

УТВЕРЖДЕНА

Дирекцией ЗАО «ФБ ММВБ»
«26» ноября 2015 г. (Протокол №29)

Генеральный директор ЗАО «ФБ ММВБ»

_____ А.В.Кузнецова

Методика расчета индикаторов ставки РЕПО с ЦК

ОГЛАВЛЕНИЕ

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	3
2. ФОРМУЛА РАСЧЕТА ИНДИКАТОРОВ.....	3
3. ИСХОДНЫЕ ДАННЫЕ ДЛЯ РАСЧЕТА. ПЕРИОДИЧНОСТЬ И ТОЧНОСТЬ РАСЧЕТА.....	4
4. РАСКРЫТИЕ ИНФОРМАЦИИ	4

1. Общие положения

- 1.1. Настоящая Методика определяет порядок расчета Закрытым акционерным обществом «Фондовая биржа ММВБ» (далее – ЗАО «ФБ ММВБ», Биржа) индикаторов ставки РЕПО с Центральным контрагентом (далее – Индикаторы), на основе информации о сделках РЕПО с Центральным контрагентом (далее – РЕПО с ЦК), совершаемых в ЗАО «ФБ ММВБ».
- 1.2. Настоящая Методика, а также все изменения и дополнения к ней, утверждаются Биржей и вступают в силу в дату, определяемую Биржей.
- 1.3. Индикаторы, рассчитываемые в соответствии с настоящей Методикой, имеют следующие наименования:
 - 1.3.1. Индикатор ставки РЕПО с ЦК облигации:

Полное наименование на русском языке «Ставка Московской Биржи рынка РЕПО с ЦК облигации»;

Полное наименование на английском языке «MOEX CCP Bond Repo Rate»;

Краткое наименование «MOEXREPO».
 - 1.3.2. Индикатор ставки РЕПО с ЦК акции:

Полное наименование на русском языке «Ставка Московской Биржи рынка РЕПО с ЦК акции»;

Полное наименование на английском языке «MOEX CCP Equity Repo Rate»;

Краткое наименование «MOEXREPO EQ».
 - 1.3.3. В зависимости от времени расчета индикаторов MOEXREPO и MOEXREPO EQ, устанавливаются коды указанных индикаторов, которые приводятся в Приложении 1 к настоящей Методике.
- 1.4. Настоящая Методика, а также изменения и дополнения к ней разрабатываются с учетом рекомендаций Комитета по РЕПО и кредитованию ценными бумагами ЗАО «ФБ ММВБ».
- 1.5. Термины и определения, используемые в настоящей Методике, применяются в значениях, установленных внутренними документами ЗАО «ФБ ММВБ», ПАО Московская биржа, а также законами Российской Федерации, нормативными актами Банка России и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

2. Формула расчета индикаторов

Расчет значений индикаторов производится по следующей формуле:

$$R = \frac{\sum_i r_i \times S_i}{\sum_i S_i}$$

Обозначения:

R – значение индикатора;

r_i	– i-е значение ставки РЕПО с ЦК в сделках, на основании которых производится расчет индикатора;
S_i	– общая сумма РЕПО с ЦК в сделках, заключенных по i-ой ставке РЕПО с ЦК

3. Исходные данные для расчета. Периодичность и точность расчета

- 3.1. В расчете индикаторов МОEXРЕРО учитываются сделки, совершенные с выпусками облигаций, включая еврооблигации (далее – Облигации), допущенными в РЕПО с ЦК.
- 3.2. В расчете индикаторов МОEXРЕРО EQ учитываются сделки, совершенные с акциями, допущенными в РЕПО с ЦК.
- 3.3. При расчете значений индикаторов используются совершенные в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Безадресные заявки» (далее – Безадресный режим) и Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки» (далее – Адресный режим) сделки, ставки РЕПО которых не менее значения ставки привлечения средств по депозитным операциям на денежном рынке, установленной Банком России.
- 3.4. Значения индикаторов выражаются в процентах годовых. Расчет значений индикаторов осуществляется с точностью до двух знаков после запятой.
- 3.5. Расчет значений индикаторов МОEXРЕРО и МОEXРЕРО EQ осуществляется каждый Рабочий день в 12:30 МСК и/или в 19:00 МСК. При расчете индикаторов в 12:30 МСК в указанный расчет включаются сделки, заключенные в период с начала торгов текущего Рабочего дня в Адресном и Безадресном режимах до 12:30 МСК этого же Рабочего дня. При расчете индикаторов в 19:00 МСК, в указанный расчет включаются сделки, заключенные в период с 12:30 МСК (включительно) текущего Рабочего дня в Адресном и Безадресном режимах до 19:00 МСК этого же Рабочего дня. Время расчета индикаторов приводится в Приложении 1 к настоящей Методике. Время расчета индикаторов, указанное в настоящем пункте, может быть изменено по решению Биржи.

4. Раскрытие информации

- 4.1. Раскрытие информации о значениях индикаторов осуществляется ежедневно через официальное представительство Биржи в сети Интернет.
- 4.2. Архивная информация о значениях индикаторов за весь период расчета, а также сведения об общем объеме сделок, на основании которых осуществлен расчет, раскрываются через официальное представительство Биржи в сети Интернет.
- 4.3. Информация, подлежащая в соответствии с настоящей Методикой раскрытию через официальное представительство Биржи в сети Интернет, дополнительно может распространяться иными способами, в том числе через информационные агентства, распространяющие данные о торгах ценными бумагами на Бирже.

Приложение 1

Краткое наименование индикатора	Код индикатора	Тип инструмента	Тип расчета	Валюта расчетов	Время расчета
«МОEXPEPO»	MOEXPEPO	Облигации	1 день (overnight)	Рубли РФ	12:30
	MOEXPEPOE	Облигации	1 день (overnight)	Рубли РФ	19:00
«МОEXPEPO EQ»	MOEXPEPOEQ	Акции	1 день (overnight)	Рубли РФ	12:30
	MOEXPEPOEQE	Акции	1 день (overnight)	Рубли РФ	19:00