



ПРОТОКОЛ №2
заседания Экспертного Совета СРО НФА
по индикаторам и ставкам

г. Москва

25.06.2015 г.

Присутствовали:

Члены Экспертный Совет:

Аношин С.А. (ОАО Сбербанк России), Волков К.А. (СРО НФА), Глубоковский П.С. (Банк ГПБ (ОАО)), Горлинский О.Ю. (Сопредседатель СД НФА, ОАО Банк ВТБ), Дабижа А.Ю. (ЕБРР), Корнев С.Б. (АО «ЮниКредит Банк»), Орлов А.А. (Банк России), Пестов К.М. (ОАО Московская Биржа), Романчук С.А. (Металлинвестбанк), Сенина Анна («Томсон Рейтер (Маркетс) С А»), Чепкунов Д.В. (ОАО Россельхозбанк), Ярушевичюс С.С. («ИНГ БАНК (ЕВРАЗИЯ) ЗАО»).

Приглашенные:

Алехина О.И. (Банк России), Анисимов М.М. (ОАО Банк ВТБ), Гамбаров Г.М. (Банк России), Кузнецова Е.С. (Банк России), Куковкин П.А. (Банк России), Митюк Ю.В. (Банк России), Мухльнов Р. В. (Банк России), Перельдик П.В. (ОАО Сбербанк России), Смирнов В.Д. (Банк России), Федоренко И.Б. (Банк России), Чекмарева Е.Л. (Банк России), Яровой В.В. (ОАО Московская Биржа), Голованев С.Б. (ОАО Московская Биржа).

Председатель заседания - Горлинский О.Ю. (Сопредседатель СД НФА, ОАО Банк ВТБ).

Секретарь заседания - Е.М. Воропаева (СРО НФА).

Об обязательности участия в индикаторах. Орлов А.А. предложил в начале заседания провести голосование по вопросу о рекомендации Банку России по обязательности участия банков в формировании индикаторов, рассмотренному на предыдущем заседании ЭС.

Решили:

Не вводить требование обязательного участия.

Голосовали: «за» - единогласно.

1. Вопрос 1 «Обсуждение предложений членов ЭС по внесению изменений в проект Указания Банка России «Об оценке качества функционирования организаций, осуществляющих деятельность по

формированию финансовых индикаторов».

Представитель ДДКП ЦБ РФ Чекмарева Б.Н. проинформировала членов Экспертного Совета о ходе работы над данным документом и отметила важность предоставленных членами Экспертного Совета замечаний. Она отметила, что видение участников рынка совпадает с мнением Банка России, а Экспертный Совет рассматривается как форма живого общения.

Аношин С.А. отметил, что надо приближаться к западным стандартам регулирования отрасли индикаторов, т.к. это будет способствовать развитию рынка, более активному открытию лимитов западными банками.

Романчук С.А. прокомментировал позиции, которые он не поддерживает в своде предложений, и предложил исключить их из итогового документа, передаваемого в ЦБ. Он отметил следующие пункты:

- невозможность и нежелательность наличия в Указании исчерпывающих критериев к качеству контрибьютеров, как то было предложено ВТБ,

- необходимость изменения формулировки полномочий ЭС, в предложении Биржи сводимым к одобрению методики.

- двусмысленность критики и отсутствие конкретных предложений в вводных абзацах предложений ВТБ.

Волков К.А. предложил Банку России подумать о концепции документа в целом, включая следующие вопросы:

- регулятору важнее оценка качества индекса (от проработки и верификации методики индекса до его использования потребителями) или качества функционирования администратора (пока документ решает в основном вторую задачу).
- требования к формированию Экспертного Совета - должны ли в состав входить только представители пользователей или контрибьютеры тоже, при этом контрибьютеры выступают в обоих качествах. Без контрибьютеров ЭС лишается предмета и превращается в некий контрольный орган.

Решили:

1.1. Одобрить в целом предложения членов ЭС по проекту Указаний (Банк ВТБ, Металлинвестбанк, Московская Биржа), с учетом высказанных замечаний.

1.2. Исполнительной дирекции СРО НФА направить после согласования окончательного текста с членами ЭС в заочной форме в Банк России свод предложений с просьбой учесть предложения членов ЭС при принятии.

1.3. Исполнительной дирекции СРО НФА проконтролировать включение высказанных на ЭС предложений в проект Указания.

1.4. Провести обсуждение Указания в окончательной редакции (после их принятия ЦБ РФ).

Голосовали: «за» - единогласно.

2. Вопрос 2 «Об изменении состава контрибьютеров».

Горлинский О.Ю. прокомментировал решение ОАО Банка ВТБ войти в состав контрибьютеров ROISFIX.

Глубоковский П.С. подтвердил решение Газпромбанка войти в состав

контрибьюторов NFEA FX Swap Rate.

Сенина А. отметила, что при включении новых членов в состав контрибьюторов Томсон Рейтере необходимо время для решения технических вопросов.

Решили:

2.1. Включить ОАО Банк ВТБ в состав контрибьюторов ROISFIX. Начать публиковать с 1 августа 2015г.

2.2. Включить «Газпромбанк» АО в состав контрибьюторов NFEA FX Swap Rate. Начать публиковать с 1 августа 2015г.

2.3. Удовлетворить заявление ИНГ БАНКА (ЕВРАЗИЯ) о выходе из состава контрибьюторов Mosprime, ROISFIX, RUREPO. При этом необходимо выполнить требования Положений о формировании ставок в части продолжения котирования:

- по Mosprime - 3 календарных месяца с даты подачи заявления о прекращении участия в формировании ставок,
- по ROISFIX - 1 календарный месяц с даты подачи заявления о прекращении участия в формировании ставок,
- по RUREPO - 3 календарных месяца с даты подачи заявления о прекращении участия в формировании ставок.

2.4. Направить официальный ответ Дойчебанку, что исключение из списка банков, по сделкам которых считается RUONIA, технически невозможно в силу статистической природы индикатора, и банк не может быть классифицирован как контрибьютор цен.

Голосовали: «за» - единогласно.

3. Вопрос 3 «Об изменении персонального состава Экспертного Совета НФА по индикаторам и ставкам».

Решили:

3.1. Удовлетворить ходатайство Банка ВТБ о замене представителя в ЭС на Анисимова М.М., заместителя начальника Казначейства, вице-президента.

3.2. ИД СРО НФА подготовить проект Положения об Экспертном Совете по индикаторам и ставкам с учетом обсуждения и направить его членам ЭС для обсуждения.

3.3. В проекте Положения предусмотреть статус «наблюдателя» или члена ЭС с правом совещательного голоса, который может применяться в следующих целях:

- ограничения возможности влияния сотрудников одной организации на принятие решений ЭС;
- как «испытательный срок» для новых членов ЭС.

3.4. Направить в МФ РФ предложение о включении уполномоченного представителя МФ РФ в состав ЭС в качестве наблюдателя.

Голосовали: «за» - единогласно,

4. Вопрос 4 «О текущем состоянии и развитии индикаторов».

Орлов А.А, предложил направить Банку России предложения:

- о вхождении Банка России в состав маркет мейкеров ROISFIX,
- о возможности предоставления Банком России некоторых инструментов рефинансирования по ставке RUONIA + спрэд.

Решили:

- 4.1. Подготовить проект письма с предложениями Орлова А.А. (отв. С.А. Аношин, М.М.Анисимов) и направить после заочного согласования с членами ЭС письмо в Банк России.
- 4.2. Принять к сведению информацию, предоставленную Томсон Рейтер о текущем состоянии расчета индикаторов.
- 4.3. Одобрить в целом проект Обращения НФА в МФ РФ, разработанный О.Ю. Горлинским (Банк ВТБ).
- 4.4. Членам ЭС дать свои замечания и предложения в проект обращения до 29 июня 2015 г.
- 4.5. ИД НФА подготовить окончательный текст Обращения с учетом предложений членов ЭС и направить его в МФ РФ.
- 4.6. Членам ЭС проработать предложения по развитию индикаторов, подготовленные А.А.Орловым (Банк России), для последующего обсуждения их на заседании ЭС НФА по индикаторам и ставкам.
- 4.7. Членам ЭС дать свои предложения по списку вопросов EBRD с указанием приоритетности их рассмотрения.
- 4.8. ЕБРР до 4 июля 2015 подготовить и направить в СРО НФА список вопросов к контрабьюторам индекса Roisfix, касающихся проведения проверочных сделок между ЕБРР и участниками панели Roisfix (сроки, объемы, метод заключения сделки и т.п.).
- 4.9. СРО НФА провести опрос участников контрабьютеров Roisfix по данному списку вопросов и направить официальный ответ в ЕБРР.
- 4.10. ЕБРР к очередному заседанию ЭС подготовить и направить в НФА конкретные предложения по проведению тестовых сделок.

Голосовали: «за» - единогласно.

- 4.11. По изменению методики расчета RUONIA и включению в состав RUONIA новых участников:
 - одобрить новую методику расчета RUONIA, исключаящую внутригрупповые сделки,
 - включить в состав участников RUONIA следующие банки: ПАО "ХАНТЫ-МАНСКИЙ БАНК ОТКРЫТИЕ", Сумитомо Мицуи Рус Банк, ОАО БАНК ЗЕНИТ, ОАО АКБ "СВЯЗЬ-БАНК", ЗАО "МИДЗУХО БАНК (МОСКВА)", ЗАО ТЛОБЭКСБАНК".

Голосовали: «за» - 11.

«воздержался» - 1.

5. Вопрос 5 «Разное».

(о дисциплине выставления котировок для индикативных ставок НФА, о рабочей встрече в СРО НФА с руководителем ЭС С.П.Щепиловым по вопросам функционирования системы индикаторов, об организационных аспектах работы Экспертного Совета (переписка, стенограммы, аудиозаписи, протоколы)).

Решили:

- 5.1. Направить в Банк УралСиб письмо за подписью Председателя ЭС с

уведомлением о необходимости соблюдения дисциплины выставления котировок.

5.2. Рассмотреть на следующем заседании ЭС включение в план работы СРО НФА рекомендации Щепилова С.П. по организации администрирования индикаторов.

5.3. Провести специальное обсуждение Плана работ СРО НФА на 20-15-2016г.г. по развитию отрасли индикаторов финансового рынка на следующем заседании ЭС.

Председатель

О.Ю. Горлинский

Отв. секретарь

Е.М. Воропаева