|  |  |
| --- | --- |
|   | **УТВЕРЖДЕНА**Правлением ПАО Московская Биржа«02» октября 2023 г. (Протокол № 64)Председатель Правления ПАО Московская Биржа \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Ю.О. Денисов |

# Методика расчета Ставок доходности валютных свопов Московской Биржи

1. **Общие положения**
	1. Настоящая Методика расчета Ставок доходности валютных свопов Московской Биржи (далее – Методика) определяет порядок расчета Публичным акционерным обществом «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее - Биржа) ставок доходности по сделкам своп с иностранной валютой (далее - валютные свопы), заключаемым на Бирже (далее – Ставки).
	2. Ставки рассчитываются Биржей на основании информации о сделках валютный своп, заключенных на торгах Биржи, а также информации о Центральном курсе доллара США к российскому рублю (далее – Центральный курс), установленному и опубликованному Небанковской кредитной организацией – центральным контрагентом Национальным клиринговым центром (АО) (далее – НКЦ).
	3. Перечень Ставок, а также коды и наименования Ставок, рассчитываемых в соответствии с Методикой, приведены в Приложении 1 к Методике.
	4. Термины и определения, используемые в Методике, применяются в значениях, установленных внутренними документами Биржи и НКЦ.
	5. Настоящая Методика, а также все изменения и дополнения к ней, утверждаются Биржей и вступают в силу в дату, определяемую Биржей.
	6. Текст утвержденной Биржей Методики (изменений и дополнений к ней) раскрывается на сайте Биржи в сети Интернет не позднее, чем за три рабочих дня до даты вступления ее в силу, если иное не предусмотрено решением Биржи.
2. **Порядок расчета Ставок и раскрытия информации о них**
	1. Расчет Ставок производится по следующей формуле

$$S\_{rate, t}=\frac{SWAP\_{t}}{NCCRATE\_{t}}×\frac{1}{\frac{D\_{leap}}{366}+\frac{D\_{norm}}{365}}×100 $$

где:

Srate,t – значение Ставки в день t;

SWAPt – средневзвешенное значение валютного свопа, рассчитанное Биржей на основании сделок заключенных с валютным свопом в день t;

NCCRATEt – значение Центрального курса НКЦ, установленное на день t;

Dnorm – количество календарных дней со дня расчетов по первой части валютного свопа (исключая день расчетов по первой части сделки) по день расчетов по второй части валютного свопа (включая день расчетов по второй части сделки), относящееся к невисокосному году;

Dleap – количество календарных дней со дня расчетов по первой части валютного свопа (исключая день расчетов по первой части сделки) по день расчетов по второй части валютного свопа (включая день расчетов по второй части сделки), относящееся к високосному году.

* 1. Значения Ставок рассчитываются в процентах, с точностью до 5 знаков после запятой.
	2. Значения Ставок рассчитываются каждый день, являющийся торговым для соответствующего валютного свопа, после окончания торгов по сделкам валютный своп. Информация о значениях Ставок за предыдущий торговый день раскрывается на сайте Биржи в сети Интернет каждый торговый день не позднее 10:00 по московскому времени. Биржа вправе установить иные сроки раскрытия информации о значениях Ставок.
	3. Информация о значениях Ставок также дополнительно может распространяться иными способами, в том числе через информационные агентства, распространяющие данные о торгах на Бирже.
	4. В случае отсутствия сделок валютный своп и/или значений Центрального курса НКЦ расчет Ставки для данного валютного свопа в данный торговый день не производится.
	5. В случае возникновения технического сбоя (в том числе при расчете Ставок или в ходе торгов валютными свопами на Бирже), приведшего к искажению данных, использовавшихся для расчета Ставок, допускается перерасчет рассчитанных ранее значений Ставок. Указанный перерасчет осуществляется в возможно короткие сроки с момента обнаружения технического сбоя.

Приложение 1 к Методике расчета Ставок доходности валютных свопов Московской Биржи

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Код Ставки** | **Наименование Ставки на русском языке** | **Наименование Стваки на английском языке** | **Наименование валютного свопа, используемого для расчета** |
| OISFIXUSD | Ставка доходности валютного свопа MOEX\* OISFIXUSD | MOEX\* OISFIXUSD swap yield | USD\_TODTOM - СВОП USD/РУБ / USD000TODTOM |

Словесное обозначение «MOEX» является товарным знаком ПАО Московская Биржа, зарегистрированным, Федеральной службой по интеллектуальной собственности в Государственном реестре товарных знаков и знаков обслуживания Российской Федерации 29 августа 2014 года (свидетельство на товарный знак № 521450).