

Комиссионное вознаграждение за учет Обеспечения в иностранной валюте/драгоценных металлах

Расчет суммы комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения

Для всех категорий Участников клиринга

Сумма комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения, подлежащая уплате Участником клиринга, рассчитывается для каждого Расчетного кода в разрезе валюты/драг. металла по формуле:

$$FEE = \text{ROUND} \left(\sum_{i=1}^m cl_bal_i \times S \times z / (y \times 100); 2 \right),$$

где

FEE - сумма комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения по Счету обеспечения / торговому банковскому счету (далее – ТБС) в соответствующей иностранной валюте/ драгоценном металле, учитываемая на соответствующем Расчетном коде, округленная до 2-х знаков после запятой;

cl_bal_i - входящий остаток индивидуального клирингового и иного обеспечения в соответствующей иностранной валюте / соответствующем драгоценном металле по Счету обеспечения / ТБС в соответствующем драгоценном металле в i-й календарный день месяца (значение поля «OPENING_BALANCE» из Отчета о движении денежных средств (ССХ99)), для дня (дней), не являющегося Расчетным днем – исходящий остаток за последний Расчетный день (значение поля «CLOSING_BALANCE» из Отчета о движении денежных средств (ССХ99)),

S – ставка комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения (в процентах годовых) в соответствующей иностранной валюте / соответствующем драгоценном металле: ставка, установленная Тарифами Клирингового центра / эффективная ставка, рассчитанная Клиринговым центром и раскрытая на Сайте Клирингового центра, соответственно,

m – количество календарных дней в отчетном месяце,

y – количество календарных дней в году, в который входит отчетный месяц,

z – курс иностранной валюты к российскому рублю, установленный Банком России на последний рабочий день месяца оказания услуг. z = 1, если плата за хранение слитков соответствующих драгоценных металлов уплачена Клиринговым центром в российских рублях.

Удержание комиссионного вознаграждения с Участников клиринга осуществляется в российских рублях, отдельными суммами за учет обеспечения в каждой из валют, по которой взимается комиссия за учет обеспечения.

Расчет ставки

Для расчета ставки комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения в иностранной валюте применяется следующая методология расчета.

Валюта	Расчет ставки ¹
EUR	ставка Европейского центрального банка на последний день месяца оказания услуг (в % годовых) + (-0,2%) годовых
CHF	ставка Национального Банка Швейцарии на последний день месяца оказания услуг (в % годовых) + (-0,5%) годовых

Эффективная ставка для расчета комиссионного вознаграждения за учет обеспечения в драгоценном металле рассчитывается как отношение общей суммы процентов, уплаченных Клиринговым центром в пользу кредитных организаций, в т.ч. иностранных кредитных организаций, в которых Клиринговым центром открыты обезличенные металлические счета (далее – ОМС)/ ТБС для учета обеспечения в соответствующем драгоценном металле и общей стоимости платы за хранение слитков соответствующих драгоценных металлов, уплаченной Клиринговым центром организациям, осуществляющим хранение слитков соответствующих драгоценных металлов на основании договоров, заключенных с Клиринговым центром, к общей сумме индивидуального клирингового и иного обеспечения в соответствующем драгоценном металле, учитываемого Клиринговым центром в каждый календарный день отчетного месяца.

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

где

S_j - эффективная ставка в процентах годовых по j -ому драг. металлу, округленная до 10 знаков после запятой;

COM_j – j -суммарная комиссия по всем банкам-корреспондентам;

y -количество календарных дней в году (365 или 366).

BAL_j - агрегированная сумма входящих остатков в j -ом драг. металле на всех ОМС/ТБС Участников клиринга, закрепленных за Расчетных кодов, за календарный месяц;

$$\text{BAL}_j = \sum_{i=1}^m \sum_{\text{PK}} \text{balance}_{\text{PK}j_i}, \text{ где}$$

$\text{balance}_{\text{PK}j_i}$ - сумма входящих остатков по ТБС Участника клиринга, открытому в рамках Расчетного кода, в j -ом 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 отчетном месяце;

PK - множество всех Расчетных кодов.

¹ 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.

Для отдельных категорий Участников клиринга

Дополнительное комиссионное вознаграждение взимается за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения в иностранной валюте (в долларах США, евро и швейцарских франках) на Счетах обеспечения, Счетах гарантийных фондов, Счетах обеспечения под стресс которого учитываются денежные средства в указанных выше иностранных валютах для отдельных категорий Участников клиринга, являющихся:

- Некредитной организацией,
- Международной организацией,
- Некредитной организацией-нерезидентом, не имеющей действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга.

Комиссия начисляется за каждый день, в который сумма входящего остатка на Счетах обеспечения, Счетах гарантийного фонда, Счетах обеспечения под стресс в долларах США, евро и швейцарских франках, пересчитанная в российские рубли², в совокупности превышает 3,5 млрд. руб.

Комиссионное вознаграждение взимается с суммы, превышающей 3,5 млрд. руб., по ставке, рассчитываемой по формуле:

$$S = SF \times KS, \text{ где}$$

SF – норматив отчислений в фонд обязательного резервирования (ФОР) в валюте, устанавливаемый Банком России, действующий в день, за который рассчитывается комиссионное вознаграждение.

KS – ключевая ставка Банка России, действующая в день, за который рассчитывается комиссионное вознаграждение.

Сумма комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения (для отдельных категорий Участников клиринга) в иностранной валюте, подлежащая уплате Участником клиринга, рассчитывается по Расчетному коду Участника клиринга по формуле:

$$Fee_{\text{ФОР}} = \sum_i \text{ОКРУГЛ}((\text{МАХ}((\sum_{\text{ПК}, j} \text{ОКРУГЛ}(cl_bal_{\text{ПК}ij} \times z_{ij}; 2)) - th; 0) \times S) / (y \times 100)); 2), \text{ где}$$

Fee_{ФОР} – сумма комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения (для отдельных категорий Участников клиринга) в иностранной валюте по Участнику клиринга,

cl_bal_{ПКij} – входящий остаток индивидуального клирингового и иного обеспечения в j-ой иностранной валюте по Счету обеспечения / Счету гарантийных фондов / Счету обеспечения под стресс, соответствующему Расчетному коду (ПК), в i-й календарный день месяца (значение поля «OPENING_BALANCE» из Отчета о движении денежных средств (ССХ99)), для дня (дней), не являющегося Расчетным днем – исходящий остаток за последний Расчетный день (значение поля «CLOSING_BALANCE» из Отчета о движении денежных средств (ССХ99)),

² По курсу Банка России, установленному на день, за который рассчитывается комиссионное вознаграждение

$th = 3,5$ млрд. руб.,

z_{ij} – курс j -ой иностранной валюты к российскому рублю, установленный Банком России на день i ,

S - ставка комиссии за отчисление в ФОР на день i ;

y – количество календарных дней в году, в который входит отчетный месяц ($y=365$ или 366).