|  |  |
| --- | --- |
|  | **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** |

**ПРИНЦИПЫ**

**обеспечения непрерывности 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).

«Сайт ROISfix» - официальный сайт в сети Интернет www.roisfix.ru

* 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.

**2. Общие положения**

1. Настоящие Принципы непрерывности определяют план действий и порядок взаимодействия между участниками процесса расчета индикатора ROISfix для обеспечения расчета в случае нарушения стандартных процедур.
2. Администратор обязан обеспечить непрерывность расчета и публикации индикатора ROISfix в следующих случаях:
   1. При осуществлении обычной деятельности с соблюдением стандартных процедур расчета;
   2. В случае если на момент расчета индикатора ROISfix от Контрибьюторов получено 3 (Три) или менее двухсторонние котировки;
   3. При отсутствии у Расчетного Агента возможности расчета индикатора ROISfix, включая случаи возникновения чрезвычайных ситуаций.
3. В случае, описанном в подпункте а) пункта 2.2, непрерывность расчета обеспечивается соблюдением требований и порядка, описанных в Методике.
4. В случаях, описанных в подпунктах б) и в) пункта 2.2, Администратор публикует информацию о задержках расчета индикатора ROISfix на Сайте ROISfix в сроки, указанные в Порядке раскрытия информации.
5. В случае, описанном в подпункте б) пункта 2.2, Администратор прилагает усилия для получения необходимого для расчета количества котировок от Контрибьюторов, 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;
6. В случае, описанном в подпункте в) пункта 2.2, Администратор прилагает усилия для организации самостоятельного расчета индикатора ROISfix в соответствии с Методикой, в том числе предпринимает действия, описанные в пункте 2.5.
7. При отсутствии достаточного количества котировок либо 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 индикатора ROISfix за предыдущую дату расчета; или
* Использовать альтернативные значения индикатора ROISfix в соответствии с предложением ЭС СРО НФА; или
* Не публиковать значение индикатора ROISfix.

1. При размещении на Сайте ROISfix информации о значении индикатора ROISfix, определенного в соответствии с пунктом 2.7, Администратор указывает в качестве аннотации о применении соответствующего подхода и причинах его применения.
2. В случае резких изменений на рынке действия Администратора определяются решением ЭС СРО НФА.

**3. Порядок утверждения и изменения Принципов непрерывности**

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