



Саморегулируемая  
организация

НАЦИОНАЛЬНАЯ  
ФИНАНСОВАЯ  
АССОЦИАЦИЯ

107045 г. Москва,  
Большой Сергиевский переулок, 10  
+7 (495) 980 98 74; www.nfa.ru; info@nfa.ru

Первому заместителю  
Председателя Банка России

К.В. Юдаевой

Исх. № 2281 от 10 декабря 2019 года

Уважаемая Ксения Валентиновна!

Саморегулируемая организация «Национальная финансовая ассоциация» (далее – СРО НФА) направляет Вам предложения по совершенствованию методики установления Банком России официальных курсов иностранных валют к рублю, содержащейся в Указании Банка России от 14 марта 2019 г. № 5094-У «О порядке установления и опубликования Центральным банком Российской Федерации официальных курсов иностранных валют по отношению к рублю» (далее - Указание).

В результате обсуждения предложений, которое состоялось на встрече в Банке России 01 августа 2019 г., представители Банка России высказали мнение о возможности изменения методологии и подготовке новой версии Указания после получения предложений, отражающих консолидированную позицию участников финансового рынка.

СРО НФА организовала рассмотрение предложений по совершенствованию методики с участниками финансового рынка, членами ACI Russia и, получив положительную оценку, вынесла этот вопрос для обсуждения на Совместный Совет по валютному рынку СРО НФА и ACI Russia (далее - ССВР). ССВР было принято решение направить в Банк России указанные предложения по внесению изменений в Методику установления официальных курсов иностранных валют и, соответственно, в дальнейшем в Указание.

Приложение: Предложение – на 1 стр.

Президент

*С уважением,*

В.В. Заблоцкий

Исп.: Власова С.В.,  
+7 (495) 980-98-74 доб. 123.



**Предложения по совершенствованию методики установления Банком России  
официальных курсов иностранных валют к рублю,  
изложенной в Указании Банка России № 5094-У от 14 марта 2019 года**

1. Устанавливать официальный курс EUR/RUB на основе биржевых торгов на Московской бирже по паре евро-рубль, аналогично методике установления официального курса доллара США к рублю, а не по методу кросс-курсов (указанному в п.4 Указания);
2. Для официальных курсов USD/RUB и EUR/RUB перейти от порядка их установления на основе данных о средневзвешенном (среднем по объему) курсе на торгах за период к порядку их установления на основе данных о значениях курсов, рассчитанных по методике средних по времени - методике валютных фиксингов Московской биржи;
3. Согласиться с позицией Банка России о необходимости установления официальных курсов рубля по состоянию на 11:30 по московскому времени;
4. Использовать для установления официальных курсов USD/RUB и EUR/RUB временной период расчета данных по итогам торгов на Московской бирже с 10:00 до 11:30 по московскому времени в течение полутора часов, усреднение 5400 посекундных значений);
5. При определении официальных курсов рубля к иным валютам (кроме USD/RUB и EUR/RUB) внести уточняющие изменения в п.6 Указания, в частности, при определении курсов других иностранных валют к рублю по методу кросс-курсов (п.6 Указания):

5.1. уточнить фразу «..и котировок данных валют к доллару США, представленных в информационной системе Томсон Рейтер (или Блумберг) на 11 часов 30 минут по московскому времени текущего рабочего дня», детализировав процедуру и источник получения котировок: с указания сторон (bid или offer или midprice), точного источника - таких как информационной страницы или источника данных, кода RIC или информационной страницы, определенного времени с точностью до микро - (милли) секунды.

5.2. использовать получасовые валютные фиксинги на 11:30 по московскому времени для определения курса рубля к тем валютам, по которым они рассчитываются бенчмарк-администраторами валютных фиксингов - компаниями WMR и Bloomberg. Банку России рекомендуется провести переговоры с администраторами бенчмарков с участием представителей ССВР.