



**Протокол № 9
заседания Экспертного Совета СРО НФА
по индикаторам и ставкам.**

г. Москва

15 декабря 2016 г.

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

Место проведения Заседания: Москва, ул. Воздвиженка д.4/7, стр.1, здание МБ.

Члены ЭС принявшие участие в Заседании:

1. Щепилов С.П. («Райффайзенбанк») – Председатель.
2. Анисимов М.М. (Банк ВТБ).
3. Борзунова Э.Г. (Банк России).
4. Буров П.Ю. (Газпромбанк).
5. Вергунов К.В. (Банк России).
6. Волков К.А. (СРО НФА).
7. Дабижа А.Ю. (ЕБРР).
8. Карпушкин Н.Г. (Альфа-Банк).
9. Паров Д.А. (Сбербанк).
10. Пестов К.М. (Московская Биржа).
11. Чепкунов Д.В. (Россельхозбанк).

Приглашенные:

1. Баранов А.В. (Россельхозбанк).
2. Заблоцкий В.В. (СРО НФА).
3. Могилина М.В. (Банк России).
4. Плющик А.В. (Райффайзенбанк).
5. Омельченко В.В. (Банк «ФК Открытие»).
6. Смирнов С.В. (Банк «ФК Открытие»).
7. Федоренко И.Б. (Банк России).

Общее число членов ЭС составляет 21 человек, число принявших участие в Заседании – 11 человек, а также 2 доверенности, выданные на имя Председателя ЭС Щепилова С.П. и 1 доверенность, выданная на имя Анисимова М.М.

Итого 14 голосов, что составило 2/3 от общего числа членов ЭС. Кворум для проведения Заседания имеется.

Повестка дня:

1. О текущем состоянии отрасли индикаторов (справка, представитель Рейтерс).
2. Обсуждение проекта Методики MosPrime Bid (докладчик А.Баранов, РСХБ).
3. О ходе согласования пакета документов для аккредитации в Банке России СРО НФА, как Администратора, а также индикатора MosPrime Rate (докладчик ИД НФА).
4. Об изменении состава ЭС:
 - замена члена ЭС от Газпромбанка,
 - кандидатуры для включения в состав ЭС от Банка «Открытие».
5. Разное, в т.ч.:
 - 5.1. Обсуждение вопроса об уровне спредов.
 - 5.2. О расширении линейки дат индикатора NFEA FX Swap.
 - 5.3. Актуализация списка RUONIA.
 - 5.4. Расчет финансовых индексов в новогодние праздники.
 - 5.5. О проведении РЕПО Форума СРО НФА.

Принятые решения:

Вопрос 1. О текущем состоянии отрасли индикаторов.

Решили:

1.1. Принять к сведению информацию о текущем состоянии отрасли индикаторов согласно презентации Tomson Reuters.

Голосование: за – 14, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 2. Обсуждение проекта Методики MosPrime Bid.

Решили:

2.1. Пройти аккредитацию финансового индекса MosPrime Rate в текущей редакции Методики расчета, согласованной Экспертным Советом СРО НФА по индикаторам и ставкам (Протокол № 8 от 08.09.2016г.).

2.2. Разработать необходимую документацию для формализации и расчета MosPrime Bid с учетом комментариев со стороны членов ЭС, Банка России и корпоративных участников, включая историческую аналитику и описательные документы для индекса.

2.3. Поручить Рейтерс предоставить ИД НФА не позднее 28 декабря 2016г. аналитику за 1-2 года по ставкам привлечения рублевых кредитов (депозитов) на межбанковском рынке, выставляемым контрибьюторами MosPrime Rate.

2.4. Создать рабочую группу по разработке документации в следующем составе:

- Россельхозбанк;
- Банк России (И.Федоренко);
- Сбербанк (Д.Паров)
- Райффайзенбанк (А.Базжин)
- Альфа Банк (Н.Карпушкин);
- представитель ИД НФА.

2.5. Провести первое заседание рабочей группы не позднее 20 января 2017 г.

2.6. Поручить А.Дабиже прислать формулировку к п.1.18. Методики MosPrime Rate в срок не позднее 20 декабря 2016 г.

Голосование: за – 14, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 3. О ходе согласования пакета документов для аккредитации в Банке России СРО НФА, как Администратора, а также индикатора MosPrime Rate.

Решили:

3.1. Принять в целом представленный пакет документов для аккредитации, разработанный ИД НФА.

3.2. Убрать Приложение 1 (Заявление) к Соглашению о формировании индикативной ставки предоставления рублевых кредитов (депозитов) на межбанковском рынке MosPrime Rate.

3.3. Рабочей группе по технологиям и процедурам Экспертного совета внести необходимые изменения в Соглашение о формировании финансового индикатора и Методику до 21 декабря 2016 г.

3.4. ИД СРО НФА разослать пакет документов членам ЭС не позднее 22 декабря 2016 г.

3.5. Утвердить текст Меморандума (приложение 1).

3.6. ИД СРО НФА совместно с членами ЭС обеспечить подписание Меморандума между Администратором и контрибьюторами MosPrime Rate до 22 января 2017г.

Голосование: за – 14, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 4. Об изменении состава ЭС.

Решили:

4.1. Исключить П.Глубоковского из состава ЭС по его заявлению.

4.2. Включить П.Бурова в состав ЭС.

4.3. Включить С.Смирнова в состав ЭС.

Голосование: за – 14, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 5. Разное.

5.1. Обсуждение вопроса об уровне спрэдов.

Решили:

5.1.1. Внести в итоги голосования п.6 голос Газпромбанка за вариант 3.

5.1.2. Установить следующий порядок по уровню спрэдов:

- если значение котировки индекса MosPrime Rate по стороне предложения (offer side) меньше или равно 10%, то между значением спроса и предложения котировок индекса MosPrime Rate устанавливается спрэд в размере 50 б.п.
- если значение котировки индекса MosPrime Rate по стороне предложения (offer side) выше 10%, то между значением спроса и предложения котировок индекса MosPrime Rate устанавливается спрэд в размере 5% от значения котировки индекса MosPrime Rate по стороне предложения (offer side).

Голосование: за – 12, против – 1, воздержался – 1.

5.2. О расширении линейки дат индикатора NFEA FX Swap.

Решили:

От голосования по вопросу воздержались в связи с отсутствием докладчика.

5.3. Актуализация списка RUONIA.

Решили:

- 5.3.1. Исключить из списка RUONIA московский филиал ПАО «МДМ БАНК».
- 5.3.2. Включить в список RUONIA московский филиал ПАО «БИНБАНК».

Голосование: за – 14, против – 0, воздержался – 0.

5.4. Расчет финансовых индексов в новогодние праздники.

Решили:

5.4.1. Установить последний день расчета RUONIA в 2016 году 29.12.2016г. Опубликовать значение RUONIA за 29.12.2016. в соответствии с регламентом (30.12.2016). За 30.12.2016г. RUONIA не рассчитывается.

Первый день расчета RUONIA в новом году установить 9.01.2017г. Опубликовать значение RUONIA за 09.01.2017. в соответствии с регламентом (10.01.2017).

5.4.2. 30.12.2016 производить расчет значений индексов MosPrime Rate и RUREPO в сроках, отличных от overnight.

5.4.3. 30.12.2016г. производить расчет значений индексов ROISFIX и NFEA FX Swap на все сроки.

5.4.4. В праздничные дни с 31.2016г. по 8.01. 2017г. (включительно) расчет индикаторов RUONIA, MosPrime Rate, RUREPO, ROISFIX и NFEA FX Swap не производить.

Голосование: за – 14, против – 0, воздержался – 0.

5.5. О проведении РЕПО Форума СРО НФА.

Решили:

Принять к сведению.

Председатель заседания:

С.П. Щепилов

Секретарь заседания:

С.В. Власова