



Управление остатками средств на едином счете

Опыт Федерального казначейства

Заместитель руководителя Федерального казначейства
Н.М. Горина



УПРАВЛЕНИЕ ОСТАТКАМИ СРЕДСТВ:

- Создание нормативной базы (законы, постановления, нормативные приказы; внутренние приказы);
- Планирование операций;
- Проведение операций;
- Учет результатов операций;
- Распределение доходов;
- Отчетность.

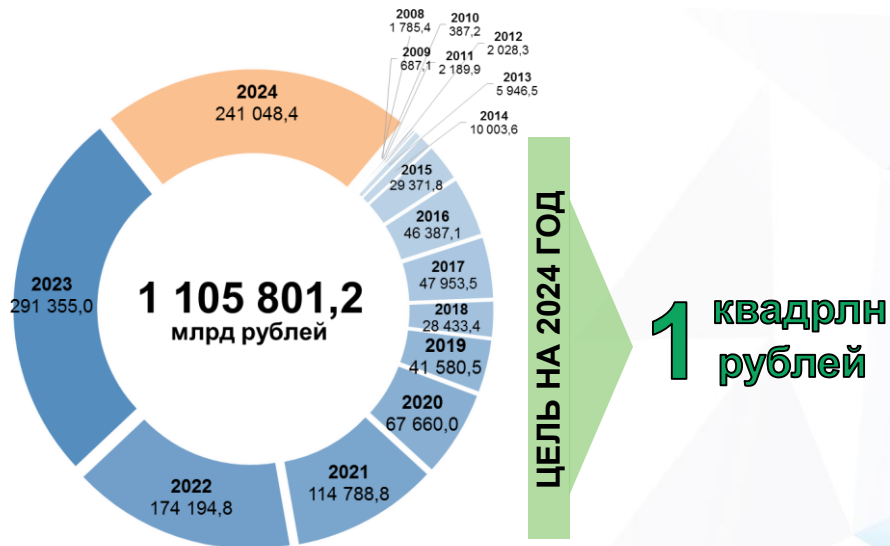


СОВЕРШЕНСТВОВАНИЕ И РАЗВИТИЕ ОПЕРАЦИЙ

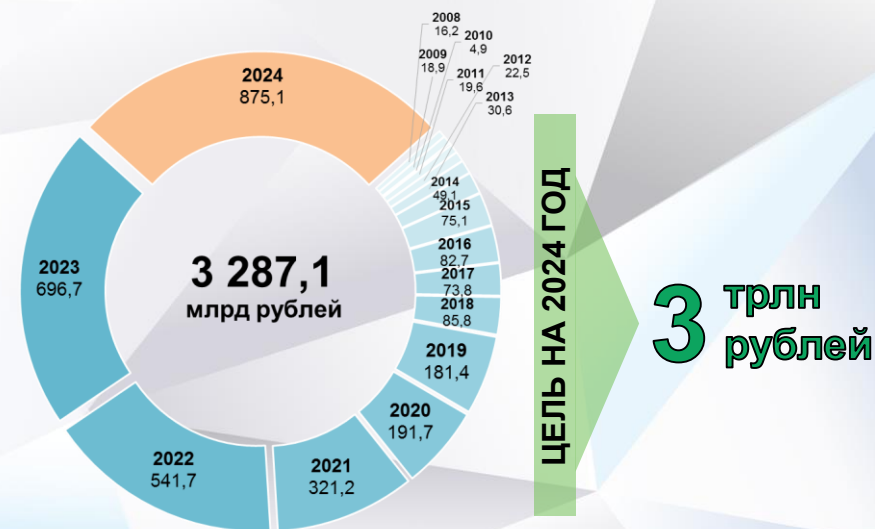
Планируемые результаты управления остатками средств на 2024 год

по состоянию на 01.10.2024
млрд рублей

ОБЪЕМЫ РАЗМЕЩЕНИЙ СРЕДСТВ ЕСФБ И ЕКС



ДОХОДЫ ОТ УПРАВЛЕНИЯ ОСТАТКАМИ СРЕДСТВ ЕСФБ И ЕКС





РАЗМЕЩЕНО СРЕДСТВ ЕСФБ И ЕКС В 2024 ГОДУ

по состоянию на 1 октября 2024 г.

241,0

 ТРЛН РУБЛЕЙ

■ Накопленным итогом с 2008 года, млрд рублей

■ Годовой объем, млрд рублей

167,5

 ТРЛН РУБЛЕЙ БИРЖЕВЫЕ ОПЕРАЦИИ

Проведено 1418 биржевых торгов





Доходы от управления остатками средств ЕКС и ЕСФБ

С 2008 года совокупный доход от управления ликвидностью составил **3 287,1** млрд рублей, в том числе:

- от управления остатками средств ЕСФБ — **1 244,8** млрд рублей
- от управления остатками средств ЕКС — **2 042,3** млрд рублей



Информация о распределении средств от управления остатками средств единого казначейского счета за 2021-2024 годы, млрд. руб.

Структура доходов	2021 г.	2022 г.	2023 г.	2024 г.									
	Итого	Итого	Итого	Итого	Январь	Февраль	Март	Апрель	Май	Июнь	Июль	Август	Сентябрь
Всего доходов	131,5	400,9	667,3	842,5	100,9	88,3	78,9	106,3	72,5	88,7	100,6	79,7	126,7
Организации	-	-	9,5	0,1	0,01	0,01	0,01	0,01	0,01	0,01	0,01	0,01	0,01
Всего доходов бюджетов	131,5	400,9	657,8	839,2	100,8	88,2	78,7	106,0	72,1	88,2	100,1	79,2	126,0
Федеральный бюджет	94,3 (72%)	233,1 (58%)	513,8 (78%)	669,1 (80%)	84,4	74,0	64,3	85,5	55,3	68,9	78,5	59,8	98,5
Бюджеты субъектов Российской Федерации	37,2 (28%)	167,8 (42%)	144,0 (22%)	170,1 (20%)	16,4	14,2	14,4	20,5	16,8	19,3	21,6	19,4	27,5
ФТ «Сириус»	-	-	-	3,2	0,06	0,08	0,18	0,24	0,38	0,50	0,58	0,48	0,71



УПРАВЛЕНИЕ ОСТАТКАМИ СРЕДСТВ

БИРЖА

**БАНКОВСКИЕ
ДЕПОЗИТЫ**

БИРЖА

ВНЕБИРЖЕВОЕ РЕПО

БЮДЖЕТНЫЕ КРЕДИТЫ

БИРЖА

ДЕПОЗИТЫ С ЦК

БИРЖА

**РЕПО С ЦК
(РАЗМЕЩЕНИЕ)**

БИРЖА

ВАЛЮТНЫЙ СВОП

**БАНКОВСКИЕ СЧЕТА
«ОВЕРНАЙТ»
(с возвратом утром)**

БИРЖА

**РЕПО С ЦК
(ПРИВЛЕЧЕНИЕ)**

БИРЖА

**ЗАЙМ ЦЕННЫМИ
БУМАГАМИ**

2024



СОВЕРШЕНСТВОВАНИЕ И РАЗВИТИЕ ОПЕРАЦИЙ

ЕЖЕМЕСЯЧНОЕ
РАСПРЕДЕЛЕНИЕ
ДОХОДОВ

2024

НОЛЬ НА ЕКС

2024

БИРЖА

ЗАЙМ ЦЕННЫМИ
БУМАГАМИ

2024

КАЗНАЧЕЙСКИЙ
ИНФРАСТРУКТУРНЫЙ
КРЕДИТ

2025

БИРЖА

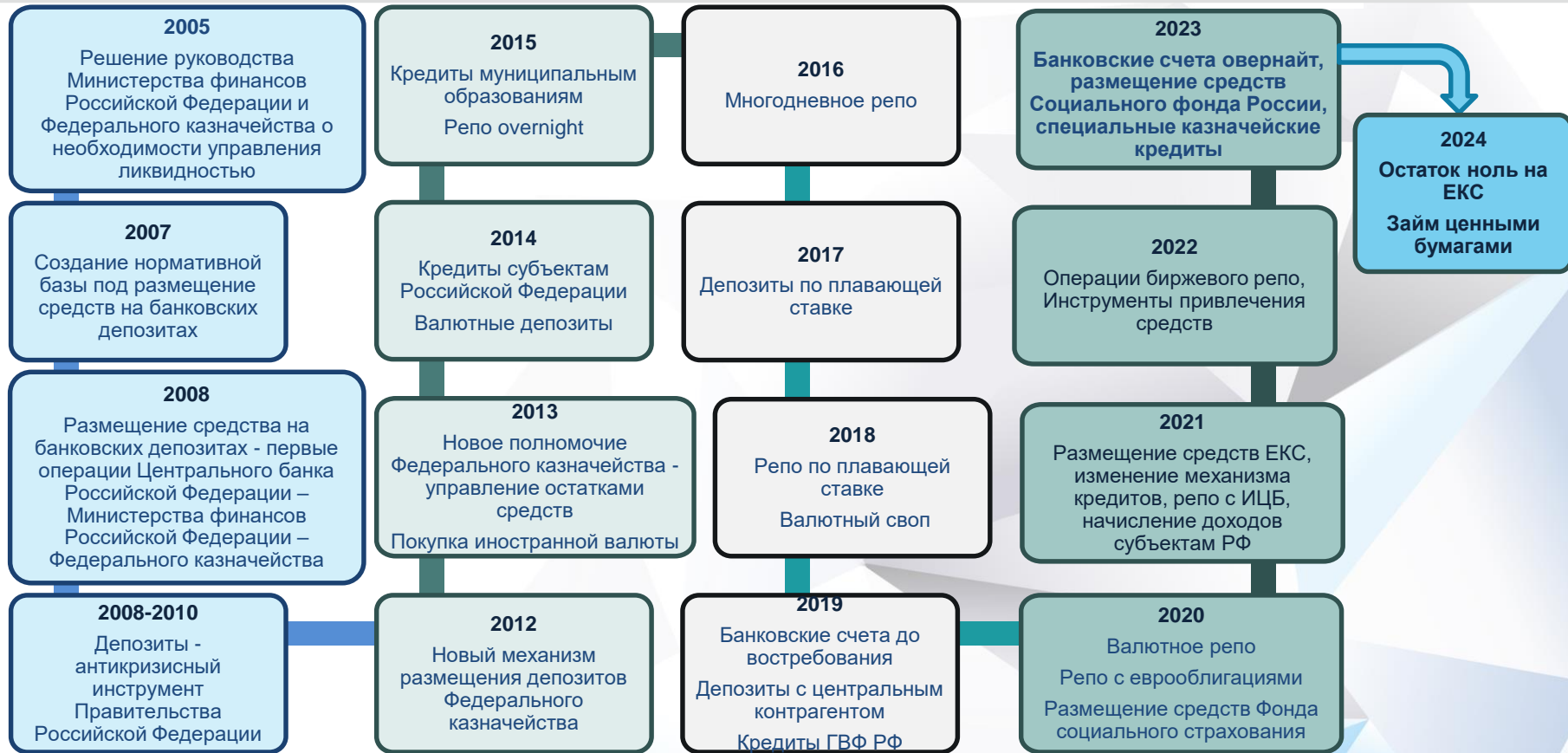
ОБЪЕДИНЕНИЕ
РАСЧЕТОВ ДЕПО И
РЕПО

2025

БИРЖА

РЕПО С ЦК с КСУ НКЦ

2025





Проект «ноль»

С целью **снижения до нуля** остатков средств единого казначейского счета и получения дополнительных доходов, совместно с Банком России и кредитными организациями, создание возможности зачисления средств, оставшихся на едином казначейском счете на конец операционного дня (до 22 часов московского времени), на открытые в кредитных организациях банковские счета, предусматривающие возврат средств до одного часа тридцати минут московского времени следующего рабочего дня *(4 квартал 2024 года)*.



Остатки средств Единого казначейского счёта



Условия:

Размещение средств в **21:30** (Банком России со счета Федерального казначейства)
Возврат средств в **01:30** утра следующего дня (без представления заявления на возврат)



Займ ценными бумагами

Предоставление Федеральным Казначейством кредитным организациям в займ ценных бумаг, полученных по операциям внебиржевого репо.
(4 квартал 2024 года).

Преимущества:

для Федерального казначейства - получение дополнительного дохода в бюджет за счет операций размещения в займ ценных бумаг, полученных по операциям репо;
для кредитных организаций - удовлетворение потребности в высоколиквидных активах за счет привлечения на баланс ценных бумаг при наличии свободного «невыбранного» лимита на необеспеченные операции.

Заемщики

только кредитные организации (КО) с гос. участием

Лимиты

в рамках текущего свободного лимита КО по необеспеченным операциям ФК (депозиты)

Расчеты

расчеты в клиринге НРД

Нормативная документация

генеральное соглашение + документы НРД

Проценты за пользование ценными бумагами

начисление процентов за пользование займом на рыночную стоимость ценных бумаг
выплата процентов ежемесячно или в конце срока

Активы, предоставляемые в займ

ОФЗ, полученные по сделкам РЕПО от КО, которой предоставляется займ

Место заключения сделок

торговая система или иные ИПТС, предоставляемые инфраструктурой Мосбиржи

Заключение сделок

адресные сделки

Срок сделок

от 2 месяцев

Основные этапы договора займа ценных бумаг

1. Заключение договоров займа

- ФК определяет параметры договора займа (объем, сроки, процентную ставку)
- ФК направляет в торговую систему перечень допущенных кредитных организаций и лимиты на них
- Банки-заемщики подают заявки на привлечение ОФЗ
- Торговая система формирует реестр договоров займа ОФЗ

2. Расчеты и обслуживание договоров займа

- НРД регистрирует и исполняет договоры займа ОФЗ
- НРД сопровождает договоры до возврата ОФЗ
- Договоры рассчитываются при наступлении срока возврата
- В дату возврата НРД перечисляет ФК проценты за пользование ценными бумагами

