|  |  |
| --- | --- |
|  | **УТВЕРЖДЕНО**  **Приказом от «27» декабря 2019 г. № 132**  **Президент СРО НФА**  **\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ В.В. Заблоцкий** |

|  |  |
| --- | --- |
|  | **СОГЛАСОВАНО**  **Экспертный Совет**  **по индикаторам и ставкам**  **Председатель Совета**  **\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ С.П. Щепилов**  **Протокол от «19» декабря 2019 г. № 30** |

**МЕТОДИКА**

**формирования и расчета финансового индикатора ROISfix**

**Москва, 2019 г.****1. Основные понятия**

* 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. 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**

* 1. Администратор осуществляет формирование индикатора ROISfix на основе котировок по сделкам процентный своп на ставку RUONIA, объявляемых Контрибьюторами.
  2. Состав Контрибьюторов определяется ЭС СРО НФА и утверждается Советом директоров СРО НФА.
  3. В состав Контрибьюторов должно входить не менее 6 (Шести) организаций.
  4. Критерии отбора организаций для участия в формировании индикатора ROISfix, а также порядок включения в состав Контрибьюторов определены Порядком выбора Контрибьюторов.
  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.
  6. Основания и порядок исключения организации из состава Контрибьюторов определены Порядком выбора Контрибьюторов.
  7. В случае прекращения участия Контрибьютора в формировании индикатора ROISfix ЭС СРО НФА рассматривает вопрос о замене Контрибьютора.
  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.
  9. Порядок и сроки информирования участников рынка об изменении состава Контрибьюторов определены Порядком раскрытия информации.
  10. Котировки, объявляемые Контрибьюторами, являются индикативной информацией, и их публикация не накладывает на Контрибьюторов каких-либо обязательств по заключению сделок, за исключением проверочных сделок, заключаемых Контрибьюторами между собой в соответствии с Регламентом проверочных сделок.
  11. Объявляемые котировки должны отражать уровень цен, по которым Контрибьюторы в момент объявления котировок будут готовы заключить сделки.
  12. Контрибьюторы объявляют свои котировки без каких-либо ссылок на котировки других Контрибьюторов.
  13. Индикатор ROISfix рассчитывается на основе котировок, объявляемых Контрибьюторами на следующие сроки: 1, 2 недели, 1, 2, 3, 6 месяцев и 1 год.
  14. Каждый Контрибьютор объявляет двухстороннюю котировку (на покупку и на продажу), при этом в целях расчета индикатора ROISfix используется усредненная котировка между котировкой на покупку и котировкой на продажу.
  15. При расчете индикатора ROISfix учитываются котировки, прошедшие контроль качества котировок в соответствии с требованиями и порядком, установленными Регламентом внутреннего контроля.
  16. 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.
  17. Контрибьюторы каждый рабочий день присылают свои котировки Расчетному агенту по установленным каналам связи в 12.15 по московскому времени.
  18. 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.
  19. 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.
  20. 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.
  21. Если на момент расчета индикатора ROISfix от Контрибьюторов получено 3 (Три) или менее двухсторонние котировки порядок действий Администратора определяется Принципами непрерывности.
  22. Администратор публикует значение индикатора ROISfix и индивидуальные котировки Контрибьюторов каждый рабочий день в соответствии с Порядком раскрытия информации.

**3. Порядок утверждения и изменения Методики**

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