

**Банк «Национальный Клиринговый Центр»  
(Акционерное общество)  
(Банк НКЦ (АО))**

---

Распоряжение № *01-02/291*

18 июля 2017 года

г. Москва

**О начислении и выплате Участникам клиринга платы (процентов) за право использования денежных средств, составляющих индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение**

В соответствии с пунктом 3.10 Правил клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» Часть I. Общая часть (далее – Правила клиринга), утвержденных решением Наблюдательного совета Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) 21.12.2016 (Протокол № 9), установить следующее:

1. С 19 июля 2017 г. Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) начисляет Участникам клиринга плату (проценты) за право использования денежных средств в российских рублях и долларах США, учитываемых в качестве Обеспечения под стресс, определяемую исходя из следующих ставок:

№	Наименование валюты	Размер ставки
1.	Российский рубль	ставка по депозитным операциям «овернайт» Банка России, действующая на дату начисления процентов, за вычетом 0,75%
2.	Доллар США	ставка Federal Funds Target Rate - Lower Bound (Тикер в Bloomberg - FDTRFTRL), действующая на дату начисления процентов, за вычетом 0,15%

2. Для целей определения размера денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения под стресс, на которые начисляется плата (проценты), предусмотренная в пункте 1 настоящего распоряжения:
  - иностранная валюта учитывается в следующей последовательности:
    - 1) Евро (EUR),
    - 2) Доллар США (USD).
3. С 19 июля установить следующий порядок начисления Клиринговым центром платы (процентов) за право использования денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга (далее – Проценты за использование) на рынке Стандартизированных ПФИ.
  - 3.1. Проценты за использование начисляются только на денежные средства в российских рублях, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

Иностранная валюта и ценные бумаги, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, для целей определения Процентов за использование не учитываются.

3.2. Проценты за использование рассчитываются по формуле:

$$\text{Проценты за использование} = \text{База для начисления процентов} * dcf_i * \text{Ставка}_{i-1}$$

Где:

$i$  – день начисления Процентов за использование;

*База для начисления Процентов* = min (Требование к обеспечению, Обеспечение в российских рублях);

$dcf_i$  (day count fraction) – коэффициент расчета дней в периоде между днями  $i-1$  и  $i$ , причем день  $i-1$  определяется как предыдущий рабочий день по календарю рабочих дней в России (Календарь\_RUB), а в качестве конвенции расчета дней принимается Actual/Actual;

$\text{Ставка}_{i-1} = \text{RUONIA}_{i-1} - \text{Spread}_1$  – опубликованная на день  $i-1$  ставка RUONIA минус спред ( $\text{Spread}_1$ ), равный:

0,25% (или 25 базисным пунктам) в случае, если на регистрах учета позиций, соответствующих Расчетному коду, учитываются обязательства Участника клиринга из Договоров СПФИ, заключенных в соответствии со Спецификацией внебиржевых договоров (контрактов) процентный своп и / или в соответствии со Спецификацией договоров (контрактов) процентный своп, с Валютой номинальной суммы российский рубль, и не учитываются обязательства Участника клиринга из иных Договоров СПФИ,

или

1% (или 100 базисным пунктам) в иных случаях.

3.3. Если  $i$  – это последний рабочий день месяца по Календарю\_RUB, не являющийся последним календарным днем месяца, то в дату  $i$  помимо Процентов за использование, рассчитанных согласно подпункту 3.2 настоящего распоряжения, рассчитываются и начисляются Проценты за использование:

$$\text{Проценты за использование} = \text{База для начисления процентов} * dcf_{i+1} * \text{Ставка}_{i-1}$$

Где:

$i+1$  – первый календарный день месяца, следующего за месяцем дня  $i$ ;

*База для начисления Процентов* = min (Требование к обеспечению, Обеспечение в российских рублях);

$dcf_{i+1}$  (day count fraction) – коэффициент расчета дней в периоде между днями  $i$  и  $i+1$ , в качестве конвенции расчета дней в периоде принимается Actual/Actual;

$\text{Ставка}_{i-1} = \text{RUONIA}_{i-1} - \text{Spread}_1$  – опубликованная на день  $i-1$  ставка RUONIA минус спред ( $\text{Spread}_1$ ), равный:

0,25% (или 25 базисным пунктам) в случае, если на регистрах учета позиций, соответствующих Расчетному коду, учитываются обязательства Участника клиринга из Договоров СПФИ, заключенных в соответствии со Спецификацией внебиржевых договоров (контрактов) процентный своп и / или в соответствии со Спецификацией договоров (контрактов) процентный своп, с Валютой номинальной суммы российский рубль, и не учитываются обязательства Участника клиринга из иных Договоров СПФИ,



или

1% (или 100 базисным пунктам) в иных случаях.

В рабочий день Календаря\_RUB, следующий за днем  $i$ , значение Процентов за использование, рассчитанное в соответствии с настоящим подпунктом распоряжения, корректируется на рассчитанное в этот день значение Процентов за использование, рассчитанное согласно подпункту 3.2 настоящего распоряжения.

- 3.4. Начисление и выплата Процентов за использование осуществляется в каждый Расчетный день.
4. Распоряжение № 01-02/43 от 20.02.2017 утрачивает силу с 19.07.2017 г.