



УТВЕРЖДЕНО

Приказом от «26» февраля 2018 г. № 25/1

Президент СРО НФА

_____ **В.В. Заблоцкий**

СОГЛАСОВАНО

Экспертный Совет

по индикаторам и ставкам

Председатель Совета

_____ **С.П. Щепилов**

Протокол от «09» февраля 2018 г. № 19

ПРИНЦИПЫ

обеспечения непрерывности расчета Финансового индикатора RUONIA

Москва, 2018 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» - 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 Финансового индикатора 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 Финансового индикатора RUONIA в следующих случаях:

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

б) при возникновении у Расчетного Агента нештатной ситуации в значении, определенном в Соглашении;

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

3. В случае, описанном в подпункте а) пункта 12, непрерывность расчета обеспечивается соблюдением требований и порядка, описанных в Методике.

4. В случае, описанном в подпункте б) пункта 12 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 Финансового индикатора RUONIA.

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

5. В случае, описанном в подпункте в) пункта 12, Администратор прилагает усилия для организации самостоятельного расчета Финансового индикатора RUONIA в соответствии с Методикой, в том числе связывается с Контрибьюторами по возможным альтернативным средствам связи, в частности, по электронным каналам связи, по рабочему или мобильному телефону, электронной почте или лично, если соответствующее применимо;

5.1. При невозможности получения информации по сделкам либо отсутствии технической возможности организации самостоятельного расчета, Администратор для целей соблюдения принципа непрерывности, руководствуясь принципом добросовестности, на основании решения ЭС СРО НФА выбирает один из следующих вариантов действий:

Публиковать значение Финансового индикатора RUONIA за предыдущую дату расчета и публикации; или

Использовать альтернативные значения Финансового индикатора RUONIA, в соответствии с предложением Администратора; или

Не публиковать значение Финансового индикатора RUONIA.

5.2. При размещении на Сайте RUONIA информации о значении Финансового индикатора RUONIA в случаях, установленных в пунктах 5, 5.1 настоящих Принципов непрерывности, Администратор указывает в качестве аннотации о применении соответствующего подхода, указанного в данных пунктах, и причинах их применения. Публикация значения Финансового индикатора RUONIA осуществляется в сроки, указанные в «Порядке раскрытия информации о Финансовом индикаторе RUONIA» на Сайте RUONIA.

6. В случае резких изменений на рынке действия Администратора определяются решением ЭС СРО НФА в соответствии с пунктом 2.1.15. Положения об Экспертном Совете СРО НФА по индикаторам и ставкам.