**Приложение № 11**

к Правилам клиринга ЗАО АКБ «Национальный   
Клиринговый Центр» на срочном рынке

МЕТОДИКА РАСЧЕТА РАЗМЕРА ВЗНОСА В ГАРАНТИЙНЫЙ ФОНД

1. Общие положения
   1. В соответствии с настоящей методикой Клиринговый центр производит расчет размера взноса в Гарантийный фонд в отношении каждой Расчетной фирмы, зарегистрированной Участником клиринга (далее – Размер взноса), устанавливает величины параметров, необходимые для данного расчета.
2. Категории Расчетных фирм
   1. Клиринговый центр устанавливает следующие категории Расчетных фирм:

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Категория** | **Доступ к Рынкам** | | | | | | |
| **1** | **2** | **3** | **4** | **5** | **6** | **7** |
| **I** | √ | √ | √ | √ | √ | √ | √ |
| **II** |  |  | √ | √ | √ | √ | √ |
| **III** |  |  |  | √ | √ | √ | √ |

где

Рынок - рынок \ режим торгов \ типы сделок

1 - Фондовый рынок Секции срочного рынка

2 - Сектор рынка Standard ЗАО «ФБ ММВБ»

3 - Денежный рынок Секции срочного рынка

4 - Товарный рынок Секции срочного рынка

5 - Секция срочного рынка ОАО «Мосэнергобиржа»

6 - Секция срочного рынка ОАО «Санкт-Петербургская биржа»

7 - Секция стандартных контрактов на зерновые, зернобобовые и технические культуры ЗАО «Национальная товарная биржа»

* 1. После внесения взноса в Гарантийный фонд в порядке, установленном Правилами клиринга, в размере, установленном настоящей методикой, Клиринговый центр может осуществлять клиринг по сделкам, заключенным с указанием кода Расчетной фирмы на Рынках, отмеченных знаком «**√**» в Таблице пункта 2.1 настоящей методики.

1. Расчет Размера взноса
   1. Размер взноса для каждой Расчетной фирмы рассчитывается по формуле:



где:

 – Размер взноса для Расчетной фирмы;

Const – минимальный Размер взноса;

  – ставка процента;

  – среднедневное Гарантийное обеспечение Расчетной фирмы, рассчитанное за 6 (Шесть) месяцев по позициям данной Расчетной фирмы (далее – Среднедневное ГО);

Cap  – максимальный Размер взноса;

 – дополнительная константа.

1. Переменные и константы, используемые для расчета Размера взноса
   1. Минимальный Размер взноса (Const):

* для Расчетной фирмы третьей категории устанавливается равным 500 тыс. руб.;
* для юридического лица, зарегистрировавшего Расчетную фирму второй категории, являющегося профессиональным участником рынка ценных бумаг, устанавливается равным 1 млн. руб., для юридического лица, зарегистрировавшего Расчетную фирму второй категории, не являющегося профессиональным участником рынка ценных бумаг, устанавливается равным 2 млн. руб.;
* для Расчетной фирмы первой категории, Среднедневное ГО () которой составляет менее 100 млн. руб., устанавливается равным 10 млн. руб.;
* для Расчетной фирмы первой категории, Среднедневное ГО () которой составляет 100 млн. руб. или более, устанавливается равным 12 млн. руб.
  1. Величина ставки процента ():
* для Расчетной фирмы первой категории, Среднедневное ГО () которой составляет 100 млн. руб. или более, устанавливается равной 2%;
* в остальных случаях устанавливается равной 4%.
  1. Максимальный Размер взноса (Cap) устанавливается равным 14 млн. руб.
  2. Величина дополнительной константы ():
* для Расчетной фирмы первой категории устанавливается равной 8 млн. руб.;
* в остальных случаях устанавливается равной 0.

1. Уведомление Участников клиринга
   1. Информация о факте изменения Размера взноса размещается на Сайте Группы "Московская Биржа" по адресу http://moex.com/ (далее – Сайт), а также направляется каждому Участнику клиринга, зарегистрировавшему Расчетную фирму, в информационном письме с указанием нового Размера взноса.