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

**РЕГЛАМЕНТ**

**организации внутреннего контроля Администратора при формировании 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.

«Регламент внутреннего контроля» - Регламент организации внутреннего контроля Администратора при формировании Финансового индикатора ROISfix.

«Соглашение» - Соглашение о формировании Финансового индикатора ROISfix

**2. Общие положения**

1. С целью контроля качества котировок, объявляемых Контрибьюторами для расчета индикатора ROISfix, а также вопросов, возникающих в процессе взаимодействия Администратора, Контрибьюторов и Расчетного агента, применяются следующие меры контроля.
2. Проверка даты обновления котировки.

Для индикатора ROISfix проверка даты обновления котировки производится Расчетным агентом в автоматическом режиме с помощью программных средств. Котировка с датой, отличной от текущей, в расчете не участвует.

1. С целью предотвращения принятия некорректных котировок к расчету индикатора ROISfix в связи с техническими ошибками на стороне Контрибьютора проводятся следующие проверки (фильтры) котировок Контрибьюторов.
   1. Проверка соответствия ставок на привлечение и размещение в котировке:

- является ли котировка получаемой ставки свопа (ASK) ниже котировки уплачиваемой ставки свопа (BID), т.е. ASK < BID;

- равна ли котировка получаемой ставки свопа (ASK) котировке уплачиваемой ставки свопа (BID), т.е. ASK = BID.

В случае положительного результата любой из этих проверок Расчетный агент действует в соответствии с пунктом 2.4 настоящего Регламента внутреннего контроля.

* 1. Проверка отклонения котировки Контрибьютора от среднего значения котировок всех Контрибьюторов до фильтрации с целью исключения технических ошибок.

Расчетным агентом производится проверка, на основании которой определяются котировки Контрибьюторов, существенно отклоняющиеся от среднего значения котировок всех Контрибьюторов до их отсечения в соответствии с Методикой. При выявлении таких котировок Расчетный агент действует в соответствии с пунктом 2.4 настоящего Регламента внутреннего контроля. Если половина и более Контрибьюторов объявляет котировки, существенно отклоняющиеся от среднего значения котировок всех Контрибьюторов до их отсечения в соответствии с Методикой, то рынок признается волатильным, и подтверждение котировок с Контрибьюторами не проводится.

1. Контрибьюторы в целях предотвращения конфликта интересов обязаны разработать внутренние документы, указанные в Соглашении.
2. Расчетным агентом применяется следующий подход к работе с котировками, у которых есть риск некорректного выставления по результатам проверок в соответствии с пунктами 2.1 и 2.2 настоящего Регламента, а также в случае отсутствия котировок.
3. Сотрудник Расчетного агента предпринимает действия для того, чтобы связаться с Контрибьютором, выставившим некорректную или сомнительную котировку, по телефону и/или электронной почте для подтверждения представителем;
4. Если связаться с Контрибьютором не удалось, то котировка не принимается к расчету.
5. Внутренний контроль Администратора в части формирования индикатора ROISfix, включая контроль предотвращения конфликта интересов между Контрибьюторами, предоставляющими котировки и одновременно выступающими в качестве представителей ЭС СРО НФА, осуществляется Службой контроля Администратора, деятельность которой регламентирована Положением о Службе контроля Администратора.

**3. Утверждение и изменения настоящего Регламента.**

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