием Способа определения плавающей ставки "EUR-LIBOR-BBA", а ссылки на "Первоначальную дату отображения ставки IBOR" считаются ссылками на такую дату, как она отображается в Источнике резервной ставки (EuroSTR).

Помимо терминов, определенных выше, для целей Способа определения плавающей ставки "EUR-LIBOR-BBA" следующие термины имеют следующие значения.

LIBOR для евро означает ставку фондирования в евро, известную как "ставка LIBOR для евро" (Euro LIBOR) (лондонская межбанковская ставка предложения (London Interbank Offered Rate)), предоставляемую компанией ICE Benchmark Administration Limited как администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки).

Евросистема означает Европейский центральный банк и национальные центральные банки государств-членов Европейского союза, валютой которых является евро.

Источник резервной ставки (EuroSTR) означает отображаемую на мониторе электронную страницу в системе Bloomberg, соответствующую тикеру Bloomberg для ставки, заменяющей ставку LIBOR для евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, доступ к которой осуществляется с использованием страницы <FBAK> <GO> в системе Bloomberg (или, если применимо, с использованием страницы <HP> <GO> в системе Bloomberg), или любой иной источник опубликования, определенный компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA).

Модифицированная EDFR означает ставку, равную Ставке по депозитам Евросистемы, увеличенной на Спред EDFR.

Первоначальная дата фиксации ставки для евро означает для любой Даты изменения плавающей ставки день, наступающий за два Рабочих дня для Системы TARGET до такой Даты изменения плавающей ставки, если иное не согласовано сторонами.

Резервная ставка (EuroSTR) означает скорректированную по сроку ставку EuroSTR, увеличенную на спред по отношению к ставке LIBOR для евро, в каждом случае применительно к сроку, равному Периоду плавающей ставки, которые предоставляются компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA), действующей(-им) в качестве провайдера скорректированной по сроку ставки EuroSTR и спреда, и публикуются в Источнике резервной ставки (EuroSTR) (либо в других источниках) или предоставляются уполномоченным дистрибьюторам и публикуются такими уполномоченными дистрибьюторами.

Рекомендуемая ЕЦБ ставка означает ставку (включая любые спреды или корректировки), рекомендованную в качестве замены ставки EuroSTR Европейским центральным банком (или администратором-правопреемником в отношении ставки EuroSTR) и/или комитетом, официально назначенным или созданным Европейским центральным банком (или администратором-правопреемником в отношении ставки EuroSTR) для целей рекомендации по замене ставки EuroSTR другой ставкой (такая другая ставка может быть установлена Европейским центральным банком или другим администратором ставки), и предоставляемую администратором такой ставки или, если такая ставка не предоставляется администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки), публикуемую уполномоченным дистрибьютором.

Спред EDFR означает:

- (А) если Рекомендуемая ЕЦБ ставка не рекомендована до конца первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR), среднее арифметическое значение ежедневной разницы между ставкой EuroSTR и Ставкой по депозитам Евросистемы за период наблюдения, равный 30 Рабочим дням для Системы TARGET, начинающийся за 30 Рабочих дней для Системы TARGET до дня, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, 30 Рабочих дней для Системы TARGET до дня, в который наступает первое Событие прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR), и заканчивающийся в Рабочий день для Системы TARGET, непосредственно предшествующий дню, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, Рабочий день для Системы TARGET, непосредственно предшествующий дню, в который наступает первое Событие прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR); или
- (Б) если наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки, среднее арифметическое значение ежедневной разницы между Рекомендуемой ЕЦБ ставкой и Ставкой по депозитам Евросистемы за период наблюдения, равный 30 Рабочим дням для Системы TARGET, начинающийся за 30 Рабочих дней для Системы TARGET до дня, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки, и заканчивающийся в Рабочий день для Системы TARGET, непосредственно предшествующий дню, в

который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки.

Ставка по депозитам Евросистемы означает ставку по депозитам, которую банки могут использовать для размещения депозитов на условиях овернайт в Евросистеме и которая публикуется на Сайте Европейского центрального банка.

- (г) **EUR-LIBOR-BBA-Bloomberg** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка LIBOR для евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая под заголовком "EUR LIBOR FIX" на странице BTMM EU в системе Bloomberg в 11:55 по лондонскому времени (и отражающая публикацию по состоянию на 11:00 по лондонскому времени) (или публикуемая в любое другое (скорректированное) время, указанное администратором ставки LIBOR для евро в методике расчета ставки LIBOR для евро) в день, наступающий за два Рабочих дня для Системы TARGET до Даты изменения плавающей ставки.

Ненаступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро

Если к 11:55 по лондонскому времени (или другому (скорректированному) времени опубликования ставки LIBOR для евро (при наличии такового), указанному администратором ставки LIBOR для евро в методике расчета ставки LIBOR для евро) в такую Дату изменения плавающей ставки ставка LIBOR для евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для евро не опубликована под заголовком "EUR LIBOR FIX" на странице BTMM EU в системе Bloomberg и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться ставка LIBOR для евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для евро, предоставленная администратором ставки LIBOR для евро и опубликованная уполномоченным дистрибьютором или самим администратором ставки LIBOR для евро. Если к 16:00 по лондонскому времени (или ко времени, наступающему через четыре часа пять минут после другого (скорректированного) времени опубликования ставки LIBOR для евро) в такую Дату изменения плавающей ставки ни администратор ставки LIBOR для евро, ни уполномоченный дистрибьютор не предоставили и не опубликовали ставку LIBOR для евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для евро и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро не наступила, то, если иное не согласовано сторонами, Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться:

- (А) ставка, официально рекомендованная к использованию администратором ставки LIBOR для евро; или
- (Б) ставка, официально рекомендованная к использованию лицом, ответственным за осуществление надзора в отношении ставки LIBOR для евро или администратором ставки LIBOR для евро,

в каждом случае в течение такого срока, пока не осуществляется публикация ставки LIBOR для евро и не наступила Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро. Если существует ставка, описанная в подпункте (А) выше, то применяется такая ставка. Если такая ставка отсутствует, но существует ставка, описанная в подпункте (Б) выше, то применяется ставка, описанная в подпункте (Б) выше. При отсутствии как ставки, описанной в подпункте (А) выше, так и ставки, описанной в подпункте (Б) выше, Расчетный агент определяет ставку, разумно (с коммерческой точки зрения) заменяющую ставку LIBOR для евро, принимая во внимание любые ставки, применяемые центральными контрагентами и/или биржами для торговли фьючерсами, в каждом случае обеспечивающими такой объем торгов фьючерсами или иными производными финансовыми инструментами, базисным актовым которых является ставка LIBOR для евро, который Расчетный агент посчитает достаточным, чтобы сделать вывод о том, что любая такая ставка является репрезентативной.

Наступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро

При наступлении События прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки, наступающей не менее чем через два Рабочих дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для евро, будет определяться, как если бы ссылка на EUR-LIBOR-BBA-Bloomberg была ссылкой на последнюю Резервную ставку (EuroSTR) для "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", соответствующей Первоначальной дате фиксации ставки для евро, предоставленную или опубликованную по состоянию на 11:30 по франкфуртскому времени в соответствующую Резервную дату установления. Если компания Bloomberg Index Services Limited (или провайдер-правопреемник, утвержденный и/или назначенный ISDA) не предоставила, а уполномоченные дистрибьюторы не опубликовали Резервную ставку (EuroSTR) для такой "Первоначальной даты отображения ставки IBOR" в 11:30 по франкфуртскому времени в соответствующую Резервную дату установления или ранее и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться последняя Резервная ставка (EuroSTR), предоставленная или опубликованная в соответствующий момент времени для последней "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", несмотря на то, что такая дата не соответствует Первоначальной дате фиксации ставки для евро.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR)

При наступлении События прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) или позднее, будет являться краткосрочная процентная ставка на денежном рынке в евро (Euro Short-Term Rate, EuroSTR) (*EuroSTR*), администратором которой является Европейский центральный банк (или администратор-правопреемник в отношении ставки), по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (EuroSTR)", после внесения в ставку EuroSTR корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой EuroSTR и Резервной ставкой (EuroSTR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку EuroSTR и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется ставка EuroSTR, ссылка на ставку EuroSTR будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку EuroSTR.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR

При наступлении Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) и Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR) или позднее, будет являться Рекомендуемая ЕЦБ ставка, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (EuroSTR)", после внесения в Рекомендуемую ЕЦБ ставку корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Рекомендуемой ЕЦБ ставкой и Резервной ставкой (EuroSTR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки

Если Рекомендуемая ЕЦБ ставка доступна до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR), но при этом ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали Рекомендуемую ЕЦБ ставку, а Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется Рекомендуемая ЕЦБ ставка, ссылка на Рекомендуемую ЕЦБ ставку будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную Рекомендуемую ЕЦБ ставку.

Отсутствие Рекомендуемой ЕЦБ ставки или наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки

Если:

- (А) Рекомендуемая ЕЦБ ставка не рекомендована до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR); или
- (Б) впоследствии наступает Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки,

то Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения

резервной ставки в отношении ставки EuroSTR) или в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки (как применимо) или позднее, будет являться ставка Модифицированная EDFR, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (EuroSTR)", после внесения в ставку Модифицированная EDFR корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой Модифицированная EDFR и Резервной ставкой (EuroSTR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки Модифицированная EDFR

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку Модифицированная EDFR (или индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в определении термина "Модифицированная EDFR") и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении такой ставки не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется такая ставка, ссылка на такую ставку будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку Модифицированная EDFR (или последний предоставленный или опубликованный индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в определении термина "Модифицированная EDFR").

Применительно к Способу определения плавающей ставки "EUR-LIBOR-BBA-Bloomberg" и ссылкам на Резервную дату установления в Способе определения плавающей ставки "EUR-LIBOR-BBA-Bloomberg", ссылки на "Рабочие дни" считаются ссылками на те Рабочие дни, которые применяются для целей обязательства по осуществлению платежа, рассчитываемого с использованием Способа определения плавающей ставки "EUR-LIBOR-BBA-Bloomberg", а ссылки на "Первоначальную дату отображения ставки IBOR" считаются ссылками на такую дату, как она отображается в Источнике резервной ставки (EuroSTR).

Помимо терминов, определенных выше, для целей Способа определения плавающей ставки "EUR-LIBOR-BBA-Bloomberg" следующие термины имеют следующие значения.

LIBOR для евро означает ставку фондирования в евро, известную как "ставка LIBOR для евро" (Euro LIBOR) (лондонская межбанковская ставка предложения (London Interbank Offered Rate)), предоставляемую компанией ICE Benchmark Administration Limited как администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки).

Евросистема означает Европейский центральный банк и национальные центральные банки государств-членов Европейского союза, валютой которых является евро.

Источник резервной ставки (EuroSTR) означает отображаемую на мониторе электронную страницу в системе Bloomberg, соответствующую тикеру Bloomberg для ставки, заменяющей ставку LIBOR для евро на срок, равный Периоду плавающей ставки, доступ к которой осуществляется с использованием страницы <FBAK> <GO> в системе Bloomberg (или, если применимо, с использованием страницы <HP> <GO> в системе Bloomberg), или любой иной источник опубликования, определенный компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA).

Модифицированная EDFR означает ставку, равную Ставке по депозитам Евросистемы, увеличенной на Спред EDFR.

Первоначальная дата фиксации ставки для евро означает для любой Даты изменения плавающей ставки день, наступающий за два Рабочих дня для Системы TARGET до такой Даты изменения плавающей ставки, если иное не согласовано сторонами.

Резервная ставка (EuroSTR) означает скорректированную по сроку ставку EuroSTR, увеличенную на спред по отношению к ставке LIBOR для евро, в каждом случае применительно к сроку, равному Периоду плавающей ставки, которые предоставляются компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA), действующей(-им) в качестве провайдера скорректированной по сроку ставки EuroSTR и спреда, и публикуются в Источнике резервной ставки (EuroSTR) (либо в других источниках) или предоставляются уполномоченным дистрибьюторам и публикуются такими уполномоченными дистрибьюторами.

Рекомендуемая ЕЦБ ставка означает ставку (включая любые спреды или корректировки), рекомендованную в качестве замены ставки EuroSTR Европейским центральным банком (или администратором-правопреемником в отношении ставки EuroSTR) и/или комитетом, официально назначенным или созданным Европейским центральным банком (или администратором-правопреемником в отношении ставки EuroSTR) для целей рекомендации по замене ставки EuroSTR другой ставкой (такая другая ставка может быть установлена Европейским центральным банком или другим администратором ставки), и предоставляемую администратором такой ставки или, если такая ставка не предоставляется администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки), публикуемую уполномоченным дистрибьютором.

Сред EDFR означает:

- (А) если Рекомендуемая ЕЦБ ставка не рекомендована до конца первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR), среднее арифметическое значение ежедневной разницы между ставкой EuroSTR и Ставкой по депозитам Евросистемы за период наблюдения, равный 30 Рабочим дням для Системы TARGET, начинающийся за 30 Рабочих дней для Системы TARGET до дня, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, 30 Рабочих дней для Системы TARGET до дня, в который наступает первое Событие прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR), и заканчивающийся в Рабочий день для Системы TARGET, непосредственно предшествующий дню, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, Рабочий день для Системы TARGET, непосредственно предшествующий дню, в который наступает первое Событие прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR); или
- (Б) если наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки, среднее арифметическое значение ежедневной разницы между Рекомендуемой ЕЦБ ставкой и Ставкой по депозитам Евросистемы за период наблюдения, равный 30 Рабочим дням для Системы TARGET, начинающийся за 30 Рабочих дней для Системы TARGET до дня, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки, и заканчивающийся в Рабочий день для Системы TARGET, непосредственно предшествующий дню, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки.

Ставка по депозитам Евросистемы означает ставку по депозитам, которую банки могут использовать для размещения депозитов на условиях овернайт в Евросистеме и которая публикуется на Сайте Европейского центрального банка.

- (д) **EUR-EURIBOR-Reuters** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка EURIBOR на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая на странице EURIBOR01 в системе Reuters по состоянию на 11:00 по брюссельскому времени (или публикуемая в любое другое (скорректированное) время, указанное администратором ставки EURIBOR в методике расчета ставки EURIBOR) в день, наступающий за два Рабочих дня для Системы TARGET до Даты изменения плавающей ставки.

Ненаступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки EURIBOR

Если к 11:00 по брюссельскому времени (или другому (скорректированному) времени опубликования ставки EURIBOR (при наличии такового), указанному администратором ставки EURIBOR в методике расчета ставки EURIBOR) в такую Дату изменения плавающей ставки ставка EURIBOR на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для евро не опубликована на странице EURIBOR01 в системе Reuters и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки EURIBOR не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться ставка EURIBOR на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для евро, предоставленная администратором ставки EURIBOR и опубликованная уполномоченным дистрибьютором или самим администратором ставки EURIBOR. Если к 15:00 по брюссельскому времени (или ко времени, наступающему через четыре часа после другого (скорректированного) времени опубликования ставки EURIBOR) в такую Дату изменения плавающей ставки ни администратор ставки EURIBOR, ни уполномоченный дистрибьютор не предоставили и не опубликовали ставку EURIBOR на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для евро и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки EURIBOR не наступила, то, если иное не согласовано сторонами, Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться:

- (А) ставка, официально рекомендованная к использованию администратором ставки EURIBOR; или
- (Б) ставка, официально рекомендованная к использованию лицом, ответственным за осуществление надзора в отношении ставки EURIBOR или администратором ставки EURIBOR,

в каждом случае в течение такого срока, пока не осуществляется публикация ставки EURIBOR и не наступила Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки EURIBOR. Если существует ставка, описанная в подпункте (А) выше, то применяется такая ставка. Если такая ставка отсутствует, но существует ставка, описанная в подпункте (Б) выше, то применяется ставка, описанная в подпункте (Б) выше. При отсутствии как ставки, описанной в подпункте (А) выше, так и ставки, описанной в подпункте (Б) выше, Расчетный агент определяет ставку, разумно (с коммерческой точки зрения) заменяющую ставку EURIBOR, принимая во внимание любые ставки, применяемые центральными контрагентами и/или биржами для торговли фьючерсами, в каждом случае обеспечивающими такой объем торгов фьючерсами или иными производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является ставка EURIBOR, который Расчетный агент посчитает достаточным, чтобы сделать вывод о том, что любая такая ставка является репрезентативной.

Наступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки EURIBOR

При наступлении События прекращения ставки в отношении ставки EURIBOR Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки, наступающей не менее чем через два Рабочих дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки EURIBOR, будет определяться, как если бы ссылка на EUR-EURIBOR-Reuters была ссылкой на последнюю Резервную ставку (EuroSTR) для "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", соответствующей Первоначальной дате фиксации ставки для евро, предоставленную или опубликованную по состоянию на 11:30 по франкфуртскому времени в соответствующую Резервную дату установления. Если компания Bloomberg Index Services Limited (или провайдер-правопреемник, утвержденный и/или назначенный ISDA) не предоставила, а уполномоченные дистрибьюторы не опубликовали Резервную ставку (EuroSTR) для такой "Первоначальной даты отображения ставки IBOR" в 11:30 по франкфуртскому времени в соответствующую Резервную дату установления или ранее и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться последняя Резервная ставка (EuroSTR), предоставленная или опубликованная в соответствующий момент времени для последней "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", несмотря на то, что такая дата не соответствует Первоначальной дате фиксации ставки для евро.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR)

При наступлении События прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) или позднее, будет являться краткосрочная процентная ставка на денежном рынке в евро (Euro Short-Term Rate, EuroSTR) (**EuroSTR**), администратором которой является Европейский центральный банк (или администратор-правопреемник в отношении ставки), по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (EuroSTR)", после внесения в ставку EuroSTR корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой EuroSTR и Резервной ставкой (EuroSTR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку EuroSTR и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется ставка EuroSTR, ссылка на ставку EuroSTR будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку EuroSTR.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR

При наступлении Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) и Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR) или позднее, будет являться Рекомендуемая ЕЦБ ставка, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (EuroSTR)", после внесения в Рекомендуемую ЕЦБ ставку корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Рекомендуемой ЕЦБ ставкой и Резервной ставкой (EuroSTR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки

Если Рекомендуемая ЕЦБ ставка доступна до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR), но при этом ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали Рекомендуемую ЕЦБ ставку, а Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется Рекомендуемая ЕЦБ ставка, ссылка на Рекомендуемую ЕЦБ ставку будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную Рекомендуемую ЕЦБ ставку.

Отсутствие Рекомендуемой ЕЦБ ставки или наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки

Если:

- (А) Рекомендуемая ЕЦБ ставка не рекомендована до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR); или
- (Б) впоследствии наступает Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки,

то Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR) или в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки (как применимо) или позднее, будет являться ставка Модифицированная EDFR, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (EuroSTR)", после внесения в ставку Модифицированная EDFR корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой Модифицированная EDFR и Резервной ставкой (EuroSTR), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки Модифицированная EDFR

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку Модифицированная EDFR (или индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в определении термина "Модифицированная EDFR") и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении такой ставки не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется такая ставка, ссылка на такую ставку будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку Модифицированная EDFR (или последний предоставленный или опубликованный индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в определении термина "Модифицированная EDFR").

Применительно к Способу определения плавающей ставки "EUR-EURIBOR-Reuters" и ссылкам на Резервную дату установления в Способе определения плавающей ставки "EUR-EURIBOR-Reuters", ссылки на "Рабочие дни" считаются ссылками на те Рабочие дни, которые применяются для целей обязательства по осуществлению платежа, рассчитываемого с использованием Способа определения плавающей ставки "EUR-EURIBOR-Reuters", а ссылки на "Первоначальную дату отображения ставки IBOR" считаются ссылками на такую дату, как она отображается в Источнике резервной ставки (EuroSTR).

Помимо терминов, определенных выше, для целей Способа определения плавающей ставки "EUR-EURIBOR-Reuters" следующие термины имеют следующие значения.

EURIBOR означает ставку фондирования в евро, известную как "Межбанковская ставка предложения в евро" (Euro Interbank Offered Rate), предоставляемую Европейским институтом денежных рынков (European Money Markets Institute) как администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки).

Евросистема означает Европейский центральный банк и национальные центральные банки государств-членов Европейского союза, валютой которых является евро.

Источник резервной ставки (EuroSTR) означает отображаемую на мониторе электронную страницу в системе Bloomberg, соответствующую тикеру Bloomberg для ставки, заменяющей ставку EURIBOR на срок, равный Периоду плавающей ставки, доступ к которой осуществляется с использованием страницы <FBAK> <GO> в системе Bloomberg (или, если применимо, с использованием страницы <HP> <GO> в системе Bloomberg), или любой иной источник опубликования, определенный компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA).

Модифицированная EDFR означает ставку, равную Ставке по депозитам Евросистемы, увеличенной на Спред EDFR.

Первоначальная дата фиксации ставки для евро означает для любой Даты изменения плавающей ставки день, наступающий за два Рабочих дня для Системы TARGET до такой Даты изменения плавающей ставки, если иное не согласовано сторонами.

Резервная ставка (EuroSTR) означает скорректированную по сроку ставку EuroSTR, увеличенную на спред по отношению к ставке EURIBOR, в каждом случае применительно к сроку, равному Периоду плавающей ставки, которые предоставляются компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA), действующей(-им) в качестве провайдера скорректированной по сроку ставки EuroSTR и спреда, и публикуются в Источнике резервной ставки (EuroSTR) (либо в других источниках) или предоставляются уполномоченным дистрибьюторам и публикуются такими уполномоченными дистрибьюторами.

Рекомендуемая ЕЦБ ставка означает ставку (включая любые спреды или корректировки), рекомендованную в качестве замены ставки EuroSTR Европейским центральным банком (или администратором-правопреемником в отношении ставки EuroSTR) и/или комитетом, официально назначенным или созванным Европейским центральным банком (или администратором-правопреемником в отношении ставки EuroSTR) для целей рекомендации по замене ставки EuroSTR другой ставкой (такая другая ставка может быть установлена Европейским центральным банком или другим администратором ставки), и предоставляемую администратором такой ставки или, если такая ставка не предоставляется администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки), публикуемую уполномоченным дистрибьютором.

Спред EDFR означает:

- (А) если Рекомендуемая ЕЦБ ставка не рекомендована до конца первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня для Системы TARGET после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR), среднее арифметическое значение ежедневной разницы между ставкой EuroSTR и Ставкой по депозитам Евросистемы за период наблюдения, равный 30 Рабочим дням для Системы TARGET, начинающийся за 30 Рабочих дней для Системы TARGET до дня, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, 30 Рабочих дней для Системы TARGET до дня, в который наступает первое Событие прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR), и заканчивающийся в Рабочий день для Системы TARGET, непосредственно предшествующий дню, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (EuroSTR) (или, если позднее, Рабочий день для Системы TARGET, непосредственно предшествующий дню, в который наступает первое Событие прекращения резервной ставки в отношении ставки EuroSTR); или
- (Б) если наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки, среднее арифметическое значение ежедневной разницы между Рекомендуемой ЕЦБ ставкой и Ставкой по депозитам Евросистемы за период наблюдения, равный 30 Рабочим дням для Системы TARGET, начинающийся за 30 Рабочих дней для Системы TARGET до дня, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки, и заканчивающийся в Рабочий день для Системы TARGET, непосредственно предшествующий дню, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой ЕЦБ ставки.

Ставка по депозитам Евросистемы означает ставку по депозитам, которую банки могут использовать для размещения депозитов на условиях овернайт в Евросистеме и которая публикуется на Сайте Европейского центрального банка.

По суммам, выраженным в фунтах стерлингов

- (е) **GBP-LIBOR-BBA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка LIBOR для фунта стерлингов на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая на странице LIBOR01 в системе Reuters в 11:55 по лондонскому времени (и отражающая публикацию по состоянию на 11:00 по лондонскому времени) (или публикуемая в любое другое (скорректированное) время, указанное администратором ставки LIBOR для фунта стерлингов в методике расчета ставки LIBOR для фунта стерлингов) в Дату изменения плавающей ставки.

Ненаступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов

Если к 11:55 по лондонскому времени (или другому (скорректированному) времени опубликования ставки LIBOR для фунта стерлингов (при наличии такового), указанному администратором ставки LIBOR для фунта стерлингов в методике расчета ставки LIBOR для фунта стерлингов) в такую Дату изменения плавающей ставки ставка LIBOR для фунта стерлингов на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении такой даты не опубликована на странице LIBOR01 в системе Reuters и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться ставка LIBOR для фунта стерлингов на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении такой даты, предоставленная администратором ставки LIBOR для фунта стерлингов и опубликованная уполномоченным дистрибьютором или самим администратором ставки LIBOR для фунта стерлингов. Если к 16:00 по лондонскому времени (или ко времени,

наступающему через четыре часа пять минут после другого (скорректированного) времени опубликования ставки LIBOR для фунта стерлингов) в такую Дату изменения плавающей ставки ни администратор ставки LIBOR для фунта стерлингов, ни уполномоченный дистрибьютор не предоставили и не опубликовали ставку LIBOR для фунта стерлингов на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении такой даты и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов не наступила, то, если иное не согласовано сторонами, Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться:

- (А) ставка, официально рекомендованная к использованию администратором ставки LIBOR для фунта стерлингов; или
- (Б) ставка, официально рекомендованная к использованию лицом, ответственным за осуществление надзора в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов или администратором ставки LIBOR для фунта стерлингов,

в каждом случае в течение такого срока, пока не осуществляется публикация ставки LIBOR для фунта стерлингов и не наступила Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов. Если существует ставка, описанная в подпункте (А) выше, то применяется такая ставка. Если такая ставка отсутствует, но существует ставка, описанная в подпункте (Б) выше, то применяется ставка, описанная в подпункте (Б) выше. При отсутствии как ставки, описанной в подпункте (А) выше, так и ставки, описанной в подпункте (Б) выше, Расчетный агент определяет ставку, разумно (с коммерческой точки зрения) заменяющую ставку LIBOR для фунта стерлингов, принимая во внимание любые ставки, применяемые центральными контрагентами и/или биржами для торговли фьючерсами, в каждом случае обеспечивающими такой объем торгов фьючерсами или иными производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является ставка LIBOR для фунта стерлингов, который Расчетный агент считает достаточным, чтобы сделать вывод о том, что любая такая ставка является репрезентативной.

Наступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов

При наступлении События прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки, наступающей в Дату наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов или позднее, будет определяться, как если бы ссылка на GBP-LIBOR-BBA была ссылкой на последнюю Резервную ставку (SONIA) для "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", соответствующей Первоначальной дате фиксации ставки для фунта стерлингов, предоставленную или опубликованную по состоянию на 11:30 по лондонскому времени в соответствующую Резервную дату установления. Если компания Bloomberg Index Services Limited (или провайдер-правопреемник, утвержденный и/или назначенный ISDA) не предоставила, а уполномоченные дистрибьюторы не опубликовали Резервную ставку (SONIA) для такой "Первоначальной даты отображения ставки IBOR" в 11:30 по лондонскому времени в соответствующую Резервную дату установления или ранее и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться последняя Резервная ставка (SONIA), предоставленная или опубликованная в соответствующий момент времени для последней "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", несмотря на то, что такая дата не соответствует Первоначальной дате фиксации ставки для фунта стерлингов.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA)

При наступлении События прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) или позднее, будет являться средневзвешенная ставка овернайт для фунта стерлингов (Sterling Overnight Index Average, SONIA) (SONIA), администратором которой является Банк Англии (или администратор-правопреемник в отношении ставки), по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SONIA)", после внесения в ставку SONIA корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой SONIA и Резервной ставкой (SONIA), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку SONIA и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется ставка SONIA, ссылка на ставку SONIA будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку SONIA.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA

При наступлении Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) и Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA) или позднее, будет являться Рекомендуемая для фунта стерлингов ставка, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SONIA)", после внесения в Рекомендуемую для фунта стерлингов ставку корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Рекомендуемой для фунта стерлингов ставкой и Резервной ставкой (SONIA), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой для фунта стерлингов ставки

Если Рекомендуемая для фунта стерлингов ставка доступна до окончания первого Рабочего дня, в которой открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня, в которой открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA), но при этом ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали Рекомендуемую для фунта стерлингов ставку, а Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой для фунта стерлингов ставки не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется Рекомендуемая для фунта стерлингов ставка, ссылка на Рекомендуемую для фунта стерлингов ставку будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную Рекомендуемую для фунта стерлингов ставку.

Отсутствие Рекомендуемой для фунта стерлингов ставки или наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой для фунта стерлингов ставки

Если:

- (А) Рекомендуемая для фунта стерлингов ставка отсутствует до окончания первого Рабочего дня, в которой открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня, в которой открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA); или
- (Б) Рекомендуемая для фунта стерлингов ставка существует, но впоследствии в отношении нее наступает Дата наступления события прекращения резервной ставки,

то Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA) или в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой для фунта стерлингов ставки (как применимо) или позднее, будет являться Ставка Банка Англии, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SONIA)", после внесения в Ставку Банка Англии корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Ставкой Банка Англии и Резервной ставкой (SONIA), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ставка Банка Англии

Применительно к любой дате, для которой требуется Ставка Банка Англии, ссылка на Ставку Банка Англии будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную Ставку Банка Англии по состоянию на время завершения операций (close of business) в г. Лондоне в такую дату.

Применительно к Способу определения плавающей ставки "GBP-LIBOR-BBA" и ссылкам на Резервную дату установления в Способе определения плавающей ставки "GBP-LIBOR-BBA", ссылки на "Рабочие дни" считаются ссылками на те Рабочие дни, которые применяются для целей обязательства по осуществлению платежа, рассчитываемого с использованием Способа определения плавающей ставки "GBP-LIBOR-BBA", а

ссылки на "Первоначальную дату отображения ставки IBOR" считаются ссылками на такую дату, как она отображается в Источнике резервной ставки (SONIA).

Помимо терминов, определенных выше, для целей Способа определения плавающей ставки "GBP-LIBOR-BBA" следующие термины имеют следующие значения.

LIBOR для фунта стерлингов означает ставку фондирования в фунтах стерлингов, известную как "ставка LIBOR для фунта стерлингов" (Sterling LIBOR) (лондонская межбанковская ставка предложения (London Interbank Offered Rate)), предоставляемую компанией ICE Benchmark Administration Limited как администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки).

Источник резервной ставки (SONIA) означает отображаемую на мониторе электронную страницу в системе Bloomberg, соответствующую тикеру Bloomberg для ставки, заменяющей ставку LIBOR для фунта стерлингов на срок, равный Периоду плавающей ставки, доступ к которой осуществляется с использованием страницы <FBAK> <GO> в системе Bloomberg (или, если применимо, с использованием страницы <HP> <GO> в системе Bloomberg), или любой иной источник опубликования, определенный компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA).

Первоначальная дата фиксации ставки для фунта стерлингов означает для любой Даты изменения плавающей ставки такую Дату изменения плавающей ставки, если иное не согласовано сторонами.

Резервная ставка (SONIA) означает скорректированную по сроку ставку SONIA, увеличенную на спред по отношению к ставке LIBOR для фунта стерлингов, в каждом случае применительно к сроку, равному Периоду плавающей ставки, которые предоставляются компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA), действующей(-им) в качестве провайдера скорректированной по сроку ставки SONIA и спреда, и публикуются в Источнике резервной ставки (SONIA) (либо в других источниках) или предоставляются уполномоченным дистрибьюторам и публикуются такими уполномоченными дистрибьюторами.

Рекомендуемая для фунта стерлингов ставка означает ставку (включая любые спреды или корректировки), рекомендованную в качестве замены ставки SONIA (A) администратором ставки SONIA, если администратором ставки SONIA является национальный центральный банк, или (B) если национальный центральный банк, являющийся администратором ставки SONIA, не дает такую рекомендацию или администратором ставки SONIA является не национальный центральный банк, комитетом, определенным для этой цели Управлением по контролю за деятельностью финансовых организаций (Financial Conduct Authority) (или его правопреемником), Банком Англии или совместно Управлением по контролю за деятельностью финансовых организаций и Банком Англии, и предоставляемую администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки) или, если такая ставка не предоставляется администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки), публикуемую уполномоченным дистрибьютором.

Ставка Банка Англии означает официальную банковскую ставку (bank rate), определяемую Комитетом по монетарной политике Банка Англии (Monetary Policy Committee of the Bank of England) и время от времени публикуемую Банком Англии.

(ж) **GBP-LIBOR-BBA-Bloomberg** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка LIBOR для фунта стерлингов на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая под заголовком "LIBOR" на странице BTMM UK в системе Bloomberg в 11:55 по лондонскому времени (и отражающая публикацию по состоянию на 11:00 по лондонскому времени) (или публикуемая в любое другое (скорректированное) время, указанное администратором ставки LIBOR для фунта стерлингов в методике расчета ставки LIBOR для фунта стерлингов) в Дату изменения плавающей ставки.

Ненаступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов

Если к 11:55 по лондонскому времени (или другому (скорректированному) времени опубликования ставки LIBOR для фунта стерлингов (при наличии такового), указанному администратором ставки LIBOR для фунта стерлингов) в методике расчета ставки LIBOR для фунта стерлингов) в такую Дату изменения плавающей ставки ставка LIBOR для фунта стерлингов на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении такой даты не опубликована под заголовком "LIBOR" на странице BTMM UK в системе Bloomberg и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться ставка LIBOR для фунта стерлингов на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении такой даты, предоставленная администратором ставки LIBOR для фунта стерлингов и опубликованная уполномоченным дистрибьютором или самим администратором ставки LIBOR для фунта стерлингов. Если к 16:00 по лондонскому времени (или ко времени, наступающему через четыре часа пять минут после другого (скорректированного) времени опубликования ставки LIBOR для фунта стерлингов) в такую Дату изменения плавающей ставки ни администратор ставки LIBOR для фунта стерлингов, ни уполномоченный дистрибьютор не предоставили и не опубликовали ставку LIBOR для фунта стерлингов на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении такой даты и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта

стерлингов не наступила, то, если иное не согласовано сторонами, Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться:

- (А) ставка, официально рекомендованная к использованию администратором ставки LIBOR для фунта стерлингов; или
- (Б) ставка, официально рекомендованная к использованию лицом, ответственным за осуществление надзора в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов или администратором ставки LIBOR для фунта стерлингов,

в каждом случае в течение такого срока, пока не осуществляется публикация ставки LIBOR для фунта стерлингов и не наступила Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов. Если существует ставка, описанная в подпункте (А) выше, то применяется такая ставка. Если такая ставка отсутствует, но существует ставка, описанная в подпункте (Б) выше, то применяется ставка, описанная в подпункте (Б) выше. При отсутствии как ставки, описанной в подпункте (А) выше, так и ставки, описанной в подпункте (Б) выше, Расчетный агент определяет ставку, разумно (с коммерческой точки зрения) заменяющую ставку LIBOR для фунта стерлингов, принимая во внимание любые ставки, применяемые центральными контрагентами и/или биржами для торговли фьючерсами, в каждом случае обеспечивающими такой объем торгов фьючерсами или иными производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является ставка LIBOR для фунта стерлингов, который Расчетный агент считает достаточным, чтобы сделать вывод о том, что любая такая ставка является репрезентативной.

Наступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов

При наступлении События прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки, наступающей в Дату наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для фунта стерлингов или позднее, будет определяться, как если бы ссылка на GBP-LIBOR-BBA-Bloomberg была ссылкой на последнюю Резервную ставку (SONIA) для "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", соответствующей Первоначальной дате фиксации ставки для фунта стерлингов, предоставленную или опубликованную по состоянию на 11:30 по лондонскому времени в соответствующую Резервную дату установления. Если компания Bloomberg Index Services Limited (или провайдер-правопреемник, утвержденный и/или назначенный ISDA) не предоставила, а уполномоченные дистрибьюторы не опубликовали Резервную ставку (SONIA) для такой "Первоначальной даты отображения ставки IBOR" в 11:30 по лондонскому времени в соответствующую Резервную дату установления или ранее и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться последняя Резервная ставка (SONIA), предоставленная или опубликованная в соответствующий момент времени для последней "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", несмотря на то, что такая дата не соответствует Первоначальной дате фиксации ставки для фунта стерлингов.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA)

При наступлении События прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) или позднее, будет являться средневзвешенная ставка овернайт для фунта стерлингов (Sterling Overnight Index Average, SONIA) (SONIA), администратором которой является Банк Англии (или администратор-правопреемник в отношении ставки), по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SONIA)", после внесения в ставку SONIA корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой SONIA и Резервной ставкой (SONIA), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку SONIA и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется ставка SONIA, ссылка на ставку SONIA будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку SONIA.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA

При наступлении Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) и Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата

установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA) или позднее, будет являться Рекомендуемая для фунта стерлингов ставка, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SONIA)", после внесения в Рекомендуемую для фунта стерлингов ставку корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Рекомендуемой для фунта стерлингов ставкой и Резервной ставкой (SONIA), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой для фунта стерлингов ставки

Если Рекомендуемая для фунта стерлингов ставка доступна до окончания первого Рабочего дня, в которой открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня, в которой открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA), но при этом ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали Рекомендуемую для фунта стерлингов ставку, а Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой для фунта стерлингов ставки не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется Рекомендуемая для фунта стерлингов ставка, ссылка на Рекомендуемую для фунта стерлингов ставку будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную Рекомендуемую для фунта стерлингов ставку.

Отсутствие Рекомендуемой для фунта стерлингов ставки или наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой для фунта стерлингов ставки

Если:

- (А) Рекомендуемая для фунта стерлингов ставка отсутствует до окончания первого Рабочего дня, в которой открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня, в которой открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA); или
- (Б) Рекомендуемая для фунта стерлингов ставка существует, но впоследствии в отношении нее наступает Дата наступления события прекращения резервной ставки,

то Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SONIA) или в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой для фунта стерлингов ставки (как применимо) или позднее, будет являться Ставка Банка Англии, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SONIA) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SONIA)", после внесения в Ставку Банка Англии корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Ставкой Банка Англии и Резервной ставкой (SONIA), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ставка Банка Англии

Применительно к любой дате, для которой требуется Ставка Банка Англии, ссылка на Ставку Банка Англии будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную Ставку Банка Англии по состоянию на время завершения операций (close of business) в г. Лондоне в такую дату.

Применительно к Способу определения плавающей ставки "GBP-LIBOR-BBA-Bloomberg" и ссылкам на Резервную дату установления в Способе определения плавающей ставки "GBP-LIBOR-BBA-Bloomberg", ссылки на "Рабочие дни" считаются ссылками на те Рабочие дни, которые применяются для целей обязательства по осуществлению платежа, рассчитываемого с использованием Способа определения плавающей ставки "GBP-LIBOR-BBA-Bloomberg", а ссылки на "Первоначальную дату отображения ставки IBOR" считаются ссылками на такую дату, как она отображается в Источнике резервной ставки (SONIA).

Помимо терминов, определенных выше, для целей Способа определения плавающей ставки "GBP-LIBOR-BBA-Bloomberg" следующие термины имеют следующие значения.

LIBOR для фунта стерлингов означает ставку фондирования в фунтах стерлингов, известную как "ставка LIBOR для фунта стерлингов" (Sterling LIBOR) (лондонская межбанковская ставка предложения (London Interbank Offered Rate)), предоставляемую компанией ICE Benchmark Administration Limited как администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки).

Источник резервной ставки (SONIA) означает отображаемую на мониторе электронную страницу в системе Bloomberg, соответствующую тикеру Bloomberg для ставки, заменяющей ставку LIBOR для фунта стерлингов на срок, равный Периоду плавающей ставки, доступ к которой осуществляется с использованием страницы <FBAK> <GO> в системе Bloomberg (или, если применимо, с использованием страницы <HP> <GO> в системе Bloomberg), или любой иной источник опубликования, определенный компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA).

Первоначальная дата фиксации ставки для фунта стерлингов означает для любой Даты изменения плавающей ставки такую Дату изменения плавающей ставки, если иное не согласовано сторонами.

Резервная ставка (SONIA) означает скорректированную по сроку ставку SONIA, увеличенную на спред по отношению к ставке LIBOR для фунта стерлингов, в каждом случае применительно к сроку, равному Периоду плавающей ставки, которые предоставляются компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA), действующей(-им) в качестве провайдера скорректированной по сроку ставки SONIA и спреда, и публикуются в Источнике резервной ставки (SONIA) (либо в других источниках) или предоставляются уполномоченным дистрибьюторам и публикуются такими уполномоченными дистрибьюторами.

Рекомендуемая для фунта стерлингов ставка означает ставку (включая любые спреды или корректировки), рекомендованную в качестве замены ставки SONIA (A) администратором ставки SONIA, если администратором ставки SONIA является национальный центральный банк, или (B) если национальный центральный банк, являющийся администратором ставки SONIA, не дает такую рекомендацию или администратором ставки SONIA является не национальный центральный банк, комитетом, определенным для этой цели Управлением по контролю за деятельностью финансовых организаций (Financial Conduct Authority) (или его правопреемником), Банком Англии или совместно Управлением по контролю за деятельностью финансовых организаций и Банком Англии, и предоставляемую администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки) или, если такая ставка не предоставляется администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки), публикуемую уполномоченным дистрибьютором.

Ставка Банка Англии означает официальную банковскую ставку (bank rate), определяемую Комитетом по монетарной политике Банка Англии (Monetary Policy Committee of the Bank of England) и время от времени публикуемую Банком Англии.

По суммам, выраженным в швейцарских франках

- (3) **CHF-LIBOR-BVA** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка LIBOR для швейцарского франка на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая на странице LIBOR02 в системе Reuters в 11:55 по лондонскому времени (и отражающая публикацию по состоянию на 11:00 по лондонскому времени) (или публикуемая в любое другое (скорректированное) время, указанное администратором ставки LIBOR для швейцарского франка в методике расчета ставки LIBOR для швейцарского франка) в день, наступающий за два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, до Даты изменения плавающей ставки.

Ненаступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка

Если к 11:55 по лондонскому времени (или другому (скорректированному) времени опубликования ставки LIBOR для швейцарского франка (при наличии такового), указанному администратором ставки LIBOR для швейцарского франка в методике расчета ставки LIBOR для швейцарского франка) в такую Дату изменения плавающей ставки ставка LIBOR для швейцарского франка на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для швейцарского франка не опубликована на странице LIBOR02 в системе Reuters и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться ставка LIBOR для швейцарского франка на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для швейцарского франка, предоставленная администратором ставки LIBOR для швейцарского франка и опубликованная уполномоченным дистрибьютором или самим администратором ставки LIBOR для швейцарского франка. Если к 16:00 по лондонскому времени (или ко времени, наступающему через четыре часа пять минут после другого (скорректированного) времени опубликования ставки LIBOR для швейцарского франка) в такую Дату изменения плавающей ставки ни администратор ставки LIBOR для швейцарского франка, ни уполномоченный дистрибьютор не предоставили и не опубликовали ставку LIBOR для швейцарского франка на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для швейцарского франка и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка

не наступила, то, если иное не согласовано сторонами, Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться:

- (А) ставка, официально рекомендованная к использованию администратором ставки LIBOR для швейцарского франка; или
- (Б) ставка, официально рекомендованная к использованию компетентным органом, ответственным за осуществление надзора в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка или администратора ставки LIBOR для швейцарского франка,

в каждом случае в течение такого срока, пока не осуществляется публикация ставки LIBOR для швейцарского франка и не наступила Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка. Если существует ставка, описанная в подпункте (А) выше, то применяется такая ставка. Если такая ставка отсутствует, но существует ставка, описанная в подпункте (Б) выше, то применяется ставка, описанная в подпункте (Б) выше. При отсутствии как ставки, описанной в подпункте (А) выше, так и ставки, описанной в подпункте (Б) выше, Расчетный агент определяет ставку, разумно (с коммерческой точки зрения) заменяющую ставку LIBOR для швейцарского франка, принимая во внимание любые ставки, применяемые центральными контрагентами и/или биржами для торговли фьючерсами, в каждом случае обеспечивающими такой объем торгов фьючерсами или иными производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является ставка LIBOR для швейцарского франка, который Расчетный агент посчитает достаточным, чтобы сделать вывод о том, что любая такая ставка является репрезентативной.

Наступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка

При наступлении События прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки, наступающей не менее чем через два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка, будет определяться, как если бы ссылка на CHF-LIBOR-BBA была ссылкой на последнюю Резервную ставку (SARON) для "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", соответствующей Первоначальной дате фиксации ставки для швейцарского франка, предоставленную или опубликованную по состоянию на 20:30 по цюрихскому времени в соответствующую Резервную дату установления. Если компания Bloomberg Index Services Limited (или провайдер-правопреемник, утвержденный и/или назначенный ISDA) не предоставила, а уполномоченные дистрибьюторы не опубликовали Резервную ставку (SARON) для такой "Первоначальной даты отображения ставки IBOR" в 20:30 по цюрихскому времени в соответствующую Резервную дату установления или ранее и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться последняя Резервная ставка (SARON), предоставленная или опубликованная в соответствующий момент времени для последней "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", несмотря на то, что такая дата не соответствует Первоначальной дате фиксации ставки для швейцарского франка.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON)

При наступлении События прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентом периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) или позднее, будет являться средневзвешенная ставка овернайт для швейцарского франка (Swiss Average Rate Overnight, SARON) (SARON), администратором которой является Швейцарская биржа (SIX Swiss Exchange AG) (или администратор-правопреемник в отношении ставки), по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SARON)", после внесения в ставку SARON корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой SARON и Резервной ставкой (SARON), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку SARON и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется ставка SARON, ссылка на ставку SARON будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку SARON.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON

При наступлении Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) и Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON

Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON) или позднее, будет являться Рекомендуемая НРГ ставка, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SARON)", после внесения в Рекомендуемую НРГ ставку корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Рекомендуемой НРГ ставкой и Резервной ставкой (SARON), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Если Рекомендуемая НРГ ставка отсутствует до окончания первого Рабочего дня, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Цюрихе, после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Цюрихе, после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON), то Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON) или позднее, будет являться Измененная учетная ставка ШНБ, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SARON)", после внесения в Измененную учетную ставку ШНБ корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Измененной учетной ставкой ШНБ и Резервной ставкой (SARON), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой НРГ ставки или Измененной учетной ставки ШНБ

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали Рекомендуемую НРГ ставку или Измененную учетную ставку ШНБ (или индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в определении термина "Измененная учетная ставка ШНБ") (как применимо) и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении такой ставки не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется такая ставка, ссылка на такую ставку будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную Рекомендуемую НРГ ставку или Измененную учетную ставку ШНБ (или последний предоставленный или опубликованный индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в определении термина "Измененная учетная ставка ШНБ") (как применимо).

Применительно к Способу определения плавающей ставки "CHF-LIBOR-BBA" и ссылкам на Резервную дату установления в Способе определения плавающей ставки "CHF-LIBOR-BBA", ссылки на "Рабочие дни" считаются ссылками на те Рабочие дни, которые применяются для целей обязательства по осуществлению платежа, рассчитываемого с использованием Способа определения плавающей ставки "CHF-LIBOR-BBA", а ссылки на "Первоначальную дату отображения ставки IBOR" считаются ссылками на такую дату, как она отображается в Источнике резервной ставки (SARON).

Помимо терминов, определенных выше, для целей Способа определения плавающей ставки "CHF-LIBOR-BBA" следующие термины имеют следующие значения.

LIBOR для швейцарского франка означает ставку фондирования в швейцарских франках, известную как "ставка LIBOR для швейцарского франка" (Swiss Franc LIBOR) (лондонская межбанковская ставка предложения (London Interbank Offered Rate)), предоставляемую компанией ICE Benchmark Administration Limited как администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки).

Источник резервной ставки (SARON) означает отображаемую на мониторе электронную страницу в системе Bloomberg, соответствующую тикеру Bloomberg для ставки, заменяющей ставку LIBOR для швейцарского франка на срок, равный Периоду плавающей ставки, доступ к которой осуществляется с использованием страницы <FBAK> <GO> в системе Bloomberg (или, если применимо, с использованием страницы <HP> <GO> в системе Bloomberg), или любой иной источник опубликования, определенный компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA).

Измененная учетная ставка ШНБ означает ставку, равную Учетной ставке ШНБ, увеличенной на Спред ШНБ.

Первоначальная дата фиксации ставки для швейцарского франка означает для любой Даты изменения плавающей ставки день, наступающий за два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций

кредитные организации в г. Лондоне, до такой Даты изменения плавающей ставки, если иное не согласовано сторонами.

Резервная ставка (SARON) означает скорректированную по сроку ставку SARON, увеличенную на спред по отношению к ставке LIBOR для швейцарского франка, в каждом случае применительно к сроку, равному Периоду плавающей ставки, которые предоставляются компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA), действующей(-им) в качестве провайдера скорректированной по сроку ставки SARON и спреда, и публикуются в Источнике резервной ставки (SARON) (либо в других источниках) или предоставляются уполномоченным дистрибьюторам и публикуются такими уполномоченными дистрибьюторами.

Рекомендуемая НРГ ставка означает ставку (включая любые спреды или корректировки), рекомендованную в качестве замены ставки SARON какой-либо рабочей группой или комитетом в Швейцарии, организованным таким же или аналогичным образом как Национальная рабочая группа по индикаторам в швейцарском франке (National Working Group on Swiss Franc Reference Rates), созданная в 2013 г. в том числе для рассмотрения предложений по реформированию индикаторов в Швейцарии, и предоставляемую администратором такой ставки или, если такая ставка не предоставляется администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки), публикуемую уполномоченным дистрибьютором.

Спред ШНБ означает определенное Расчетным агентом историческое медианное значение между ставкой SARON и Учетной ставкой ШНБ за период наблюдения, равный двум годам, начинающийся за два года до дня, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) (или, если позднее, два года до дня, в который наступает первое Событие прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON), и заканчивающийся в Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Цюрихе, непосредственно предшествующий дню, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) (или, если позднее, Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Цюрихе, непосредственно предшествующий дню, в который наступает первое Событие прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON).

Учетная ставка ШНБ означает учетную ставку (policy rate) Швейцарского национального банка.

- (и) **CHF-LIBOR-BBA-Bloomberg** означает, что Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки является ставка LIBOR для швейцарского франка на срок, равный Периоду плавающей ставки, публикуемая под заголовком "LIBOR" на странице BTMM SZ в системе Bloomberg в 11:55 по лондонскому времени (и отражающая публикацию по состоянию на 11:00 по лондонскому времени) (или публикуемая в любое другое (скорректированное) время, указанное администратором ставки LIBOR для швейцарского франка в методике расчета ставки LIBOR для швейцарского франка) в день, наступающий за два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, до Даты изменения плавающей ставки.

Ненаступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка

Если к 11:55 по лондонскому времени (или другому (скорректированному) времени опубликования ставки LIBOR для швейцарского франка (при наличии такового), указанному администратором ставки LIBOR для швейцарского франка в методике расчета ставки LIBOR для швейцарского франка) в такую Дату изменения плавающей ставки ставка LIBOR для швейцарского франка на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для швейцарского франка не опубликована под заголовком "LIBOR" на странице BTMM SZ в системе Bloomberg и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться ставка LIBOR для швейцарского франка на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для швейцарского франка, предоставленная администратором ставки LIBOR для швейцарского франка и опубликованная уполномоченным дистрибьютором или самим администратором ставки LIBOR для швейцарского франка. Если к 16:00 по лондонскому времени (или ко времени, наступающему через четыре часа пять минут после другого (скорректированного) времени опубликования ставки LIBOR для швейцарского франка) в такую Дату изменения плавающей ставки ни администратор ставки LIBOR для швейцарского франка, ни уполномоченный дистрибьютор не предоставили и не опубликовали ставку LIBOR для швейцарского франка на срок, равный Периоду плавающей ставки, в отношении Первоначальной даты фиксации ставки для швейцарского франка и при этом Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка не наступила, то, если иное не согласовано сторонами, Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться:

- (А) ставка, официально рекомендованная к использованию администратором ставки LIBOR для швейцарского франка; или
- (Б) ставка, официально рекомендованная к использованию компетентным органом, ответственным за осуществление надзора в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка или администратором ставки LIBOR для швейцарского франка,

в каждом случае в течение такого срока, пока не осуществляется публикация ставки LIBOR для швейцарского франка и не наступила Дата наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка. Если существует ставка, описанная в подпункте (А) выше, то применяется такая ставка. Если такая ставка отсутствует, но существует ставка, описанная в подпункте (Б) выше, то применяется ставка, описанная в подпункте (Б) выше. При отсутствии как ставки, описанной в подпункте (А) выше, так и ставки, описанной в подпункте (Б) выше, Расчетный агент определяет ставку, разумно (с коммерческой точки зрения) заменяющую ставку LIBOR для швейцарского франка, принимая во внимание любые ставки, применяемые центральными контрагентами и/или биржами для торговли фьючерсами, в каждом случае обеспечивающими такой объем торгов фьючерсами или иными производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является ставка LIBOR для швейцарского франка, который Расчетный агент считает достаточным, чтобы сделать вывод о том, что любая такая ставка является репрезентативной.

Наступление Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка

При наступлении События прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки, наступающей не менее чем через два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, после Даты наступления события прекращения ставки в отношении ставки LIBOR для швейцарского франка, будет определяться, как если бы ссылка на CHF-LIBOR-BBA-Bloomberg была ссылкой на последнюю Резервную ставку (SARON) для "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", соответствующей Первоначальной дате фиксации ставки для швейцарского франка, предоставленную или опубликованную по состоянию на 20:30 по цюрихскому времени в соответствующую Резервную дату установления. Если компания Bloomberg Index Services Limited (или провайдер-правопреемник, утвержденный и/или назначенный ISDA) не предоставила, а уполномоченные дистрибьюторы не опубликовали Резервную ставку (SARON) для такой "Первоначальной даты отображения ставки IBOR" в 20:30 по цюрихскому времени в соответствующую Резервную дату установления или ранее и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) не наступила, то Плавающей ставкой для такой Даты изменения плавающей ставки будет являться последняя Резервная ставка (SARON), предоставленная или опубликованная в соответствующий момент времени для последней "Первоначальной даты отображения ставки IBOR", несмотря на то, что такая дата не соответствует Первоначальной дате фиксации ставки для швейцарского франка.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON)

При наступлении События прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) или позднее, будет являться средневзвешенная ставка овернайт для швейцарского франка (Swiss Average Rate Overnight, SARON) (SARON), администратором которой является Швейцарская биржа (SIX Swiss Exchange AG) (или администратор-правопреемник в отношении ставки), по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SARON)", после внесения в ставку SARON корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между ставкой SARON и Резервной ставкой (SARON), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали ставку SARON и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется ставка SARON, ссылка на ставку SARON будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную ставку SARON.

Наступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON

При наступлении Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) и Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON) или позднее, будет являться Рекомендуемая НРГ ставка, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SARON)", после внесения в Рекомендуемую НРГ ставку корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Рекомендуемой НРГ

ставкой и Резервной ставкой (SARON), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Если Рекомендуемая НРГ ставка отсутствует до окончания первого Рабочего дня, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Цюрихе, после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) (или, если позднее, до окончания первого Рабочего дня, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Цюрихе, после Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON), то Плавающей ставкой для Даты изменения плавающей ставки, которая относится к какому-либо Процентному периоду (или какому-либо Периоду капитализации в таком Процентном периоде), в отношении которого Резервная дата установления наступает в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) (или, если позднее, в Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON) или позднее, будет являться Измененная учетная ставка ШНБ, по отношению к которой Расчетный агент применяет последний опубликованный на Дату наступления события прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) спред, указанный в определении термина "Резервная ставка (SARON)", после внесения в Измененную учетную ставку ШНБ корректировок, необходимых для того, чтобы учесть любую разницу в кривой доходности и сроке между Измененной учетной ставкой ШНБ и Резервной ставкой (SARON), учитывая при этом также Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок.

Ненаступление Даты наступления события прекращения резервной ставки в отношении Рекомендуемой НРГ ставки или Измененной учетной ставки ШНБ

Если ни администратор ставки, ни уполномоченные дистрибьюторы не предоставили и не опубликовали Рекомендуемую НРГ ставку или Измененную учетную ставку ШНБ (или индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в определении термина "Измененная учетная ставка ШНБ") (как применимо) и при этом Дата наступления события прекращения резервной ставки в отношении такой ставки не наступила, то применительно к любому, дню, для которого требуется такая ставка, ссылка на такую ставку будет считаться ссылкой на последнюю предоставленную или опубликованную Рекомендуемую НРГ ставку или Измененную учетную ставку ШНБ (или последний предоставленный или опубликованный индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в определении термина "Измененная учетная ставка ШНБ") (как применимо).

Применительно к Способу определения плавающей ставки "CHF-LIBOR-BBA-Bloomberg" и ссылкам на Резервную дату установления в Способе определения плавающей ставки "CHF-LIBOR-BBA-Bloomberg", ссылки на "Рабочие дни" считаются ссылками на те Рабочие дни, которые применяются для целей обязательства по осуществлению платежа, рассчитываемого с использованием Способа определения плавающей ставки "CHF-LIBOR-BBA-Bloomberg", а ссылки на "Первоначальную дату отображения ставки IBOR" считаются ссылками на такую дату, как она отображается в Источнике резервной ставки (SARON).

Помимо терминов, определенных выше, для целей Способа определения плавающей ставки "CHF-LIBOR-BBA-Bloomberg" следующие термины имеют следующие значения.

LIBOR для швейцарского франка означает ставку фондирования в швейцарских франках, известную как "ставка LIBOR для швейцарского франка" (Swiss Franc LIBOR) (лондонская межбанковская ставка предложения (London Interbank Offered Rate)), предоставляемую компанией ICE Benchmark Administration Limited как администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки).

Источник резервной ставки (SARON) означает отображаемую на мониторе электронную страницу в системе Bloomberg, соответствующую тикеру Bloomberg для ставки, заменяющей ставку LIBOR для швейцарского франка на срок, равный Периоду плавающей ставки, доступ к которой осуществляется с использованием страницы <FBAK> <GO> в системе Bloomberg (или, если применимо, с использованием страницы <HP> <GO> в системе Bloomberg), или любой иной источник опубликования, определенный компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA).

Измененная учетная ставка ШНБ означает ставку, равную Учетной ставке ШНБ, увеличенной на Спред ШНБ.

Первоначальная дата фиксации ставки для швейцарского франка означает для любой Даты изменения плавающей ставки день, наступающий за два Рабочих дня, в которые открыты для проведения операций кредитные организации в г. Лондоне, до такой Даты изменения плавающей ставки, если иное не согласовано сторонами.

Резервная ставка (SARON) означает скорректированную по сроку ставку SARON, увеличенную на спред по отношению к ставке LIBOR для швейцарского франка, в каждом случае применительно к сроку, равному Периоду плавающей ставки, которые предоставляются компанией Bloomberg Index Services Limited (или провайдером-правопреемником, утвержденным и/или назначенным ISDA), действующей(-им) в качестве провайдера скорректированной по сроку ставки SARON и спреда, и публикуются в Источнике резервной ставки (SARON) (либо в других источниках) или предоставляются уполномоченным дистрибьюторам и публикуются такими уполномоченными дистрибьюторами.

Рекомендуемая НРГ ставка означает ставку (включая любые спреды или корректировки), рекомендованную в качестве замены ставки SARON какой-либо рабочей группой или комитетом в Швейцарии, организованным таким же или аналогичным образом как Национальная рабочая группа по индикаторам в швейцарском франке (National Working Group on Swiss Franc Reference Rates), созданная в 2013 г. в том числе для рассмотрения предложений по реформированию индикаторов в Швейцарии, и предоставляемую администратором такой ставки или, если такая ставка не предоставляется администратором такой ставки (или администратором-правопреемником в отношении такой ставки), публикуемую уполномоченным дистрибьютором.

Спред ШНБ означает определенное Расчетным агентом историческое медианное значение между ставкой SARON и Учетной ставкой ШНБ за период наблюдения, равный двум годам, начинающийся за два года до дня, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) (или, если позднее, два года до дня, в который наступает первое Событие прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON), и заканчивающийся в Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Цюрихе, непосредственно предшествующий дню, в который наступает Событие прекращения резервной ставки в отношении Резервной ставки (SARON) (или, если позднее, Рабочий день, в который открыты для проведения операций кредитные организации в г. Цюрихе, непосредственно предшествующий дню, в который наступает первое Событие прекращения резервной ставки в отношении ставки SARON).

Учетная ставка ШНБ означает учетную ставку (policy rate) Швейцарского национального банка.

- (к) **Дополнительные определения.** Для целей настоящего пункта 8.6 и пункта 8.8 Стандартных условий следующие термины имеют следующие значения.

ISDA означает Международную ассоциацию свопов и деривативов (International Swaps and Derivatives Association, ISDA).

Базисная ставка означает:

- (А) ставку SOFR, если Применимой резервной ставкой является Резервная ставка (SOFR);
- (Б) ставку EuroSTR, если Применимой резервной ставкой является Резервная ставка (EuroSTR);
- (В) ставку SONIA, если Применимой резервной ставкой является Резервная ставка (SONIA);
- (Г) ставку SARON, если Применимой резервной ставкой является Резервная ставка (SARON).

Дата наступления события прекращения резервной ставки означает применительно к Событию прекращения резервной ставки, первый день, в который Применимая резервная ставка более не предоставляется. Если прекращается предоставление Применимой резервной ставки в тот же день, в который требуется определить Плавающую ставку для Даты изменения плавающей ставки согласно соответствующему Способу определения плавающей ставки, но Применимая резервная ставка была предоставлена во время, в которое она должна быть определена согласно соответствующему Способу определения плавающей ставки (или, если такое время не указано в соответствующем Способе определения плавающей ставки, во время, в которое она обычно публикуется), то Датой наступления события прекращения резервной ставки будет следующий день, в который Плавающая ставка должна быть обычно опубликована. Если Применимой резервной ставкой является ставка Модифицированная EDFR или Измененная учетная ставка ШНБ, то ссылка на Применимую резервную ставку в настоящем определении термина "Дата наступления события прекращения резервной ставки" будет считаться ссылкой на индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в определении термина "Модифицированная EDFR" или "Измененная учетная ставка ШНБ", как применимо.

Дата наступления события прекращения ставки означает применительно к Применимой ставке и одному или нескольким Событиям прекращения ставки, первый день, в который Применимая ставка более не предоставляется или, применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, первый день, в который Применимая ставка либо (А) становится Нерепрезентативной (основываясь на последнем заявлении или публикации информации, как указано в подпункте (В) определения термина "Событие прекращения ставки"), даже если такая Применимая ставка продолжает предоставляться в такой день, либо (Б) более не предоставляется. Если прекращается предоставление Применимой ставки в Соответствующую первоначальную дату фиксации ставки, но Применимая ставка была предоставлена (и применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR не является Нерепрезентативной) во время, в которое она должна быть определена согласно соответствующему Способу определения плавающей ставки, то Датой наступления события прекращения ставки будет следующий день, в который Плавающая ставка должна быть обычно опубликована.

Нерепрезентативная означает применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, что регулирующий орган, осуществляющий надзор в отношении администратора Применимой ставки:

- (А) установил и объявил, что Применимая ставка более не является репрезентативной для рынка, на данных которого она основывается, и экономической деятельности, которую она призвана отразить в числовом значении, и репрезентативность Применимой ставки не будет восстановлена; и
- (Б) понимает, что это повлечет применение договорных положений о резервных вариантах исполнения обязательств (contractual triggers for fallbacks), включенных в договоры в связи с объявлениями, ранее сделанными таким регулирующим органом, осуществляющим надзор, о прекращении в будущем действия Применимой ставки (pre-cessation announcements) (независимо от того, как такие объявления описаны в договорах),

при условии, что такая Применимая ставка будет "Нерепрезентативной" со ссылкой на дату, указанную в последнем заявлении или публикации информации, как указано в подпункте (В) определения термина "Событие прекращения ставки".

Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок означает Правила по определению значений резервных ставок (IBOR Fallback Rate Adjustments Rule Book), опубликованные компанией Bloomberg Index Services Limited (или ее правопреемником, который может быть время от времени утвержден и/или назначен ISDA), с вносимыми время от времени в соответствии с положениями данных Правил изменениями и дополнениями.

Применимая резервная ставка означает применительно к Сделке для целей:

- (А) пунктов 8.6(а) и 8.6(б) Стандартных условий Резервную ставку (SOFR);
- (Б) пунктов 8.6(в), 8.6(г) и 8.6(д) Стандартных условий Резервную ставку (EuroSTR);
- (В) пунктов 8.6(е) и 8.6(ж) Стандартных условий Резервную ставку (SONIA);
- (Г) пунктов 8.6(з) и 8.6(и) Стандартных условий Резервную ставку (SARON),

или в каждом случае любая последующая резервная процентная ставка, указанная в соответствующем пункте Стандартных условий.

Применимая ставка означает применительно к Сделке для целей:

- (А) пунктов 8.6(а) и 8.6(б) Стандартных условий ставку LIBOR для доллара США;
- (Б) пунктов 8.6(в) и 8.6(г) Стандартных условий ставку LIBOR для евро;
- (В) пункта 8.6(д) Стандартных условий ставку EURIBOR;
- (Г) пунктов 8.6(е) и 8.6(ж) Стандартных условий ставку LIBOR для фунта стерлингов;
- (Д) пунктов 8.6(з) и 8.6(и) Стандартных условий ставку LIBOR для швейцарского франка.

Резервная дата установления означает применительно к Дате изменения плавающей ставки и Процентному периоду (или Периоду капитализации в Процентном периоде), к которому относится такая Дата изменения плавающей ставки, день, наступающий за два Рабочих дня до соответствующей Даты платежа, если иное не согласовано сторонами.

Событие прекращения резервной ставки означает применительно к Применимой резервной ставке:

- (А) официальное заявление или публикация информации администратором Применимой резервной ставки или от его имени, где объявляется, что он на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять Применимую резервную ставку, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении Применимой резервной ставки, который мог бы продолжить предоставлять Применимую резервную ставку; или
- (Б) если Применимой резервной ставкой является:
 - (aa) Резервная ставка (SOFR), Резервная ставка (EuroSTR), Резервная ставка (SONIA) или Резервная ставка (SARON), официальное заявление или публикация информации регулирующим органом, осуществляющим надзор в отношении администратора Базисной ставки, центральным банком для валюты Базисной ставки, официальным лицом, наделенным полномочиями по делу о несостоятельности в отношении администратора Базисной ставки, органом по разрешению споров, обладающим юрисдикцией в отношении администратора Базисной ставки, или судом, лицом или органом со схожими полномочиями в вопросах несостоятельности или разрешения споров в отношении администратора Базисной ставки, которым устанавливается, что администратор Базисной ставки на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять Базисную ставку, при условии

отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении Базисной ставки, который мог бы продолжить предоставлять Базисную ставку; или

- (бб) ставка SOFR, Рекомендуемая ФРС ставка, ставка OIBFR, Целевая ставка FOMC, ставка EuroSTR, Рекомендуемая ЕЦБ ставка, ставка Модифицированная EDFR, ставка SONIA, Рекомендуемая для фунта стерлингов ставка, ставка SARON, Рекомендуемая НРГ ставка или Измененная учетная ставка ШНБ, официальное заявление или публикация информации регулирующим органом, осуществляющим надзор в отношении администратора Применимой резервной ставки или лица, предоставляющего Применимую резервную ставку, центральным банком для валюты Применимой резервной ставки, официальным лицом, наделенным полномочиями по делу о несостоятельности в отношении администратора Применимой резервной ставки или лица, предоставляющего Применимую резервную ставку, органом по разрешению споров, обладающим юрисдикцией в отношении администратора Применимой резервной ставки или лица, предоставляющего Применимую резервную ставку, или судом, лицом или органом со схожими полномочиями в вопросах несостоятельности или разрешения споров в отношении администратора Применимой резервной ставки или лица, предоставляющего Применимую резервную ставку, которым устанавливается, что администратор Применимой резервной ставки или лицо, предоставляющее Применимую резервную ставку, на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять Применимую резервную ставку, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении Применимой резервной ставки или правопреемника лица, предоставляющего Применимую резервную ставку, который мог бы продолжить предоставлять Применимую резервную ставку.

Если Применимой резервной ставкой является ставка Модифицированная EDFR или Измененная учетная ставка ШНБ, то ссылка на Применимую резервную ставку в настоящем определении термина "Событие прекращения резервной ставки" будет считаться ссылкой на индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в определении термина "Модифицированная EDFR" или "Измененная учетная ставка ШНБ", как применимо.

Событие прекращения ставки означает применительно к Применимой ставке:

- (А) официальное заявление или публикация информации администратором Применимой ставки или от его имени, где объявляется, что он на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять Применимую ставку, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении Применимой ставки, который мог бы продолжить предоставлять Применимую ставку;
- (Б) официальное заявление или публикация информации регулирующим органом, осуществляющим надзор в отношении администратора Применимой ставки, центральным банком для валюты Применимой ставки, официальным лицом, наделенным полномочиями по делу о несостоятельности в отношении администратора Применимой ставки, органом по разрешению споров, обладающим юрисдикцией в отношении администратора Применимой ставки, или судом, лицом или органом со схожими полномочиями в вопросах несостоятельности или разрешения споров в отношении администратора Применимой ставки, которым устанавливается, что администратор Применимой ставки на постоянной или бессрочной основе прекратил или прекратит предоставлять Применимую ставку, при условии отсутствия к этому времени администратора-правопреемника в отношении Применимой ставки, который мог бы продолжить предоставлять Применимую ставку; или
- (В) если Применимой ставкой является ставка LIBOR для доллара США, ставка LIBOR для евро, ставка LIBOR для фунта стерлингов или ставка LIBOR для швейцарского франка, официальное заявление или публикация информации регулирующим органом, осуществляющим надзор в отношении администратора такой Применимой ставки, где объявляется, что:
- (aa) таким регулирующим органом, осуществляющим надзор, было установлено, что Применимая ставка более не является или, начиная с определенной даты в будущем, не будет более являться репрезентативной для рынка, на данных которого она основывается, и экономической деятельности, которую она призвана отразить в числовом значении, и репрезентативность Применимой ставки не будет восстановлена; и
- (бб) такое заявление или публикация информации делается с пониманием того, что это повлечет применение договорных положений о резервных вариантах исполнения обязательств (contractual triggers for fallbacks), включенных в договоры в связи с объявлениями, ранее сделанными таким регулирующим органом, осуществляющим надзор, о прекращении в будущем действия Применимой ставки (pre-cessation announcements) (независимо от того, как такие объявления описаны в договорах).

Способ определения плавающей ставки LIBOR имеет значение, определенное в пункте 8.8(б) Стандартных условий.

Соответствующая первоначальная дата фиксации ставки означает для целей:

- (А) пунктов 8.6(а) и 8.6(б) Стандартных условий Первоначальную дату фиксации ставки для доллара США;
- (Б) пунктов 8.6(в), 8.6(г) и 8.6(д) Стандартных условий Первоначальную дату фиксации ставки для евро;
- (В) пунктов 8.6(е) и 8.6(ж) Стандартных условий Первоначальную дату фиксации ставки для фунта стерлингов;
- (Г) пунктов 8.6(з) и 8.6(и) Стандартных условий Первоначальную дату фиксации ставки для швейцарского франка.

8.7. Если применительно к Сделке изменено определение, методика расчета, формула или иные средства расчета Способа определения плавающей ставки (или, если применимо, индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в Способе определения плавающей ставки), то ссылки на такой Способ определения плавающей ставки (или индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в Способе определения плавающей ставки) будут считаться ссылками на Способ определения плавающей ставки (или индекс, индикатор или иное числовое значение (index, benchmark or other price source), указанное в Способе определения плавающей ставки) с соответствующими изменениями, если иное не указано в Стандартных условиях или не согласовано сторонами.

В случае противоречия между положениями настоящего пункта 8.7 и положениями пунктов 8.2-8.6 Стандартных условий о Способах определения плавающей ставки (включая, помимо прочего, положения пункта 8.6(а) Стандартных условий в той мере, в которой они применяются к такому Способу определения плавающей ставки), положения пунктов 8.2-8.6 Стандартных условий имеют преимущественную силу.

8.8. **Отмененные ставки.**

(а) Если применительно к Сделке Затронутая отмененная ставка должна быть определена для Даты изменения плавающей ставки по Определенной затронутой сделке:

- (А) для которой отсутствует Превалирующее резервное положение; и
- (Б) Дата фиксации ставки по которой наступает в Дату отмены ставки в отношении такой Затронутой отмененной ставки или позднее, -

то, несмотря на любое положение Стандартных условий об ином, ставкой, заменяющей такую Затронутую отмененную ставку для такой Даты изменения плавающей ставки, будет Интерполированная ставка применительно к такой Затронутой отмененной ставке для такой Даты изменения плавающей ставки. В случае противоречия между положениями настоящего подпункта (а) и положениями пунктов 8.2-8.6 Стандартных условий о Способах определения плавающей ставки (включая, во избежание сомнений, положения о замене ставки, которая становится на постоянной основе недоступной или, применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, Нерепрезентативной), положения настоящего подпункта (а) имеют преимущественную силу.

Если применимый Способ определения плавающей ставки по сделке установлен путем ссылки на наименование любого из способов, указанных в пункте 8.6 Стандартных условий, Применимая ставка для Периода плавающей ставки является на постоянной основе недоступной или, применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, Нерепрезентативной и Сделка не является Определенной затронутой сделкой, так как отсутствует Ставка ближайшего более длинного периода или Ставка ближайшего более короткого периода, то Событие прекращения ставки считается наступившим в отношении такой Применимой ставки, к которой относится такая Сделка, и Датой наступления события прекращения ставки будет первый день, в который отсутствует Ставка ближайшего более длинного периода или Ставка ближайшего более короткого периода (или, если позднее, первый день, в который Применимая ставка для Периода плавающей ставки становится на постоянной основе недоступной или, применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, Нерепрезентативной).

(б) Для целей пункта 8.6 Стандартных условий и настоящего пункта 8.8 следующие термины имеют следующие значения.

Администратор ставки означает применительно к ставке, определенной в отношении Способа определения плавающей ставки по сделке, и Периоду плавающей ставки, лицо, которое администрирует (administers), предоставляет, рассчитывает, публикует или определяет такую ставку, как указано в определении такого Способа определения плавающей ставки по сделке, исключая любого резервного администратора такой ставки.

Дата отмены ставки означает применительно к Отмененной ставке определенного периода день, по состоянию на который Администратор ставки прекратил на постоянной основе предоставлять такую

Отмененная ставку определенного периода или, применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, такая Отмененная ставка определенного периода становится Нерепрезентативной.

Дата фиксации ставки означает применительно к Плавающей ставке и Дате изменения плавающей ставки по Определенной затронутой сделке день, в который такая Плавающая ставка должна быть определена для такой Даты определения плавающей ставки.

Затронутая дата фиксации ставки применительно к Затронутой отмененной ставке по Определенной затронутой сделке имеет значение, указанное в определении термина "Определенная затронутая сделка".

Затронутая отмененная ставка применительно к Дате изменения плавающей ставки по Определенной затронутой сделке имеет значение, указанное в определении термина "Определенная затронутая сделка".

Интерполированная ставка означает применительно к Затронутой отмененной ставке и Дате изменения плавающей ставки по Определенной затронутой сделке ставку, определенную для такой Даты изменения плавающей ставки посредством линейной интерполяции Ставки ближайшего более длинного периода и Ставки ближайшего более короткого периода.

Определенная затронутая сделка означает Сделку, по которой Плавающая ставка для Даты изменения плавающей ставки определяется путем ссылки на ставку, которая является Отмененной ставкой определенного периода, применительно к которой (А) Дата фиксации ставки наступает в Дату отмены ставки в отношении такой Отмененной ставки определенного периода или позднее (далее любая такая Дата фиксации ставки – "Затронутая дата фиксации") и (Б) существуют Ставка ближайшего более длинного периода и Ставка ближайшего более короткого периода (далее любая такая Отмененная ставка определенного периода – "Затронутая отмененная ставка").

Период плавающей ставки означает исключительно для целей настоящего пункта 8.8 и применительно к Способу определения плавающей ставки по сделке, для которого Плавающая ставка может быть определена применительно к одному или более периоду, любой такой период.

Отмененная ставка определенного периода означает применительно к Сделке ставку, определенную для Способа определения плавающей ставки по сделке, и Периода плавающей ставки, которая по состоянию на любой день:

- (А) на постоянной основе отменена (discontinued); или
- (Б) применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, является или стала Нерепрезентативной,

и, в каждом случае, если ставка для такого Способа определения плавающей ставки и, по крайней мере, двух других Периодов плавающей ставки (по крайней мере, один из которых меньше по продолжительности, чем такой Период плавающей ставки, и, по крайней мере, один из которых больше по продолжительности, чем такой Период плавающей ставки), предоставляется Администратором ставки в отношении такой ставки и, применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, не является Нерепрезентативной.

Превалирующее резервное положение означает применительно к Затронутой отмененной ставке:

- (А) любое положение, (аа) которое прямо предусмотрено в Подтверждении по соответствующей Сделке и которым устанавливается резервный способ определения ставки применительно к такой Затронутой отмененной ставке для такой Даты изменения плавающей ставки, если Администратор ставки в отношении такой Затронутой отмененной ставки более не предоставляет такую ставку (или, применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, если такая ставка является Нерепрезентативной) по состоянию на определенную дату, и (бб) которое не является Резервным положением – банки-ориентир; или
- (Б) любое положение, которое прямо предусмотрено в соглашении о внесении изменений (независимо от того, является ли такое соглашение двусторонним или многосторонним), к которому присоединились стороны Сделки или которое было заключено сторонами Сделки и (аа) которое применяется к Сделке, которая бы иначе была бы Определенной затронутой сделкой, (бб) к которому присоединились стороны Сделки или которое было заключено сторонами Сделки после Даты сделки в отношении такой Сделки и (вв) которым устанавливается резервный способ определения ставки применительно к такой Затронутой отмененной ставке для такой Даты изменения плавающей ставки, если Администратор ставки в отношении такой Затронутой отмененной ставки более не предоставляет такую ставку (или, применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, если такая ставка является Нерепрезентативной) по состоянию на определенную дату.

Резервные способы определения ставки, подлежащие применению, если ставка на постоянной или временной основе является недоступной (или, применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, если ставка является Нерепрезентативной), и указанные в Способах определения плавающей ставки в пунктах 8.2, 8.4-8.6 Стандартных условий, не являются Превалирующими резервными положениями.

Резервное положение – банки-ориентир означает применительно к Сделке любое положение, которое предусматривает резервный способ определения ставки применительно к Затронутой отмененной ставке, если Администратор ставки в отношении соответствующей Затронутой отмененной ставки более не предоставляет такую ставку (или, применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, если такая ставка является Нерепрезентативной) по состоянию на определенную дату, посредством использования одной или более ставок, предоставленных ведущими банками на соответствующем межбанковском рынке.

Способ определения плавающей ставки LIBOR означает Способ определения плавающей ставки по сделке, применительно к которому Применимой ставкой является ставка LIBOR для доллара США, ставка LIBOR для евро, ставка LIBOR для фунта стерлингов или ставка LIBOR для швейцарского франка.

Способ определения плавающей ставки по сделке означает исключительно для целей настоящего пункта 8.8 и применительно к Плавающей ставке и Дате изменения плавающей ставки по Определенной затронутой сделке Способ определения плавающей ставки, определенный в Подтверждении, который – если Способ определения плавающей ставки определен в Подтверждении путем ссылки на наименование любого из способов, указанных в пунктах 8.2, 8.4-8.6 Стандартных условий, - не будет включать какие-либо резервные положения, предусмотренные таким Способом определения плавающей ставки на случай, если ставка (согласно базовому определению (primary method)) не предоставляется Администратором ставки, не публикуется в определенном источнике информации (включая определенную страницу в системе) или является Нерепрезентативной.

Ставка ближайшего более длинного периода означает применительно к Затронутой отмененной ставке и Дате изменения плавающей ставки по Определенной затронутой сделке ставку, определенную для такой Даты изменения плавающей ставки, как если бы (А) Способом определения плавающей ставки по сделке был Способ определения плавающей ставки, предусмотренный для такой Затронутой отмененной ставки, и (Б) Периодом плавающей ставки был период, для которого Способ определения плавающей ставки по сделке для такой Затронутой отмененной ставки не был на постоянной основе отменен (discontinued) (или, применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, не является Нерепрезентативным) по состоянию на Затронутую дату фиксации ставки, являющийся следующим большим по продолжительности периодом (next longer), чем Период плавающей ставки, соответствующий такой Затронутой отмененной ставке.

Ставка ближайшего более короткого периода означает применительно к Затронутой отмененной ставке и Дате изменения плавающей ставки по Определенной затронутой сделке ставку, определенную для такой Даты изменения плавающей ставки, как если бы (А) Способом определения плавающей ставки по сделке был Способ определения плавающей ставки, предусмотренный для такой Затронутой отмененной ставки, и (Б) Периодом плавающей ставки был период, для которого Способ определения плавающей ставки по сделке для такой Затронутой отмененной ставки не был на постоянной основе отменен (discontinued) (или, применительно к Способу определения плавающей ставки LIBOR, не является Нерепрезентативным) по состоянию на Затронутую дату фиксации ставки, являющийся следующим меньшим по продолжительности периодом (next shorter), чем Период плавающей ставки, соответствующий такой Затронутой отмененной ставке.

- (в) Для целей настоящего пункта 8.8 ссылки на Применимую ставку в определении термина "Нерепрезентативная" будут считаться ссылками на соответствующий срок Применимой ставки.
- (г) Для целей настоящего пункта 8.8 ссылки на ставку, которая является на постоянной основе недоступной, была на постоянной основе отменена (discontinued) или более не предоставляется на постоянной основе, будут считаться ссылками на такую ставку, которая является на постоянной основе недоступной, была на постоянной основе отменена (discontinued) или более не предоставляется на постоянной основе вследствие официального заявления или публикации информации, которое было бы Событием прекращения ставки в отношении такой ставки соответствующего срока согласно подпункту (А) или (Б) определения термина "Событие прекращения ставки".

8.9. **Источники информации.**

- (а) Ссылки в Стандартных условиях на какую-либо страницу в системе Bloomberg являются ссылками на страницу, обозначенную в качестве таковой в системе Bloomberg, или на Сайт-преемник.
- (б) Ссылки в Стандартных условиях на какую-либо страницу в системе Reuters являются ссылками на страницу, обозначенную в качестве таковой в системе Reuters, или на Сайт-преемник.
- (в) Для целей настоящего пункта 8 следующие термины имеют следующие значения.

Сайт www.ruonia.ru означает сайт www.ruonia.ru или Сайт-преемник.

Сайт Банка России означает сайт <http://www.cbr.ru/> или Сайт-преемник.

Сайт Европейского центрального банка означает сайт <https://www.ecb.europa.eu/home/html/index.en.html> или Сайт-преемник.

Сайт ПАО Московская Биржа означает сайт <https://www.moex.com/> или Сайт-преемник.

Сайт-преемник означает для любой электронной страницы, отображаемой на мониторе (в том числе сайта в сети Интернет и страницы в информационной системе), иного источника опубликования информации, продавца информации или лица, предоставляющего информацию, предусмотренных Стандартными условиями:

- (А) электронную страницу, отображаемую на мониторе, иной источник опубликования информации, продавца информации или лицо, предоставляющее информацию, которые официально определены в качестве преемника владельцем (администратором) первоначального сайта или иного источника информации; или
- (Б) если владелец (администратор) первоначального сайта или иного источника информации официально не определил такого преемника, электронную страницу, отображаемую на мониторе, иной источник опубликования информации, службу или лицо, предоставляющее информацию, которые определены в качестве преемника соответствующим продавцом информации или лицом, предоставляющим информацию (если он не является владельцем (администратором) первоначального сайта или иного источника информации).

Сайт Федерального резервного банка Нью-Йорка означает сайт <https://www.newyorkfed.org/> или Сайт-преемник.

Сайт Федеральной резервной системы США означает сайт <https://www.federalreserve.gov/> или Сайт-преемник."

14. В пункте 10.4 Стандартных условий слова "в пункте 8.2" заменить словами "в пунктах 8.2, 8.4-8.6".
15. Дополнить Стандартные условия приложением 9 в редакции приложения 1 к Изменениям.
16. Удалить ссылки на термины "EUR-EURIBOR-Reuters" (пункт 8.2(з)), "Moscow InterBank Offered Rate" (пункт 8.2(а)), "MosIBOR" (пункт 8.2(а)), "USD-LIBOR BBA" (пункт 8.2(д)) и "HBA" (пункт 8.2(а)) из алфавитно-предметного указателя Стандартных условий.
17. В алфавитно-предметном указателе Стандартных условий термин "Период плавающей ставки" дополнить ссылкой на пункт 8.8(б) Стандартных условий.
18. Дополнить алфавитно-предметный указатель Стандартных условий следующими терминами (расположив их в алфавитном порядке с учетом терминов, уже включенных в алфавитно-предметный указатель) со ссылками на следующие пункты Стандартных условий:

CHF-LIBOR-BBA	8.6(з)
CHF-LIBOR-BBA-Bloomberg	8.6(и)
CHF-SARON-OIS-COMPOUND	8.4(д)
EUR-EONIA-OIS-COMPOUND	8.4(г)
EUR-EURIBOR-Reuters	8.6(д)
EUR-EuroSTR-COMPOUND	8.5(б)
EUR-LIBOR-BBA	8.6(в)
EUR-LIBOR-BBA-Bloomberg	8.6(г)
GBP-LIBOR-BBA	8.6(е)
GBP-LIBOR-BBA-Bloomberg	8.6(ж)
GBP-SONIA-COMPOUND	8.5(в)
JPY-TONA-OIS-COMPOUND	8.4(е)
RUB Key Rate 1D AVG	8.2(г ¹)
RUB Key Rate 1W CMP	8.2(г ²)
Ruble OverNight Index Average	8.4(а)
RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND	8.4(б)

RUONIA	8.4(а)
RUSFAR	8.2(а)
Russian Secured Funding Average Rate	8.2(а)
USD-Federal Funds-H.15-OIS-COMPOUND	8.4(в)
USD-LIBOR-BBA	8.6(а)
USD-LIBOR-BBA-Bloomberg	8.6(б)
USD-SOFR-COMPOUND	8.5(а)
Администратор ставки	8.8(б)
Базисная ставка	8.6(к)
Дата наступления события прекращения резервной ставки	8.6(к)
Дата наступления события прекращения ставки	8.6(к)
Дата отмены ставки	8.8(б)
Дата фиксации ставки	8.8(б)
Затронутая дата фиксации ставки	8.8(б)
Затронутая отмененная ставка	8.8(б)
Интерполированная ставка	8.8(б)
Ключевая ставка Банка России	8.2(г)
Нерепрезентативная	8.6(к)
Определенная затронутая сделка	8.8(б)
Отмененная ставка определенного периода	8.8(б)
Правила Bloomberg по определению значений резервных ставок	8.6(к)
Превалирующее резервное положение	8.8(б)
Применимая резервная ставка	8.6(к)
Применимая ставка	8.6(к)
Резервная дата установления	8.6(к)
Резервное положение – банки-ориентиры	8.8(б)
Сайт Банка России	8.9
Сайт Европейского центрального банка	8.9
Сайт ПАО Московская Биржа	8.9
Сайт-преемник	8.9
Сайт Федерального резервного банка Нью-Йорка	8.9
Сайт Федеральной резервной системы США	8.9
Событие прекращения резервной ставки	8.6(к)
Событие прекращения ставки	8.6(к)
Способ определения плавающей ставки LIBOR	8.8(б)

Способ определения плавающей ставки по сделке	8.8(б)
Соответствующая первоначальная дата фиксации ставки	8.6(к)
Ставка ближайшего более длинного периода	8.8(б)
Ставка ближайшего более короткого периода	8.8(б)

ПРИЛОЖЕНИЕ 1
к Изменениям № 1 к Стандартным условиям срочных сделок
на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г.

ПРИЛОЖЕНИЕ 9
к Стандартным условиям срочных сделок
на процентные ставки и сделок свопцион 2011 г.
Способы определения плавающей ставки, указанные в Стандартных условиях

Валюта, в которой выражены суммы	Способ определения плавающей ставки	Пункт Стандартных условий
Рубли	RUSFAR или Russian Secured Funding Average Rate	8.2(а)
	RUB-MOSPRIME-NFEA	8.2(б)
	RUB-MOSPRIME-банки-ориентиры	8.2(в)
	Ключевая ставка Банка России	8.2(г)
	RUB Key Rate 1D AVG	8.2(г ¹)
	RUB Key Rate 1W CMP	8.2(г ²)
	RUONIA или Ruble OverNight Index Average	8.4(а)
	RUB-RUONIA-OIS-COMPOUND	8.4(б)
Доллары США	USD-Federal Funds-H.15	8.2(е)
	USD-LIBOR-банки-ориентиры	8.2(ж)
	USD-Federal Funds-H.15-OIS-COMPOUND	8.4(в)
	USD-SOFR-COMPOUND	8.5(а)
	USD-LIBOR-BBA	8.6(а)
	USD-LIBOR-BBA-Bloomberg	8.6(б)
Евро	EUR-EURIBOR-банки-ориентиры	8.2(и)
	EUR-EONIA-OIS-COMPOUND	8.4(г)
	EUR-EuroSTR-COMPOUND	8.5(б)
	EUR-LIBOR-BBA	8.6(в)
	EUR-LIBOR-BBA-Bloomberg	8.6(г)
	EUR-EURIBOR-Reuters	8.6(д)
Фунты стерлингов	GBP-SONIA-COMPOUND	8.5(в)
	GBP-LIBOR-BBA	8.6(е)
	GBP-LIBOR-BBA-Bloomberg	8.6(ж)
Швейцарские франки	CHF-SARON-OIS-COMPOUND	8.4(д)
	CHF-LIBOR-BBA	8.6(з)
	CHF-LIBOR-BBA-Bloomberg	8.6(и)
Иены	JPY-TONA-OIS-COMPOUND	8.4(е)