



Протокол N 18 заседания Экспертного Совета СРО НФА по индикаторам и ставкам

г. Москва

28 ноября 2017 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, принявшие участие в Заседании:

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

Приглашенные:

1. Авдеев А.С. (Томсон Рейтерс).
2. Антошкин Д.В. (МБ).
3. Балабушкин А.Н. (МБ).
4. Лутков А.С. (МБ).
5. Федоренко И.Б. (Банк России).

Общее число членов ЭС составляет 22 человека, число принявших участие в Заседании – 11 человек, а также 6 доверенностей, выданных на имя Председателя ЭС Щепилова С.П.

Итого 17 голосов, что составило более 2/3 от общего числа членов ЭС. Кворум для проведения Заседания имеется.

Повестка дня:

1. Дисциплина выставления котировок по индикаторам СРО НФА (докладчик – Томсон Рейтерс).
2. Обсуждение вариантов монетизации финансовых индикаторов.
3. Готовность банков-Контрибьюторов к совершению проверочных сделок по ROISfix 3M OTC clearing CCP (докладчик – СРО НФА).

4. Согласование Регламента проведения сделок ROISfix на внебиржевом рынке.
5. Предложение по использованию кривой OIS в качестве основной кривой рублевого денежного рынка (докладчик А.Н. Балабушкин).
6. Принятие решения об инициации процедуры аккредитации Банком России финансового индикатора ROISfix.
7. Обсуждение письма, поступившего в СРО НФА из Федерального казначейства (в обсуждении вопроса принимает участие О.И. Дроздов).
8. Подготовка к XIII международному РЕПО Форуму (докладчик – СРО НФА).
9. Разное.
 - О подписании договоров о контрибуции с СРО НФА.
 - О расчете финансовых индикаторов в последний рабочий день года 29.12.2017 г.

Принятые решения:

Вопрос 1. Дисциплина выставления котировок по индикаторам СРО НФА.

Решили:

1.1. Принять к сведению информацию о текущем состоянии отрасли индикаторов согласно презентации Томсон Рейтерс.

1.2. Признать качество выставление котировок удовлетворительным.

1.3. Контрибьюторам, в случае использования для связи с Расчетным агентом электронной почты, предоставить дополнительные телефонные номера (возможно мобильные) для связи с трейдерами.

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

Вопрос 2. Обсуждение вариантов монетизации финансовых индикаторов.

Решили:

2.1. Одобрить концепцию монетизации финансовых индикаторов. Вынести данный вопрос на заседание Совета директоров СРО НФА.

2.2. Членам Экспертного Совета в срок до 14.12.2017 г. дать предложения по выбору коммерческих моделей монетизации.

2.3. Обсуждение уровня монетизации перенести на январь 2018 г.

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

Вопрос 3. Готовность банков-Контрибьюторов к совершению проверочных сделок по ROISfix 3M OTC clearing CCP.

Решили:

3.1. Информацию по готовности банков-Контрибьюторов принять к сведению.

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

Вопрос 4. Согласование Регламента проведения сделок ROISfix на внебиржевом рынке.

Решили:

4.1. ИД СРО НФА в течение декабря 2017 г. провести заочное голосование Контрибьюторов по вопросу определения суммы проверочных сделок ROISfix. Предлагается выбрать 500 млн. руб. или 1 млрд. руб.

4.2. Установить в п.1.6., что проверочные сделки проводятся только между Контрибьюторами.

4.3. В п.1.7. Регламента установить время ответа на запрос – 15 минут.

4.4. Поручить А.Дабиже внести изменения в п.1.6., 1.7. и 1.8. Регламента в соответствии с проведенным обсуждением и направить новую редакцию СРО НФА в срок до 15.12.2017г.

4.5. Расширить круг Контрибьюторов ROISfix до 10 банков.

4.6. ИД СРО НФА:

- уточнить список активных участников торгов OIS (RUONIA) на Московской Бирже,
- провести заочное голосование членов Экспертного Совета по кандидатурам в Контрибьюторы ROISfix,
- направить выбранным кандидатам предложение об участии в расчете финансового индикатора ROISfix.

4.7. ИД СРО НФА связаться с представителями Газпромбанка и выяснить их заинтересованность в котировании ROISfix на срок 2 года.

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

Вопрос 5. Предложение по использованию кривой OIS в качестве основной кривой рублевого денежного рынка (докладчик А.Н. Балабушкин).

Решили:

5.1. Принять к сведению информацию по внесенным изменениям в методике

5.2. ИД СРО НФА обратиться к уполномоченным сотрудникам МБ с просьбой дать экспертное суждение о качестве предложенной методики, о возможности ее использования Биржей для расчета индикативной кривой длинных рублевых ставок, дать ответ о возможности расчета силами МБ кривой длинных рублевых ставок на базе предложенной методики с целью дальнейшего опубликования полученной кривой на сайте МБ для информационных целей.

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

Вопрос 6. Принятие решения об инициации процедуры аккредитации Банком России финансового индикатора ROISfix.

Решили:

6.1. Поручить ИД СРО НФА подготовить проекты документов и провести аккредитацию финансового индикатора ROISfix в Банке России.

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

Вопрос 7. Обсуждение письма, поступившего в СРО НФА из Федерального казначейства.

7.1. Вынести обсуждение использования финансового индикатора RUONIA в качестве базовой плавающей процентной ставки на XIII международный РЕПО Форум.

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

Вопрос 8. Подготовка к XIII международному РЕПО Форуму.

8.1. Принять к сведению.

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

Вопрос 9. Разное.

- О подписании договоров о контрибуции с СРО НФА.

9.1. Принять к сведению.

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

- О расчете финансовых индикаторов в последний рабочий день года 29.12.2017 г.

9.2. Принять следующий порядок расчета:

9.2.1. Установить последний день расчета RUONIA в 2017 году 28.12.2017 г. Опубликовать значение RUONIA за 28.12.2017 г. в соответствии с регламентом (29.12.2017г.). За 29.12.2017 г. RUONIA не рассчитывается.

Первый день расчета RUONIA в новом году установить 9.01.2018г. Опубликовать значение RUONIA за 09.01.2018г. в соответствии с регламентом (10.01.2018г.).

9.2.2. Производить расчет значений индексов MosPrime Rate и RUREPO 29.12.2017 г. в сроках, отличных от overnight.

9.2.3. Производить расчет значений индексов ROISFIX и NFEA FX Swap 29.12.2017 г. на все сроки.

9.2.4. В праздничные дни с 30.12.2017 г. по 8.01.2018 г. (включительно) расчет индикаторов RUONIA, MosPrime Rate, RUREPO, ROISFIX и NFEA FX Swap не производить.

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

Председатель заседания:

С.П. Щепилов

Секретарь заседания:

С.В. Власова