

Методология процесса установления официальных курсов иностранных валют по отношению к рублю в соответствии с Указанием Банка России от 3 октября 2022 г. N 6290-У «О порядке установления и опубликования Центральным банком Российской Федерации официальных курсов иностранных валют по отношению к рублю».

1. Официальный курс иностранной валюты по отношению к рублю рассчитывается:

1.1. Для валют доллар США, евро и китайский юань по результатам сделок, совершенных на валютных рынках.

1.1.1 На основе данных о средневзвешенном курсе иностранной валюты по отношению к рублю, рассчитанном по сделкам, заключенным на организованных торгах ПАО Московская Биржа по иностранной валюте за рубли со сроком расчетов на следующий рабочий день после даты заключения сделки (далее - срок расчетов "завтра") в период с 10 часов 00 минут по 15 часов 30 минут по московскому времени в соответствии со следующей формулой:

$$r_{CUR/RUB} = \frac{1}{Q_{CUR}} \sum_{10:00 \leq t < 15:30} q_{CUR}^t \cdot CURRUBTOM_t,$$

где  $CURRUBTOM_t$  — цена сделки по инструменту в валюте CUR на момент времени  $t$  по валютной паре CUR/RUB со сроком расчетов на следующий рабочий день;

$q_{CUR}^t$  — объем в иностранной валюте сделки по валютной паре CUR/RUB на момент времени  $t$ ;

$Q_{CUR}$  — объем торгов в иностранной валюте валютной пары CUR/RUB в промежуток с 10:00 по 15:30;

1.1.2. В случае отсутствия данных от ПАО Московская Биржа официальный курс иностранной валюты по отношению к рублю рассчитывается Банком России на основе данных о сделках, заключенных в течение текущего дня до 15 часов 30 минут по московскому времени на валютных рынках по иностранной валюте за рубли со сроком расчетов "завтра", представленных в Банк России в составе отчетности кредитных организаций, по следующему алгоритму:

1.1.2.1. При наличии в составе представленной в Банк России отчетности данных по сделкам, заключенным тремя и более кредитными организациями, курс каждой сделки ( $r_{CUR/RUB}^i$ ) рассчитывается как отношение суммы требования или обязательства в рублях к сумме требования или обязательства в иностранной валюте:

$$r_{CUR/RUB}^i = \frac{Q_{CUR}^i}{V_{CUR}^i}, \quad i = 1, \dots, n,$$

где  $i$  – порядковый номер сделки;

$n$  – количество заключенных сделок по иностранной валюте  $CUR$ ;

$CUR$  – иностранная валюта, для которой устанавливается официальный курс;

$Q_{CUR}^i$  – сумма требования или обязательства по  $i$ -й сделке с иностранной валютой  $CUR$  в рублях;

$V_{CUR}^i$  – сумма требования или обязательства по  $i$ -й сделке с иностранной валютой  $CUR$  в иностранной валюте  $CUR$ ;

Для расчета отбираются сделки с иностранной валютой  $CUR$ , которые находятся в промежутке:

$$[q_{0,25} - 1,5 \cdot (q_{0,75} - q_{0,25}), \quad q_{0,75} + 1,5 \cdot (q_{0,75} - q_{0,25})],$$

где  $q_\alpha$  –  $\alpha$ -квантиль выборки курсов иностранной валюты  $CUR$  по отношению к рублю по указанным сделкам.

Официальный курс иностранной валюты по отношению к рублю ( $r_{CUR/RUB}$ ) рассчитывается как среднее арифметическое взвешенное по объему:

$$r_{CUR/RUB} = \frac{\sum_{i=1}^k r_{CUR/RUB}^i \cdot V_{CUR}^i}{\sum_{i=1}^k V_{CUR}^i},$$

где  $i$  – порядковый номер сделки;

$k$  – количество сделок, соответствующих условию пункта 1.1.2 настоящего методологического комментария и находящихся в интервале, заданном в настоящем пункте;

$CUR$  – иностранная валюта, для которой устанавливается официальный курс;

$r_{CUR/RUB}^i$  – курс иностранной валюты  $CUR$  по отношению к рублю для  $i$ -ой сделки;

$V_{CUR}^i$  – объем по  $i$ -й сделке с иностранной валютой  $CUR$  в иностранной валюте  $CUR$ .

1.1.2.2. При наличии в составе представленной в Банк России отчетности данных по сделкам, заключенным менее чем тремя кредитными организациями, и при условии, что предыдущее значение официального курса иностранной валюты было рассчитано в соответствии с пунктом 1.1.2.1. настоящего методологического комментария, расчет производится следующим образом:

$$r_{CUR/RUB} = \frac{r_{CUR/RUB}(t-1) \cdot V_{CUR}(t-1) + r_{CUR/RUB}(t) \cdot V_{CUR}(t)}{V_{CUR}(t-1) + V_{CUR}(t)},$$

где  $r_{CUR/RUB}$  – значение официального курса иностранной валюты;

$CUR$  – иностранная валюта, для которой устанавливается официальный курс;

$t$  – дата, в которую рассчитывается официальный курс иностранной валюты  $CUR$ ;

$t-1$  – дата предыдущего расчета официального курса иностранной валюты  $CUR$ ;

$r_{CUR/RUB}(t)$  – величина курса иностранной валюты  $CUR$  по отношению к рублю в дату расчета ( $t$ ), рассчитанная в соответствии с пунктом 1.1.2.1 без отбора сделок в соответствии с пунктом 1.1.2.1 настоящего методологического комментария;

$r_{CUR/RUB}(t - 1)$  – величина официального курса иностранной валюты  $CUR$  по отношению к рублю в дату расчета ( $t - 1$ ), рассчитанная в соответствии с пунктом 1.1.2.1;

$V_{CUR}(t)$  – объемы сделок с иностранной валютой  $CUR$  в рублях в дату  $t$ ;

$V_{CUR}(t - 1)$  – объемы сделок с иностранной валютой  $CUR$  в рублях в дату  $t - 1$ .

1.1.3. В случае отсутствия данных от ПАО Московская Биржа и в составе отчетности кредитных организаций или при наличии в составе представленной в Банк России отчетности данных по сделкам, заключенным менее чем тремя кредитными организациями в случае, если предыдущее значение официального курса иностранной валюты было рассчитано путем использования порядка, предусмотренного пунктом 1.1.1 или 1.1.2.2 настоящего методологического комментария, официальный курс иностранной валюты по отношению к рублю ( $r_{CUR/RUB}$ ) рассчитывается Банком России на основе данных о средневзвешенном курсе иностранной валюты по отношению к рублю, рассчитанном по сделкам, заключенным в течение текущего дня до 15 часов 30 минут по московскому времени на валютных рынках по иностранной валюте за рубли со сроком расчетов "завтра", полученных Банком России в рамках доступа к цифровым платформам внебиржевых торгов, в соответствии со следующей формулой:

$$r_{CUR/RUB} = \frac{\sum_{i=1}^n r_{CUR/RUB}^i \cdot t_{CUR}^i}{\sum_{i=1}^n t_{CUR}^i}, \quad i = 1, \dots, n,$$

где  $i$  – порядковый номер котировки;

$n$  – количество котировок по иностранной валюте  $CUR$ ;

$CUR$  – иностранная валюта, для которой устанавливается официальный курс;

$r_{CUR/RUB}^i$  –  $i$ -ая котировка валютой пары  $CUR/RUB$  в рублях;

$t_{CUR}^i$  – время действия котировки  $r_{CUR/RUB}^i$  валютной пары  $CUR/RUB$ , в секундах.

1.2. Курсы валют, отличные от доллара США, евро и китайского юаня рассчитываются на основе соотношения данных об официальном курсе доллара США по отношению к рублю, установленном Банком России в соответствии с пунктом 1.1 настоящего методологического комментария, и данных об официальных курсах доллара США по отношению к другим иностранным валютам, установленных центральными (национальными) банками или соответствующими уполномоченными финансовыми организациями стран-эмитентов данных валют (далее – национальный банк - эмитент валюты) на их официальных сайтах в сети "Интернет" на 15 часов 30 минут по московскому времени текущего рабочего дня, по следующей формуле:

- в случае если национальный банк - эмитент валюты публикует курс доллара США по отношению к национальной валюте:

$$r_{CUR/RUB} = \frac{r_{USD/RUB}}{r_{USD/CUR}} ;$$

- в случае если национальный банк - эмитент валюты публикует отдельно курсы покупки и продажи доллара США по отношению к национальной валюте:

$$r_{CUR/RUB} = \frac{2 \cdot r_{USD/RUB}}{r_{USD/CUR}^{BUY} + r_{USD/CUR}^{SELL}} ;$$

- в случае если национальный банк - эмитент валюты публикует курс национальной валюты по отношению к доллару США:

$$r_{CUR/RUB} = r_{USD/RUB} \cdot r_{CUR/USD} ;$$

- в случае если национальный банк - эмитент валюты публикует отдельно курсы покупки и продажи национальной валюты по отношению к доллару США:

$$r_{CUR/RUB} = r_{USD/RUB} \cdot \left( \frac{r_{CUR/USD}^{BUY} + r_{CUR/USD}^{SELL}}{2} \right),$$

где  $r_{CUR/RUB}$  — официальный курс другой иностранной валюты по отношению к рублю;

$r_{USD/RUB}$  — официальный курс доллара США по отношению к рублю;

$r_{USD/CUR}$  — обратный курс доллара США по отношению к другой иностранной валюте, установленный иностранным национальным банком - эмитентом соответствующей другой иностранной валюты;

$r_{USD/CUR}^{BUY}$  — курс покупки доллара США по отношению к другой иностранной валюте, установленный иностранным национальным банком - эмитентом соответствующей другой иностранной валюты;

$r_{USD/CUR}^{SELL}$  — курс продажи доллара США по отношению к другой иностранной валюте, установленный иностранным национальным банком - эмитентом соответствующей другой иностранной валюты;

$r_{CUR/USD}$  — курс другой иностранной валюты по отношению к доллару США, установленный иностранным национальным банком - эмитентом соответствующей другой национальной валюты;

$r_{CUR/USD}^{BUY}$  — курс покупки другой иностранной валюты по отношению к доллару США, установленный иностранным национальным банком - эмитентом соответствующей другой национальной валюты;

$r_{CUR/USD}^{SELL}$  — курс продажи другой иностранной валюты по отношению к доллару США, установленный иностранным национальным банком - эмитентом соответствующей другой национальной валюты.

2. При невозможности расчета значения курса иностранной валюты по отношению к рублю в соответствии с пунктом 1 настоящего методологического комментария официальный курс иностранной валюты по отношению к рублю устанавливается Банком России равным значению предыдущего дня.

3. Официальный курс специальных прав заимствования по отношению к рублю устанавливается Банком России в соответствии с п.1.2 настоящего методологического комментария на основе данных о курсе специальных прав заимствования по отношению к доллару США, установленном Международным валютным фондом.

4. Числовое значение официального курса иностранной валюты по отношению к рублю округляется до сотых долей копейки.

5. Числовое значение официального курса иностранной валюты по отношению к рублю, за исключением официального курса иностранной валюты по отношению к рублю, предусмотренного абзацем вторым настоящего пункта, выражается в виде шестизначного числа, четыре последние цифры которого являются десятичными знаками (XX,XXXX руб.).

В случае если официальный курс иностранной валюты по отношению к рублю равен или превышает сто рублей за единицу иностранной валюты, числовое значение официального курса иностранной валюты по отношению к рублю может содержать более шести цифр, при этом четыре последние из них должны являться десятичными знаками.

6. Официальные курсы иностранных валют по отношению к рублю устанавливаются приказом Банка России с даты, указанной в нем, до даты, с которой следующим приказом Банка России устанавливаются новые официальные курсы иностранных валют по отношению к рублю.

7. Официальные курсы иностранных валют по отношению к рублю, установленные приказом Банка России, подлежат опубликованию

на официальном сайте Банка России в сети "Интернет" в день установления,  
а также в "Вестнике Банка России" в соответствии со сроком его публикации.