



**Протокол N 4
заседания Экспертного Совета СРО НФА
по индикаторам и ставкам.**

г. Москва

24 ноября 2015 г.

Форма проведения Заседания: очное голосование по вопросам повестки дня, поставленным на голосование.

Место проведения Заседания: Москва, Б. Кисловский пер, д. 13, здание МБ.

Члены ЭС принявшие участие в Заседании:

1. Щепилов С.П. (АО «Райффайзенбанк») – Председатель.
2. Анисимов М.М. (Банк ВТБ).
3. Аношин С.А. (ОАО Сбербанк России).
4. Борзунова Э.Г. (Банк России).
5. Вергунов К.В. (Банк России).
6. Волков К.А. (СРО НФА).
7. Дабижа А.Ю. (ЕБРР).
8. Карпушкин Н.Г. (Альфа-Банк).
9. Орлов А.А. (Банк России).
10. Перельдик П.В. (Банк Кредит Свисс).
11. Пестов К.М. (ОАО Московская Биржа).
12. Романчук С.А. (Металлинвестбанк).
13. Сенина Анна («Томсон Рейтер (Маркетс) СА») – Секретарь.
14. Хавин А.С. (ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»).
15. Чепкунов Д.В. (Россельхозбанк).
16. Шведов А.В. (Банк Голдман Сакс).

Приглашенные:

1. Чекмарева Е.Н. (Банк России).
2. Пономарева В.Л. (БК Регион).
3. Паров Д. (Сбербанк).

Общее число членов ЭС составляет 21 человек, число принявших участие в Заседании 24.11.2015 – 16 человек, что составило более 50% от общего числа членов ЭС. Кворум для проведения Заседания имеется.

Повестка дня:

1. О текущем состоянии отрасли индикаторов.
2. Отчет о работе, проделанной СРО НФА по результатам рекомендаций Председателя Экспертного Совета.

3. Обсуждение проектов внутренних документов СРО НФА как Администратора индикаторов, необходимых для аккредитации в Банке России.
4. О расширении состава контрибьюторов.
5. Проверочные сделки. Инициатива ЕБРР.
6. Организационные вопросы.
7. Подведение итогов года.

Принятые решения:

Вопрос 1. О текущем состоянии отрасли индикаторов.

- 1.1. Обсуждение итогов заочного голосования по увеличению сроков ROISFIX.
- 1.2. Обсуждение формулы перевода форвардных пунктов в процентные ставки для NFEA FW Swap Rates.
- 1.3. О результатах заседания рабочей группы RUREPO.

Решили:

- 1.1. Принять к сведению информацию о текущем состоянии рынка отраслей индикаторов согласно презентации Tomson Reuters.
Поручить Россельхозбанку уточнить корректность выставления котировок NFEA FW Swap Rates на сроки 1 год с середины октября 2015 г. по настоящее время.
- 1.2. Удлинить срок расчета индикатора ROISFIX до 1 года. ИД НФА осуществить необходимую информационную рассылку участникам рынка в соответствующие сроки. Начать публикацию срока 1 год для индекса ROISFIX с 01 марта 2016 г.
- 1.3. Принять к сведению методику расчета формулы для перевода форвардных пунктов в процентные ставки для NFEA FW Swap Rates. Поручить ИД НФА разместить данную методику на сайте НФА.
- 1.4. Приняли к сведению информацию о результатах заседания рабочей группы RUREPO.

Голосование: за – 15, против – 0, воздержался – 1.

Вопрос 2. Отчет о работе, проделанной СРО НФА по результатам рекомендаций Председателя ЭС Щепилова С.П.

Решили:

- 2.1. Принять к сведению отчет о работе по письму Щепилова С.П.
- 2.2. Поручить REUTERS изменить барьер предупреждения об ошибке с величины отклонения 20% до 15%. Поручить REUTERS в срок до 01.02.2016 г. формализовать и задокументировать проверочные процедуры согласно пунктам 3,4,6, 8 письма.
- 2.3. Вопрос утверждения механизма проверочных сделок по Моспрайм включить в повестку дня следующего заседания ЭС.

Голосование: за - 16, против - 0, воздержались – 0.

Вопрос 3. Обсуждение проектов внутренних документов СРО НФА как Администратора индикаторов, необходимых для аккредитации в Банке России.

- 3.1. Соглашение о формировании индикатора российских межбанковских кредитов MosPrime.
- 3.2. Методика формирования MosPrimeRate, ROISfix, NFEA Swap Rate, RuREPO.

3.3. Регламент организации внутреннего контроля Администратора при формировании финансовых индикаторов, а также процедуры, направленные на предотвращение злоупотреблений в процессе формирования финансового индикатора.

3.4. Порядок раскрытия информации о финансовых индикаторах, Принципы обеспечения непрерывности расчета финансового индикатора MosPrimeRate.

3.5. Порядок выбора контрабьюторов и Расчетного агента, взаимодействия Администратора с третьими лицами, а также осуществления Администратором контроля за указанными лицами.

Решили:

Рекомендовать ИД НФА рассмотреть вопрос о привлечении сторонней юридической организации для подготовки пакета документов СРО НФА как Администратора индикаторов, необходимых для аккредитации в Банке России. Провести сравнительный анализ цен на данную услугу со стороны юридических организаций.

Голосование: за - 16, против - 0, воздержались – 0.

Вопрос 4. О расширении состава контрабьюторов.

4.1. Включение Россельхозбанка состав контрабьюторов ROISFIX и RuREPO.

4.2. Предложения о вхождении в состав контрабьюторов Промсвязьбанку, Банку Открытие и Росбанку.

Решили:

4.1. Включить Россельхозбанк состав контрабьюторов ROISFIX и RuREPO.

4.2. Направить предложения о вхождении в состав контрабьюторов Промсвязьбанку, Банку Открытие и Росбанку.

Голосование: за - 16, против - 0, воздержались – 0.

Вопрос 5. Проверочные сделки. Инициатива ЕБРР.

Решили:

5.1. Провести заседание рабочей группы контрабьюторов с участниками индекса ROISFIX для выяснения их готовности с 01.02.2016 г. к заключению внебиржевых проверочных сделок ROISFIX на срок 3 месяца с последующим клирингом через ЦК.

5.2. Вернуться к вопросу об обязательности проверочных сделок во II квартале 2016 г.

Голосование: за - 16, против - 0, воздержались – 0.

Вопрос 6. Организационные вопросы.

6.1. Статистика посещений заседаний членами ЭС, ротация членов ЭС.

6.2. О секретаре Экспертного Совета.

6.3. Обсуждение документа, вынесенного на СПФИ.

6.4. О включении представителей Банка России в состав Экспертного Совета.

Решили:

6.1. Рекомендовать ИД ЭС обратить внимание ряда участников на дисциплину при посещении Заседаний Экспертного Совета в случае их отсутствия на более 50% заседаний ЭС.

6.2. Поручить ведение и подготовку Протоколов Заседания Председателю ЭС Щепилову С.П., для чего поручить ИД НФА внести в списки постоянно приглашенного лица ассистента Щепилова С.П. Емельяненко О.А.

6.3. Поручить ИД НФА повторно запросить Министерство Финансов по вопросу вхождения представителей Министерства Финансов в состав ЭС.

6.4. Поручить НФА связаться с ассоциацией корпоративных казначеев по вопросу проведения совместного мероприятия для обсуждения заинтересованности представителей корпоративного бизнеса в процессе формирования индикаторов и ставок денежного рынка и работе в составе ЭС.

Голосование: за - 16, против - 0, воздержались – 0.

Вопрос 7. Подведение итогов года.

Решили:

Принять информацию к сведению.

Председатель заседания:

С.П. Щепилов

Секретарь заседания:

А.Ю. Сенина