

УТВЕРЖДЕН

решением Правления АО НТБ
Протокол № 255 от 07 апреля 2022 г.

Директор АО НТБ

_____ Н.А. Захаров

М.П.

Положение о пересчете значений индексов АО НТБ

Москва, 2022 г.

АО НТБ (далее – Администратор) является администратором индексов зерновых культур и других товаров. Администратор ведет свой бизнес добросовестно и предоставляет качественную индексную информацию своим клиентам и заинтересованным сторонам. Администратор признает, что в некоторых ситуациях могут возникать обстоятельства, которые могут потребовать пересмотра значений одного или нескольких индексов. Такие неточности могут быть вызваны рядом событий, включая:

- I. Неправильные входные данные (например, цены, курсы, условия внебиржевых договоров, которые были неверны или были дополнительно обновлены) или неверные вспомогательные данные (например, ошибки в данных индексного календаря); или
- II. Неправильное применение методики расчета индекса (например, ошибка в реализации расчета индекса или в процессе трансляции индекса); или
- III. Неправильные параметры для расчета индекса (например, составляющие индекса, которые не соответствуют критериям, определенным в методике индекса, и поэтому неправильно включены в индекс или удалены из него).

Администратор использует ряд проверок для обнаружения аномалий, которые могут указывать на ошибку или проблему с данными. К таким проверкам относятся проверки существенных изменений цен исходных данных и существенных изменений значений индексов. Также проводятся дополнительные проверки данных на уровне системы передачи информации от источника информации до системы расчета. Все выявленные аномалии проверяются и анализируются сотрудниками Администратора. В случае, если аномалии выявлены до публикации значений индекса, Администратор исправляет ошибку до официальной публикации значений индекса.

Порядок пересчета значений индексов

В случае, если неточность не будет выявлена и устранена до расчета и публикации индекса или если полученные входные данные будут пересмотрены ретроспективно, Администратор рассмотрит влияние выявленной неточности на затронутый индекс.

Если иное решение не будет принято Администратором, то при выявлении неточностей будут применяться процессы, указанные ниже.

1. Неточности, вызванные неправильными входными данными или вспомогательными данными.
 - 1.1. Администратор пересчитывает значения индекса в случае, если:
 - неточность выявлена в течение трех рабочих дней после публикации значений индекса; и
 - величина отклонения индекса из-за выявленной неточности превышает 5%.
 - 1.2. В случае пересчета значений индекса Администратор раскрывает соответствующую информацию на сайте.
 - 1.3. Пересчет значений индекса производится при наличии одновременно двух условий, указанных в пункте 1.1 Положения, если иное решение не будет принято Администратором.
2. Неточности, вызванные неправильным применением методики расчета индекса.
 - 2.1. При выявлении неточностей, вызванных неправильным применением методики расчета индекса, применяется алгоритм, предусмотренный в разделе 1 Положения.

2.2. Администратор применяет меры по устранению ошибок в применении методики расчета индекса (например, путем внесения изменений в методику и/или обновления внутренних систем).

2.3. Любые изменения в методику расчета индекса подлежат обсуждению с участием Экспертного совета по индексам зерновых культур АО НТБ.

3. Неправильные параметры для расчета индекса и вытекающие из этого неточности значений индекса.

3.1. Администратор рассматривает и оценивает все выявленные ошибки в параметрах для расчета индекса. Решение о пересчете значений индекса принимается Администратором с учетом пункта 1.1 Положения.

4. Общий подход Администратора к пересчету значений индексов.

При определении необходимости пересчета значений индекса Администратор принимает во внимание различные факторы, в том числе:

- нарушена ли заявленная цель расчета индекса;
- существенность отклонения между опубликованным и обновленным значениями индекса;
- как давно имела место данная неточность;
- переносится ли неточность изо дня в день;
- в каких целях используется индекс (т. е. связан ли он с контрактами на финансовые инструменты или активами под управлением);
- даты периода пересчета;
- влияние пересчета на среднее значение индекса на заданный период;
- продолжительность периода, подлежащего пересчету;
- как повлияет отсутствие пересчета;
- является ли первопричина аномалией рынка.

Не все из вышеуказанных факторов являются обязательными, при этом некоторые из них могут быть более определяющими, чем другие, в зависимости от того какая неточность имела место.