



НАЦИОНАЛЬНЫЙ
КЛИРИНГОВЫЙ
ЦЕНТР
ГРУППА МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Департамент
Клиринга

Изменение порядка взимания комиссионного вознаграждения за учет обеспечения

Действующий до 31.12.2019 (включительно) порядок расчета эффективной ставки для расчета комиссионного вознаграждения за учет обеспечения в иностранной валюте

Комиссионное вознаграждение за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения в иностранной валюте взимается в российских рублях с Участника клиринга, на Счетах обеспечения, Счетах гарантийных фондов, Счетах обеспечения, под стресс которого учитываются денежные средства в иностранной валюте, **по эффективной ставке, рассчитываемой НКЦ.**

Эффективная ставка рассчитывается как отношение общей суммы процентов, уплаченных НКЦ в пользу кредитных организаций, в т.ч. иностранных кредитных организаций, в которых НКЦ открыты клиринговые / корреспондентские счета для учета клирингового / иного обеспечения в соответствующей иностранной валюте, к общей сумме индивидуального клирингового и иного обеспечения в соответствующей иностранной валюте, учитываемого НКЦ в каждый календарный день отчетного месяца.

Эффективная ставка раскрывается на Сайте НКЦ <https://nationalclearingcentre.ru/catalog/02080101> и рассчитывается по формуле:

$S_j = \text{ROUND}(\text{COM}_j / \text{BAL}_j \times y \times 100; 10)$, где

- S_j – эффективная ставка комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения (в процентах годовых) в j-ой валюте валюте, раскрытая на Сайте Клирингового центра. Рассчитывается с точностью до 10-ти (десяти) знаков после запятой путем округления остальных знаков,
- COM_j – j-суммарная комиссия по всем банкам-корреспондентам;
- y – количество календарных дней в году, в который входит расчетный месяц (365 или 366);
- BAL_j - агрегированная сумма входящих остатков в j-ой валюте на всех Счетах обеспечения Участников клиринга, открытых в рамках Расчетных кодов, за календарный месяц;

m

$\text{BAL}_j = \sum_{i=1}^m \text{PK} \sum \text{balancePK}_{ji}$, где

$i=1$

- balancePK_{ji} - сумма входящих остатков по Счету обеспечения Участника клиринга, открытому в рамках Расчетного кода, в j-ой валюте/драг.металле в i-ый календарный день месяца (для нерабочих дней в качестве входящего остатка нужно брать исходящий остаток последнего рабочего дня, который предшествует нерабочему);
- m – количество календарных дней в расчетном месяце,
- PK - множество всех Расчетных кодов.

НОВЫЙ с 01.01.2020 порядок расчета новой ставки для расчета комиссионного вознаграждения за учет обеспечения в иностранной валюте

Валюта	Расчет ставки	Ставка
EUR	Отрицательная ставка, установленная ЕЦБ на последний день месяца оказания услуг в % годовых (-0,5%) + -0,2% годовых	- 0,7
CHF	Отрицательная ставка, установленная Национальным банком Швейцарии на последний день месяца оказания услуг в % годовых (-0,75%) + -0,5% годовых	- 1,25

По новым ставкам расчет комиссионного вознаграждения за учет обеспечения в евро и швейцарских франках первый раз будет произведен **в феврале 2020** за учет обеспечения на Счетах обеспечения, Счетах гарантийных фондов, Счетах обеспечения под стресс **в январе 2020**.

Дата списания комиссионного вознаграждения за учет обеспечения в иностранной валюте – **первый рабочий день месяца, следующего за отчетным**.

В случае изменения размера ставки ЕЦБ или Национальным банком Швейцарии в середине месяца комиссия за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения в иностранной валюте будет рассчитываться в соответствии со ставками, установленными ЕЦБ и/или Национальным банком Швейцарии на последний день отчетного месяца.

