



УТВЕРЖДЕНО

Приказом от «15» апреля 2020 г. № 57

Президент СРО НФА

_____ **В.В. Заблоцкий**

СОГЛАСОВАНО

Экспертный Совет

по индикаторам и ставкам

Председатель Совета

_____ **С.П. Щепилов**

Протокол от «10» апреля 2020 г. № 33

ПРИНЦИПЫ

обеспечения непрерывности расчета Финансового индикатора RUONIA

Москва, 2020 г.

1. Основные понятия

«Администратор» - Саморегулируемая организация «Национальная финансовая ассоциация» (СРО НФА). СРО НФА является владельцем товарного знака Финансового индикатора RUONIA и обладает установленными законодательством правами в отношении данного индикатора.

«Контрибьютор» - банк-участник, предоставляющий информацию для расчета Финансового индикатора RUONIA.

«Расчетный Агент» – Центральный банк Российской Федерации, осуществляющий расчет Финансового индикатора RUONIA по утвержденной Президентом Администратора Методике расчета индикативной взвешенной рублевой депозитной ставки «овернайт» российского межбанковского рынка RUONIA (далее – «Методика»).

«Сайт RUONIA» - официальный сайт в сети Интернет www.ruonia.ru.

«Соглашение» - соглашение о формировании и публикации Финансового индикатора RUONIA между Администратором и Расчетным Агентом (с учетом возможных изменений и дополнений).

«Финансовый индикатор RUONIA», «RUONIA» - индикативная взвешенная ставка однодневных рублевых кредитов (депозитов), которая отражает оценку стоимости необеспеченного рублевого заимствования на условиях «овернайт» стандартным заемщиком из числа российских банков с минимальным кредитным риском.

«ЭС СРО НФА» - Экспертный Совет СРО НФА по индикаторам и ставкам, который является постоянно действующим рабочим органом Администратора.

2. Общие положения

1. Настоящие Принципы обеспечения непрерывности расчета Финансового индикатора RUONIA (далее – «Принципы непрерывности») определяют план действий и порядок взаимодействия между участниками процесса расчета RUONIA для обеспечения расчета в случае нарушения стандартных процедур.

1.1. Кроме случаев, когда термины определены непосредственно в Принципах непрерывности, ниже они употребляются в значении, указанном в Соглашении.

2. Администратор обязан обеспечить непрерывность расчета RUONIA в следующих случаях:

а) При осуществлении обычной деятельности с соблюдением стандартных процедур расчета;

б) При возникновении на стороне Расчетного Агента задержки расчета RUONIA, которая делает невозможной своевременную публикацию до 15:00 по московскому времени;

в) При отсутствии у Расчетного Агента возможности расчета RUONIA, включая случаи возникновения чрезвычайных ситуаций;

3. В случае, описанном в подпункте а) пункта 2, непрерывность расчета обеспечивается соблюдением требований и порядка, описанных в Методике.

4. В случае, описанном в подпункте б) пункта 2 Расчетный Агент действует в соответствии с правилами, определенными в пунктах 2.7-2.9 Соглашения (или в иных аналогичных положениях Соглашения в случае его изменения), и уведомляет Администратора обо всех задержках расчета RUONIA.

4.1. Администратор размещает информацию о задержках расчета RUONIA на Сайте RUONIA в соответствии с уведомлениями Расчетного Агента.

5.1. При отсутствии у Расчетного Агента возможности расчета RUONIA, включая случаи возникновения чрезвычайных ситуаций, Расчетный Агент в соответствии с Соглашением направляет Администратору уведомление по установленным каналам связи.

5.2. При получении уведомления Расчетного Агента об отсутствии возможности расчета RUONIA Администратор в срок до 15:00 по московскому времени либо в максимально возможный короткий срок после 15:00 по московскому времени осуществляет расчет значения RUONIA по альтернативной методике (далее – Резервное значение) и публикует рассчитанное Резервное значение.

5.3. В целях пункта 5.2 Резервное значение RUONIA рассчитывается по формуле:

$$\textit{Fallback RUONIA}(t) = \textit{RUONIA}(t-1) + [\textit{MosPrime ON}(t) - \textit{MosPrime ON}(t-1)],$$

где t – дата ставки RUONIA, $\textit{Fallback RUONIA}(t)$ – Резервное значение RUONIA за день t , $\textit{RUONIA}(t-1)$ – значение RUONIA за предыдущий рабочий день $t-1$, $\textit{MosPrime ON}(t)$ и $\textit{MosPrime ON}(t-1)$ – значения индикатора MosPrime Rate срочностью овернайт за соответствующие дни, опубликованные на сайте www.mosprime.com.

5.4. При отсутствии возможности расчета в соответствии с пунктом 5.3 Резервное значение RUONIA рассчитывается по альтернативной формуле:

$$\textit{Fallback RUONIA}(t) = \textit{RUONIA}(t-1) + [KC(t) - KC(t-1)],$$

где t – дата ставки RUONIA, $\textit{Fallback RUONIA}(t)$ – Резервное значение RUONIA за день t , $\textit{RUONIA}(t-1)$ – значение RUONIA за предыдущий рабочий день $t-1$, $KC(t)$ и $KC(t-1)$ – значения Ключевой ставки Банка России за соответствующие дни.

5.5. Расчет и публикация Резервного значения RUONIA в соответствии с пунктами 5.2-5.4 осуществляются Администратором при краткосрочном (не более двух рабочих дней подряд) отсутствии у Расчетного Агента возможности расчета RUONIA.

5.6. При продолжительном (более двух рабочих дней подряд) отсутствии у Расчетного Агента возможности расчета RUONIA возможность дальнейшего расчета и публикации Резервного значения RUONIA в соответствии с пунктами 5.2-5.4 определяется Администратором по согласованию с ЭС СРО НФА.

5.7. При размещении на Сайте RUONIA Резервного значения RUONIA Администратор указывает в качестве аннотации о применении соответствующего подхода и причинах его применения.

б. В случае резких изменений на рынке действия Администратора определяются решением ЭС СРО НФА в соответствии с пунктом 2.2.15 Положения об Экспертном Совете СРО НФА по индикаторам и ставкам.