Документ предоставлен [КонсультантПлюс](https://www.consultant.ru)

**СРАВНЕНИЕ**

|  |  |
| --- | --- |
| Указание Банка России от 08.10.2018 N 4927-У | Указание Банка России от 10.04.2023 N 6406-У |
| Расчет показателя краткосрочной ликвидности ("Базель III") (Код формы по ОКУД 0409122 (месячная)) | Расчет показателя краткосрочной ликвидности ("Базель III") (Форма (месячная), код формы по ОКУД 0409122) |
|  | Форма |
|

|  |  |
| --- | --- |
|  | Банковская отчетность |
|  | Код территории по ОКАТО | Код кредитной организации (филиала) |
| по ОКПО | регистрационный номер (/порядковый номер) |
|  |  |  |  |

 РАСЧЕТ ПОКАЗАТЕЛЯ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ ("БАЗЕЛЬ III") по состоянию на "\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ г. |

|  |
| --- |
| Банковская отчетность |
|  | Код территории по ОКАТО <1> | Код кредитной организации (филиала) |
| по ОКПО <2> | регистрационный номер (/порядковый номер) |
|  |  |  |  |

|  |
| --- |
| РАСЧЕТ ПОКАЗАТЕЛЯ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ ("БАЗЕЛЬ III")по состоянию на "\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_ г. |

 |
| Полное ~~или сокращенное~~ фирменное наименование кредитной организации \_\_\_\_\_\_\_Адрес ~~(место~~ нахождения~~)~~ кредитной организации \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |

|  |  |
| --- | --- |
| Полное фирменное наименование кредитной организации |  |
| Адрес кредитной организации в пределах места нахождения кредитной организации \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |

 |
|  Код формы по ОКУД 0409122 Месячная |

|  |
| --- |
| Код формы по ОКУД <3> 0409122 |
| Месячная |

 |
| Раздел 1. Информация о компонентах расчета показателя краткосрочной ликвидности |

|  |  |
| --- | --- |
| Раздел 1. | Информация о компонентах расчета показателя краткосрочной ликвидности (далее - ПКЛ) |

 |
| Код валюты: \_\_\_\_\_\_\_~~.~~ |

|  |
| --- |
| Код валюты: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |

 |
|  тыс. руб.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Номер строки | Наименование показателя | Величина требований (обязательств) | Весовой коэффициент | Взвешенная величина требований (обязательств) |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 | Высоколиквидные активы, скорректированные с учетом ограничений на структуру высоколиквидных активов (ВЛА - ВК), итого, в том числе: | X | X |  |
| 1.1 | ВЛА-1, итого, в том числе: |  | X |  |
| 1.1.1 | наличная валюта |  | 1,00 |  |
| 1.1.2 | средства на счетах кредитных организаций (филиалов) по кассовому обслуживанию структурных подразделений, а также средства для кассового обслуживания кредитных организаций (филиалов), которое осуществляется не по месту открытия корреспондентского счета (субсчета) |  | 1,00 |  |
| 1.1.3 | средства в Банке России и в уполномоченных органах других стран, в том числе суммы, депонированные в Банке России и центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, для получения следующим днем наличных денежных средств, средства на корреспондентском счете (корреспондентских счетах) в Банке России и в центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, средства на депозитных счетах в Банке России с оставшимся сроком до погашения один календарный день, средства на депозитных счетах в центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, до востребования и с оставшимся сроком до погашения один календарный день и требования к Банку России и центральному банку иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, со сроком исполнения не позднее чем на следующий календарный день по получению начисленных (накопленных) процентов по указанным счетам, суммы переплаты, подлежащие возврату банку со счетов по учету обязательных резервов в Банке России и центральных банках (уполномоченных органах) иностранного государства, если возврат средств должен быть осуществлен не позднее следующего календарного дня с даты расчета ПКЛ, а также средства на счетах по учету обязательных резервов (их часть) в центральных банках (уполномоченных органах) иностранных государств, если банку (филиалу банка) предоставлено право обращаться в соответствующий центральный банк (уполномоченный орган) иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, за возвратом указанных средств (их части) и возврат средств (их части) осуществляется не позднее следующего календарного дня с даты расчета ПКЛ |  | 1,00 |  |
| 1.1.4 | средства на депозитных счетах в центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, с оставшимся сроком до погашения более одного календарного дня, если банку (филиалу банка) предоставлено право обращаться в соответствующий центральный банк иностранного государства с требованием о досрочном возврате депозита при условии, что возврат депозита осуществляется не позднее следующего календарного дня с даты расчета ПКЛ, требования к центральному банку иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, со сроком исполнения не позднее чем на следующий календарный день по получению начисленных (накопленных) процентов по указанным счетам |  | 1,00 |  |
| 1.1.5 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами~~,~~ центральными банками стран, имеющих ~~страновую оценку "0" или "1", а также стран с высоким уровнем доходов, являющихся членами ОЭСР и (или) Еврозоны~~, международными финансовыми организациями и международными банками развития, ~~требования к которым отнесены в I группу активов,~~ или полностью обеспеченные гарантиями ~~(банковскими гарантиями)~~ указанных эмитентов |  | 1,00 |  |
| 1.1.6 | долговые ценные бумаги, выпущенные организациями, которым в соответствии с законодательством стран, имеющих ~~страновую оценку "0" или "1", а также стран с высоким уровнем доходов, являющихся членами ОЭСР и (или) Еврозоны~~, предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, или полностью обеспеченные гарантиями указанных эмитентов |  | 1,00 |  |
| 1.1.7 | долговые ценные бумаги, номинированные в рублях, выпущенные Правительством Российской Федерации или Банком России |  | 1,00 |  |
| 1.1.8 | долговые ценные бумаги, номинированные в иностранной валюте, выпущенные Правительством Российской Федерации или Банком России |  | 1,00 |  |
| 1.1.9 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами~~,~~ центральными банками стран, не ~~имеющих страновую оценку "0" или "1", а также не являющихся странами с высоким уровнем доходов, являющимися членами ОЭСР и (или) Еврозоны~~, номинированные в валюте страны-эмитента |  | 1,00 |  |
| 1.2 | ВЛА-2А, итого, в том числе: |  | X |  |
| 1.2.1 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами~~,~~ центральными банками стран, имеющих ~~страновую оценку "2", в части ценных бумаг, не отраженных по строке 1.1.9 настоящей таблицы, и международными банками развития, требования к которым отнесены во II группу активов~~, или полностью обеспеченные гарантиями ~~(банковскими гарантиями)~~ указанных эмитентов |  | 0,85 |  |
| 1.2.2 | долговые ценные бумаги, выпущенные организациями, которым в соответствии с законодательством стран, имеющих ~~страновую оценку "2"~~, предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, или полностью обеспеченные гарантиями указанных эмитентов |  | 0,85 |  |
| 1.2.3 | долговые ценные бумаги (~~кроме~~ облигаций с ипотечным покрытием), выпущенные нефинансовыми организациями (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности ~~по международной шкале~~, присвоенный ~~рейтинговыми агентствами на уровне не ниже "AA-" по классификации~~ рейтинговых агентств Эс~~-~~энд~~-~~Пи Глобал Рейтингс (S&P Global Ratings) или Фитч Рейтингс (Fitch Ratings) либо "Aa3" по ~~классификации рейтингового агентства~~ Мудис Инвесторс Сервис (Moody's Investors Service) |  | 0,85 |  |
| 1.2.4 | обеспеченные облигации, выпущенные банками или ипотечными организациями в соответствии с законодательством иностранного государства, предусматривающим защиту владельцев облигаций, исполнение обязательств по которым полностью обеспечено залогом ипотечного покрытия или иных активов, находящихся на балансе эмитента ценных бумаг (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности ~~по международной шкале~~, присвоенный ~~рейтинговыми агентствами на уровне не ниже "AA-" по классификации~~ рейтинговых агентств Эс~~-~~энд~~-~~Пи Глобал Рейтингс (S&P Global Ratings) или Фитч Рейтингс (Fitch Ratings) либо "Aa3" по ~~классификации рейтингового агентства~~ Мудис Инвесторс Сервис (Moody's Investors Service) |  | 0,85 |  |
| 1.3 | ВЛА-2Б, итого, в том числе: |  | X |  |
| 1.3.1 | жилищные облигации с ипотечным покрытием, выпущенные юридическими лицами - нерезидентами (кроме банков) (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности ~~по международной шкале~~, присвоенный ~~рейтинговыми агентствами на уровне не ниже "AA" по классификации~~ рейтинговых агентств Эс~~-~~энд~~-~~Пи Глобал Рейтингс (S&P Global Ratings) или Фитч Рейтингс (Fitch Ratings) либо "Aa2" по ~~классификации рейтингового агентства~~ Мудис Инвесторс Сервис (Moody's Investors Service) |  | 0,75 |  |
| 1.3.2 | долговые ценные бумаги (кроме облигаций с ипотечным покрытием), выпущенные нефинансовыми организациями (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности ~~по международной шкале~~, присвоенный ~~рейтинговыми агентствами~~ на уровне от "A+" до "BBB-" по ~~классификации рейтинговых агентств~~ Эс~~-~~энд~~-~~Пи Глобал Рейтингс (S&P Global Ratings) или Фитч Рейтингс (Fitch Ratings) либо от "A1" до "Baa3" по ~~классификации рейтингового агентства~~ Мудис Инвесторс Сервис (Moody's Investors Service) |  | 0,5 |  |
| 1.3.3 | обыкновенные акции, включенные организатором торговли (фондовой биржей) в списки для расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, а также индексов акций, указанных в приложении 6 к Инструкции Банка России N 199-И |  | 0,5 |  |
| 1.4 | ВК 15 | X | X |  |
| 1.5 | Итого ВЛА-2Б после корректировки | X | X |  |
| 1.6 | ВК 40 | X | X |  |
| 1.7 | Итого ВЛА-2 после корректировки | X | X |  |
| 2 | Ожидаемые оттоки денежных средств, итого, в том числе: | X | X |  |
| 2.1 | Ожидаемый отток денежных средств физических лиц, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.1.1 | стабильные средства физических лиц, итого, в том числе: |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.1 | денежные средства в рублях, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.1.1.1.1 | на банковских счетах, на которые осуществляется перечисление заработной платы или иных выплат, связанных с выполнением трудовых обязанностей, итого, в том числе: |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.1.1.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.1.1.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.1.2 | на счетах физических лиц, имеющих установленные взаимоотношения с банком, итого, в том числе: |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.1.2.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.1.2.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.2 | денежные средства в отдельных иностранных валютах (в долларах США и евро), итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.1.1.2.1 | на банковских счетах, на которые осуществляется перечисление заработной платы или иных выплат, связанных с выполнением трудовых обязанностей, итого, в том числе: |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.2.1.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.2.1.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.2.2 | на счетах физических лиц, имеющих установленные взаимоотношения с банком, итого, в том числе: |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.2.2.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.2.2.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.2 | нестабильные средства физических лиц, итого, в том числе: |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.1 | денежные средства, превышающие максимальный размер возмещения по вкладам при наступлении страхового случая, установленный Федеральным законом N 177-ФЗ, итого, в том числе: |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.1.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.1.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.2 | прочие денежные средства физических лиц, которые не могут быть отнесены к стабильным, в том числе средства на банковских счетах, открытие и управление которыми осуществляется только дистанционным способом, квалифицированных инвесторов и связанных с банком лиц, итого, в том числе: |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.2.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.2.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.3 | средства клиентов, совокупная сумма которых превышает ~~пять~~ миллионов рублей |  | 0,10 |  |
| 2.2 | Ожидаемый отток денежных средств клиентов, привлеченных без обеспечения, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.2.1 | депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.2.1.1 | стабильные депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса |  | 0,05 |  |
| 2.2.1.2 | нестабильные депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса |  | 0,10 |  |
| 2.2.2 | операционные депозиты, итого, в том числе: |  | 0,25 |  |
| 2.2.2.1 | юридических лиц, за исключением финансовых организаций |  | 0,25 |  |
| 2.2.2.2 | финансовых организаций |  | 0,25 |  |
| 2.2.2.3 | Федерального казначейства и Банка России |  | 0,25 |  |
| 2.2.2.4 | субъектов Российской Федерации, муниципальных образований Российской Федерации, внебюджетных фондов Российской Федерации |  | 0,25 |  |
| 2.2.2.5 | правительств и центральных банков иностранных государств, организаций, которым в соответствии с законодательством их стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, международных банков развития |  | 0,25 |  |
| 2.2.3 | депозиты и прочие привлеченные средства юридических лиц (за исключением финансовых организаций) и государственных органов, итого, в том числе: |  | 0,40 |  |
| 2.2.3.1 | юридических лиц, за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса |  | 0,40 |  |
| 2.2.3.2 | Федерального казначейства и Банка России, а также центрального банка иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка |  | 0,40 |  |
| 2.2.3.3 | субъектов Российской Федерации, муниципальных образований Российской Федерации, внебюджетных фондов Российской Федерации |  | 0,40 |  |
| 2.2.3.4 | правительств иностранных государств, ~~международных банков развития,~~ организаций, которым в соответствии с законодательством их стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства |  | 0,40 |  |
| 2.2.3.5 | средства субъектов малого бизнеса, не включенные в расчет ожидаемого оттока денежных средств клиентов, привлеченных без обеспечения, в соответствии с абзацами пятым - восьмым подпункта 3.3.5 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П |  | 0,40 |  |
| 2.2.4 | депозиты и прочие привлеченные денежные средства связанных с банком юридических лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П, за исключением финансовых организаций, Банка России, а также центрального банка иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка |  | 1,00 |  |
| 2.2.5 | прочие привлеченные денежные средства без обеспечения, итого, в том числе: |  | 1,00 |  |
| 2.2.5.1 | средства выгодоприобретателей банка |  | 1,00 |  |
| 2.2.5.2 | средства финансовых организаций |  | 1,00 |  |
| 2.2.5.3 | средства специализированных финансовых обществ (компаний специального назначения), кроме средств, привлеченных от юридических лиц в рамках размещения ценных бумаг в интересах банка |  | 1,00 |  |
| 2.2.5.4 | средства, привлеченные по выпущенным ценным бумагам (включая облигации и векселя), кроме сберегательных и депозитных сертификатов, а также средства, привлеченные от юридических лиц в рамках размещения ценных бумаг в интересах банка |  | 1,00 |  |
| 2.2.5.5 | средства, привлеченные банком в результате предоставления услуг по брокерскому обслуживанию |  | 1,00 |  |
| 2.2.5.6 | просроченная задолженность и просроченные проценты по кредитам, депозитам и прочим привлеченным средствам, прочие не исполненные в срок обязательства |  | 1,00 |  |
| 2.2.6 | средства, подлежащие депонированию на счетах по учету обязательных резервов и (или) внесению на корреспондентский счет (корреспондентские субсчета) банка в Банке России и уполномоченном органе (центральном банке) иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, в величине, необходимой для выполнения банком обязанности по выполнению обязательных резервных требований |  | 1,00 |  |
| 2.3 | Ожидаемый отток денежных средств, привлеченных под обеспечение активами банка, а также по договорам займа ценных бумаг, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.3.1 | обязательства банка обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка |  | 0,00 |  |
| 2.3.2 | обязательства банка по операциям с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, вне зависимости от вида предоставленного обеспечения, итого, в том числе: |  | 0,00 |  |
| 2.3.2.1 | денежные средства, привлеченные под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1 |  | 0,00 |  |
| 2.3.2.2 | денежные средства, привлеченные под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2 |  | 0,00 |  |
| 2.3.2.3 | денежные средства, привлеченные под обеспечение прочими активами |  | 0,00 |  |
| 2.3.3 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка |  | 0,15 |  |
| 2.3.4 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами (кроме ценных бумаг, удовлетворяющих критериям, предъявляемым к ВЛА-1 или ВЛА-2А), по операциям с Федеральным казначейством и международными банками развития |  | 0,25 |  |
| 2.3.5 | обязательства банка, обеспеченные жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, Федеральным казначейством и международными банками развития |  | 0,25 |  |
| 2.3.6 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, за исключением жилищных облигаций с ипотечным покрытием, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, Федеральным казначейством и международными банками развития |  | 0,50 |  |
| 2.3.7 | обязательства банка по операциям со связанными с банком юридическими лицами, определенными в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П, вне зависимости от вида ценных бумаг, предоставленных в обеспечение |  | 1,00 |  |
| 2.3.8 | прочие привлеченные средства под обеспечение активами, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, Федеральным казначейством и международными банками развития |  | 1,00 |  |
| 2.4 | Дополнительные ожидаемые оттоки денежных средств, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.4.1 | ожидаемый отток денежных средств по производным финансовым инструментам |  | 1,00 |  |
| 2.4.2 | оценка дополнительной потребности в ликвидности по обязательствам банка, производным финансовым инструментам и прочим договорам (контрактам), связанной со снижением рейтинга долгосрочной и краткосрочной кредитоспособности банка или с другими отлагательными условиями |  | 1,00 |  |
| 2.4.3 | оценка дополнительной потребности в ликвидности, связанной с потенциальным изменением стоимости предоставленного банком обеспечения |  | 1,00 |  |
| 2.4.4 | ожидаемый отток денежных средств, обусловленный правом клиента потребовать возврата части предоставленного банку обеспечения, входящего в единый пул обеспечения |  | 1,00 |  |
| 2.4.5 | ожидаемый отток денежных средств по операциям, предусматривающим предоставление банком обеспечения, которое контрагент имеет право потребовать в соответствии с условиями договора |  | 1,00 |  |
| 2.4.6 | ожидаемый отток денежных средств по операциям, условия которых предусматривают возможность замещения клиентами банка обеспечения на активы, соответствующие критериям высоколиквидных активов более низкого уровня и (или) не соответствующие критериям ВЛА-1, ВЛА-2А и ВЛА-2Б |  | 1,00 |  |
| 2.4.7 | дополнительная потребность в ликвидности (ожидаемые оттоки денежных средств), связанная с изменением рыночной стоимости производных финансовых инструментов |  | 1,00 |  |
| 2.4.8 | ожидаемый отток денежных средств, связанный с осуществлением платежей, установленных условиями выпуска ценных бумаг, обеспеченных поступлениями денежных средств по активам |  | 1,00 |  |
| 2.4.9 | ожидаемый отток денежных средств по ценным бумагам, обеспеченным активами и выпущенным специализированными финансовыми обществами в интересах банка |  | 1,00 |  |
| 2.4.10 | ожидаемый отток денежных средств по обязательствам банка по неиспользованным безотзывным и условно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.4.10.1 | кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные физическим лицам и субъектам малого бизнеса |  | 0,05 |  |
| 2.4.10.2 | кредитные линии, предоставленные юридическим лицам (за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса), правительствам и организациям, которым в соответствии с законодательством предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, центральным банкам и международным банкам развития |  | 0,10 |  |
| 2.4.10.3 | линии ликвидности, предоставленные юридическим лицам (за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса), правительствам и организациям, которым в соответствии с законодательством предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, центральным банкам и международным банкам развития |  | 0,30 |  |
| 2.4.10.4 | кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные кредитным организациям (в том числе банкам-нерезидентам) |  | 0,40 |  |
| 2.4.10.5 | кредитные линии, предоставленные финансовым организациям (кроме кредитных организаций, специализированных финансовых обществ, хедж-фондов и фондов денежного рынка) |  | 0,40 |  |
| 2.4.10.6 | линии ликвидности, предоставленные финансовым организациям (кроме кредитных организаций, специализированных финансовых обществ, хедж-фондов и фондов денежного рынка) |  | 1,00 |  |
| 2.4.10.7 | линии ликвидности и кредитные линии, предоставленные прочим клиентам |  | 1,00 |  |
| 2.4.11 | ожидаемый отток денежных средств по безусловно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности |  | 0,05 |  |
| 2.4.12 | ожидаемый отток денежных средств по условным обязательствам кредитного характера банка по предоставлению денежных средств на проведение сделок торгового финансирования |  | 0,05 |  |
| 2.4.13 | ожидаемый отток денежных средств по предоставленным гарантиям и поручительствам, а также аккредитивам, не относящимся к торговому финансированию |  | 0,10 |  |
| 2.4.14 | прочие обязательства банка, установленные условиями договора, по предоставлению средств в ближайшие 30 календарных дней, итого, в том числе: | X | X |  |
| 2.4.14.1 | обязательства по предоставлению денежных средств финансовым организациям, центральным (национальным) банкам |  | 1,00 |  |
| 2.4.14.2 | обязательства по предоставлению средств клиентам (кроме финансовых организаций, центральных (национальных) банков и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П), в том числе: |  | X | X |
| 2.4.14.2.1 | обязательства по предоставлению денежных средств физическим лицам |  | X | X |
| 2.4.14.2.2 | обязательства по предоставлению денежных средств субъектам малого бизнеса |  | X | X |
| 2.4.14.2.3 | обязательства по предоставлению денежных средств нефинансовым организациям |  | X | X |
| 2.4.14.2.4 | обязательства по предоставлению денежных средств прочим клиентам |  | X | X |
| 2.4.14.3 | величина превышения обязательств по предоставлению средств клиентам (кроме финансовых организаций, центральных (национальных) банков и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П) над величиной притоков денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций, центральных (национальных) банков и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П), установленных условиями договора, не включенной в расчет ожидаемых притоков денежных средств |  | 1,00 |  |
| 2.4.14.4 | обязательства по предоставлению средств связанным с банком лицам, определенным в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П (кроме финансовых организаций и центральных (национальных) банков) |  | 1,00 |  |
| 2.4.15 | оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, по предоставлению средств связанным с банком юридическим лицам, определенным в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П |  | 1,00 |  |
| 2.4.16 | оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, по предоставлению средств по заключенному в соответствии с российским или иностранным правом договору, предметом которого является осуществление юридическими лицами совместных действий без образования юридического лица для извлечения прибыли или достижения иной цели, или по предоставлению средств юридическим лицам, на деятельность которых банк прямо или косвенно оказывает существенное влияние, а также в уставном капитале которых банк имеет миноритарные (неконсолидированные) доли участия |  | 1,00 |  |
| 2.4.17 | иные оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.4.17.1 | оценочные обязательства, проистекающие из потенциальных требований к банку по досрочному выкупу выпущенных долговых обязательств (включая облигации и векселя) или досрочному погашению (частичному погашению) обязательств, возникающих в рамках размещения долговых ценных бумаг в интересах банка |  | 1,00 |  |
| 2.4.17.2 | оценочные обязательства по досрочному выкупу собственных долговых ценных бумаг сроком до погашения свыше 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ у финансовых организаций - профессиональных участников рынка ценных бумаг, являющихся связанными с банком лицами |  | 1,00 |  |
| 2.4.17.3 | оценочные обязательства, связанные с деятельностью банка по управлению активами |  | 1,00 |  |
| 2.4.17.4 | оценочные обязательства по покрытию коротких позиций клиентов за счет обеспечения, предоставленного другими клиентами |  | 1,00 |  |
| 2.4.17.5 | прочие оценочные обязательства (оттоки) |  | 1,00 |  |
| 2.4.18 | ожидаемые оттоки денежных средств в ближайшие 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, не включенные в другие категории оттоков денежных средств |  | 1,00 |  |
| 3 | Ожидаемые притоки денежных средств, итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.1 | Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение ценными бумагами, включая операции обратного репо, итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.1.1 | ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение ценными бумагами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), в случае если полученные в обеспечение ценные бумаги не были реализованы или переданы в обеспечение по привлеченным средствам, итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.1.1.1 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1 |  | 0,00 |  |
| 3.1.1.2 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А |  | 0,15 |  |
| 3.1.1.3 | под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б |  | 0,25 |  |
| 3.1.1.4 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием |  | 0,50 |  |
| 3.1.1.5 | под обеспечение прочими ценными бумагами |  | 1,00 |  |
| 3.1.1.6 | требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение ценными бумагами, не относящимися к ВЛА-1 и ВЛА-2 |  | 0,50 |  |
| 3.1.2 | ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение ценными бумагами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), в случае проведения операций с данными ценными бумагами, что приводит к формированию собственных коротких позиций, итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.1.2.1 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1 |  | 0,00 |  |
| 3.1.2.2 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А |  | 0,00 |  |
| 3.1.2.3 | под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б |  | 0,00 |  |
| 3.1.2.4 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием |  | 0,00 |  |
| 3.1.2.5 | под обеспечение прочими ценными бумагами |  | 0,00 |  |
| 3.1.2.6 | требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение ценными бумагами, не относящимися к ВЛА-1 и ВЛА-2 |  | 0,00 |  |
| 3.2 | Притоки денежных средств по прочим операциям размещения средств, установленные условиями договора, в зависимости от вида контрагента, итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.2.1 | поступления от операций с финансовыми организациями, итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.2.1.1 | от операций размещения операционных депозитов |  | 0,00 |  |
| 3.2.1.2 | от операций по предоставлению средств связанным с банком финансовым организациям |  | 1,00 |  |
| 3.2.1.3 | от прочих операций размещения денежных средств |  | 1,00 |  |
| 3.2.2 | ожидаемый приток денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций и связанных лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П), итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.2.2.1 | ожидаемый приток денежных средств от физических лиц |  | 0,50 |  |
| 3.2.2.2 | ожидаемый приток денежных средств от субъектов малого бизнеса |  | 0,50 |  |
| 3.2.2.3 | ожидаемый приток денежных средств от юридических лиц, за исключением субъектов малого бизнеса |  | 0,50 |  |
| 3.2.2.4 | ожидаемый приток денежных средств от Банка России и иностранных центральных (национальных) банков |  | 1,00 |  |
| 3.2.2.5 | ожидаемый приток денежных средств по операциям с прочими клиентами, Министерством финансов Российской Федерации, субъектами Российской Федерации, муниципальными образованиями Российской Федерации, внебюджетными фондами Российской Федерации, правительствами, международными банками развития, а также организациями, которым в соответствии с законодательством их стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства |  | 0,50 |  |
| 3.2.3 | ожидаемый приток денежных средств по операциям со связанными с банком лицами (кроме финансовых организаций), определенными в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П |  | 0,50 |  |
| 3.3 | Поступления денежных средств в течение срока, не превышающего 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, от ценных бумаг, не включенных в ВЛА-1 и ВЛА-2 |  | 1,00 |  |
| 3.4 | Ожидаемый приток денежных средств по производным финансовым инструментам |  | 1,00 |  |
| 3.5 | Прочие ожидаемые притоки денежных средств (иные притоки денежных средств, установленные условиями договора) |  | 1,00 |  |
| 4 | Ожидаемый приток денежных средств после применения ограничения на максимальную допустимую величину | X | X |  |
| 5 | Чистый ожидаемый отток денежных средств (ЧООДС) | X | X |  |
| 6 | ПКЛ | X | X |  |

Раздел 2. Дополнительная информация к расчету показателя краткосрочной ликвидности |

|  |
| --- |
| тыс. руб. |
| Номер строки | Наименование показателя | Величина требований (обязательств) | Весовой коэффициент | Взвешенная величина требований (обязательств) |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 | Высоколиквидные активы, скорректированные с учетом ограничений на структуру высоколиквидных активов (ВЛА - ВК), итого, в том числе: | X | X |  |
| 1.1 | ВЛА-1, итого, в том числе: |  | X |  |

--------------------------------<1> Общероссийский классификатор объектов административно-территориального деления.<2> Общероссийский классификатор предприятий и организаций.<3> Общероссийский классификатор управленческой документации.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1.1.1 | наличная валюта |  | 1,00 |  |
| 1.1.2 | средства на счетах кредитных организаций (филиалов) по кассовому обслуживанию структурных подразделений, а также средства для кассового обслуживания кредитных организаций (филиалов), которое осуществляется не по месту открытия корреспондентского счета (субсчета) |  | 1,00 |  |
| 1.1.3 | средства в Банке России и в уполномоченных органах других стран, в том числе суммы, депонированные в Банке России и центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, для получения следующим днем наличных денежных средств, средства на корреспондентском счете (корреспондентских счетах) в Банке России и в центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, средства на депозитных счетах в Банке России с оставшимся сроком до погашения один календарный день, средства на депозитных счетах в центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, до востребования и с оставшимся сроком до погашения один календарный день и требования к Банку России и центральному банку иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, со сроком исполнения не позднее чем на следующий календарный день по получению начисленных (накопленных) процентов по указанным счетам, суммы переплаты, подлежащие возврату банку со счетов по учету обязательных резервов в Банке России и центральных банках (уполномоченных органах) иностранного государства, если возврат средств должен быть осуществлен не позднее следующего календарного дня с даты расчета ПКЛ, а также средства на счетах по учету обязательных резервов (их часть) в центральных банках (уполномоченных органах) иностранных государств, если банку (филиалу банка) предоставлено право обращаться в соответствующий центральный банк (уполномоченный орган) иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, за возвратом указанных средств (их части) и возврат средств (их части) осуществляется не позднее следующего календарного дня с даты расчета ПКЛ |  | 1,00 |  |
| 1.1.4 | средства на депозитных счетах в центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, с оставшимся сроком до погашения более одного календарного дня, если банку (филиалу банка) предоставлено право обращаться в соответствующий центральный банк иностранного государства с требованием о досрочном возврате депозита при условии, что возврат депозита осуществляется не позднее следующего календарного дня с даты расчета ПКЛ, требования к центральному банку иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, со сроком исполнения не позднее чем на следующий календарный день по получению начисленных (накопленных) процентов по указанным счетам |  | 1,00 |  |
| 1.1.5 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами или центральными банками стран (выпуски ценных бумаг), имеющих (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный иностранным кредитным рейтинговым агентством "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service) <1> на уровне от "AAA" до "AA-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "Aaa" до "Aa3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), международными финансовыми организациями (Банком международных расчетов, Международным валютным фондом, Европейским центральным банком) и международными банками развития группы Всемирного банка, указанными в абзаце тринадцатом подпункта 2.3.1 пункта 2.3 Инструкции Банка России N 199-И <2>, или полностью обеспеченные гарантиями указанных эмитентов |  | 1,00 |  |

--------------------------------<1> Далее при совместном упоминании - иностранные кредитные рейтинговые агентства.<2> Инструкция Банка России от 29 ноября 2019 года N 199-И "Об обязательных нормативах и надбавках к нормативам достаточности капитала банков с универсальной лицензией" (зарегистрирована Минюстом России 27 декабря 2019 года, регистрационный N 57008) с изменениями, внесенными Указаниями Банка России от 26 марта 2020 года N 5423-У (зарегистрировано Минюстом России 31 марта 2020 года, регистрационный N 57913), от 3 августа 2020 года N 5520-У (зарегистрировано Минюстом России 3 ноября 2020 года, регистрационный N 60730), от 3 августа 2020 года N 5521-У (зарегистрировано Минюстом России 11 сентября 2020 года, регистрационный N 59770), от 12 января 2021 года N 5705-У (зарегистрировано Минюстом России 15 апреля 2021 года, регистрационный N 63150), от 20 апреля 2021 года N 5783-У (зарегистрировано Минюстом России 11 июня 2021 года, регистрационный N 63866), от 18 августа 2021 года N 5886-У (зарегистрировано Минюстом России 21 сентября 2021 года, регистрационный N 65078), от 24 декабря 2021 года N 6040-У (зарегистрировано Минюстом России 26 января 2022 года, регистрационный N 67014), от 3 апреля 2023 года N 6393-У (зарегистрировано Минюстом России 29 мая 2023 года, регистрационный N 73538), от 17 апреля 2023 года N 6412-У (зарегистрировано Минюстом России 23 мая 2023 года, регистрационный N 73399), от 6 июня 2023 года N 6436-У (зарегистрировано Минюстом России 9 июня 2023 года, регистрационный N 73793) (далее - Инструкция Банка России N 199-И).

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.1.6 | долговые ценные бумаги, выпущенные организациями, которым в соответствии с законодательством стран, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "AAA" до "AA-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "Aaa" до "Aa3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, или полностью обеспеченные гарантиями указанных эмитентов |  | 1,00 |  |
| 1.1.7 | долговые ценные бумаги, номинированные в рублях, выпущенные Правительством Российской Федерации или Банком России |  | 1,00 |  |
| 1.1.8 | долговые ценные бумаги, номинированные в иностранной валюте, выпущенные Правительством Российской Федерации или Банком России |  | 1,00 |  |
| 1.1.9 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами или центральными банками стран, не отраженные по строке 1.1.5 раздела 1, номинированные в валюте страны-эмитента |  | 1,00 |  |
| 1.2 | ВЛА-2А, итого, в том числе: |  | X |  |
| 1.2.1 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами или центральными банками стран (выпуски ценных бумаг), имеющих (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "A+" до "A-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "A1" до "A3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), или полностью обеспеченные гарантиями указанных эмитентов в части ценных бумаг, не отраженных по строке 1.1.9 раздела 1 |  | 0,85 |  |
| 1.2.2 | долговые ценные бумаги, выпущенные организациями, которым в соответствии с законодательством стран, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "A+" до "A-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "A1" до "A3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, или полностью обеспеченные гарантиями указанных эмитентов |  | 0,85 |  |
| 1.2.3 | долговые ценные бумаги (за исключением облигаций с ипотечным покрытием), выпущенные нефинансовыми организациями (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "AAA" до "AA-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "Aaa" до "Aa3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), или не имеющими (не имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной рейтинговой шкале, присвоенный хотя бы одним иностранным кредитным рейтинговым агентством, и величина компонента кредитного риска в части оценки вероятности дефолта по которым, самостоятельно полученной банком с использованием банковских методик управления кредитными рисками и моделей количественной оценки кредитных рисков, соответствует вероятности дефолта ценных бумаг, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной рейтинговой шкале, присвоенный на уровне, указанном в настоящей строке |  | 0,85 |  |
| 1.2.4 | обеспеченные облигации, выпущенные банками или ипотечными организациями в соответствии с законодательством иностранного государства, предусматривающим защиту владельцев облигаций, исполнение обязательств по которым полностью обеспечено залогом ипотечного покрытия или иных активов, находящихся на балансе эмитента ценных бумаг (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "AAA" до "AA-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "Aaa" до "Aa3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), или не имеющими (не имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной рейтинговой шкале, присвоенный кредитными рейтинговыми агентствами, и оценки вероятности дефолта которых, самостоятельно полученные банком с использованием внутренних моделей, соответствуют вероятности дефолта ценных бумаг, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной рейтинговой шкале, присвоенный на уровне, указанном в настоящей строке |  | 0,85 |  |
| 1.2.5 | долговые ценные бумаги, исполнение обязательств по которым полностью обеспечено поручительством единого института развития в жилищной сфере, определенного в соответствии с частью 1 статьи 2 Федерального закона от 13 июля 2015 года N 225-ФЗ <1>, <2>, если ипотечное покрытие сформировано требованиями по ипотечным кредитам физических лиц, обеспеченным жилой недвижимостью, одно ипотечное покрытие обеспечивает только один выпуск таких ценных бумаг и эмитентом является ипотечный агент, 100 процентов акций (долей) уставного капитала которого принадлежат единому институту развития в жилищной сфере |  | 0,85 |  |
| 1.2.6 | номинированные в российских рублях облигации, выпущенные государственной корпорацией развития "ВЭБ.РФ" в соответствии с пунктом 3 части 4 статьи 3 Федерального закона N 82-ФЗ <3> |  | 0,85 |  |
| 1.3 | ВЛА-2Б, итого, в том числе: |  | X |  |
| 1.3.1 | жилищные облигации с ипотечным покрытием, выпущенные юридическими лицами - нерезидентами (кроме банков) (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "AAA" до "AA" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "Aaa" до "Aa2" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service) |  | 0,75 |  |

--------------------------------<1> Федеральный закон от 13 июля 2015 года N 225-ФЗ "О содействии развитию и повышению эффективности управления в жилищной сфере и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации" (далее - Федеральный закон N 225-ФЗ).<2> Далее - единый институт развития в жилищной сфере.<3> Федеральный закон от 17 мая 2007 года N 82-ФЗ "О государственной корпорации развития "ВЭБ.РФ" (далее - Федеральный закон N 82-ФЗ).

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.3.2 | долговые ценные бумаги (кроме облигаций с ипотечным покрытием), итого, в том числе: |  | 0,5 |  |
| 1.3.2.1 | долговые ценные бумаги, указанные в строке 1.2.3 раздела 1, но не включенные в расчет ВЛА-2А по причине несоответствия требованиям абзаца пятнадцатого пункта 2.6 Положения Банка России N 421-П <1> |  | 0,5 |  |
| 1.3.2.2 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами или центральными банками стран (выпуски ценных бумаг), имеющих (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "BBB+" до "BBB-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "Baa1" до "Baa3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), кроме долговых ценных бумаг, отраженных по строке 1.1.9 раздела 1 |  | 0,5 |  |
| 1.3.2.3 | долговые ценные бумаги (кроме облигаций с ипотечным покрытием), выпущенные нефинансовыми организациями (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "A+" до "BBB-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "A1" до "Baa3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service) |  | 0,5 |  |

--------------------------------<1> Положение Банка России от 30 мая 2014 года N 421-П "О порядке расчета показателя краткосрочной ликвидности ("Базель III")" (зарегистрировано Минюстом России 25 июня 2014 года, регистрационный N 32844) с изменениями, внесенными Указаниями Банка России от 25 ноября 2014 года N 3452-У (зарегистрировано Минюстом России 11 декабря 2014 года, регистрационный N 35134), от 1 декабря 2015 года N 3872-У (зарегистрировано Минюстом России 25 декабря 2015 года, регистрационный N 40282), от 6 июня 2019 года N 5164-У (зарегистрировано Минюстом России 2 сентября 2019 года, регистрационный N 55800), от 27 февраля 2020 года N 5404-У (зарегистрировано Минюстом России 31 марта 2020 года, регистрационный N 57915), от 11 октября 2021 года N 5971-У (зарегистрировано Минюстом России 26 ноября 2021 года, регистрационный N 65999) (далее - Положение Банка России N 421-П).

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.3.2.4 | долговые ценные бумаги (кроме облигаций с ипотечным покрытием), выпущенные нефинансовыми организациями (выпуски ценных бумаг), не имеющими (не имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной рейтинговой шкале, присвоенный хотя бы одним иностранным кредитным рейтинговым агентством, и оценки вероятности дефолта которых, самостоятельно полученные банком с использованием банковских методик управления кредитными рисками и моделей количественной оценки кредитных рисков, соответствуют вероятности дефолта ценных бумаг, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной рейтинговой шкале, присвоенный на уровне, указанном в строке 1.3.2.3 раздела 1 |  | 0,5 |  |
| 1.3.3 | обыкновенные акции, включенные организатором торговли (фондовой биржей) в списки для расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, а также фондовых индексов акций, указанных в приложении 6 к Инструкции Банка России N 199-И |  | 0,5 |  |
| 1.4 | ВК 15 | X | X |  |
| 1.5 | Итого ВЛА-2Б после корректировки | X | X |  |
| 1.6 | ВК 40 | X | X |  |
| 1.7 | Итого ВЛА-2 после корректировки | X | X |  |
| 2 | Ожидаемые оттоки денежных средств, итого, в том числе: | X | X |  |
| 2.1 | Ожидаемый отток денежных средств физических лиц, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.1.1 | стабильные средства физических лиц, итого, в том числе: |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.1 | денежные средства в рублях, кроме подлежащих отражению в строке 2.1.1.3 раздела 1, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.1.1.1.1 | на банковских счетах, на которые осуществляется перечисление заработной платы или иных выплат, связанных с выполнением трудовых обязанностей, итого, в том числе: |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.1.1.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.1.1.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.1.2 | на счетах физических лиц, имеющих установленные взаимоотношения с банком, итого, в том числе: |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.1.2.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.1.2.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.2 | денежные средства в отдельных иностранных валютах (в национальной валюте иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, в долларах США и евро), кроме подлежащих отражению в строке 2.1.1.3 раздела 1, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.1.1.2.1 | на банковских счетах, на которые осуществляется перечисление заработной платы или иных выплат, связанных с выполнением трудовых обязанностей, итого, в том числе: |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.2.1.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.2.1.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.2.2 | на счетах физических лиц, имеющих установленные взаимоотношения с банком, итого, в том числе: |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.2.2.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.2.2.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней |  | 0,05 |  |
| 2.1.1.3 | стабильные средства физических лиц, привлеченные филиалом банка, в случае если коэффициент оттока стабильных средств физических лиц, установленный центральным банком и (или) иным органом надзора иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, отличен от 5 процентов |  | X |  |
| 2.1.2 | нестабильные средства физических лиц, итого, в том числе: |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.1 | денежные средства, превышающие максимальный размер возмещения по вкладам при наступлении страхового случая, установленный Федеральным законом N 177-ФЗ <1> или законодательством иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, кроме подлежащих отражению в строке 2.1.2 раздела 1, итого, в том числе: |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.1.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.1.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.2 | прочие денежные средства физических лиц, кроме подлежащих отражению в строке 2.1.2.4 раздела 1, которые не могут быть отнесены к стабильным, в том числе средства на банковских счетах, открытие и управление которыми осуществляется только дистанционным способом, а также квалифицированных инвесторов и связанных с банком лиц, итого, в том числе: |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.2.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.2.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.3 | средства клиентов, кроме подлежащих отражению в строке 2.1.2.4 раздела 1, совокупная сумма которых превышает 5 миллионов рублей |  | 0,10 |  |
| 2.1.2.4 | средства физических лиц, привлеченные филиалом банка, в случае если коэффициент оттока нестабильных средств физических лиц, установленный центральным банком и (или) иным органом надзора иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, отличен от 10 процентов |  | X |  |
| 2.2 | Ожидаемый отток денежных средств клиентов, привлеченных без обеспечения, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.2.1 | депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.2.1.1 | стабильные депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса |  | 0,05 |  |
| 2.2.1.2 | нестабильные депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса |  | 0,10 |  |

--------------------------------<1> Федеральный закон от 23 декабря 2003 года N 177-ФЗ "О страховании вкладов в банках Российской Федерации" (далее - Федеральный закон N 177-ФЗ).

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 2.2.2 | операционные депозиты, итого, в том числе: |  | 0,25 |  |
| 2.2.2.1 | юридических лиц, за исключением финансовых организаций |  | 0,25 |  |
| 2.2.2.2 | финансовых организаций |  | 0,25 |  |
| 2.2.2.3 | Федерального казначейства и Банка России |  | 0,25 |  |
| 2.2.2.4 | субъектов Российской Федерации, муниципальных образований Российской Федерации, внебюджетных фондов Российской Федерации |  | 0,25 |  |
| 2.2.2.5 | правительств и центральных банков иностранных государств, организаций, которым в соответствии с законодательством их стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, международных банков развития |  | 0,25 |  |
| 2.2.3 | депозиты и прочие привлеченные средства юридических лиц (за исключением финансовых организаций) и государственных органов, итого, в том числе: |  | 0,40 |  |
| 2.2.3.1 | юридических лиц, за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса |  | 0,40 |  |
| 2.2.3.2 | Федерального казначейства и Банка России, а также центрального банка иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка |  | 0,40 |  |
| 2.2.3.3 | субъектов Российской Федерации, муниципальных образований Российской Федерации, внебюджетных фондов Российской Федерации |  | 0,40 |  |
| 2.2.3.4 | правительств иностранных государств, организаций, которым в соответствии с законодательством их стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, международных банков развития |  | 0,40 |  |
| 2.2.3.5 | средства субъектов малого бизнеса, не включенные в расчет ожидаемого оттока денежных средств клиентов, привлеченных без обеспечения, в соответствии с абзацами пятым - восьмым подпункта 3.3.5 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П |  | 0,40 |  |
| 2.2.4 | депозиты и прочие привлеченные денежные средства связанных с банком юридических лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П, за исключением финансовых организаций, Банка России, а также центрального банка иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка |  | 1,00 |  |
| 2.2.5 | прочие привлеченные денежные средства без обеспечения, итого, в том числе: |  | 1,00 |  |
| 2.2.5.1 | средства выгодоприобретателей банка |  | 1,00 |  |
| 2.2.5.2 | средства финансовых организаций |  | 1,00 |  |
| 2.2.5.3 | средства специализированных финансовых обществ (компаний специального назначения), кроме средств, привлеченных от юридических лиц в рамках размещения ценных бумаг в интересах банка |  | 1,00 |  |
| 2.2.5.4 | средства, привлеченные по выпущенным ценным бумагам (включая облигации и векселя), кроме сберегательных и депозитных сертификатов, а также средства, привлеченные от юридических лиц в рамках размещения ценных бумаг в интересах банка |  | 1,00 |  |
| 2.2.5.5 | средства, привлеченные банком в результате предоставления услуг по брокерскому обслуживанию |  | 1,00 |  |
| 2.2.5.6 | просроченная задолженность и просроченные проценты по кредитам, депозитам и прочим привлеченным средствам, прочие не исполненные в срок обязательства |  | 1,00 |  |
| 2.2.6 | средства, подлежащие депонированию на счетах по учету обязательных резервов и (или) внесению на корреспондентский счет (корреспондентские субсчета) банка в Банке России и уполномоченном органе (центральном банке) иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, в величине, необходимой для выполнения банком обязанности по выполнению обязательных резервных требований |  | 1,00 |  |
| 2.3 | Ожидаемый отток денежных средств, привлеченных под обеспечение активами банка, а также по договорам займа ценных бумаг, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.3.1 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка |  | 0,00 |  |
| 2.3.2 | обязательства банка по операциям с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, вне зависимости от вида предоставленного обеспечения, итого, в том числе: |  | 0,00 |  |
| 2.3.2.1 | денежные средства, привлеченные под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1 |  | 0,00 |  |
| 2.3.2.2 | денежные средства, привлеченные под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2 |  | 0,00 |  |
| 2.3.2.3 | денежные средства, привлеченные под обеспечение прочими активами |  | 0,00 |  |
| 2.3.3 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка |  | 0,15 |  |
| 2.3.4 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами (кроме ценных бумаг, удовлетворяющих критериям, предъявляемым к ВЛА-1 или ВЛА-2А), по операциям с Федеральным казначейством и международными банками развития |  | 0,25 |  |
| 2.3.5 | обязательства банка, обеспеченные жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, Федеральным казначейством и международными банками развития |  | 0,25 |  |
| 2.3.6 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, за исключением жилищных облигаций с ипотечным покрытием, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, Федеральным казначейством и международными банками развития |  | 0,50 |  |
| 2.3.7 | обязательства банка по операциям со связанными с банком юридическими лицами, определенными в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П, вне зависимости от вида ценных бумаг, предоставленных в обеспечение |  | 1,00 |  |
| 2.3.8 | прочие привлеченные средства под обеспечение активами, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, Федеральным казначейством и международными банками развития |  | 1,00 |  |
| 2.4 | Дополнительные ожидаемые оттоки денежных средств, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.4.1 | ожидаемый отток денежных средств по производным финансовым инструментам |  | 1,00 |  |
| 2.4.2 | оценка дополнительной потребности в ликвидности по обязательствам банка, производным финансовым инструментам и прочим договорам (контрактам), связанной со снижением рейтинга долгосрочной и краткосрочной кредитоспособности банка или с другими отлагательными условиями |  | 1,00 |  |
| 2.4.3 | оценка дополнительной потребности в ликвидности, связанной с потенциальным изменением стоимости предоставленного банком обеспечения |  | 1,00 |  |
| 2.4.4 | ожидаемый отток денежных средств, обусловленный правом клиента потребовать возврата части предоставленного банку обеспечения, входящего в единый пул обеспечения |  | 1,00 |  |
| 2.4.5 | ожидаемый отток денежных средств по операциям, предусматривающим предоставление банком обеспечения, которое контрагент имеет право потребовать в соответствии с условиями договора |  | 1,00 |  |
| 2.4.6 | ожидаемый отток денежных средств по операциям, условия которых предусматривают возможность замещения клиентами банка обеспечения на активы, соответствующие критериям высоколиквидных активов более низкого уровня и (или) не соответствующие критериям ВЛА-1, ВЛА-2А и ВЛА-2Б |  | 1,00 |  |
| 2.4.7 | дополнительная потребность в ликвидности (ожидаемые оттоки денежных средств), связанная с изменением рыночной стоимости производных финансовых инструментов |  | 1,00 |  |
| 2.4.8 | ожидаемый отток денежных средств, связанный с осуществлением платежей, установленных условиями выпуска ценных бумаг, обеспеченных поступлениями денежных средств по активам |  | 1,00 |  |
| 2.4.9 | ожидаемый отток денежных средств по ценным бумагам, обеспеченным активами и выпущенным специализированными финансовыми обществами в интересах банка |  | 1,00 |  |
| 2.4.10 | ожидаемый отток денежных средств по обязательствам банка по неиспользованным безотзывным и условно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.4.10.1 | кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные физическим лицам и субъектам малого бизнеса |  | 0,05 |  |
| 2.4.10.2 | кредитные линии, предоставленные юридическим лицам (за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса), правительствам и организациям, которым в соответствии с законодательством предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, центральным банкам и международным банкам развития |  | 0,10 |  |
| 2.4.10.3 | линии ликвидности, предоставленные юридическим лицам (за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса), правительствам и организациям, которым в соответствии с законодательством предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, центральным банкам и международным банкам развития |  | 0,30 |  |
| 2.4.10.4 | кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные кредитным организациям (в том числе банкам-нерезидентам) |  | 0,40 |  |
| 2.4.10.5 | кредитные линии, предоставленные финансовым организациям (кроме кредитных организаций, специализированных финансовых обществ, хедж-фондов и фондов денежного рынка) |  | 0,40 |  |
| 2.4.10.6 | линии ликвидности, предоставленные финансовым организациям (кроме кредитных организаций, специализированных финансовых обществ, хедж-фондов и фондов денежного рынка) |  | 1,00 |  |
| 2.4.10.7 | линии ликвидности и кредитные линии, предоставленные прочим клиентам |  | 1,00 |  |
| 2.4.11 | ожидаемый отток денежных средств по безусловно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности |  | 0,05 |  |
| 2.4.12 | ожидаемый отток денежных средств по условным обязательствам кредитного характера банка по предоставлению денежных средств на проведение сделок торгового финансирования |  | 0,05 |  |
| 2.4.13 | ожидаемый отток денежных средств по предоставленным гарантиям и поручительствам, а также аккредитивам, не относящимся к торговому финансированию |  | 0,10 |  |
| 2.4.14 | прочие обязательства банка, установленные условиями договора, по предоставлению средств в ближайшие 30 календарных дней, итого, в том числе: | X | X |  |
| 2.4.14.1 | обязательства по предоставлению денежных средств финансовым организациям, центральным (национальным) банкам |  | 1,00 |  |
| 2.4.14.2 | обязательства по предоставлению средств клиентам (кроме финансовых организаций, центральных (национальных) банков и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П), в том числе: |  | X | X |
| 2.4.14.2.1 | обязательства по предоставлению денежных средств физическим лицам |  | X | X |
| 2.4.14.2.2 | обязательства по предоставлению денежных средств субъектам малого бизнеса |  | X | X |
| 2.4.14.2.3 | обязательства по предоставлению денежных средств нефинансовым организациям |  | X | X |
| 2.4.14.2.4 | обязательства по предоставлению денежных средств прочим клиентам |  | X | X |
| 2.4.14.3 | величина превышения обязательств по предоставлению средств клиентам (кроме финансовых организаций, центральных (национальных) банков и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П) над величиной притоков денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций, центральных (национальных) банков и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П), установленных условиями договора, не включенной в расчет ожидаемых притоков денежных средств |  | 1,00 |  |
| 2.4.14.4 | обязательства по предоставлению средств связанным с банком лицам, определенным в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П (кроме финансовых организаций и центральных (национальных) банков) |  | 1,00 |  |
| 2.4.15 | оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, по предоставлению средств связанным с банком юридическим лицам, определенным в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П |  | 1,00 |  |
| 2.4.16 | оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, по предоставлению средств по заключенному в соответствии с российским или иностранным правом договору, предметом которого является осуществление юридическими лицами совместных действий без образования юридического лица для извлечения прибыли или достижения иной цели, или по предоставлению средств юридическим лицам, на деятельность которых банк прямо или косвенно оказывает существенное влияние, а также в уставном капитале которых банк имеет миноритарные (неконсолидированные) доли участия |  | 1,00 |  |
| 2.4.17 | иные оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, итого, в том числе: |  | X |  |
| 2.4.17.1 | оценочные обязательства, проистекающие из потенциальных требований к банку по досрочному выкупу выпущенных долговых обязательств (включая облигации и векселя) или досрочному погашению (частичному погашению) обязательств, возникающих в рамках размещения долговых ценных бумаг в интересах банка |  | 1,00 |  |
| 2.4.17.2 | оценочные обязательства по досрочному выкупу собственных долговых ценных бумаг сроком до погашения свыше 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ у финансовых организаций - профессиональных участников рынка ценных бумаг, являющихся связанными с банком лицами |  | 1,00 |  |
| 2.4.17.3 | оценочные обязательства, связанные с деятельностью банка по управлению активами |  | 1,00 |  |
| 2.4.17.4 | оценочные обязательства по покрытию коротких позиций клиентов за счет обеспечения, предоставленного другими клиентами |  | 1,00 |  |
| 2.4.17.5 | прочие оценочные обязательства (оттоки) |  | 1,00 |  |
| 2.4.18 | ожидаемые оттоки денежных средств в ближайшие 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, не включенные в другие категории оттоков денежных средств |  | 1,00 |  |
| 3 | Ожидаемые притоки денежных средств, итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.1 | Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение ценными бумагами, включая операции обратного репо, итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.1.1 | ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение ценными бумагами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), в случае если полученные в обеспечение ценные бумаги не были реализованы или переданы в обеспечение по привлеченным средствам, итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.1.1.1 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1 |  | 0,00 |  |
| 3.1.1.2 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А |  | 0,15 |  |
| 3.1.1.3 | под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б |  | 0,25 |  |
| 3.1.1.4 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием |  | 0,50 |  |
| 3.1.1.5 | под обеспечение прочими ценными бумагами |  | 1,00 |  |
| 3.1.1.6 | требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение ценными бумагами, не относящимися к ВЛА-1 и ВЛА-2 |  | 0,50 |  |
| 3.1.2 | ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение ценными бумагами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), в случае проведения операций с данными ценными бумагами, что приводит к формированию собственных коротких позиций, итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.1.2.1 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1 |  | 0,00 |  |
| 3.1.2.2 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А |  | 0,00 |  |
| 3.1.2.3 | под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б |  | 0,00 |  |
| 3.1.2.4 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием |  | 0,00 |  |
| 3.1.2.5 | под обеспечение прочими ценными бумагами |  | 0,00 |  |
| 3.1.2.6 | требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение ценными бумагами, не относящимися к ВЛА-1 и ВЛА-2 |  | 0,00 |  |
| 3.2 | Притоки денежных средств по прочим операциям размещения средств, установленные условиями договора, в зависимости от вида контрагента, итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.2.1 | поступления от операций с финансовыми организациями, итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.2.1.1 | от операций размещения операционных депозитов |  | 0,00 |  |
| 3.2.1.2 | от операций по предоставлению средств связанным с банком финансовым организациям |  | 1,00 |  |
| 3.2.1.3 | от прочих операций размещения денежных средств |  | 1,00 |  |
| 3.2.2 | ожидаемый приток денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П), итого, в том числе: |  | X |  |
| 3.2.2.1 | ожидаемый приток денежных средств от физических лиц |  | 0,50 |  |
| 3.2.2.2 | ожидаемый приток денежных средств от субъектов малого бизнеса |  | 0,50 |  |
| 3.2.2.3 | ожидаемый приток денежных средств от юридических лиц, за исключением субъектов малого бизнеса |  | 0,50 |  |
| 3.2.2.4 | ожидаемый приток денежных средств от Банка России и иностранных центральных (национальных) банков |  | 1,00 |  |
| 3.2.2.5 | ожидаемый приток денежных средств по операциям с прочими клиентами, Министерством финансов Российской Федерации, субъектами Российской Федерации, муниципальными образованиями Российской Федерации, внебюджетными фондами Российской Федерации, правительствами, международными банками развития, а также организациями, которым в соответствии с законодательством их стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства |  | 0,50 |  |
| 3.2.3 | ожидаемый приток денежных средств по операциям со связанными с банком лицами (кроме финансовых организаций), определенными в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П |  | 0,50 |  |
| 3.3 | Поступления денежных средств в течение срока, не превышающего 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, от ценных бумаг, не включенных в ВЛА-1 и ВЛА-2 |  | 1,00 |  |
| 3.4 | Ожидаемый приток денежных средств по производным финансовым инструментам |  | 1,00 |  |
| 3.5 | Прочие ожидаемые притоки денежных средств (иные притоки денежных средств, установленные условиями договора) |  | 1,00 |  |
| 4 | Ожидаемый приток денежных средств после применения ограничения на максимальную допустимую величину | X | X |  |
| 5 | Чистый ожидаемый отток денежных средств (ЧООДС) | X | X |  |
| 6 | ПКЛ | X | X |  |

|  |  |
| --- | --- |
| Раздел 2. | Дополнительная информация к расчету показателя краткосрочной ликвидности |

 |
|  тыс. руб.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Номер строки | Наименование ~~статьи~~ | Величина денежных средств |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Величина ВЛА-1скорр |  |
| 2 | Величина ВЛА-2Аскорр |  |
| 3 | Величина ВЛА-2Бскорр |  |
| 4 | Оценочная величина денежных средств, которые могут быть привлечены от Банка России по операциям рефинансирования под обеспечение активами (с учетом поправочных коэффициентов, применяемых Банком России) в соответствии с ~~Условиями~~ рефинансирования кредитных организаций под обеспечение, итого, в том числе: |  |
| 4.1 | под обеспечение ценными бумагами |  |
| 4.2 | под обеспечение правами требования по кредитным договорам |  |
| 4.3 | под обеспечение иными активами |  |
| 5 | Величина лимита безотзывной кредитной линии, определенная в соответствии с договором об открытии безотзывной кредитной линии, уменьшенная на стоимость активов (с учетом поправочных коэффициентов, применяемых Банком России), использованных для расчета величины лимита безотзывной кредитной линии и включенных кредитной организацией в расчет высоколиквидных активов |  |
| 6 | Стоимость активов, которые могут быть использованы кредитной организацией в качестве обеспечения по кредиту Банка России (без умножения на соответствующие поправочные коэффициенты, установленные Банком России) в соответствии с ~~Условиями~~ рефинансирования кредитных организаций под обеспечение, итого, в том числе: |  |
| 6.1 | ценные бумаги |  |
| 6.2 | права требования по кредитным договорам |  |
| 6.3 | иные активы |  |
| 7 | Величина активов, соответствующих всем критериям высоколиквидных активов, но не включенных в расчет ПКЛ в связи с превышением величины активов, номинированных в соответствующей иностранной валюте, над величиной чистых ожидаемых оттоков денежных средств в той же иностранной валюте, в соответствии с пунктом 2.9 Положения Банка России N 421-П, итого, в том числе: |  |
| 7.1 | ВЛА-1, не включенные в расчет ПКЛ |  |
| 7.2 | ВЛА-2А, не включенные в расчет ПКЛ |  |
| 7.3 | ВЛА-2Б, не включенные в расчет ПКЛ |  |
| 8 | Величина вложений в активы, исключенные из расчета числителя ПКЛ в связи с невыполнением условий, установленных пунктом 2.1 Положения Банка России N 421-П |  |

Должностное лицо, уполномоченное подписывать Отчет (~~Ф.И.О.~~)Исполнитель (~~Ф.И.О.~~)Телефон:"\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ г. |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Номер строки | Наименование показателя | Величина денежных средств, тыс. руб. |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Величина ВЛА-1скорр |  |
| 2 | Величина ВЛА-2Аскорр |  |
| 3 | Величина ВЛА-2Бскорр |  |
| 4 | Оценочная величина денежных средств, которые могут быть привлечены от Банка России по операциям рефинансирования под обеспечение активами (с учетом поправочных коэффициентов, применяемых Банком России) в соответствии с условиями рефинансирования кредитных организаций под обеспечение <1>, итого, в том числе: |  |
| 4.1 | под обеспечение ценными бумагами |  |
| 4.2 | под обеспечение правами требования по кредитным договорам |  |
| 4.3 | под обеспечение иными активами |  |
| 5 | Величина лимита безотзывной кредитной линии, определенная в соответствии с договором об открытии безотзывной кредитной линии, уменьшенная на стоимость активов (с учетом поправочных коэффициентов, применяемых Банком России), использованных для расчета величины лимита безотзывной кредитной линии и включенных кредитной организацией в расчет высоколиквидных активов |  |
| 6 | Стоимость активов, которые могут быть использованы кредитной организацией в качестве обеспечения по кредиту Банка России (без умножения на соответствующие поправочные коэффициенты, установленные Банком России) в соответствии с условиями рефинансирования кредитных организаций под обеспечение, итого, в том числе: |  |
| 6.1 | ценные бумаги |  |
| 6.2 | права требования по кредитным договорам |  |
| 6.3 | иные активы |  |
| 7 | Величина активов, соответствующих всем критериям высоколиквидных активов, но не включенных в расчет ПКЛ в связи с превышением величины активов, номинированных в соответствующей иностранной валюте, над величиной чистых ожидаемых оттоков денежных средств (ЧООДС) в той же иностранной валюте, в соответствии с пунктом 2.9 Положения Банка России N 421-П, итого, в том числе: |  |
| 7.1 | ВЛА-1, не включенные в расчет ПКЛ |  |
| 7.2 | ВЛА-2А, не включенные в расчет ПКЛ |  |
| 7.3 | ВЛА-2Б, не включенные в расчет ПКЛ |  |
| 8 | Величина вложений в активы, исключенные из расчета числителя ПКЛ в связи с невыполнением условий, установленных пунктом 2.1 Положения Банка России N 421-П |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Должностное лицо,уполномоченное подписывать Отчет |  |  |  |  |
| (должность) |  | (подпись) |  | (фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Исполнитель: |  |  |
|  |  | (фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) |
| Телефон:"\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_ г. |

 |
|  | --------------------------------<1> Предусмотрены Указанием Банка России от 15 сентября 2021 года N 5930-У "О форме и условиях рефинансирования кредитных организаций под обеспечение" (зарегистрировано Минюстом России 18 октября 2021 года, регистрационный N 65458) с изменениями, внесенными Указанием Банка России от 21 марта 2022 года N 6091-У (зарегистрировано Минюстом России 29 марта 2022 года, регистрационный N 67968). |
| Порядоксоставления и представления отчетности по форме 0409122"Расчет показателя краткосрочной ликвидности("Базель III")"1. Отчетность по форме 0409122 "Расчет показателя краткосрочной ликвидности ("Базель III")" (далее - Отчет) составляется в соответствии с Положением Банка России ~~от 30 мая 2014 года~~ N 421-П ~~"О порядке расчета показателя краткосрочной ликвидности ("Базель III")", зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 25 июня 2014 года N 32844, 11 декабря 2014 года N 35134, 25 декабря 2015 года N 40282, 2 сентября 2019 года N 55800, 31 марта 2020 года N 57915 (далее - Положение Банка России N 421-П),~~ и заполняется с учетом ~~приведенных ниже~~ таблиц. | Порядоксоставления и представления отчетности по форме 0409122"Расчет показателя краткосрочной ликвидности ("Базель III")"1. Отчетность по форме 0409122 "Расчет показателя краткосрочной ликвидности ("Базель III")" (далее - Отчет) составляется в соответствии с Положением Банка России N 421-П и заполняется с учетом следующих таблиц: |
| Раздел 1. Информация о компонентах расчета показателя краткосрочной ликвидности ~~(далее - ПКЛ)~~

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Номер строки | Наименование показателя | Пункт (подпункт) Положения Банка России N 421-П или иной алгоритм, в соответствии с ~~которым~~ производится заполнение ~~строки~~ |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Высоколиквидные активы, скорректированные с учетом ограничений на структуру высоколиквидных активов (ВЛА - ВК), итого, в том числе: | Сумма строк 1.1 и 1.7 |
| 1.1 | ВЛА-1, итого, в том числе: | Сумма строк 1.1.1 - 1.1.9 |
| 1.1.1 | наличная валюта | 2.5.1 |
| 1.1.2 | средства на счетах кредитных организаций (филиалов) по кассовому обслуживанию структурных подразделений, а также средства для кассового обслуживания кредитных организаций (филиалов), которое осуществляется не по месту открытия корреспондентского счета (субсчета) | 2.5.1 |
| 1.1.3 | средства в Банке России и в уполномоченных органах других стран, в том числе суммы, депонированные в Банке России и центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, для получения следующим днем наличных денежных средств, средства на корреспондентском счете (корреспондентских счетах) в Банке России и в центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, средства на депозитных счетах в Банке России с оставшимся сроком до погашения один календарный день, средства на депозитных счетах в центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, до востребования и с оставшимся сроком до погашения один календарный день и требования к Банку России и центральному банку иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, со сроком исполнения не позднее чем на следующий календарный день по получению начисленных (накопленных) процентов по указанным счетам, суммы переплаты, подлежащие возврату банку со счетов по учету обязательных резервов в Банке России и в центральных банках (уполномоченных органах) иностранного государства, если возврат средств должен быть осуществлен не позднее следующего календарного дня с даты расчета ПКЛ, а также средства на счетах по учету обязательных резервов (их часть) в центральных банках (уполномоченных органах) иностранных государств, если банку (филиалу банка) предоставлено право обращаться в соответствующий центральный банк (уполномоченный орган) иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, за возвратом указанных средств (их части) и возврат средств (их части) осуществляется не позднее следующего календарного дня с даты расчета ПКЛ | 2.5.2 |
| 1.1.4 | средства на депозитных счетах в центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, с оставшимся сроком до погашения более одного календарного дня, если банку (филиалу банка) предоставлено право обращаться в соответствующий центральный банк иностранного государства с требованием о досрочном возврате депозита при условии, что возврат депозита осуществляется не позднее следующего календарного дня с даты расчета ПКЛ, требования к центральному банку иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, со сроком исполнения не позднее чем на следующий календарный день по получению начисленных (накопленных) процентов по указанным счетам | 2.5.2 |
| 1.1.5 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами~~,~~ центральными банками стран, имеющих ~~страновую оценку "0" или "1", а также стран с высоким уровнем доходов, являющихся членами ОЭСР и (или) Еврозоны~~, международными финансовыми организациями и международными банками развития, ~~требования к которым отнесены в I группу активов,~~ или полностью обеспеченные гарантиями ~~(банковскими гарантиями)~~ указанных эмитентов | 2.5.3 |
| 1.1.6 | долговые ценные бумаги, выпущенные организациями, которым в соответствии с законодательством стран, имеющих ~~страновую оценку "0" или "1", а также стран с высоким уровнем доходов, являющихся членами ОЭСР и (или) Еврозоны~~, предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, или полностью обеспеченные гарантиями указанных эмитентов | 2.5.3 |
| 1.1.7 | долговые ценные бумаги, номинированные в рублях, выпущенные Правительством Российской Федерации или Банком России | 2.5.3 |
| 1.1.8 | долговые ценные бумаги, номинированные в иностранной валюте, выпущенные Правительством Российской Федерации или Банком России | 2.5.3 |
| 1.1.9 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами~~,~~ центральными банками стран, не ~~имеющих страновую оценку "0" или "1", а также не являющихся странами с высоким уровнем доходов, являющимися членами ОЭСР и (или) Еврозоны~~, номинированные в валюте страны-эмитента | 2.5.3 |
| 1.2 | ВЛА-2А, итого, в том числе: | Сумма строк 1.2.1 - 1.2.~~4~~ |
| 1.2.1 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами~~,~~ центральными банками стран, имеющих ~~страновую оценку "2", в части ценных бумаг, не отраженных по строке 1.1.9 настоящей таблицы, и международными банками развития, требования к которым отнесены во II группу активов~~, или полностью обеспеченные гарантиями ~~(банковскими гарантиями)~~ указанных эмитентов | 2.6, 2.5.3 |
| 1.2.2 | долговые ценные бумаги, выпущенные организациями, которым в соответствии с законодательством стран, имеющих ~~страновую оценку "2"~~, предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, или полностью обеспеченные гарантиями указанных эмитентов | 2.6 |
| 1.2.3 | долговые ценные бумаги (~~кроме~~ облигаций с ипотечным покрытием), выпущенные нефинансовыми организациями (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности ~~по международной шкале~~, присвоенный ~~рейтинговыми агентствами на уровне не ниже "AA-" по классификации~~ рейтинговых агентств Эс~~-~~энд~~-~~Пи Глобал Рейтингс (S&P Global Ratings) или Фитч Рейтингс (Fitch Ratings) либо "Aa3" по ~~классификации рейтингового агентства~~ Мудис Инвесторс Сервис (Moody's Investors Service) | 2.6 |
| 1.2.4 | обеспеченные облигации, выпущенные банками или ипотечными организациями в соответствии с законодательством иностранного государства, предусматривающим защиту владельцев облигаций, исполнение обязательств по которым полностью обеспечено залогом ипотечного покрытия или иных активов, находящихся на балансе эмитента ценных бумаг (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности ~~по международной шкале~~, присвоенный ~~рейтинговыми агентствами на уровне не ниже "AA-" по классификации~~ рейтинговых агентств Эс~~-~~энд~~-~~Пи Глобал Рейтингс (S&P Global Ratings) или Фитч Рейтингс (Fitch Ratings) либо "Aa3" по ~~классификации рейтингового агентства~~ Мудис Инвесторс Сервис (Moody's Investors Service) | 2.6 |
| 1.3 | ВЛА-2Б, итого, в том числе: | Сумма строк 1.3.1 - 1.3.3 |
| 1.3.1 | жилищные облигации с ипотечным покрытием, выпущенные юридическими лицами - нерезидентами (кроме банков) (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности ~~по международной шкале~~, присвоенный ~~рейтинговыми агентствами на уровне не ниже "AA" по классификации~~ рейтинговых агентств Эс~~-~~энд~~-~~Пи Глобал Рейтингс (S&P Global Ratings) или Фитч Рейтингс (Fitch Ratings) либо "Aa2" по ~~классификации рейтингового агентства~~ Мудис Инвесторс Сервис (Moody's Investors Service) | 2.7.1 |
| 1.3.2 | долговые ценные бумаги (кроме облигаций с ипотечным покрытием), выпущенные нефинансовыми организациями (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности ~~по международной шкале~~, присвоенный ~~рейтинговыми агентствами~~ на уровне от "A+" до "BBB-" по ~~классификации рейтинговых агентств~~ Эс~~-~~энд~~-~~Пи Глобал Рейтингс (S&P Global Ratings) или Фитч Рейтингс (Fitch Ratings) либо от "A1" до "Baa3" по ~~классификации рейтингового агентства~~ Мудис Инвесторс Сервис (Moody's Investors Service) | 2.7.2 |
| 1.3.3 | обыкновенные акции, включенные организатором торговли (фондовой биржей) в списки для расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, а также индексов акций, указанных в приложении 6 к Инструкции Банка России ~~от 29 ноября 2019 года~~ N 199-И ~~"Об обязательных нормативах и надбавках к нормативам достаточности капитала банков с универсальной лицензией" <1> (далее - Инструкция Банка России N 199-И)~~ | 2.7.3 |
| 1.4 | ВК 15 | 2.12 |
| 1.5 | Итого ВЛА-2Б после корректировки | Строка 1.3 минус строка 1.4 |
| 1.6 | ВК 40 | 2.12 |
| 1.7 | Итого ВЛА-2 после корректировки | Сумма строк 1.2 и 1.5 минус строка 1.6 |
| 2 | Ожидаемые оттоки денежных средств, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1, 2.2, 2.3 и 2.4 |
| 2.1 | Ожидаемый отток денежных средств физических лиц, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1 и 2.1.2 |
| 2.1.1 | стабильные средства физических лиц, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.1 ~~и~~ 2.1.1.~~2~~ |
| 2.1.1.1 | денежные средства в рублях, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.1.1 и 2.1.1.1.2 |
| 2.1.1.1.1 | на банковских счетах, на которые осуществляется перечисление заработной платы или иных выплат, связанных с выполнением трудовых обязанностей, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.1.1.1 и 2.1.1.1.1.2 |
| 2.1.1.1.1.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.1.1.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.1.2 | на счетах физических лиц, имеющих установленные взаимоотношения с банком, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.1.2.1 и 2.1.1.1.2.2 |
| 2.1.1.1.2.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.1.2.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.2 | денежные средства в отдельных иностранных валютах (в долларах США и евро), итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.2.1 и 2.1.1.2.2 |
| 2.1.1.2.1 | на банковских счетах, на которые осуществляется перечисление заработной платы или иных выплат, связанных с выполнением трудовых обязанностей, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.2.1.1 и 2.1.1.2.1.2 |
| 2.1.1.2.1.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.2.1.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней | 3.2.3 |

~~--------------------------------~~~~<1> Зарегистрирована Министерством юстиции Российской Федерации 27 декабря 2019 года N 57008, 31 марта 2020 года N 57913.~~

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| ~~1~~ | ~~2~~ | ~~3~~ |
| 2.1.1.2.2 | на счетах физических лиц, имеющих установленные взаимоотношения с банком, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.2.2.1 и 2.1.1.2.2.2 |
| 2.1.1.2.2.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.2.2.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.2 | нестабильные средства физических лиц, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.2.1~~,~~ 2.1.2.~~2, 2.1.2.3~~ |
| 2.1.2.1 | денежные средства, превышающие максимальный размер возмещения по вкладам при наступлении страхового случая, установленный Федеральным законом ~~от 23 декабря 2003 года~~ N 177-ФЗ ~~"О страховании вкладов в банках Российской Федерации" <1> (далее - Федеральный закон N 177-ФЗ)~~, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.2.1.1 и 2.1.2.1.2 |
| 2.1.2.1.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней | 3.2.4 |
| 2.1.2.1.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней | 3.2.4 |
| 2.1.2.2 | прочие денежные средства физических лиц, которые не могут быть отнесены к стабильным, в том числе средства на банковских счетах, открытие и управление которыми осуществляется только дистанционным способом, квалифицированных инвесторов~~,~~ и связанных с банком лиц, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.2.2.1 и 2.1.2.2.2 |
| 2.1.2.2.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней | 3.2.4 |
| 2.1.2.2.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней | 3.2.4 |
| 2.1.2.3 | средства клиентов, совокупная сумма которых превышает ~~пять~~ миллионов рублей | 3.2.4 |
| 2.2 | Ожидаемый отток денежных средств клиентов, привлеченных без обеспечения, итого, в том числе: | Сумма строк 2.2.1, 2.2.2, 2.2.3, 2.2.4, 2.2.5 и 2.2.6 |
| 2.2.1 | депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса, итого, в том числе: | Сумма строк 2.2.1.1 и 2.2.1.2 |
| 2.2.1.1 | стабильные депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса | 3.3.5 |
| 2.2.1.2 | нестабильные депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса | 3.3.5 |

~~--------------------------------~~~~<1> Собрание законодательства Российской Федерации, 2003, N 52, ст. 5029; "Официальный интернет-портал правовой информации" (www.pravo.gov.ru), 7 апреля 2020 года).~~

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| ~~1~~ | ~~2~~ | ~~3~~ |
| 2.2.2 | операционные депозиты, итого, в том числе: | Сумма строк 2.2.2.1 - 2.2.2.5 |
| 2.2.2.1 | юридических лиц, за исключением финансовых организаций | 3.3.6 - 3.3.9 |
| 2.2.2.2 | финансовых организаций | 3.3.6 - 3.3.9 |
| 2.2.2.3 | Федерального казначейства и Банка России | 3.3.6 - 3.3.9 |
| 2.2.2.4 | субъектов Российской Федерации, муниципальных образований Российской Федерации, внебюджетных фондов Российской Федерации | 3.3.6 - 3.3.9 |
| 2.2.2.5 | правительств и центральных банков иностранных государств, организаций, которым в соответствии с законодательством их стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, международных банков развития | 3.3.6 - 3.3.9 |
| 2.2.3 | депозиты и прочие привлеченные средства юридических лиц (за исключением финансовых организаций) и государственных органов, итого, в том числе: | Сумма строк 2.2.3.1 - 2.2.3.5 |
| 2.2.3.1 | юридических лиц, за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса | 3.3.11 |
| 2.2.3.2 | Федерального казначейства и Банка России, а также центрального банка иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка | 3.3.11 |
| 2.2.3.3 | субъектов Российской Федерации, муниципальных образований Российской Федерации, внебюджетных фондов Российской Федерации | 3.3.11 |
| 2.2.3.4 | правительств иностранных государств, ~~международных банков развития,~~ организаций, которым в соответствии с законодательством их стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства | 3.3.11 |
| 2.2.3.5 | средства субъектов малого бизнеса, не включенные в расчет ожидаемого оттока денежных средств клиентов, привлеченных без обеспечения, в соответствии с абзацами пятым - восьмым подпункта 3.3.5 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П | 3.3.11, абзацы пятый - восьмой подпункта 3.3.5 |
| 2.2.4 | депозиты и прочие привлеченные денежные средства связанных с банком юридических лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П, за исключением финансовых организаций, Банка России, а также центрального банка иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка | 3.3.12 |
| 2.2.5 | прочие привлеченные денежные средства без обеспечения, итого, в том числе: | Сумма строк 2.2.5.1 - 2.2.5.6 |
| 2.2.5.1 | средства выгодоприобретателей банка | 3.3.13 |
| 2.2.5.2 | средства финансовых организаций | 3.3.13 |
| 2.2.5.3 | средства специализированных финансовых обществ (компаний специального назначения), кроме средств, привлеченных от юридических лиц в рамках размещения ценных бумаг в интересах банка | 3.3.13 |
| 2.2.5.4 | средства, привлеченные по выпущенным ценным бумагам (включая облигации и векселя), кроме сберегательных и депозитных сертификатов, а также средства, привлеченные от юридических лиц в рамках размещения ценных бумаг в интересах банка | 3.3.13 |
| 2.2.5.5 | средства, привлеченные банком в результате предоставления услуг по брокерскому обслуживанию | 3.3.13 |
| 2.2.5.6 | просроченная задолженность и просроченные проценты по кредитам, депозитам и прочим привлеченным средствам, прочие не исполненные в срок обязательства | 3.3.13 |
| 2.2.6 | средства, подлежащие депонированию на счетах по учету обязательных резервов и (или) внесению на корреспондентский счет (корреспондентские субсчета) банка в Банке России и уполномоченном органе (центральном банке) иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, в величине, необходимой для выполнения банком обязанности по выполнению обязательных резервных требований | 3.3.14 |
| 2.3 | Ожидаемый отток денежных средств, привлеченных под обеспечение активами банка, а также по договорам займа ценных бумаг, итого, в том числе: | Сумма строк 2.3.1 - 2.3.8 |
| 2.3.1 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка | 3.4.5 (строка 1 таблицы) |
| 2.3.2 | обязательства банка по операциям с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, вне зависимости от вида предоставленного обеспечения, итого, в том числе: | Сумма строк 2.3.2.1 - 2.3.2.3 |
| 2.3.2.1 | денежные средства, привлеченные под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1 | 3.4.5 (строка 2 таблицы) |
| 2.3.2.2 | денежные средства, привлеченные под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2 | 3.4.5 (строка 2 таблицы) |
| 2.3.2.3 | денежные средства, привлеченные под обеспечение прочими активами | 3.4.5 (строка 2 таблицы) |
| 2.3.3 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка | 3.4.5 (строка 3 таблицы) |
| 2.3.4 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами (кроме ценных бумаг, удовлетворяющих критериям, предъявляемым к ВЛА-1 или ВЛА-2А), по операциям с Федеральным казначейством и международными банками развития | 3.4.5 (строка 4 таблицы) |
| 2.3.5 | обязательства банка, обеспеченные жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, Федеральным казначейством и международными банками развития | 3.4.5 (строка 5 таблицы) |
| 2.3.6 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, за исключением жилищных облигаций с ипотечным покрытием, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, Федеральным казначейством и международными банками развития | 3.4.5 (строка 6 таблицы) |
| 2.3.7 | обязательства банка по операциям со связанными с банком юридическими лицами, определенными в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П, вне зависимости от вида ценных бумаг, предоставленных в обеспечение | 3.4.5 (строка 7 таблицы), 3.3.12 |
| 2.3.8 | прочие привлеченные средства под обеспечение активами, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, Федеральным казначейством и международными банками развития | 3.4.5 (строка 8 таблицы) |
| 2.4 | Дополнительные ожидаемые оттоки денежных средств, итого, в том числе: | Сумма строк 2.4.1 - 2.4.18 |
| 2.4.1 | ожидаемый отток денежных средств по производным финансовым инструментам | 3.5.1 - 3.5.3 |
| 2.4.2 | оценка дополнительной потребности в ликвидности по обязательствам банка, производным финансовым инструментам и прочим договорам (контрактам), связанной со снижением рейтинга долгосрочной и краткосрочной кредитоспособности банка или с другими отлагательными условиями | 3.5.4 |
| 2.4.3 | оценка дополнительной потребности в ликвидности, связанной с потенциальным изменением стоимости предоставленного банком обеспечения | 3.5.5 |
| 2.4.4 | ожидаемый отток денежных средств, обусловленный правом клиента потребовать возврата части предоставленного банку обеспечения, входящего в единый пул обеспечения | 3.5.6 |
| 2.4.5 | ожидаемый отток денежных средств по операциям, предусматривающим предоставление банком обеспечения, которое контрагент имеет право потребовать в соответствии с условиями договора | 3.5.7 |
| 2.4.6 | ожидаемый отток денежных средств по операциям, условия которых предусматривают возможность замещения клиентами банка обеспечения на активы, соответствующие критериям высоколиквидных активов более низкого уровня и (или) не соответствующие критериям ВЛА-1, ВЛА-2А и ВЛА-2Б | 3.5.8 |
| 2.4.7 | дополнительная потребность в ликвидности (ожидаемые оттоки денежных средств), связанная с изменением рыночной стоимости производных финансовых инструментов | 3.5.9 |
| 2.4.8 | ожидаемый отток денежных средств, связанный с осуществлением платежей, установленных условиями выпуска ценных бумаг, обеспеченных поступлениями денежных средств по активам | 3.5.10 |
| 2.4.9 | ожидаемый отток денежных средств по ценным бумагам, обеспеченным активами и выпущенным специализированными финансовыми обществами в интересах банка | 3.5.11 |
| 2.4.10 | ожидаемый отток денежных средств по обязательствам банка по неиспользованным безотзывным и условно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности, итого, в том числе: | Сумма строк 2.4.10.1 - 2.4.10.7 |
| 2.4.10.1 | кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные физическим лицам и субъектам малого бизнеса | 3.5.15 (строка 1 таблицы) |
| 2.4.10.2 | кредитные линии, предоставленные юридическим лицам (за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса), правительствам и организациям, которым в соответствии с законодательством предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, центральным банкам и международным банкам развития | 3.5.15 (строка 2 таблицы) |
| 2.4.10.3 | линии ликвидности, предоставленные юридическим лицам (за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса), правительствам и организациям, которым в соответствии с законодательством предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, центральным банкам и международным банкам развития | 3.5.15 (строка 3 таблицы) |
| 2.4.10.4 | кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные кредитным организациям (в том числе банкам-нерезидентам) | 3.5.15 (строка 4 таблицы) |
| 2.4.10.5 | кредитные линии, предоставленные финансовым организациям (кроме кредитных организаций, специализированных финансовых обществ, хедж-фондов и фондов денежного рынка) | 3.5.15 (строка 5 таблицы) |
| 2.4.10.6 | линии ликвидности, предоставленные финансовым организациям (кроме кредитных организаций, специализированных финансовых обществ, хедж-фондов и фондов денежного рынка) | 3.5.15 (строка 6 таблицы) |
| 2.4.10.7 | линии ликвидности и кредитные линии, предоставленные прочим клиентам | 3.5.15 (строка 7 таблицы) |
| 2.4.11 | ожидаемый отток денежных средств по безусловно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности | 3.5.16 |
| 2.4.12 | ожидаемый отток денежных средств по условным обязательствам кредитного характера банка по предоставлению денежных средств на проведение сделок торгового финансирования | 3.5.17 |
| 2.4.13 | ожидаемый отток денежных средств по предоставленным гарантиям и поручительствам, а также аккредитивам, не относящимся к торговому финансированию | 3.5.18 |
| 2.4.14 | прочие обязательства банка, установленные условиями договора, по предоставлению средств в ближайшие 30 календарных дней, итого, в том числе: | Сумма строк 2.4.14.1, 2.4.14.3 и 2.4.14.4 |
| 2.4.14.1 | обязательства по предоставлению денежных средств финансовым организациям, центральным (национальным) банкам | 3.5.19 |
| 2.4.14.2 | обязательства по предоставлению средств клиентам (кроме финансовых организаций, центральных (национальных) банков и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П), в том числе: | Сумма строк 2.4.14.2.1 - 2.4.14.2.4, подпункт 3.3.12 |
| 2.4.14.2.1 | обязательства по предоставлению денежных средств физическим лицам | 3.5.19 |
| 2.4.14.2.2 | обязательства по предоставлению денежных средств субъектам малого бизнеса | 3.5.19 |
| 2.4.14.2.3 | обязательства по предоставлению денежных средств нефинансовым организациям | 3.5.19 |
| 2.4.14.2.4 | обязательства по предоставлению денежных средств прочим клиентам | 3.5.19 |
| 2.4.14.3 | величина превышения обязательств по предоставлению средств клиентам (кроме финансовых организаций, центральных (национальных) банков и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П) над величиной притоков денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций, центральных (национальных) банков и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П), установленных условиями договора, не включенной в расчет ожидаемых притоков денежных средств | МАКС (0; строка 2.4.14.2 минус разница данных графы 3 и графы 5 строки 3.2.2), подпункт 3.3.12 |
| 2.4.14.4 | обязательства по предоставлению средств связанным с банком лицам, определенным в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П (кроме финансовых организаций) и центральных (национальных) банков) | 3.5.19, 3.3.12 |
| 2.4.15 | оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, по предоставлению средств связанным с банком юридическим лицам, определенным в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П | 3.5.20, 3.3.12 |
| 2.4.16 | оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, по предоставлению средств по заключенному в соответствии с российским или иностранным правом договору, предметом которого является осуществление юридическими лицами совместных действий без образования юридического лица для извлечения прибыли или достижения иной цели, или по предоставлению средств юридическим лицам, на деятельность которых банк прямо или косвенно оказывает существенное влияние, а также в уставном капитале которых банк имеет миноритарные (неконсолидированные) доли участия | 3.5.21 |
| 2.4.17 | иные оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, итого,в том числе: | Сумма строк 2.4.17.1 - 2.4.17.5 |
| 2.4.17.1 | оценочные обязательства, проистекающие из потенциальных требований к банку по досрочному выкупу выпущенных долговых обязательств (включая облигации и векселя) или досрочному погашению (частичному погашению) обязательств, возникающих в рамках размещения долговых ценных бумаг в интересах банка | 3.5.22 |
| 2.4.17.2 | оценочные обязательства по досрочному выкупу собственных долговых ценных бумаг сроком до погашения свыше 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ у финансовых организаций - профессиональных участников рынка ценных бумаг, являющихся связанными с банком лицами | 3.5.22 |
| 2.4.17.3 | оценочные обязательства, связанные с деятельностью банка по управлению активами | 3.5.22 |
| 2.4.17.4 | оценочные обязательства по покрытию коротких позиций клиентов за счет обеспечения, предоставленного другими клиентами | 3.5.22 |
| 2.4.17.5 | прочие оценочные обязательства (оттоки) | 3.5.22 |
| 2.4.18 | ожидаемые оттоки денежных средств в ближайшие 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, не включенные в другие категории оттоков денежных средств | 3.5.24 |
| 3 | Ожидаемые притоки денежных средств, итого, в том числе: | Сумма строк 3.1, 3.2, 3.3, 3.4 и 3.5 |
| 3.1 | Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение ценными бумагами, включая операции обратного репо, итого, в том числе: | Сумма строк 3.1.1 и 3.1.2 |
| 3.1.1 | ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение ценными бумагами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), в случае если полученные в обеспечение ценные бумаги не были реализованы или переданы в обеспечение по привлеченным средствам, итого, в том числе: | Сумма строк 3.1.1.1 - 3.1.1.6 |
| 3.1.1.1 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1 | 4.4 (строка 1 таблицы) |
| 3.1.1.2 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А | 4.4 (строка 2 таблицы) |
| 3.1.1.3 | под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б | 4.4 (строка 3 таблицы) |
| 3.1.1.4 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием | 4.4 (строка 4 таблицы) |
| 3.1.1.5 | под обеспечение прочими ценными бумагами | 4.4 (строка 5 таблицы) |
| 3.1.1.6 | требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение ценными бумагами, не относящимися к ВЛА-1 и ВЛА-2 | Абзац второй пункта 4.4 |
| 3.1.2 | ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение ценными бумагами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), в случае проведения операций с данными ценными бумагами, что приводит к формированию собственных коротких позиций, итого, в том числе: | Сумма строк 3.1.2.1 - 3.1.2.6 |
| 3.1.2.1 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1 | Абзац третий пункта 4.4 |
| 3.1.2.2 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А | Абзац третий пункта 4.4 |
| 3.1.2.3 | под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б | Абзац третий пункта 4.4 |
| 3.1.2.4 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием | Абзац третий пункта 4.4 |
| 3.1.2.5 | под обеспечение прочими ценными бумагами | Абзац третий пункта 4.4 |
| 3.1.2.6 | требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение ценными бумагами, не относящимися к ВЛА-1 и ВЛА-2 | Абзац третий пункта 4.4 |
| 3.2 | Притоки денежных средств по прочим операциям размещения средств, установленные условиями договора, в зависимости от вида контрагента, итого, в том числе: | Сумма строк 3.2.1, 3.2.2 и 3.2.3 |
| 3.2.1 | поступления от операций с финансовыми организациями, итого, в том числе: | Сумма строк 3.2.1.1, 3.2.1.2 и 3.2.1.3 |
| 3.2.1.1 | от операций размещения операционных депозитов | 4.6.2 |
| 3.2.1.2 | от операций по предоставлению средств связанным с банком финансовым организациям | 4.6.2 |
| 3.2.1.3 | от прочих операций размещения денежных средств | 4.6.2 |
| 3.2.2 | ожидаемый приток денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций и связанных лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П), итого, в том числе: | Сумма строк 3.2.2.1 - 3.2.2.5, подпункт 3.3.12 |
| 3.2.2.1 | ожидаемый приток денежных средств от физических лиц | 4.6.1 |
| 3.2.2.2 | ожидаемый приток денежных средств от субъектов малого бизнеса | 4.6.1 |
| 3.2.2.3 | ожидаемый приток денежных средств от юридических лиц, за исключением субъектов малого бизнеса | 4.6.2 |
| 3.2.2.4 | ожидаемый приток денежных средств от Банка России и иностранных центральных (национальных) банков | 4.6.2 |
| 3.2.2.5 | ожидаемый приток денежных средств по операциям с прочими клиентами, Министерством финансов Российской Федерации, субъектами Российской Федерации, муниципальными образованиями Российской Федерации, внебюджетными фондами Российской Федерации, правительствами, международными банками развития, а также организациями, которым в соответствии с законодательством их стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства | 4.6.2 |
| 3.2.3 | ожидаемый приток денежных средств по операциям со связанными с банком лицами (кроме финансовых организаций), определенными в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П | 4.6.2, 3.3.12 |
| 3.3 | Поступления денежных средств в течение срока, не превышающего 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, от ценных бумаг, не включенных в ВЛА-1 и ВЛА-2 | 4.7 |
| 3.4 | Ожидаемый приток денежных средств по производным финансовым инструментам | 4.8 |
| 3.5 | Прочие ожидаемые притоки денежных средств (иные притоки денежных средств, установленные условиями договора) | 4.9 |
| 4 | Ожидаемый приток денежных средств после применения ограничения на максимальную допустимую величину | 1.3 |
| 5 | Чистый ожидаемый отток денежных средств (ЧООДС) | Строка 2 минус строка 4 |
| 6 | ПКЛ | Отношение строки 1 к строке 5 |

Раздел 2. Дополнительная информация к расчету ~~ПКЛ~~ | Раздел 1. Информация о компонентах расчета показателя краткосрочной ликвидности

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Номер строки | Наименование показателя | Пункт (подпункт) Положения Банка России N 421-П, или строки настоящей таблицы, или иной алгоритм, в соответствии с которыми производится заполнение строк Отчета |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Высоколиквидные активы, скорректированные с учетом ограничений на структуру высоколиквидных активов (ВЛА - ВК), итого, в том числе: | Сумма строк 1.1 и 1.7 |
| 1.1 | ВЛА-1, итого, в том числе: | Сумма строк 1.1.1 - 1.1.9 |
| 1.1.1 | наличная валюта | 2.5.1 |
| 1.1.2 | средства на счетах кредитных организаций (филиалов) по кассовому обслуживанию структурных подразделений, а также средства для кассового обслуживания кредитных организаций (филиалов), которое осуществляется не по месту открытия корреспондентского счета (субсчета) | 2.5.1 |
| 1.1.3 | средства в Банке России и в уполномоченных органах других стран, в том числе суммы, депонированные в Банке России и центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, для получения следующим днем наличных денежных средств, средства на корреспондентском счете (корреспондентских счетах) в Банке России и в центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, средства на депозитных счетах в Банке России с оставшимся сроком до погашения один календарный день, средства на депозитных счетах в центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, до востребования и с оставшимся сроком до погашения один календарный день и требования к Банку России и центральному банку иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, со сроком исполнения не позднее чем на следующий календарный день по получению начисленных (накопленных) процентов по указанным счетам, суммы переплаты, подлежащие возврату банку со счетов по учету обязательных резервов в Банке России и в центральных банках (уполномоченных органах) иностранного государства, если возврат средств должен быть осуществлен не позднее следующего календарного дня с даты расчета ПКЛ, а также средства на счетах по учету обязательных резервов (их часть) в центральных банках (уполномоченных органах) иностранных государств, если банку (филиалу банка) предоставлено право обращаться в соответствующий центральный банк (уполномоченный орган) иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, за возвратом указанных средств (их части) и возврат средств (их части) осуществляется не позднее следующего календарного дня с даты расчета ПКЛ | 2.5.2 |
| 1.1.4 | средства на депозитных счетах в центральном банке иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, с оставшимся сроком до погашения более одного календарного дня, если банку (филиалу банка) предоставлено право обращаться в соответствующий центральный банк иностранного государства с требованием о досрочном возврате депозита при условии, что возврат депозита осуществляется не позднее следующего календарного дня с даты расчета ПКЛ, требования к центральному банку иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, со сроком исполнения не позднее чем на следующий календарный день по получению начисленных (накопленных) процентов по указанным счетам | 2.5.2 |
| 1.1.5 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами или центральными банками стран (выпуски ценных бумаг), имеющих (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный иностранным кредитным рейтинговым агентством "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service) на уровне от "AAA" до "AA-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "Aaa" до "Aa3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), международными финансовыми организациями (Банком международных расчетов, Международным валютным фондом, Европейским центральным банком) и международными банками развития группы Всемирного банка, указанными в абзаце тринадцатом подпункта 2.3.1 пункта 2.3 Инструкции Банка России N 199-И, или полностью обеспеченные гарантиями указанных эмитентов | 2.5.3 |
| 1.1.6 | долговые ценные бумаги, выпущенные организациями, которым в соответствии с законодательством стран, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "AAA" до "AA-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "Aaa" до "Aa3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, или полностью обеспеченные гарантиями указанных эмитентов | 2.5.3 |
| 1.1.7 | долговые ценные бумаги, номинированные в рублях, выпущенные Правительством Российской Федерации или Банком России | 2.5.3 |
| 1.1.8 | долговые ценные бумаги, номинированные в иностранной валюте, выпущенные Правительством Российской Федерации или Банком России | 2.5.3 |
| 1.1.9 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами или центральными банками стран, не отраженные по строке 1.1.5 раздела 1, номинированные в валюте страны-эмитента | 2.5.3 |
| 1.2 | ВЛА-2А, итого, в том числе: | Сумма строк 1.2.1 - 1.2.6 |
| 1.2.1 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами или центральными банками стран (выпуски ценных бумаг), имеющих (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "A+" до "A-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "A1" до "A3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), или полностью обеспеченные гарантиями указанных эмитентов в части ценных бумаг, не отраженных по строке 1.1.9 раздела 1 | 2.6, 2.5.3 |
| 1.2.2 | долговые ценные бумаги, выпущенные организациями, которым в соответствии с законодательством стран, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "A+" до "A-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "A1" до "A3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, или полностью обеспеченные гарантиями указанных эмитентов | 2.6 |
| 1.2.3 | долговые ценные бумаги (за исключением облигаций с ипотечным покрытием), выпущенные нефинансовыми организациями (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "AAA" до "AA-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "Aaa" до "Aa3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), или не имеющими (не имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной рейтинговой шкале, присвоенный хотя бы одним иностранным кредитным рейтинговым агентством, величина компонента кредитного риска в части оценки вероятности дефолта по которым, самостоятельно полученной банком с использованием внутренних моделей, соответствует вероятности дефолта ценных бумаг, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной рейтинговой шкале, присвоенный на уровне, указанном в настоящей строке | 2.6 |
| 1.2.4 | обеспеченные облигации, выпущенные банками или ипотечными организациями в соответствии с законодательством иностранного государства, предусматривающим защиту владельцев облигаций, исполнение обязательств по которым полностью обеспечено залогом ипотечного покрытия или иных активов, находящихся на балансе эмитента ценных бумаг (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "AAA" до "AA-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "Aaa" до "Aa3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), или не имеющими (не имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной рейтинговой шкале, присвоенный кредитными рейтинговыми агентствами, и оценки вероятности дефолта которых, самостоятельно полученные банком с использованием внутренних моделей, соответствуют вероятности дефолта ценных бумаг, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной рейтинговой шкале, присвоенный на уровне, указанном в настоящей строке | 2.6 |
| 1.2.5 | долговые ценные бумаги, исполнение обязательств по которым полностью обеспечено поручительством единого института развития в жилищной сфере, определенного в соответствии с частью 1 статьи 2 Федерального закона N 225-ФЗ, если ипотечное покрытие сформировано требованиями по ипотечным кредитам физических лиц, обеспеченным жилой недвижимостью, одно ипотечное покрытие обеспечивает только один выпуск таких ценных бумаг и эмитентом является ипотечный агент, 100 процентов акций (долей) уставного капитала которого принадлежат единому институту развития в жилищной сфере | 2.6 |
| 1.2.6 | номинированные в российских рублях облигации, выпущенные государственной корпорацией развития "ВЭБ.РФ" в соответствии с пунктом 3 части 4 статьи 3 Федерального закона N 82-ФЗ | 2.6 |
| 1.3 | ВЛА-2Б, итого, в том числе: | Сумма строк 1.3.1 - 1.3.3 |
| 1.3.1 | жилищные облигации с ипотечным покрытием, выпущенные юридическими лицами - нерезидентами (кроме банков) (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "AAA" до "AA" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "Aaa" до "Aa2" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service) | 2.7.1 |
| 1.3.2 | долговые ценные бумаги (кроме облигаций с ипотечным покрытием), итого, в том числе: | Сумма строк 1.3.2.1 - 1.3.2.4 |
| 1.3.2.1 | долговые ценные бумаги, указанные в строке 1.2.3 раздела 1, но не включенные в расчет ВЛА-2А по причине несоответствия требованиям абзаца пятнадцатого пункта 2.6 Положения Банка России N 421-П | 2.7.2 |
| 1.3.2.2 | долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами или центральными банками стран (выпуски ценных бумаг), имеющих (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "BBB+" до "BBB-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "Baal" до "Baa3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service), кроме долговых ценных бумаг, отраженных по строке 1.1.9 раздела 1 | 2.7.2 |
| 1.3.2.3 | долговые ценные бумаги (кроме облигаций с ипотечным покрытием), выпущенные нефинансовыми организациями (выпуски ценных бумаг), имеющими (имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности, присвоенный хотя бы одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне от "A+" до "BBB-" по международной рейтинговой шкале "Эс энд Пи Глобал Рейтингс" (S&P Global Ratings) или "Фитч Рейтингс" (Fitch Ratings) либо от "A1" до "Baa3" по международной рейтинговой шкале "Мудис Инвесторс Сервис" (Moody's Investors Service) | 2.7.2 |
| 1.3.2.4 | долговые ценные бумаги (кроме облигаций с ипотечным покрытием), выпущенные нефинансовыми организациями (выпуски ценных бумаг), не имеющими (не имеющие) рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной рейтинговой шкале, присвоенный хотя бы одним иностранным кредитным рейтинговым агентством, и оценки вероятности дефолта которых, самостоятельно полученные банком с использованием банковских методик управления кредитными рисками и моделей количественной оценки кредитных рисков, соответствуют вероятности дефолта ценных бумаг, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной рейтинговой шкале, присвоенный на уровне, указанном в строке 1.3.2.3 раздела 1 | 2.7.2 |
| 1.3.3 | обыкновенные акции, включенные организатором торговли (фондовой биржей) в списки для расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, а также фондовых индексов акций, указанных в приложении 6 к Инструкции Банка России N 199-И | 2.7.3 |
| 1.4 | ВК 15 | 2.12 |
| 1.5 | Итого ВЛА-2Б после корректировки | Строка 1.3 минус строка 1.4 |
| 1.6 | ВК 40 | 2.12 |
| 1.7 | Итого ВЛА-2 после корректировки | Сумма строк 1.2 и 1.5 минус строка 1.6 |
| 2 | Ожидаемые оттоки денежных средств, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1, 2.2, 2.3 и 2.4 |
| 2.1 | Ожидаемый отток денежных средств физических лиц, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1 и 2.1.2 |
| 2.1.1 | стабильные средства физических лиц, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.1 - 2.1.1.3 |
| 2.1.1.1 | денежные средства в рублях, кроме подлежащих отражению в строке 2.1.1.3 раздела 1, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.1.1 и 2.1.1.1.2 |
| 2.1.1.1.1 | на банковских счетах, на которые осуществляется перечисление заработной платы или иных выплат, связанных с выполнением трудовых обязанностей, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.1.1.1 и 2.1.1.1.1.2 |
| 2.1.1.1.1.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.1.1.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.1.2 | на счетах физических лиц, имеющих установленные взаимоотношения с банком, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.1.2.1 и 2.1.1.1.2.2 |
| 2.1.1.1.2.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.1.2.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.2 | денежные средства в отдельных иностранных валютах (в национальной валюте иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, в долларах США и евро), кроме подлежащих отражению в строке 2.1.1.3 раздела 1, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.2.1 и 2.1.1.2.2 |
| 2.1.1.2.1 | на банковских счетах, на которые осуществляется перечисление заработной платы или иных выплат, связанных с выполнением трудовых обязанностей, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.2.1.1 и 2.1.1.2.1.2 |
| 2.1.1.2.1.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.2.1.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.2.2 | на счетах физических лиц, имеющих установленные взаимоотношения с банком, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.1.2.2.1 и 2.1.1.2.2.2 |
| 2.1.1.2.2.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.2.2.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней | 3.2.3 |
| 2.1.1.3 | стабильные средства физических лиц, привлеченные филиалом банка, в случае если коэффициент оттока стабильных средств физических лиц, установленный центральным банком и (или) иным органом надзора иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, отличен от 5 процентов | 3.2.3 |
| 2.1.2 | нестабильные средства физических лиц, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.2.1 - 2.1.2.4 |
| 2.1.2.1 | денежные средства, превышающие максимальный размер возмещения по вкладам при наступлении страхового случая, установленный Федеральным законом N 177-ФЗ или законодательством иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, кроме подлежащих отражению в строке 2.1.2.4 раздела 1, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.2.1.1 и 2.1.2.1.2 |
| 2.1.2.1.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней | 3.2.4 |
| 2.1.2.1.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней | 3.2.4 |
| 2.1.2.2 | прочие денежные средства физических лиц, кроме подлежащих отражению в строке 2.1.2.4 раздела 1, которые не могут быть отнесены к стабильным, в том числе средства на банковских счетах, открытие и управление которыми осуществляется только дистанционным способом, а также квалифицированных инвесторов и связанных с банком лиц, итого, в том числе: | Сумма строк 2.1.2.2.1 и 2.1.2.2.2 |
| 2.1.2.2.1 | со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней | 3.2.4 |
| 2.1.2.2.2 | со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней | 3.2.4 |
| 2.1.2.3 | средства клиентов, кроме подлежащих отражению в строке 2.1.2.4 раздела 1, совокупная сумма которых превышает 5 миллионов рублей | 3.2.4 |
| 2.1.2.4 | средства физических лиц, привлеченные филиалом банка, в случае если коэффициент оттока нестабильных средств физических лиц, установленный центральным банком и (или) иным органом надзора иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, отличен от 10 процентов | 3.2.4 |
| 2.2 | Ожидаемый отток денежных средств клиентов, привлеченных без обеспечения, итого, в том числе: | Сумма строк 2.2.1, 2.2.2, 2.2.3, 2.2.4, 2.2.5 и 2.2.6 |
| 2.2.1 | депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса, итого, в том числе: | Сумма строк 2.2.1.1 и 2.2.1.2 |
| 2.2.1.1 | стабильные депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса | 3.3.5 |
| 2.2.1.2 | нестабильные депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса | 3.3.5 |
| 2.2.2 | операционные депозиты, итого, в том числе: | Сумма строк 2.2.2.1 - 2.2.2.5 |
| 2.2.2.1 | юридических лиц, за исключением финансовых организаций | 3.3.6 - 3.3.9 |
| 2.2.2.2 | финансовых организаций | 3.3.6 - 3.3.9 |
| 2.2.2.3 | Федерального казначейства и Банка России | 3.3.6 - 3.3.9 |
| 2.2.2.4 | субъектов Российской Федерации, муниципальных образований Российской Федерации, внебюджетных фондов Российской Федерации | 3.3.6 - 3.3.9 |
| 2.2.2.5 | правительств и центральных банков иностранных государств, организаций, которым в соответствии с законодательством их стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, международных банков развития | 3.3.6 - 3.3.9 |
| 2.2.3 | депозиты и прочие привлеченные средства юридических лиц (за исключением финансовых организаций) и государственных органов, итого, в том числе: | Сумма строк 2.2.3.1 - 2.2.3.5 |
| 2.2.3.1 | юридических лиц, за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса | 3.3.11 |
| 2.2.3.2 | Федерального казначейства и Банка России, а также центрального банка иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка | 3.3.11 |
| 2.2.3.3 | субъектов Российской Федерации, муниципальных образований Российской Федерации, внебюджетных фондов Российской Федерации | 3.3.11 |
| 2.2.3.4 | правительств иностранных государств, организаций, которым в соответствии с законодательством их стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, международных банков развития | 3.3.11 |
| 2.2.3.5 | средства субъектов малого бизнеса, не включенные в расчет ожидаемого оттока денежных средств клиентов, привлеченных без обеспечения, в соответствии с абзацами пятым - восьмым подпункта 3.3.5 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П | 3.3.11, абзацы пятый - восьмой подпункта 3.3.5 |
| 2.2.4 | депозиты и прочие привлеченные денежные средства связанных с банком юридических лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П, за исключением финансовых организаций, Банка России, а также центрального банка иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка | 3.3.12 |
| 2.2.5 | прочие привлеченные денежные средства без обеспечения, итого, в том числе: | Сумма строк 2.2.5.1 - 2.2.5.6 |
| 2.2.5.1 | средства выгодоприобретателей банка | 3.3.13 |
| 2.2.5.2 | средства финансовых организаций | 3.3.13 |
| 2.2.5.3 | средства специализированных финансовых обществ (компаний специального назначения), кроме средств, привлеченных от юридических лиц в рамках размещения ценных бумаг в интересах банка | 3.3.13 |
| 2.2.5.4 | средства, привлеченные по выпущенным ценным бумагам (включая облигации и векселя), кроме сберегательных и депозитных сертификатов, а также средства, привлеченные от юридических лиц в рамках размещения ценных бумаг в интересах банка | 3.3.13 |
| 2.2.5.5 | средства, привлеченные банком в результате предоставления услуг по брокерскому обслуживанию | 3.3.13 |
| 2.2.5.6 | просроченная задолженность и просроченные проценты по кредитам, депозитам и прочим привлеченным средствам, прочие не исполненные в срок обязательства | 3.3.13 |
| 2.2.6 | средства, подлежащие депонированию на счетах по учету обязательных резервов и (или) внесению на корреспондентский счет (корреспондентские субсчета) банка в Банке России и уполномоченном органе (центральном банке) иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, в величине, необходимой для выполнения банком обязанности по выполнению обязательных резервных требований | 3.3.14 |
| 2.3 | Ожидаемый отток денежных средств, привлеченных под обеспечение активами банка, а также по договорам займа ценных бумаг, итого, в том числе: | Сумма строк 2.3.1 - 2.3.8 |
| 2.3.1 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка | 3.4.5 (строка 1 таблицы) |
| 2.3.2 | обязательства банка по операциям с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, вне зависимости от вида предоставленного обеспечения, итого, в том числе: | Сумма строк 2.3.2.1 - 2.3.2.3 |
| 2.3.2.1 | денежные средства, привлеченные под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1 | 3.4.5 (строка 2 таблицы) |
| 2.3.2.2 | денежные средства, привлеченные под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2 | 3.4.5 (строка 2 таблицы) |
| 2.3.2.3 | денежные средства, привлеченные под обеспечение прочими активами | 3.4.5 (строка 2 таблицы) |
| 2.3.3 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка | 3.4.5 (строка 3 таблицы) |
| 2.3.4 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами (кроме ценных бумаг, удовлетворяющих критериям, предъявляемым к ВЛА-1 или ВЛА-2А), по операциям с Федеральным казначейством и международными банками развития | 3.4.5 (строка 4 таблицы) |
| 2.3.5 | обязательства банка, обеспеченные жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, Федеральным казначейством и международными банками развития | 3.4.5 (строка 5 таблицы) |
| 2.3.6 | обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, за исключением жилищных облигаций с ипотечным покрытием, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, Федеральным казначейством и международными банками развития | 3.4.5 (строка 6 таблицы) |
| 2.3.7 | обязательства банка по операциям со связанными с банком юридическими лицами, определенными в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П, вне зависимости от вида ценных бумаг, предоставленных в обеспечение | 3.4.5 (строка 7 таблицы), 3.3.12 |
| 2.3.8 | прочие привлеченные средства под обеспечение активами, кроме операций с Банком России и центральным банком иностранного государства, на территории которого расположен филиал банка, Федеральным казначейством и международными банками развития | 3.4.5 (строка 8 таблицы) |
| 2.4 | Дополнительные ожидаемые оттоки денежных средств, итого, в том числе: | Сумма строк 2.4.1 - 2.4.18 |
| 2.4.1 | ожидаемый отток денежных средств по производным финансовым инструментам | 3.5.1 - 3.5.3 |
| 2.4.2 | оценка дополнительной потребности в ликвидности по обязательствам банка, производным финансовым инструментам и прочим договорам (контрактам), связанной со снижением рейтинга долгосрочной и краткосрочной кредитоспособности банка или с другими отлагательными условиями | 3.5.4 |
| 2.4.3 | оценка дополнительной потребности в ликвидности, связанной с потенциальным изменением стоимости предоставленного банком обеспечения | 3.5.5 |
| 2.4.4 | ожидаемый отток денежных средств, обусловленный правом клиента потребовать возврата части предоставленного банку обеспечения, входящего в единый пул обеспечения | 3.5.6 |
| 2.4.5 | ожидаемый отток денежных средств по операциям, предусматривающим предоставление банком обеспечения, которое контрагент имеет право потребовать в соответствии с условиями договора | 3.5.7 |
| 2.4.6 | ожидаемый отток денежных средств по операциям, условия которых предусматривают возможность замещения клиентами банка обеспечения на активы, соответствующие критериям высоколиквидных активов более низкого уровня и (или) не соответствующие критериям ВЛА-1, ВЛА-2А и ВЛА-2Б | 3.5.8 |
| 2.4.7 | дополнительная потребность в ликвидности (ожидаемые оттоки денежных средств), связанная с изменением рыночной стоимости производных финансовых инструментов | 3.5.9 |
| 2.4.8 | ожидаемый отток денежных средств, связанный с осуществлением платежей, установленных условиями выпуска ценных бумаг, обеспеченных поступлениями денежных средств по активам | 3.5.10 |
| 2.4.9 | ожидаемый отток денежных средств по ценным бумагам, обеспеченным активами и выпущенным специализированными финансовыми обществами в интересах банка | 3.5.11 |
| 2.4.10 | ожидаемый отток денежных средств по обязательствам банка по неиспользованным безотзывным и условно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности, итого, в том числе: | Сумма строк 2.4.10.1 - 2.4.10.7 |
| 2.4.10.1 | кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные физическим лицам и субъектам малого бизнеса | 3.5.15 (строка 1 таблицы) |
| 2.4.10.2 | кредитные линии, предоставленные юридическим лицам (за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса), правительствам и организациям, которым в соответствии с законодательством предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, центральным банкам и международным банкам развития | 3.5.15 (строка 2 таблицы) |
| 2.4.10.3 | линии ликвидности, предоставленные юридическим лицам (за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса), правительствам и организациям, которым в соответствии с законодательством предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, центральным банкам и международным банкам развития | 3.5.15 (строка 3 таблицы) |
| 2.4.10.4 | кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные кредитным организациям (в том числе банкам-нерезидентам) | 3.5.15 (строка 4 таблицы) |
| 2.4.10.5 | кредитные линии, предоставленные финансовым организациям (кроме кредитных организаций, специализированных финансовых обществ, хедж-фондов и фондов денежного рынка) | 3.5.15 (строка 5 таблицы) |
| 2.4.10.6 | линии ликвидности, предоставленные финансовым организациям (кроме кредитных организаций, специализированных финансовых обществ, хедж-фондов и фондов денежного рынка) | 3.5.15 (строка 6 таблицы) |
| 2.4.10.7 | линии ликвидности и кредитные линии, предоставленные прочим клиентам | 3.5.15 (строка 7 таблицы) |
| 2.4.11 | ожидаемый отток денежных средств по безусловно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности | 3.5.16 |
| 2.4.12 | ожидаемый отток денежных средств по условным обязательствам кредитного характера банка по предоставлению денежных средств на проведение сделок торгового финансирования | 3.5.17 |
| 2.4.13 | ожидаемый отток денежных средств по предоставленным гарантиям и поручительствам, а также аккредитивам, не относящимся к торговому финансированию | 3.5.18 |
| 2.4.14 | прочие обязательства банка, установленные условиями договора, по предоставлению средств в ближайшие 30 календарных дней, итого, в том числе: | Сумма строк 2.4.14.1, 2.4.14.3 и 2.4.14.4 |
| 2.4.14.1 | обязательства по предоставлению денежных средств финансовым организациям, центральным (национальным) банкам | 3.5.19 |
| 2.4.14.2 | обязательства по предоставлению средств клиентам (кроме финансовых организаций, центральных (национальных) банков и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П), в том числе: | Сумма строк 2.4.14.2.1 - 2.4.14.2.4, подпункт 3.3.12 |
| 2.4.14.2.1 | обязательства по предоставлению денежных средств физическим лицам | 3.5.19 |
| 2.4.14.2.2 | обязательства по предоставлению денежных средств субъектам малого бизнеса | 3.5.19 |
| 2.4.14.2.3 | обязательства по предоставлению денежных средств нефинансовым организациям | 3.5.19 |
| 2.4.14.2.4 | обязательства по предоставлению денежных средств прочим клиентам | 3.5.19 |
| 2.4.14.3 | величина превышения обязательств по предоставлению средств клиентам (кроме финансовых организаций, центральных (национальных) банков и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П) над величиной притоков денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций, центральных (национальных) банков и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П), установленных условиями договора, не включенной в расчет ожидаемых притоков денежных средств | МАКС (0; строка 2.4.14.2 минус разница данных графы 3 и графы 5 строки 3.2.2), подпункт 3.3.12 |
| 2.4.14.4 | обязательства по предоставлению средств связанным с банком лицам, определенным в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П (кроме финансовых организаций) и центральных (национальных) банков) | 3.5.19, 3.3.12 |
| 2.4.15 | оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, по предоставлению средств связанным с банком юридическим лицам, определенным в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П | 3.5.20, 3.3.12 |
| 2.4.16 | оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, по предоставлению средств по заключенному в соответствии с российским или иностранным правом договору, предметом которого является осуществление юридическими лицами совместных действий без образования юридического лица для извлечения прибыли или достижения иной цели, или по предоставлению средств юридическим лицам, на деятельность которых банк прямо или косвенно оказывает существенное влияние, а также в уставном капитале которых банк имеет миноритарные (неконсолидированные) доли участия | 3.5.21 |
| 2.4.17 | иные оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, итого, в том числе: | Сумма строк 2.4.17.1 - 2.4.17.5 |
| 2.4.17.1 | оценочные обязательства, проистекающие из потенциальных требований к банку по досрочному выкупу выпущенных долговых обязательств (включая облигации и векселя) или досрочному погашению (частичному погашению) обязательств, возникающих в рамках размещения долговых ценных бумаг в интересах банка | 3.5.22 |
| 2.4.17.2 | оценочные обязательства по досрочному выкупу собственных долговых ценных бумаг сроком до погашения свыше 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ у финансовых организаций - профессиональных участников рынка ценных бумаг, являющихся связанными с банком лицами | 3.5.22 |
| 2.4.17.3 | оценочные обязательства, связанные с деятельностью банка по управлению активами | 3.5.22 |
| 2.4.17.4 | оценочные обязательства по покрытию коротких позиций клиентов за счет обеспечения, предоставленного другими клиентами | 3.5.22 |
| 2.4.17.5 | прочие оценочные обязательства (оттоки) | 3.5.22 |
| 2.4.18 | ожидаемые оттоки денежных средств в ближайшие 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, не включенные в другие категории оттоков денежных средств | 3.5.24 |
| 3 | Ожидаемые притоки денежных средств, итого, в том числе: | Сумма строк 3.1, 3.2, 3.3, 3.4 и 3.5 |
| 3.1 | Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение ценными бумагами, включая операции обратного репо, итого, в том числе: | Сумма строк 3.1.1 и 3.1.2 |
| 3.1.1 | ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение ценными бумагами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), в случае если полученные в обеспечение ценные бумаги не были реализованы или переданы в обеспечение по привлеченным средствам, итого, в том числе: | Сумма строк 3.1.1.1 - 3.1.1.6 |
| 3.1.1.1 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1 | 4.4 (строка 1 таблицы) |
| 3.1.1.2 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А | 4.4 (строка 2 таблицы) |
| 3.1.1.3 | под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б | 4.4 (строка 3 таблицы) |
| 3.1.1.4 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием | 4.4 (строка 4 таблицы) |
| 3.1.1.5 | под обеспечение прочими ценными бумагами | 4.4 (строка 5 таблицы) |
| 3.1.1.6 | требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение ценными бумагами, не относящимися к ВЛА-1 и ВЛА-2 | Абзац второй пункта 4.4 |
| 3.1.2 | ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение ценными бумагами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), в случае проведения операций с данными ценными бумагами, что приводит к формированию собственных коротких позиций, итого, в том числе: | Сумма строк 3.1.2.1 - 3.1.2.6 |
| 3.1.2.1 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1 | Абзац третий пункта 4.4 |
| 3.1.2.2 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А | Абзац третий пункта 4.4 |
| 3.1.2.3 | под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б | Абзац третий пункта 4.4 |
| 3.1.2.4 | под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием | Абзац третий пункта 4.4 |
| 3.1.2.5 | под обеспечение прочими ценными бумагами | Абзац третий пункта 4.4 |
| 3.1.2.6 | требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение ценными бумагами, не относящимися к ВЛА-1 и ВЛА-2 | Абзац третий пункта 4.4 |
| 3.2 | Притоки денежных средств по прочим операциям размещения средств, установленные условиями договора, в зависимости от вида контрагента, итого, в том числе: | Сумма строк 3.2.1, 3.2.2 и 3.2.3 |
| 3.2.1 | поступления от операций с финансовыми организациями, итого, в том числе: | Сумма строк 3.2.1.1, 3.2.1.2 и 3.2.1.3 |
| 3.2.1.1 | от операций размещения операционных депозитов | 4.6.2 |
| 3.2.1.2 | от операций по предоставлению средств связанным с банком финансовым организациям | 4.6.2 |
| 3.2.1.3 | от прочих операций размещения денежных средств | 4.6.2 |
| 3.2.2 | ожидаемый приток денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций и связанных с банком лиц, определенных в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П), итого, в том числе: | Сумма строк 3.2.2.1 - 3.2.2.5, подпункт 3.3.12 |
| 3.2.2.1 | ожидаемый приток денежных средств от физических лиц | 4.6.1 |
| 3.2.2.2 | ожидаемый приток денежных средств от субъектов малого бизнеса | 4.6.1 |
| 3.2.2.3 | ожидаемый приток денежных средств от юридических лиц, за исключением субъектов малого бизнеса | 4.6.2 |
| 3.2.2.4 | ожидаемый приток денежных средств от Банка России и иностранных центральных (национальных) банков | 4.6.2 |
| 3.2.2.5 | ожидаемый приток денежных средств по операциям с прочими клиентами, Министерством финансов Российской Федерации, субъектами Российской Федерации, муниципальными образованиями Российской Федерации, внебюджетными фондами Российской Федерации, правительствами, международными банками развития, а также организациями, которым в соответствии с законодательством их стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства | 4.6.2 |
| 3.2.3 | ожидаемый приток денежных средств по операциям со связанными с банком лицами (кроме финансовых организаций), определенными в соответствии с подпунктом 3.3.12 пункта 3.3 Положения Банка России N 421-П | 4.6.2, 3.3.12 |
| 3.3 | Поступления денежных средств в течение срока, не превышающего 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, от ценных бумаг, не включенных в ВЛА-1 и ВЛА-2 | 4.7 |
| 3.4 | Ожидаемый приток денежных средств по производным финансовым инструментам | 4.8 |
| 3.5 | Прочие ожидаемые притоки денежных средств (иные притоки денежных средств, установленные условиями договора) | 4.9 |
| 4 | Ожидаемый приток денежных средств после применения ограничения на максимальную допустимую величину | 1.3 |
| 5 | Чистый ожидаемый отток денежных средств (ЧООДС) | Строка 2 минус строка 4 |
| 6 | ПКЛ | Отношение строки 1 к строке 5 |

Раздел 2. Дополнительная информация к расчету показателя краткосрочной ликвидности |
|

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Номер строки | Наименование статьи | Пункт (подпункт) Положения Банка России N 421-П или иной алгоритм, в соответствии с которым производится заполнение ~~строки~~ |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Величина ВЛА-1скорр | 2.11 |
| 2 | Величина ВЛА-2Аскорр | 2.11 |
| 3 | Величина ВЛА-2Бскорр | 2.11 |
| 4 | Оценочная величина денежных средств, которые могут быть привлечены от Банка России по операциям рефинансирования под обеспечение активами (с учетом поправочных коэффициентов, применяемых Банком России) в соответствии ~~с Указанием Банка России от 22 мая 2018 года N 4801-У "О форме и условиях~~ рефинансирования кредитных организаций под обеспечение~~" <1> (далее - Условия рефинансирования кредитных организаций под обеспечение)~~, итого, в том числе: | Сумма строк 4.1 - 4.3 |
| 4.1 | под обеспечение ценными бумагами | 5.1.1 |
| 4.2 | под обеспечение правами требования по кредитным договорам | 5.1.1 |
| 4.3 | под обеспечение иными активами | 5.1.1 |
| 5 | Величина лимита безотзывной кредитной линии, определенная в соответствии с договором об открытии безотзывной кредитной линии, уменьшенная на стоимость активов (с учетом поправочных коэффициентов, применяемых Банком России), использованных для расчета величины лимита безотзывной кредитной линии и включенных кредитной организацией в расчет высоколиквидных активов | 5.1.1 |
| 6 | Стоимость активов, которые могут быть использованы кредитной организацией в качестве обеспечения по кредиту Банка России (без умножения на соответствующие поправочные коэффициенты, установленные Банком России) в соответствии с ~~Условиями~~ рефинансирования кредитных организаций под обеспечение, итого, в том числе: | Сумма строк 6.1 - 6.3 |
| 6.1 | ценные бумаги | 5.1.1 |
| 6.2 | права требования по кредитным договорам | 5.1.1 |
| 6.3 | иные активы | 5.1.1 |
| 7 | Величина активов, соответствующих всем критериям высоколиквидных активов, но не включенных в расчет ПКЛ в связи с превышением величины активов, номинированных в соответствующей иностранной валюте, над величиной чистого ожидаемого оттока денежных средств в той же иностранной валюте, в соответствии с пунктом 2.9 Положения Банка России N 421-П, итого, в том числе: | Сумма строк 7.1 - 7.3 |
| 7.1 | ВЛА-1, не включенные в расчет ПКЛ | 5.1.2 |
| 7.2 | ВЛА-2А, не включенные в расчет ПКЛ | 5.1.2 |
| 7.3 | ВЛА-2Б, не включенные в расчет ПКЛ | 5.1.2 |
| 8 | Величина вложений в активы, исключенные из расчета числителя ПКЛ в связи с невыполнением условий, установленных пунктом 2.1 Положения Банка России N 421-П | 5.1.3 |

 |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Номер строки | Наименование показателя | Пункт (подпункт) Положения Банка России N 421-П, строки настоящей таблицы или иной алгоритм, в соответствии с которыми производится заполнение строк Отчета |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Величина ВЛА-1скорр | 2.11 |
| 2 | Величина ВЛА-2Аскорр | 2.11 |
| 3 | Величина ВЛА-2Бскорр | 2.11 |
| 4 | Оценочная величина денежных средств, которые могут быть привлечены от Банка России по операциям рефинансирования под обеспечение активами (с учетом поправочных коэффициентов, применяемых Банком России) в соответствии условиями рефинансирования кредитных организаций под обеспечение, итого, в том числе: | Сумма строк 4.1 - 4.3 |
| 4.1 | под обеспечение ценными бумагами | 5.1.1 |
| 4.2 | под обеспечение правами требования по кредитным договорам | 5.1.1 |
| 4.3 | под обеспечение иными активами | 5.1.1 |
| 5 | Величина лимита безотзывной кредитной линии, определенная в соответствии с договором об открытии безотзывной кредитной линии, уменьшенная на стоимость активов (с учетом поправочных коэффициентов, применяемых Банком России), использованных для расчета величины лимита безотзывной кредитной линии и включенных кредитной организацией в расчет высоколиквидных активов | 5.1.1 |
| 6 | Стоимость активов, которые могут быть использованы кредитной организацией в качестве обеспечения по кредиту Банка России (без умножения на соответствующие поправочные коэффициенты, установленные Банком России) в соответствии с условиями рефинансирования кредитных организаций под обеспечение, итого, в том числе: | Сумма строк 6.1 - 6.3 |
| 6.1 | ценные бумаги | 5.1.1 |
| 6.2 | права требования по кредитным договорам | 5.1.1 |
| 6.3 | иные активы | 5.1.1 |
| 7 | Величина активов, соответствующих всем критериям высоколиквидных активов, но не включенных в расчет ПКЛ в связи с превышением величины активов, номинированных в соответствующей иностранной валюте, над величиной чистого ожидаемого оттока денежных средств (ЧООДС) в той же иностранной валюте, в соответствии с пунктом 2.9 Положения Банка России N 421-П, итого, в том числе: | Сумма строк 7.1 - 7.3 |
| 7.1 | ВЛА-1, не включенные в расчет ПКЛ | 5.1.2 |
| 7.2 | ВЛА-2А, не включенные в расчет ПКЛ | 5.1.2 |
| 7.3 | ВЛА-2Б, не включенные в расчет ПКЛ | 5.1.2 |
| 8 | Величина вложений в активы, исключенные из расчета числителя ПКЛ в связи с невыполнением условий, установленных пунктом 2.1 Положения Банка России N 421-П | 5.1.3 |

 |
| ~~--------------------------------~~~~<1> Зарегистрировано Министерством юстиции Российской Федерации 7 июня 2018 года N 51310.~~ |  |
| 2. Отчет формируется кредитной организацией суммарно по операциям в рублях, иностранной валюте и драгоценных металлах, отдельно в рублях и каждой иностранной валюте, операции в которой признаются значимыми в соответствии с пунктом 5.2 Положения Банка России N 421-П. В Отчете суммы в иностранной валюте указываются в рублевом эквиваленте, определяемом по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России в соответствии с пунктом 15 статьи 4 Федерального закона "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" ~~(Собрание законодательства Российской Федерации 2002, N 28, ст. 2790; 2020, N 14, ст. 2036)~~ (далее - курс иностранной валюты~~, установленный Банком России~~), обязательства в драгоценных металлах указываются в рублевом эквиваленте по учетным ценам, установленным на дату осуществления расчета. При составлении Отчета по операциям отдельно в рублях и каждой значимой иностранной валюте в поле "Код валюты" указывается согласно Общероссийскому классификатору валют (ОКВ) цифровой код валюты, в которой осуществляются операции, а для Отчета, сформированного суммарно по операциям в рублях, иностранной валюте и драгоценных металлах, - условный код 000. | 2. Отчет формируется кредитной организацией суммарно по операциям в рублях, иностранной валюте и драгоценных металлах, отдельно в рублях и в каждой иностранной валюте, операции в которой признаются значимыми в соответствии с пунктом 5.2 Положения Банка России N 421-П. В Отчете суммы в иностранной валюте указываются в рублевом эквиваленте, определяемом по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России в соответствии с пунктом 15 статьи 4 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (далее соответственно - Федеральный закон N 86-ФЗ, официальный курс иностранной валюты), обязательства в драгоценных металлах указываются в рублевом эквиваленте по учетным ценам, установленным на дату осуществления расчета. При составлении Отчета по операциям отдельно в рублях и в каждой значимой иностранной валюте в поле "Код валюты" указывается согласно Общероссийскому классификатору валют (ОКВ) цифровой код валюты, в которой осуществляются операции, а для Отчета, сформированного суммарно по операциям в рублях, иностранной валюте и драгоценных металлах, - условный код "000". |
| 3. В Отчете отражаются активы, ожидаемые притоки и ожидаемые оттоки денежных средств в рублях по курсу соответствующей иностранной валюты~~, установленному Банком России,~~ на дату расчета ПКЛ.4. В строках 1.2.1 - 1.2.~~4~~ раздела 1 Отчета отражаются высоколиквидные активы, включенные в высоколиквидные активы уровня 2А, с учетом ограничения, установленного пунктом 2.9 Положения Банка России N 421-П, до корректировки величины ВЛА-2 в соответствии с пунктом 2.10 Положения Банка России N 421-П.5. В строках 1.3.1 - 1.3.3 раздела 1 Отчета отражаются высоколиквидные активы, включенные в высоколиквидные активы уровня 2Б, с учетом ограничения, установленного пунктом 2.9 Положения Банка России N 421-П, до корректировки величины ВЛА-2 и ВЛА-2Б в соответствии с пунктом 2.10 Положения Банка России N 421-П.6. В строке 2.4.14.3 раздела 1 Отчета отражаются обязательства по предоставлению денежных средств клиентам (кроме финансовых организаций), рассчитанные в соответствии с подпунктом 3.5.19 пункта 3.5 Положения Банка России N 421-П. | 3. В Отчете отражаются активы, ожидаемые притоки и ожидаемые оттоки денежных средств в рублях по официальному курсу соответствующей иностранной валюты на дату расчета ПКЛ.4. В строках 1.2.1 - 1.2.6 раздела 1 Отчета отражаются высоколиквидные активы, включенные в высоколиквидные активы уровня 2А (ВЛА-2А), с учетом ограничения, установленного пунктом 2.9 Положения Банка России N 421-П, до корректировки величины высоколиквидных активов уровня 2 (ВЛА-2) в соответствии с пунктом 2.10 Положения Банка России N 421-П.5. В строках 1.3.1 - 1.3.3 раздела 1 Отчета отражаются высоколиквидные активы, включенные в высоколиквидные активы уровня 2Б (ВЛА-2Б), с учетом ограничения, установленного пунктом 2.9 Положения Банка России N 421-П, до корректировки величины высоколиквидных активов уровня 2 и 2Б (ВЛА-2 и ВЛА-2Б) в соответствии с пунктом 2.10 Положения Банка России N 421-П.6. В строке 2.4.14.3 раздела 1 Отчета отражаются обязательства по предоставлению денежных средств клиентам (кроме финансовых организаций), рассчитанные в соответствии с подпунктом 3.5.19 пункта 3.5 Положения Банка России N 421-П. |
| ~~Пример заполнения строк 2.4.14.2 и 2.4.14.3. Величина обязательств по предоставлению денежных средств клиентам - нефинансовым организациям в течение ближайших 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ составляет 200 рублей (отражается в строке 2.4.14.2 раздела 1 Отчета), величина притоков денежных средств, установленных условиями договора, - 100 рублей (отражается в графе 3 строки 3.2.2 раздела 1 Отчета). Величина притока денежных средств с учетом коэффициента 50 процентов составляет 50 рублей (отражается в графе 5 строки 3.2.2 раздела 1 Отчета). Величина поступлений денежных средств, не включенная в расчет притоков денежных средств, составляет 50 рублей (100 рублей минус 50 рублей). Для определения величины оттока денежных средств рассчитывается разность между обязательствами в размере 200 рублей и 50 рублями, что составляет 150 рублей (отражается в строке 2.4.14.3 раздела 1 Отчета).~~ |  |
| 7. В разделе 2 Отчета отражается дополнительная информация к расчету ПКЛ в соответствии с главой 5 Положения Банка России N 421-П.7.1. В строках 1 - 3 раздела 2 Отчета отражаются величины скорректированных высоколиквидных активов ~~первого~~ уровня, уровней 2А и 2Б, рассчитанные с учетом сделок, в результате исполнения которых в течение ближайших 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ происходит изменение величины высоколиквидных активов соответствующего уровня (ВЛА-1скорр, ВЛА-2Аскорр, ВЛА-2Бскорр) в соответствии с пунктом 2.10 Положения Банка России N 421-П.7.2. В строках 4.1 - 4.3 раздела 2 Отчета отражаются оценочные величины денежных средств, которые могут быть привлечены от Банка России в рамках проведения операций рефинансирования.7.3. В строке 5 отражается величина лимита безотзывной кредитной линии, рассчитанная в соответствии с договором об открытии безотзывной кредитной линии, уменьшенная на определенную в соответствии с условиями договора об открытии безотзывной кредитной линии стоимость активов (с учетом поправочных коэффициентов, применяемых Банком России для соответствующих активов), использованных для расчета величины лимита безотзывной кредитной линии и включенных кредитной организацией в расчет высоколиквидных активов. В случае если кредитной организацией не заключен с Банком России договор об открытии безотзывной кредитной линии, ~~указанная~~ строка не заполняется.7.4. В строках 6.1 - 6.3 раздела 2 Отчета отражаются оценочные величины активов, которые могут быть переданы в обеспечение по кредиту Банка России в рамках проведения операций рефинансирования, в соответствующей валюте без учета поправочных коэффициентов, устанавливаемых Банком России. | 7. В разделе 2 Отчета отражается дополнительная информация к расчету ПКЛ в соответствии с главой 5 Положения Банка России N 421-П.7.1. В строках 1 - 3 раздела 2 Отчета отражаются величины скорректированных высоколиквидных активов уровня 1 (ВЛА-1), уровней 2А и 2Б (ВЛА-2А и ВЛА-2Б), рассчитанные с учетом сделок, в результате исполнения которых в течение ближайших 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ происходит изменение величины высоколиквидных активов соответствующего уровня (ВЛА-1скорр, ВЛА-2Аскорр, ВЛА-2Бскорр), в соответствии с пунктом 2.10 Положения Банка России N 421-П.7.2. В строках 4.1 - 4.3 раздела 2 Отчета отражаются оценочные величины денежных средств, которые могут быть привлечены от Банка России в рамках проведения операций рефинансирования.7.3. В строке 5 раздела 2 Отчета отражается величина лимита безотзывной кредитной линии, рассчитанная в соответствии с договором об открытии безотзывной кредитной линии, уменьшенная на определенную в соответствии с условиями договора об открытии безотзывной кредитной линии стоимость активов (с учетом поправочных коэффициентов, применяемых Банком России для соответствующих активов), использованных для расчета величины лимита безотзывной кредитной линии и включенных кредитной организацией в расчет высоколиквидных активов. В случае если кредитной организацией не заключен с Банком России договор об открытии безотзывной кредитной линии, строка 5 раздела 2 Отчета не заполняется.7.4. В строках 6.1 - 6.3 раздела 2 Отчета отражаются оценочные величины активов, которые могут быть переданы в обеспечение по кредиту Банка России в рамках проведения операций рефинансирования, в соответствующей валюте без учета поправочных коэффициентов, устанавливаемых Банком России. |
| 7.~~5.~~ В строке ~~7~~ раздела 2 Отчета отражается величина вложений в активы, не включенные в расчет числителя ПКЛ в соответствии с условиями пункта 2.1 Положения Банка России N 421-П. |  |
| 7.~~6.~~ В строках 7.1 - 7.3 раздела 2 Отчета отражаются величины активов, номинированных в долларах США, евро, японских йенах, английских фунтах стерлингов, швейцарских франках и соответствующих всем критериям высоколиквидных активов, но не включенных в расчет ПКЛ в соответствии с пунктом 2.9 Положения Банка России N 421-П. Информация предоставляется в разрезе уровней высоколиквидных активов. | 7.5. В строках 7.1 - 7.3 раздела 2 Отчета отражаются величины активов, номинированных в долларах США, евро, японских йенах, английских фунтах стерлингов, швейцарских франках и соответствующих всем критериям высоколиквидных активов, но не включенных в расчет ПКЛ в соответствии с пунктом 2.9 Положения Банка России N 421-П. Информация предоставляется в разрезе уровней высоколиквидных активов. |
|  | 7.6. В строке 8 раздела 2 Отчета отражается величина вложений в активы, не включенные в расчет числителя ПКЛ в соответствии с условиями пункта 2.1 Положения Банка России N 421-П. |
| 8. Отчет представляется в Банк России по состоянию на ~~1-е~~ число месяца, следующего за отчетным ~~периодом~~, ~~в целом~~ по кредитной организации (за исключением небанковских кредитных организаций), соответствующей хотя бы одному из следующих условий:кредитная организация признана Банком России системно значимой кредитной организацией в соответствии с Указанием Банка России от 13 апреля 2021 года N 5778-У "О методике определения системно значимых кредитных организаций"~~, зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации~~ 17 мая 2021 года N 63482 (далее - системно значимая кредитная организация); | 8. Отчет представляется в Банк России по состоянию на первое число месяца, следующего за отчетным месяцем, по кредитной организации в целом (за исключением небанковских кредитных организаций), соответствующей хотя бы одному из следующих условий:кредитная организация признана Банком России системно значимой кредитной организацией в соответствии с Указанием Банка России от 13 апреля 2021 года N 5778-У "О методике определения системно значимых кредитных организаций" <1> (далее - системно значимая кредитная организация);--------------------------------<1> Зарегистрировано Минюстом России 17 мая 2021 года, регистрационный N 63482. |
| кредитная организация является участником банковской группы, головной кредитной организацией которой является системно значимая кредитная организация, в случае если отчетные данные участника банковской группы подлежат включению в расчет норматива Н26 в соответствии с Положением Банка России от 3 декабря 2015 года N 510-П "О порядке расчета норматива краткосрочной ликвидности ("Базель III") системно значимыми кредитными организациями"~~, зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации~~ 28 декабря 2015 года N 40319, 2 сентября 2019 года N 55801, и по состоянию на 1 января текущего года удовлетворяет критериям пункта 7 части первой статьи 76 Федерального закона ~~"О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (Собрание законодательства Российской Федерации 2002, N 28, ст. 2790; 2018, N 49, ст. 7524)~~; | кредитная организация является участником банковской группы, головной кредитной организацией которой является системно значимая кредитная организация, в случае если отчетные данные участника банковской группы подлежат включению в расчет норматива Н26 в соответствии с Положением Банка России от 3 декабря 2015 года N 510-П "О порядке расчета норматива краткосрочной ликвидности ("Базель III") системно значимыми кредитными организациями" <2>, и по состоянию на 1 января текущего года удовлетворяет критериям пункта 7 части первой статьи 76 Федерального закона N 86-ФЗ;--------------------------------<2> Зарегистрировано Минюстом России 28 декабря 2015 года, регистрационный N 40319, с изменениями, внесенными Указаниями Банка России от 6 июня 2019 года N 5165-У (зарегистрировано Минюстом России 2 сентября 2019 года, регистрационный N 55801), от 3 августа 2020 года N 5520-У (зарегистрировано Минюстом России 3 ноября 2020 года, регистрационный N 60730), от 11 октября 2021 года N 5972-У (зарегистрировано Минюстом России 26 ноября 2021 года, регистрационный N 66002). |
| ~~по состоянию на 1 января текущего года~~ величина активов кредитной организации в соответствии со строкой 14 отчетности по форме 0409806 "Бухгалтерский баланс (публикуемая форма)" составляет 100 млрд рублей и более.Отчет представляется в Банк России в ~~следующий срок~~:кредитными организациями, за исключением крупных кредитных организаций с широкой сетью подразделений, - не позднее ~~10-го~~ рабочего дня месяца, следующего за отчетным;крупными кредитными организациями с широкой сетью подразделений - не позднее ~~12-го~~ рабочего дня месяца, следующего за отчетным. | величина активов кредитной организации по состоянию на 1 января текущего года в соответствии со строкой 14 отчетности по форме 0409806 "Бухгалтерский баланс (публикуемая форма)" составляет 100 млрд рублей и более.Отчет представляется в Банк России в следующие сроки:кредитными организациями, за исключением крупных кредитных организаций с широкой сетью подразделений, - не позднее десятого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;крупными кредитными организациями с широкой сетью подразделений - не позднее двенадцатого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем. |