

УТВЕРЖДЕНО**Приказом от «23» апреля 2021 г. № 61****Президент СРО НФА**_____ **В.В. Заблоцкий****СОГЛАСОВАНО****Экспертный Совет****по индикаторам и ставкам****Председатель Совета**_____ **О.Ю. Горлинский****Протокол от «23» апреля 2021 г. № 41****МЕТОДИКА****формирования и расчета финансового индикатора ROISfix****Москва, 2021 г.**

1. Основные понятия

1.1. Термины и определения, используемые далее по тексту:

«**ROISfix**» - финансовый индикатор, формируемый на основе котировок по сделкам процентный своп на ставку RUONIA.

«**Администратор**» - Саморегулируемая организация «Национальная финансовая ассоциация» (далее - СРО НФА), осуществляющая деятельность по формированию индикатора ROISfix в соответствии с Методикой. СРО НФА является владельцем товарного знака индикатора ROISfix и обладает установленными законодательством правами в отношении данного индикатора.

«**Контрибьютор**» - юридическое лицо, предоставляющее котировки для расчета индикатора ROISfix.

«**Расчетный агент**» - юридическое лицо, выполняющее на основании соглашения с Администратором функции расчета индикатора ROISfix в соответствии с Методикой.

«**Экспертный Совет СРО НФА по индикаторам и ставкам**» - функционирующий при Администраторе независимый коллегиальный орган, состоящий из представителей профессионального сообщества и осуществляющий контроль за формированием индикатора ROISfix (далее - ЭС СРО НФА).

1.2. Внутренние документы, регламентирующие организацию работы Администратора по формированию индикатора ROISfix, ссылки на которые используются далее по тексту:

«**Методика**» - Методика формирования и расчета Финансового индикатора ROISfix.

«**Порядок раскрытия информации**» - Порядок раскрытия информации о Финансовом индикаторе ROISfix.

«**Принципы непрерывности**» - Принципы обеспечения непрерывности расчета Финансового индикатора ROISfix.

«**Регламент внутреннего контроля**» - Регламент организации внутреннего контроля Администратора при формировании Финансового индикатора ROISfix.

«**Порядок выбора Контрибьюторов**» - Порядок выбора Контрибьюторов и Расчетного агента ROISfix, взаимодействия Администратора с третьими лицами, а также осуществления Администратором контроля за указанными лицами.

«**Регламент проверочных сделок**» - Регламент проведения проверочных сделок ROISfix на внебиржевом рынке.

2. Расчет и публикация индикатора ROISfix

2.1. Администратор осуществляет формирование индикатора ROISfix на основе котировок по сделкам процентный своп на ставку RUONIA, объявляемых Контрибьюторами.

- 2.2. Состав Контрибьюторов определяется ЭС СРО НФА и утверждается Советом директоров СРО НФА.
- 2.3. В состав Контрибьюторов должно входить не менее 6 (Шести) организаций.
- 2.4. Критерии отбора организаций для участия в формировании индикатора ROISfix, а также порядок включения в состав Контрибьюторов определены Порядком выбора Контрибьюторов.
- 2.5. Состав Контрибьюторов пересматривается ЭС СРО НФА не реже 1 (Одного) раза в год, при этом каких-либо ограничений на повторное включение организации в указанный список не устанавливается.
- 2.6. Основания и порядок исключения организации из состава Контрибьюторов определены Порядком выбора Контрибьюторов.
- 2.7. В случае прекращения участия Контрибьютора в формировании индикатора ROISfix ЭС СРО НФА рассматривает вопрос о замене Контрибьютора.
- 2.8. В случае замены Контрибьютора, котировки, объявляемые новым Контрибьютором, начинают учитываться в расчете индикатора ROISfix не ранее дня, следующего за последним днем учета котировок, поданных замененным Контрибьютором.
- 2.9. Порядок и сроки информирования участников рынка об изменении состава Контрибьюторов определены Порядком раскрытия информации.
- 2.10. Контрибьюторы принимают на себя обязательства по заключению проверочных сделок по объявляемым котировкам в соответствии с Регламентом проверочных сделок.
- 2.11. Объявляемые котировки должны отражать уровень цен, по которым Контрибьюторы в момент объявления котировок будут готовы заключить проверочные сделки.
- 2.12. Контрибьютор не участвует в объявлении котировок при отсутствии у него возможности для заключения проверочных сделок и информирует об этом Администратора и Расчетного агента.
- 2.13. Контрибьюторы объявляют свои котировки без каких-либо ссылок на котировки других Контрибьюторов.
- 2.14. Индикатор ROISfix рассчитывается на основе котировок, объявляемых Контрибьюторами на следующие сроки: 1, 2 недели, 1, 2, 3, 6 месяцев и 1 год.
- 2.15. Каждый Контрибьютор объявляет двухстороннюю котировку (на покупку и на продажу), при этом величина разницы между котировкой на продажу и котировкой на покупку для каждого из сроков не должна превышать 20 базисных пунктов.
- 2.16. В целях расчета индикатора ROISfix используется усредненная котировка между котировкой на покупку и котировкой на продажу.

- 2.17. При расчете индикатора ROISfix учитываются котировки, прошедшие контроль качества котировок в соответствии с требованиями и порядком, установленными Регламентом внутреннего контроля.
- 2.18. Расчет индикатора ROISfix осуществляется каждый рабочий день в 12.30 по московскому времени. При этом под рабочим днем здесь и далее понимается каждый рабочий день, установленный в соответствии с законодательством Российской Федерации.
- 2.19. Контрибьюторы каждый рабочий день присылают свои котировки Расчетному агенту по установленным каналам связи в 12.15 по московскому времени.
- 2.20. Если на момент расчета индикатора ROISfix от Контрибьюторов получено 9 (Девять) или более двухсторонних котировок, из числа усредненных котировок отсекаются 2 (Две) самые низкие и 2 (Две) самые высокие котировки, а из оставшихся усредненных котировок рассчитывается среднее арифметическое значение, которое присваивается значению индикатора ROISfix.
- 2.21. Если на момент расчета индикатора ROISfix от Контрибьюторов получено от 6 (Шести) до 8 (Восьми) двухсторонних котировок, из числа усредненных котировок отсекаются 1 (Одна) самая высокая и 1 (Одна) самая низкая котировки, а из оставшихся усредненных котировок рассчитывается среднее арифметическое значение, которое присваивается значению индикатора ROISfix.
- 2.22. Если на момент расчета индикатора ROISfix от Контрибьюторов получено 5 (Пять) или 4 (Четыре) двухсторонние котировки, из числа усредненных котировок рассчитывается среднее арифметическое значение, которое присваивается значению индикатора ROISfix.
- 2.23. Если на момент расчета индикатора ROISfix от Контрибьюторов получено 3 (Три) или менее двухсторонние котировки порядок действий Администратора определяется Принципами непрерывности.
- 2.24. Администратор публикует значение индикатора ROISfix и индивидуальные котировки Контрибьюторов каждый рабочий день в соответствии с Порядком раскрытия информации.

3. Порядок утверждения и изменения Методики

- 3.1. Настоящая Методика утверждается в порядке, установленном Уставом СРО НФА и иными внутренними документами СРО НФА.
- 3.2. Текст Методики, а также изменения и дополнения к нему подлежат предварительному согласованию с ЭС СРО НФА.
- 3.3. Порядок и сроки информирования участников рынка об изменениях Методики определены Порядком раскрытия информации.