

Описание групп ставок информационного сервиса «Значения индикативных ставок»

1. RREFKEYR - ключевая ставка Банка России
2. RUONIA - индикативная взвешенная рублевая депозитная ставка «овернайт» российского межбанковского рынка, рассчитанная Банком России; RUONIA1M, RUONIA3M, RUONIA6M - срочные версии RUONIA на сроки один, три и шесть месяцев
3. ROIS1W, ROIS2W, ROIS1M, ROIS2M, ROIS3M, ROIS6M, ROIS1Y – индикативные ставки по операциям «процентный своп» на ставку RUONIA (ROISfix) на сроки 1 неделя (ROIS1W), 2 недели (ROIS2W), 1 месяц (ROIS1M), 2 месяца (ROIS2M), 3 месяца (ROIS3M), 6 месяцев (ROIS6M), 1 год (ROIS1Y), рассчитанные Национальной финансовой ассоциацией (НФА)
4. Индикативная ставка (RUONmDS) – разница между Индикативной ставкой RUONIA, выраженной в процентах, опубликованной на официальном сайте Банка России в сети Интернет в день, предшествующий дню, за который начисляются проценты, и дисконтом DS
5. Индикативная ставка (RUONmDS2) – разница между Индикативной ставкой RUONIA, выраженной в процентах, опубликованной на официальном сайте Банка России в сети Интернет в день, предшествующий дню, за который начисляются проценты, и дисконтом DS2
6. Индикативная ставка (RREFKmDS) – разница между Индикативной ставкой RREFKEYR, выраженной в процентах, действующей в календарный день, за который начисляются проценты, и опубликованной на официальном сайте Банка России в сети Интернет, и дисконтом DS
7. Индикативные ставки ROI1WDS, ROI2WDS, ROI1MDS, ROI2MDS, ROI3MDS, ROI6MDS, ROI1YDS определяются как разница между Индикативными ставками ROISfix, рассчитанными на соответствующие сроки, опубликованные на официальном сайте НФА в день, предшествующий дню, за который начисляются проценты, и дисконтом DS
8. Индикативные ставки ROI1WDS2, ROI2WDS2, ROI1MDS2, ROI2MDS2, ROI3MDS2, ROI6MDS2, ROI1YDS2 определяются как разница между Индикативными ставками ROISfix, рассчитанными на соответствующие сроки, опубликованные на официальном сайте НФА в день, предшествующий дню, за который начисляются проценты, и дисконтом DS2

Формула расчета дисконта

Дисконт DS выражен в процентах и рассчитывается по следующей формуле с округлением до двух десятичных знаков:

$$DS = RREFKEYR * RBR SOLER / 100, \text{ где}$$

RREFKEYR - значение ключевой ставки Банка России, выраженное в процентах;

RBSOLER - значение норматива обязательных резервов по иным обязательствам кредитных организаций для банков с универсальной лицензией (за исключением долгосрочных) в валюте Российской Федерации, выраженное в процентах.

Дисконт **DS2** выражен в процентах и рассчитывается по следующей формуле:

$$DS2 = DS + FDS, \text{ где}$$

DS – дисконт, выраженный в процентах и рассчитанный по указанной выше формуле с округлением до двух десятичных знаков;

FDS – фиксированный дисконт, выраженный в процентах, указанный в Решении о проведении отбора Заявок, публикуемом на сайте Государственного кредитора, и округленный до двух десятичных знаков.