

Протокол N 20
заседания Экспертного Совета СРО НФА
по индикаторам и ставкам

г. Москва

12 апреля 2018 г.

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

Место проведения заседания: Москва, Большой Сергиевский переулок, дом 10.

Члены Экспертного Совета СРО НФА по индикаторам и ставкам (далее – ЭС СРО НФА), принявшие участие в заседании:

1. Щепилов С.П. (Райффайзенбанк) – Председатель.
2. Вергунов К.В. (Банк России).
3. Дабижа А.Ю. (ЕБРР).
4. Заблоцкий В.В. (СРО НФА).
5. Орлов А.А. (Банк России).
6. Паров Д.А. (Сбербанк).
7. Редман С.А. (Банк Санкт-Петербург).
8. Романчук С.А. (Металлинвестбанк).
9. Сенина А.Ю. (Томсон Рейтерс).
10. Смирнов С.В. (Банк «ФК Открытие»).
11. Чепкунов Д.В.

Приглашенные:

1. Староверов С.В. (Внешэкономбанк).
2. Титов С. (МБ).
3. Закройщиков В. (МБ).
4. Глазков А. (МБ).

Общее число членов ЭС СРО НФА составляет 23 человека, число принявших участие в заседании – 11 человек, а также 5 доверенностей, выданных на имя Председателя ЭС СРО НФА Щепилова С.П.

Итого 16 голосов, что составило 2/3 от общего числа членов ЭС СРО НФА. Кворум для проведения заседания имеется.

Повестка дня:

1. Дисциплина выставления котировок по индикаторам (презентация Томсон Рейтерс).
2. Приём новых членов в состав Контрибьюторов индикатора RuREPO.
3. Выработка механизмов сбора информации и контроля заключения проверочных сделок индикатора ROISfix.
4. Обсуждение вопроса расширения состава Контрибьюторов индикатора ROISfix.
5. Согласование пакета документов по индикатору MosPrime Rate с учетом замечаний Банка России по итогам проведенной в 2017 году аккредитации.
6. Обсуждение предложения о снижении порога кворума до 50% при принятии решений ЭС СРО НФА.
7. Вопрос монетизации индикаторов СРО НФА.

8. Разное.
 - 8.1. Новый фьючерсный контракт на индикатор ставки РЕПО (презентация МБ).
 - 8.2. Об изменении состава участников RUONIA.

Принятые решения:

Вопрос 1. Дисциплина выставления котировок по индикаторам.

Решили:

- 1.1. Принять к сведению информацию о текущем состоянии отрасли индикаторов согласно презентации Томсон Рейтерс.
- 1.2. Поручить ИД СРО НФА написать официальное письмо в Промсвязьбанк для определения готовности дальнейшего участия банка в формировании индикатора RuREPO с учетом негативной статистики дисциплины выставления им котировок.
- 1.3. Поручить ИД СРО НФА подготовить к следующему заседанию ЭС СРО НФА анализ актуальности индикатора RuREPO для рынка, в том числе:
 - а) Провести анализ текущего состояния и динамики объемов российского рынка внебиржевого РЕПО по данным НРД.
 - б) Провести опрос участников рынка для определения состава пользователей индикатора RuREPO.
- 1.4. Рекомендовать членам ЭС СРО НФА рассмотреть возможные варианты дальнейшего развития индикаторов рынка РЕПО, в том числе вариант создания смешанного индикатора на основе биржевых сделок РЕПО и индикативных внебиржевых котировок.

Голосование: за – 16, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 2. Приём новых членов в состав Контрибьюторов индикатора RuREPO.

Решили:

- 2.1. Рекомендовать Совету директоров СРО НФА включить Внешэкономбанк и ПАО «МТС-Банк» в состав Контрибьюторов индикатора RuREPO с 13 июня 2018 г.
- 2.2. Поручить ИД СРО НФА вынести вопрос включения новых членов на заседание Совета директоров СРО НФА, а также проинформировать участников рынка в соответствии с установленной процедурой.
- 2.3. Поручить ИД СРО НФА обеспечить наличие контактов сотрудников новых Контрибьюторов (основных и дополнительных) и коммуникацию с Расчетным агентом (Томсон Рейтерс).

Голосование: за – 16, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 3. Выработка механизмов сбора информации и контроля заключения проверочных сделок индикатора ROISfix.

Решили:

- 3.1. Принять к сведению представленную информацию о вариантах сбора статистики проверочных сделок индикатора ROISfix.
- 3.2. Включить в повестку дня следующего заседания ЭС СРО НФА вопрос обсуждения степени готовности инфраструктуры Московской Биржи к переходу на обязательный централизованный клиринг по стандартизированным процентным ПФИ.

Голосование: за – 16, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 4. Обсуждение вопроса расширения состава Контрибьюторов индикатора ROISfix.

Решили:

- 4.1. Принять к сведению представленную информацию о потенциальных Контрибьюторах индикатора ROISfix - Уралсиб и Ренессанс Капитал.

Голосование: за – 16, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 5. Согласование пакета документов по индикатору MosPrime Rate с учетом замечаний Банка России по итогам проведенной в 2017 году аккредитации.

Решили:

- 5.1. Согласовать представленный пакет документов по индикатору MosPrime Rate и направить его в Банк России.
- 5.2. Поручить ИД СРО НФА доработать п.6.2. «Соглашения о формировании Финансового индикатора предоставления рублевых кредитов (депозитов) на межбанковском рынке MosPrime Rate» в части порядка раскрытия информации по чрезвычайным ситуациям.
- 5.3. Поручить ИД СРО НФА доработать «Методику формирования и расчета Финансового индикатора предоставления рублевых кредитов (депозитов) на межбанковском рынке MosPrime Rate» и «Принципы обеспечения непрерывности расчета Финансового индикатора MosPrime Rate» в части механизмов обеспечения непрерывности расчета индикатора MosPrime Rate по аналогии с RUONIA.

Голосование: за – 16, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 6. Обсуждение предложения о снижении порога кворума до 50% при принятии решений ЭС СРО НФА.

Решили:

- 6.1. Поручить ИД СРО НФА провести опрос членов ЭС СРО НФА для определения готовности их дальнейшего участия в работе ЭС СРО НФА с учетом статистики посещаемости заседаний.
- 6.2. Рекомендовать Совету директоров СРО НФА одобрить снижение порога кворума до 50% при принятии решений ЭС СРО НФА.

Голосование: за – 16, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 7. Вопрос монетизации индикаторов СРО НФА.

Решили:

- 7.1. Перенести данный вопрос на следующее заседание ЭС СРО НФА.

Голосование: за – 16, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 8. Разное.

8.1. Новый фьючерсный контракт на индикатор ставки РЕПО (презентация МБ).

- 8.1.1. Принять к сведению представленную в презентации информацию.

- 8.1.2. Поддержать инициативу развития индикаторов денежного рынка, основанных на биржевых сделках РЕПО с ЦК, а также работу по созданию кривой денежного рынка на основе данных индикаторов.

Голосование: за – 16, против – 0, воздержался – 0.

8.2. Об изменении состава участников RUONIA.

- 8.2.1. Сохранить Промсвязьбанк в составе участников RUONIA до прекращения действия временной администрации.
- 8.2.2. Поручить ИД СРО НФА внести предложение на Совет директоров СРО НФА о включении с 01 июня 2018 года Банк «ББР» (АО) (рег.№ 3287) в состав участников RUONIA.
- 8.2.3. В соответствии с пунктом 3.1.11 Соглашения № БР-Д-46-3-1/1346 «О формировании и публикации индикативной взвешенной рублевой депозитной ставки «овернайт» российского межбанковского рынка RUONIA» довести указанную информацию до Банка России.

Голосование: за – 16, против – 0, воздержался – 0.

Председатель заседания

С.П. Щепилов

Секретарь заседания

С.В. Власова