

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****РЕГЛАМЕНТ****проведения проверочных сделок ROISfix
на внебиржевом рынке****Москва, 2021 г.**

Общие положения

- 1.1. Настоящий Регламент проведения проверочных сделок ROISfix на внебиржевом рынке (далее – «Регламент») определяет порядок и условия проведения проверочных сделок процентный своп на ставку RUONIA на внебиржевом рынке.
- 1.2. Все термины и определения в Регламенте используются в значении, определенном в Методике формирования и расчета финансового индикатора ROISfix.

Способы заключения проверочных сделок

- 1.3. Контрибьюторы заключают проверочные сделки одним из следующих способов:
 - Сделки на внебиржевом рынке с центральным контрагентом в соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) («проверочные сделки с ЦК»);
 - Сделки на внебиржевом рынке без участия центрального контрагента («проверочные сделки без ЦК»).
- 1.4. Контрибьюторы обеспечивают готовность инфраструктуры и наличие лимита на центрального контрагента для заключения проверочных сделок с ЦК.
- 1.5. Контрибьюторам *рекомендуется* обеспечить готовность инфраструктуры, наличие заключенных генеральных соглашений и двухсторонних лимитов на других Контрибьюторов для заключения проверочных сделок без ЦК в дополнение к возможности заключения проверочных сделок с ЦК.
- 1.6. Контрибьюторы вправе по взаимной договоренности заключать проверочные сделки без ЦК если это не противоречит требованиям Указания Банка России от 16.12.2019 № 5352-У «О случаях, когда договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, заключаются только при условии, что другой стороной по таким договорам является лицо, осуществляющее функции центрального контрагента» (*об обязательном клиринге*).
- 1.7. Контрибьюторы самостоятельно определяют применимость требований Указания Банка России от 16.12.2019 № 5352-У (*об обязательном клиринге*) при выборе способа заключения проверочной сделки и несут ответственность за соблюдение указанных требований.

Условия проверочных сделок

- 1.8. Общие условия проверочных сделок определяются спецификацией внебиржевых договоров процентный своп на ставку RUONIA, утвержденной НКО НКЦ (АО).
- 1.9. Цена проверочной сделки определяется объявленной котировкой Контрибьютора, получившего запрос на заключение проверочной сделки, и не зависит от способа заключения проверочной сделки (с ЦК или без ЦК).

1.10. Сумма одной проверочной сделки составляет 500 миллионов российских рублей.

Порядок заключения проверочных сделок

1.11. Каждый Контрибьютор имеет право направить запрос на заключение проверочных сделок другому Контрибьютору, который в свою очередь обязуется заключить проверочные сделки по объявленным им котировкам при условии получения запроса в течение 15 минут с момента опубликования ROISfix.

1.12. Контрибьютор заключает проверочные сделки с другими Контрибьюторами в порядке очередности поступления запросов от них.

1.13. Контрибьютор освобождается от обязательств по заключению проверочных сделок за текущую дату при выполнении одного из следующих условий:

- Отсутствует возможность заключения проверочных сделок с ЦК и без ЦК;
- Отсутствует возможность заключения проверочных сделок с ЦК, при этом заключение проверочных сделок без ЦК приведет к нарушению требований Указания Банка России от 16.12.2019 № 5352-У (об обязательном клиринге);
- Общее кол-во заключенных Контрибьютором проверочных сделок за текущую дату достигло 3 (трёх);
- Запрос на заключение проверочной сделки получен после истечения 15-минутного периода времени после опубликования ROISfix;
- Наступление исключительных случаев, на период действия таких случаев;
- Если заключение Контрибьютором проверочной сделки может повлечь нарушение требований законодательства Российской Федерации.

1.14. Для целей настоящего Регламента, исключительными случаями являются обстоятельства непреодолимой силы, то есть чрезвычайные и непредотвратимые при данных условиях обстоятельства, находящиеся вне разумного контроля, включая, но не ограничиваясь, пожар, наводнение, землетрясение, эпидемия, забастовка, военные действия, а также иные действия, определенные в действующем законодательстве Российской Федерации.

Порядок информирования сторон

1.15. Контрибьютор несет ответственность за своевременное предоставление Администратору контактных данных сотрудников, ответственных за заключение проверочных сделок.

1.16. Контрибьютор предпринимает необходимые меры для своевременного информирования ответственных сотрудников о наличии обязательств по заключению проверочных сделок по объявленным котировкам, в том числе при разделении функций объявления котировок и заключения проверочных сделок внутри организационной структуры между разными сотрудниками.

- 1.17. Контрибьютор в течение дня информирует Администратора о возникновении одного из следующих событий (инцидентов):
- Предоставление отказа на полученный от другого Контрибьютора запрос на заключение проверочной сделки (*с указанием причины отказа*);
 - Получение отказа на направленный другому Контрибьютору запрос на заключение проверочной сделки;
 - Отсутствие возможности связаться с ответственным сотрудником другого Контрибьютора для своевременного направления запроса на заключение проверочной сделки;
 - Отсутствие возможности заключения проверочных сделок.
- 1.18. При отсутствии возможности заключения проверочных сделок Контрибьютор заблаговременно информирует Администратора и Расчетного агента о неучастии в формировании ROISfix за соответствующую дату и производит очистку полей предоставления котировок Расчетному агенту.
- 1.19. Администратор после получения информации об инциденте анализирует причины его возникновения и предпринимает меры по оперативному реагированию, при этом информация об инциденте включается в отчет статистики формирования индикаторов для рассмотрения на очередном заседании ЭС СРО НФА.
- 1.20. Если инцидент в отношении одного из Контрибьюторов продолжается более двух рабочих дней подряд, то Администратор рассматривает возможность вынесения вопроса на внеочередное заседание ЭС СРО НФА.

Прочие положения

- 1.21. Настоящий Регламент утверждается в порядке, установленном Уставом СРО НФА и иными внутренними документами СРО НФА.
- 1.22. Текст Регламента, а также изменения и дополнения к нему подлежат предварительному согласованию с ЭС СРО НФА.