

Протокол № 48**заседания Экспертного Совета СРО НФА по индикаторам и ставкам****Формат встречи: Zoom****01.03.2022****Участствовали:****Члены ЭС СРО НФА:**

- | | |
|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 1. Заблоцкий Василий (СРО НФА) | 9. Гостюшев Александр (БНП Париба) |
| 2. Калинин Роман (ВТБ) | 10. Паров Денис (Сбербанк) |
| 3. Моисеев Сергей (Банк России) | 11. Пестов Кирилл (Московская биржа) |
| 4. Потятынный Тарас (ЮниКредит Банк) | 12. Буров Павел (ГПБ) |
| 5. Пономарева Варвара (БСПБ) | 13. Павлов Егор (Банк ГПБ) |
| 6. Чепкунов Дмитрий (МСП Банк) | 14. Карпушкин Николай (Альфа банк) |
| 7. Мельникова Ирина (Банк России) | 15. Базжин Алексей (Райффайзенбанк) |
| 8. Смирнов Сергей (ФК Открытие) | 16. Сенина Анна (Refinitiv) |

Приглашенные:

- | | |
|---------------------------------------|--|
| 1. Осинцев Юрий (Банк России) | 5. Севостьянова Наталия (СРО НФА) |
| 2. Кокорев Максим (Банк России) | 6. Черемисин Владимир (Московская биржа) |
| 3. Локтионов Роман (Московская биржа) | 7. Штерн Наталья (Refinitiv) |
| 4. Крючкова Ольга (СРО НФА) | 8. Кешаниди Ксения (Refinitiv) |

Общее число членов ЭС: 26

Из них принявших участие в заседании: 16

Доверенности: 0

Итого голосов: 16 из 26

Повестка дня:

Вопрос 1. Порядок расчёта и публикации индикаторов в сложившейся ситуации.

Вопрос 1. Порядок расчёта и публикации индикаторов в сложившейся ситуации.**Докладчик: К. Григорьев-Белоцерковский.**

К. Григорьев-Белоцерковский информировал, что 25.03.2022 и 28.03.2022 по сообщениям, полученным от компании Refinitiv, несколько банков контрибьюторов индикаторов MosPrime Rate, Rois Fix, NFEA FX Swap Rate и RUREPO не предоставили котировок по данным индикаторам. Присланных данных другими контрибьюторами оказалось достаточно для формирования

индикаторов согласно утвержденной методике. Представители банков, которые не прислали котировок, пояснили о том, что причиной послужило отсутствие рынка в упомянутые дни.

В. Заблоцкий предложил участникам заседания высказаться, что, по их мнению, корректно предпринять, если в дальнейшем возникнет ситуация невозможности расчета индикаторов в соответствии с утвержденной методикой. Также было предложено до 2 марта 2022 года 17:00 провести заочное голосование членов ЭС СРО НФА согласно опроснику предоставленного СРО НФА.

С. Моисеев предложил в качестве резервной ставки использовать ключевую ставку Банка России с учетом на поправочный спрэд по срокам индикаторов. Также предложил рассмотреть возможность замены расчетного агента в случае невозможности осуществления расчетных функций компанией Refinitiv.

Коллеги высказали свои мнения по сложившейся ситуации и поддержали решение о проведении голосования отдельно по всем индикаторам.

Решили: провести голосование отдельно по всем индикаторам и прислать свои мнения в СРО НФА до 17:00 2 марта 2022 года.

Вопросы для голосования:

1. В случае невозможности расчета индикатора, согласны ли вы брать в резервный расчет ключевую ставку Банка России?
2. В случае использования ключевой ставки Банка России как резервной, какую величину поправочного спрэда к ключевой ставке вы считаете справедливой?
3. В случае использования предыдущего значения индикатора с поправкой на ключевую ставку, какую величину поправочного спрэда вы считаете справедливой?
4. Кого, по вашему мнению, нужно добавить в список контрибьюторов?
5. При продолжении расчета и публикации индикаторов в соответствии с утвержденной методикой предлагается увеличить спрэд по разным срокам индикатора. Предложите свои варианты изменения спрэдов на срок.

Президент СРО НФА Член ЭС СРО НФА

В.В. Заблоцкий

Ответственный секретарь ЭС СРО НФА

К.С. Григорьев-Белоцерковский