



Протокол N 14 заседания Экспертного Совета СРО НФА по индикаторам и ставкам.

г. Москва

25 сентября 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. Борзунова Э.Г. (Банк России).
4. Буров П.Ю. (Газпромбанк).
5. Дабижа А.Ю. (ЕБРР).
6. Заблоцкий В.В. (СРО НФА).
7. Карпушкин Н.Г. (Альфа-Банк).
8. Марич И.Л. (МБ).
9. Орлов А.А. (Банк России).
10. Паров Д.А. (Сбербанк).
11. Перельдик П.В. (Сбербанк КИБ).
12. Пестов К.М. (Московская Биржа).
13. Романчук С.А. (Металлинвестбанк).
14. Смирнов С.В. (Банк «ФК Открытие»).
15. Хавин А.С. (НКЦ).
16. Чепкунов А.В.

Приглашенные:

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

Общее число членов ЭС составляет 22 человека, число принявших участие в Заседании – 16 человек, а также 1 доверенность, выданная 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 CPO НФА (докладчик - Reuters).
2. Готовность банков-контрибьюторов к совершению проверочных сделок по ROISFIX 3M OTC clearing CCP (докладчик – CPO НФА).
3. Предложение по использованию кривой OIS в качестве основной кривой рублевого денежного рынка (докладчики – РБА, МБ, ГПБ).
4. Ранний расчет финансового индикатора Ruonia (докладчик – CPO НФА):
 - заключение договора с Банком России - Расчетным агентом,
 - изменение Методики расчета с 29.09.2017 г.,
 - готовность Банка России к изменению времени расчета.
5. Подготовка к Форуму ПФИ-2017 (докладчик – CPO НФА).
6. Разное.
 - Изменения в Методику MosPrime Rate.
 - Изменение объема проверочных сделок по MosPrime Rate до 300 млн. руб.
 - Внешэкономбанк – Контрибьютор MosPrime Rate.
 - О подписании Соглашений по MosPrime Rate.

Принятые решения:

Вопрос 1. Дисциплина выставления котировок по индикаторам CPO НФА.

Решили:

- 1.1. Принять к сведению информацию о текущем состоянии отрасли индикаторов согласно презентации Tomson Reuters.
- 1.2. Признать качество выставление котировок удовлетворительным.
- 1.3. ИД CPO НФА связаться с представителями Промсвязьбанка для обсуждения исполнения регламента выставления котировок по RuREPO.

Голосование: за – 17, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 2. Готовность банков-контрибьюторов к совершению проверочных сделок по ROISFIX 3M OTC clearing CCP (докладчик – CPO НФА).

Решили:

- 2.1. В связи с неготовностью Россельхозбанка проводить проверочные сделки на бирже, ИД CPO НФА довести до сведения руководства банка о планах Банка России вывести внебиржевые сделки с ПФИ на централизованный клиринг.

2.2. Банку «ФК Открытие» (С. Смирнов) дать 2 недели на уточнение позиции по проведению сделок с ПФИ на биржевом рынке. После получения ответа ИД СРО НФА обсудить вопрос с Председателем ЭС о необходимости отправки письма руководству временной администрации о подтверждении мандата на проведение банком – Контрибьютором финансового индикатора ROISfix проверочных сделок с ПФИ на Московской Бирже, а также необходимости проведения ротации.

2.3. ИД СРО НФА в срок до 15.10.2017 г. собрать замечания по Регламенту проведения проверочных сделок и разослать финальную версию членам Экспертного Совета.

2.4. Определить дату начала проведения проверочных сделок по ROISfix – 1 января 2018 г.

Голосование: за – 17, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 3. Предложение по использованию кривой OIS в качестве основной кривой рублевого денежного рынка.

Решили:

3.1. Запрос рынка на кривую OIS есть. Предложение по использованию кривой OIS принять к сведению.

3.2. Поручить членам ЭС, а также членам ЭС ценового центра СРО НФА проанализировать Методику (с учетом дополнительных расчетов со стороны МБ) в срок до 01.11.2017 г. ИД СРО НФА включить этот вопрос в повестку дня следующего заседания ЭС для обсуждения.

Голосование: за – 17, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 4. Ранний расчет финансового индикатора Ruonia (докладчик – СРО НФА):

- заключение договора с Банком России - Расчетным агентом,
- изменение Методики расчета с 29.09.2017 г.,
- готовность Банка России к изменению времени расчета.

Решили:

4.1. ИД СРО НФА обсудить с Банком России – Расчетным агентом возможность расчета и публикации финансового индикатора RUONIA к 15.00, а также вопрос

подписания соглашения между Расчетным агентом и Администратором финансового индикатора RUONIA. В случае неготовности Расчетного агента на изменение времени расчета и публикации, перенести этот вопрос на более поздний срок.

Голосование: за – 17, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 5. Подготовка к Форуму ПФИ-2017 (докладчик – СРО НФА).

Решили:

5.1. Принять к сведению.

Голосование: за – 17, против – 0, воздержался – 0.

Вопрос 6. Разное.

Решили:

6.1. ИД СРО НФА согласовать изменения в Методику расчета MosPrime Rate с Банком России.

6.2. Газпромбанку, Райффайзенбанку и Сбербанку в срок до 16.10.2017 г. подписать Соглашение и Дополнительное соглашение с Администратором финансового индикатора MosPrime Rate СРО НФА.

Голосование: за – 17, против – 0, воздержался – 0.

Председатель заседания:

С.П. Щепилов

Секретарь заседания:

С.В. Власова