

<b>информационные сообщения .....</b>	<b>2</b>
<b>аналитические материалы .....</b>	<b>5</b>
Мировая экономика в III квартале 2012 года .....	5
<b>кредитные организации.....</b>	<b>10</b>
Приказ Банка России от 27.12.2012 № ОД-867 .....	10
Приказ Банка России от 27.12.2012 № ОД-868 .....	10
<b>официальные документы .....</b>	<b>12</b>
Указание Банка России от 30.10.2012 № 2904-У “Об основаниях для отказа в согласовании Комитетом банковского надзора Банка России предложения конкурсного управляющего кредитной организации, функции которого осуществляет государственная корпорация “Агентство по страхованию вкладов”, об осуществлении передачи имущества (активов) и обязательств кредитной организации или их части приобретателю (приобретателям) и в согласовании приобретателя (приобретателей) имущества (активов) и обязательств кредитной организации” .....	12
Указание Банка России от 16.11.2012 № 2911-У “О внесении изменений в приложение I к Указанию Банка России от 14 июля 2005 года № 1594-У “О перечне, формах и порядке составления и представления отчетности ликвидируемых кредитных организаций в Центральный банк Российской Федерации” .....	13
Указание Банка России от 16.11.2012 № 2914-У “О внесении изменений в Указание Банка России от 17 ноября 2004 года № 1517-У “Об осуществлении выплат Банка России по вкладам физических лиц в признанных банкротами банках, не участвующих в системе обязательного страхования вкладов физических лиц в банках Российской Федерации, и о порядке взаимодействия банков-агентов с Банком России” .....	17
Указание Банка России от 03.12.2012 № 2919-У “Об оценке качества управления кредитной организации, осуществляющей функции центрального контрагента” .....	20
Письмо Банка России от 26.12.2012 № 182-Т “О включении ценных бумаг в Ломбардный список Банка России” .....	41

## ИНФОРМАЦИЯ

Департамент внешних и общественных связей Банка России сообщает, что приказом Банка России от 27.12.2012 № ОД-867\* отозвана лицензия на осуществление банковских операций у кредитной организации Небанковская кредитная организация Закрытое акционерное общество «Межрегиональный Клиринговый Центр» НКО ЗАО «МежрегионКлиринг-Центр» (г. Москва) с 27.12.2012.

Решение о применении крайней меры воздействия — отзыве лицензии на осуществление банковских операций — принято Банком России в связи с неисполнением НКО ЗАО «МежрегионКлирингЦентр» федеральных законов, регулирующих банковскую деятельность, а также нормативных актов Банка России, учитывая неоднократное применение в течение одного года мер, предусмотренных Федеральным законом «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)».

НКО ЗАО «МежрегионКлирингЦентр» нарушала правила ведения бухгалтерского

учета, порядок составления и представления отчетности в Банк России, а также не исполняла требования предписаний надзорного органа. Кредитная организация открывала счета клиентам и осуществляла по ним операции в значительном объеме с нарушением норм законодательства о валютном регулировании.

В соответствии с приказом Банка России от 27.12.2012 № ОД-868\* в НКО ЗАО «МежрегионКлирингЦентр» назначена временная администрация сроком действия до момента назначения в соответствии с Федеральным законом «О несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций» конкурсного управляющего либо назначения в соответствии со статьей 23.1 Федерального закона «О банках и банковской деятельности» ликвидатора. Полномочия исполнительных органов кредитной организации в соответствии с федеральными законами приостановлены.

27.12.2012 г.

## ОФИЦИАЛЬНОЕ СООБЩЕНИЕ

### о проведении ломбардного кредитного аукциона

Департамент внешних и общественных связей Банка России сообщает, что Центральный банк Российской Федерации 28 декабря 2012 года проведет ломбардный кредитный аукцион с кредитными организациями — резидентами Российской Федерации со сроком предоставления денежных средств «1 неделя».

Дата проведения аукционов	Дата предоставления средств	Дата возврата средств
28.12.2012	09.01.2013	16.01.2013

27.12.2012 г.

\* Опубликован в разделе «Кредитные организации».

## О выпуске в обращение памятных монет из драгоценных металлов

Департамент внешних и общественных связей Банка России сообщает, что 28 декабря 2012 года Банк России выпускает в обращение памятные монеты из драгоценных металлов:

- три серебряные монеты номиналом 2 рубля “Исакова М.Г.”, “Скобликова Л.П.” и “Гришин Е.Р.” серии “Выдающиеся спортсмены России” (конькобежный спорт);
- серебряную монету номиналом 3 рубля “Сезоны русского языка и литературы во Французской Республике и французского языка и литературы в Российской Федерации”;
- серебряную монету номиналом 25 рублей “Здание Адмиралтейства, архитектор Андреян Дмитриевич Захаров” серии “Архитектурные шедевры России”. Серебряные монеты номиналом 2 рубля (масса драгоценного металла в чистоте — 15,55 г, проба сплава — 925) имеют форму круга диаметром 33,0 мм.

С лицевой и оборотной сторон монет по окружности имеется выступающий кант.

На лицевой стороне монет в круге, обрамленном бусовым ободком, расположено рельефное изображение эмблемы Банка России — двуглавого орла с опущенными крыльями, под ним надпись полукругом “БАНК РОССИИ”, а также по окружности имеются надписи, разделенные точками: номинал монет — “ДВА РУБЛЯ” — и год чеканки — “2012 г.”, между ними проставлены обозначение металла по Периодической системе элементов Д.И. Менделеева, проба сплава, товарный знак Московского монетного двора и масса драгоценного металла в чистоте.

- На оборотной стороне расположены:
- первой монеты (каталожный номер — 5110-0120) — рельефное изображение М.Г. Исаковой и конькобежки, слева по окружности имеется надпись “МАРИЯ ИСАКОВА”;



- второй монеты (каталожный номер — 5110-0121) — рельефное изображение

Л.П. Скобликовой и конькобежки, слева по окружности имеется надпись “ЛИДИЯ СКОБЛИКОВА”;



- третьей монеты (каталожный номер — 5110-0122) — рельефное изображение Е.Р. Гришина и конькобежца, слева по окружности имеется надпись “ЕВГЕНИЙ ГРИШИН”.



Боковая поверхность монет рифленая. Монеты изготовлены качеством “пруф”. Тираж монет — по 3,0 тыс. штук каждого вида.

Серебряная монета номиналом 3 рубля (масса драгоценного металла в чистоте — 31,1 г, проба сплава — 925, каталожный номер — 5111-0248) имеет форму круга диаметром 39,0 мм.

С лицевой и оборотной сторон монеты по окружности имеется выступающий кант.

На лицевой стороне монеты в круге, обрамленном бусовым ободком, расположено рельефное изображение эмблемы Банка России — двуглавого орла с опущенными крыльями, под ним надпись полукругом “БАНК РОССИИ”, а также по окружности имеются надписи, разделенные точками: номинал монеты — “ТРИ РУБЛЯ” — и год чеканки — “2012 г.”, между ними проставлены обозначение металла по Периодической системе элементов Д.И. Менделеева, проба сплава, товарный знак Санкт-Петербургского монетного двора и масса драгоценного металла в чистоте.

На оборотной стороне монеты расположены рельефные изображения: в центре —

портрета писателя И.А. Бунина, слева от него — фрагмента собора Покрова на рву на Красной площади в г. Москве, справа — стилизованное изображение зданий и Эйфелевой башни в г. Париже, ниже — раскрытой книги с цветком, имеются надписи: над книгой — “СЕЗОНЫ”, слева — “ФРАНЦУЗСКОГО ЯЗЫКА И ЛИТЕРАТУРЫ В РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ”, ниже под книгой — “РУССКОГО ЯЗЫКА И ЛИТЕРАТУРЫ ВО ФРАНЦУЗСКОЙ РЕСПУБЛИКЕ”.



Боковая поверхность монеты рифленая. Монета изготовлена качеством “пруф”. Тираж монеты — 5,0 тыс. штук.

Серебряная монета номиналом 25 рублей (масса драгоценного металла в чистоте — 155,5 г, проба сплава — 925, каталожный номер — 5115-0079) имеет форму круга диаметром 60,0 мм.

С лицевой и оборотной сторон монеты по окружности имеется выступающий кант.

На лицевой стороне монеты в круге, обрамленном бусовым ободком, расположено рельефное изображение эмблемы Банка России — двуглавого орла с опущенными крыльями, под ним надпись полукругом “БАНК РОССИИ”, а также по окружности имеются надпи-

си, разделенные точками: номинал монеты — “ДВАДЦАТЬ ПЯТЬ РУБЛЕЙ” — и год чеканки — “2012 г.”, между ними проставлены обозначение металла по Периодической системе элементов Д.И. Менделеева, проба сплава, товарный знак Санкт-Петербургского монетного двора и масса драгоценного металла в чистоте.

На оборотной стороне монеты слева на матовом поле расположено изображение центральной части главного фасада здания Адмиралтейства в г. Санкт-Петербурге и ниже — выполненное в цвете изображение капители, справа — рельефное изображение портрета архитектора, под портретом имеется надпись в три строки — “АНДРЕЯН ДМИТРИЕВИЧ ЗАХАРОВ”.



Боковая поверхность монеты рифленая. Монета изготовлена качеством “пруф”. Тираж монеты — 1,5 тыс. штук.

Выпускаемые монеты являются законным средством наличного платежа на территории Российской Федерации и обязательны к приему по номиналу во все виды платежей без всяких ограничений.

## МИРОВАЯ ЭКОНОМИКА В III КВАРТАЛЕ 2012 ГОДА

В III квартале 2012 г. рост мировой экономики замедлился. Продолжался циклический спад в еврозоне, начавшийся в IV квартале 2011 года. На протяжении длительного времени сокращался ВВП в Италии, Испании, Португалии, в последние два квартала — также в Словении и Финляндии. Кроме того, в III квартале 2012 г. значительно сократился ВВП Нидерландов. В то же время производство товаров и услуг в Германии продолжало увеличиваться. Возобновился рост ВВП Франции, а среди стран, не входящих в еврозону, — Великобритании и Швейцарии. Существенно повысились темпы роста экономики США. Сократилось производство товаров и услуг в Японии. Замедлился рост ВВП Китая и Республики Корея.

Следствием неопределенности перспектив глобального спроса стало продолжение инвестиционного спада. В еврозоне уменьшение вложений в основной капитал наблюдалось шестой квартал подряд. Продолжали сокращаться инвестиции в Италии и Испании, возобновилось их снижение во Франции (после увеличения во II квартале). В условиях падения спроса на жилье и низкой загрузки производственных мощностей резко уменьшились вложения в основной капитал в Нидерландах. В то же время приостановился инвестиционный спад в Германии, которая характеризуется относительно более высоким по сравнению с еврозоной в целом уровнем загрузки производственных мощностей, а также повышением активности в жилищном строи-

тельстве. В США впервые после I квартала 2011 г. сократились вложения в основной капитал производственной сферы. Инвестиции в жилищное строительство продолжали расти. Повышение цен на рынке жилья и увеличение числа закладок фундаментов жилых домов указывают на оживление в отрасли после длительной депрессии.

Фактором, способствовавшим повышению совокупного спроса в развитых странах, была динамика потребительских расходов. В США расходы на потребление домашних хозяйств росли стабильными темпами, чему способствовало увеличение располагаемых доходов населения относительно предыдущего квартала. В еврозоне расходы домашних хозяйств, сокращавшиеся на протяжении трех предыдущих кварталов, в III квартале не изменились. Их рост отмечался в Германии, где относительно предыдущего года сократилась безработица и повысилась реальная заработная плата. Увеличение потребительских расходов наблюдалось также во Франции. В Италии и Испании продолжалось их сокращение. Потребительская активность в развитых странах поддерживается мягкой денежно-кредитной политикой, однако в условиях необходимости сокращения дефицитов государственных бюджетов эта политика не может быть дополнена стимулированием спроса за счет государственных расходов.

Инфляция в крупнейших экономиках мира в III квартале 2012 г. была ниже, чем в предыдущем квартале. Замедлился рост по-

**Таблица 1. Основные показатели экономического развития ведущих стран мира (в % к аналогичному периоду предыдущего года, если не указано иное)**

	Реальный ВВП*			Промышленное производство**			Потребительские цены			Уровень безработицы***		
	январь–сентябрь 2010	январь–сентябрь 2011	январь–сентябрь 2012	январь–сентябрь 2010	январь–сентябрь 2011	январь–сентябрь 2012	январь–сентябрь 2010	январь–сентябрь 2011	январь–сентябрь 2012	январь–сентябрь 2010	январь–сентябрь 2011	январь–сентябрь 2012
США	2,4	1,8	2,4	5,1	4,1	4,2	1,8	3,1	2,1	9,6	9,0	8,2
Япония	5,1	-0,7	2,6	20,2	-3,1	1,0	-0,9	-0,3	0,0	5,1	4,6	4,4
Китай	10,6	9,4	7,7	-2,3	14,2	10,0	2,9	5,7	2,8	4,3	4,1	4,1
Великобритания	1,9	0,9	0,0	1,8	-0,1	-2,5	3,3	4,4	2,9	7,9	7,9	8,1
Еврозона****	1,8	1,8	-0,4	7,0	4,7	-2,1	1,5	2,6	2,6	10,1	10,0	11,2
Германия	4,0	3,5	1,0	10,1	9,4	-0,2	1,0	2,4	2,2	7,8	7,1	6,8
Франция	1,5	1,9	0,2	4,9	2,4	-2,3	1,7	2,2	2,4	9,3	9,1	9,8
Италия	1,6	0,9	-2,0	7,1	1,3	-6,3	1,5	2,6	3,5	8,4	8,2	10,4

По данным национальных источников статистической информации и агентства Eurostat.

\* На основе сезонно сглаженных данных (кроме Китая).

\*\* Для Китая — производство всех государственных предприятий и негосударственных предприятий с годовым объемом продаж свыше 5 млн. юаней.

\*\*\* В % от численности экономически активного населения, в среднем за период; для Китая — уровень безработицы в городах на начало периода.

\*\*\*\* В составе 17 стран.

требительских цен в США, Китае, Республике Корея, Турции, в Японии возобновилось их снижение. В еврозоне темпы инфляции не изменились.

ВВП США в III квартале 2012 г. увеличился относительно аналогичного квартала предыдущего года на 2,6% (во II квартале — на 2,1%). Повышение темпов роста было обусловлено сокращением отрицательного вклада государственных расходов и увеличением положительного вклада прироста запасов готовой продукции.

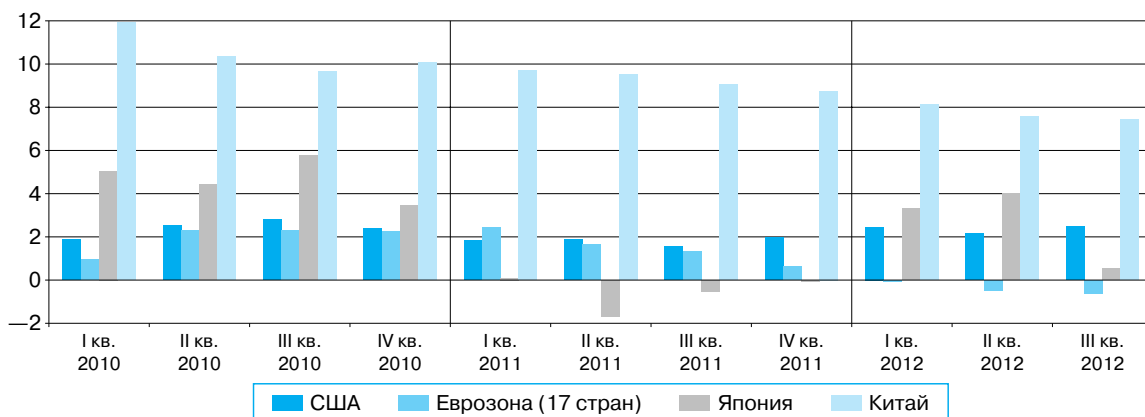
Относительно предыдущего квартала ВВП США увеличился на 0,8% (во II квартале — на 0,3%)<sup>1</sup>. Ускорение роста ВВП было обусловлено возобновившимся увеличением государственных расходов и динамикой запасов готовой продукции. Рост вложений в основной капитал замедлился, причем их увеличение наблюдалось исключительно в сфере жилищно-строительства. Инвестиции в производст-

венную сферу сократились после пяти кварталов непрерывного роста. При этом инвестиции в оборудование и нематериальные активы уменьшились, тогда как объем инвестиций в здания и сооружения не изменился.

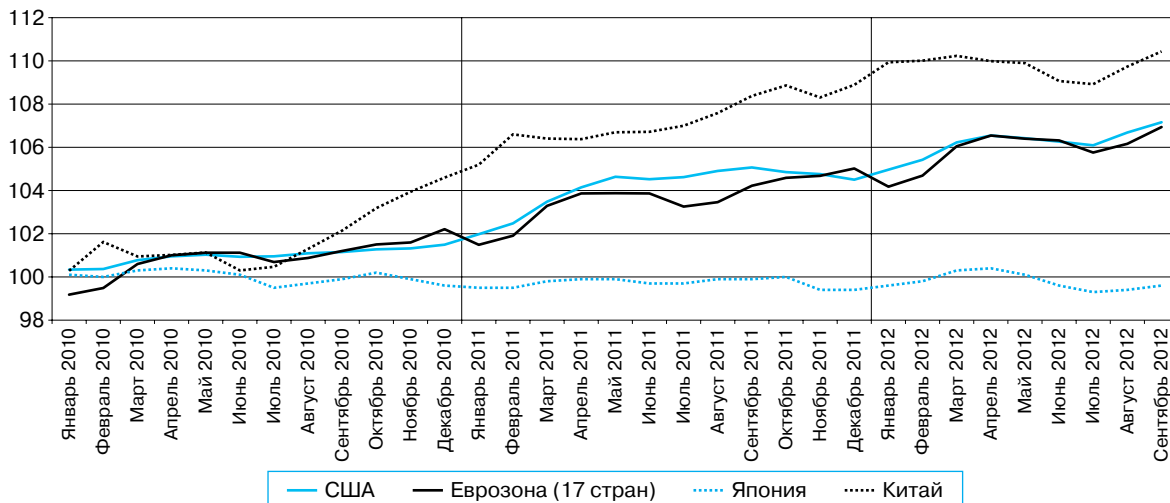
ВВП еврозоны в III квартале 2012 г. сократился относительно аналогичного квартала предыдущего года на 0,6% (во II квартале — на 0,5%). Относительно предыдущего квартала ВВП еврозоны в III квартале 2012 г. уменьшился на 0,1% (во II квартале — на 0,2%). Спад был обусловлен снижением внутреннего спроса. Продолжалось падение валового накопления и государственных расходов. В то же время расходы домашних хозяйств стабилизировались после сокращения на протяжении трех предыдущих кварталов.

ВВП Японии в III квартале 2012 г. относительно аналогичного квартала предыдущего года увеличился на 0,5% (во II квартале — на 4,0%). Снизились темпы роста потреби-

**Рисунок 1. Прирост реального ВВП США, еврозоны, Японии и Китая в 2010–2012 гг. (в % по отношению к аналогичному кварталу предыдущего года)**



**Рисунок 2. Изменение уровня потребительских цен в ведущих экономиках мира в 2010–2012 гг. (рост в % к декабрю 2009 г.)**



<sup>1</sup> Прирост ВВП в пересчете на год, который обычно публикуется Бюро экономического анализа США, составил соответственно 1,3% во II квартале 2012 г. и 3,1% в III квартале.



тельских расходов, вложений в основной капитал, вклад чистого экспорта стал отрицательным вследствие уменьшения экспорта товаров и услуг.

Сокращение ВВП Японии относительно предыдущего квартала составило в рассматриваемый период 0,9% (во II квартале данный показатель не изменился), что было обусловлено снижением потребительских расходов, вложений в основной капитал и уменьшением экспорта товаров и услуг.

Замедление роста глобального спроса и неустойчивое состояние мировых финансовых рынков обусловили снижение темпов роста ВВП стран с формирующейся рыночной экономикой. ВВП Китая в январе—сентябре 2012 г. увеличился относительно аналогичного периода предыдущего года на 7,7% (в первые девять месяцев 2011 г. — на 9,4%). В Индии рост ВВП составил 5,4% (в январе—сентябре 2011 г. — 7,5%), в Республике Корея — 2,2% (3,7%), в Турции — 2,6% (9,8%), в Бразилии — 0,7% (3,2%).

Инфляция (темпы роста потребительских цен по отношению к аналогичному месяцу предыдущего года) в США в первые девять месяцев 2012 г. колебалась от 2,9% в январе—феврале до 1,4% в июле (в январе—сентябре 2011 г. — от 1,6 до 3,9%). В III квартале 2012 г. относительно аналогичного квартала предыдущего года прирост цен составил 1,7% (во II квартале — 1,9%). Замедление инфляции было обусловлено уменьшением темпов базовой инфляции. Снижение цен на энергоносители было менее значительным, чем во II квартале.

Инфляция в еврозоне менялась от 2,7% в январе—марте до 2,4% в мае—июле (в январе—сентябре 2011 г. — от 2,3 до 3,0%). С декабря 2010 г. инфляция в еврозоне остается выше среднесрочного ориентира ЕЦБ — 2%. В III квартале 2012 г. ускорился рост цен на энергоносители. Однако стабильность базовой инфляции обусловила неизменность

общей инфляции. Прирост потребительских цен относительно аналогичного квартала предыдущего года составил 2,5%, оставшись на уровне II квартала.

Изменение потребительских цен в Японии колебалось в диапазоне от роста на 0,5% в марте—апреле 2012 г. до снижения на 0,5% в августе (в январе—сентябре 2011 г. — от снижения на 0,6% до роста на 0,2%). В III квартале 2012 г. относительно аналогичного квартала предыдущего года потребительские цены снизились на 0,4% (во II квартале — возросли на 0,2%).

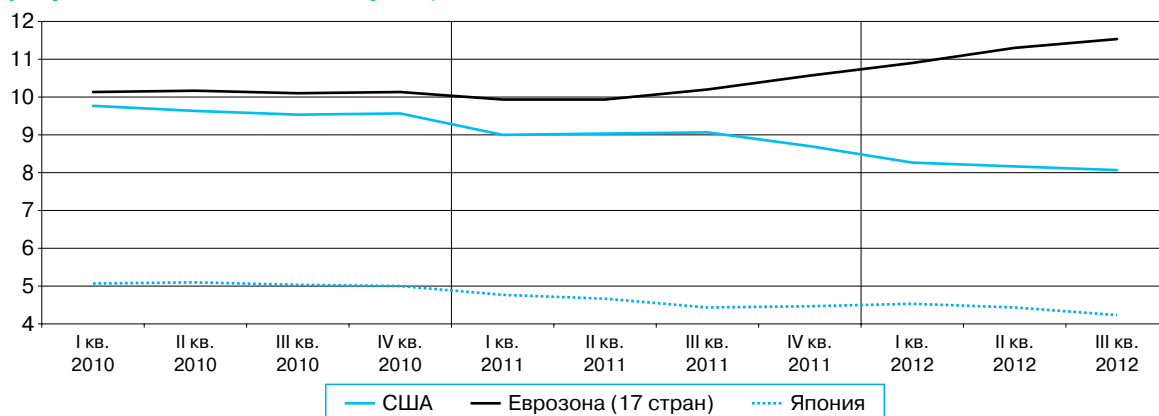
Инфляция в Китае колебалась в диапазоне от 4,5% в январе 2012 г. до 1,8% в июле (в январе—сентябре 2011 г. — от 4,9 до 6,5%). В III квартале 2012 г. относительно аналогичного квартала предыдущего года она составила 1,9% (во II квартале — 2,9%). Темпы роста цен на продукты питания снизились с 5,7 до 2,8%.

В Республике Корея инфляция в III квартале составила 1,6% (во II квартале — 2,4%), в Турции — 9,0% (9,4%), в Бразилии — 5,2% (5,0%).

Уровень безработицы в США в III квартале 2012 г. понизился до 8,1% от численности экономически активного населения по сравнению с 8,2% во II квартале. В еврозоне он повысился с 11,3 до 11,5%. Это самый высокий уровень безработицы за все время существования Экономического и валютного союза.

Дефицит торговли товарами США в январе—сентябре 2012 г. составил 553,9 млрд. долл. (в январе—сентябре 2011 г. — 549,2 млрд. долл.). Экспорт товаров увеличился на 5,5% (в январе—сентябре 2011 г. — на 18,1%). Темпы роста экспорта в Китай были близки к средним. Экспорт в еврозону увеличился лишь на 0,3%. Импорт товаров возрос на 3,9% (в январе—сентябре 2011 г. — на 16,5%). Темпы роста импорта из стран еврозоны находились на среднем уровне. Выше средних были темпы

**Рисунок 3. Уровень безработицы в ведущих развитых экономиках в 2010—2012 гг. (в среднем за отчетный квартал, % от численности экономически активного населения)**



роста импорта из Китая (6,5%). Дефициты торговли с Китаем и странами еврозоны увеличились. Дефицит торговли товарами США в III квартале 2012 г. уменьшился до 173,9 млрд. долл. по сравнению со 185,7 млрд. долл. во II квартале, что объяснялось сокращением импорта.

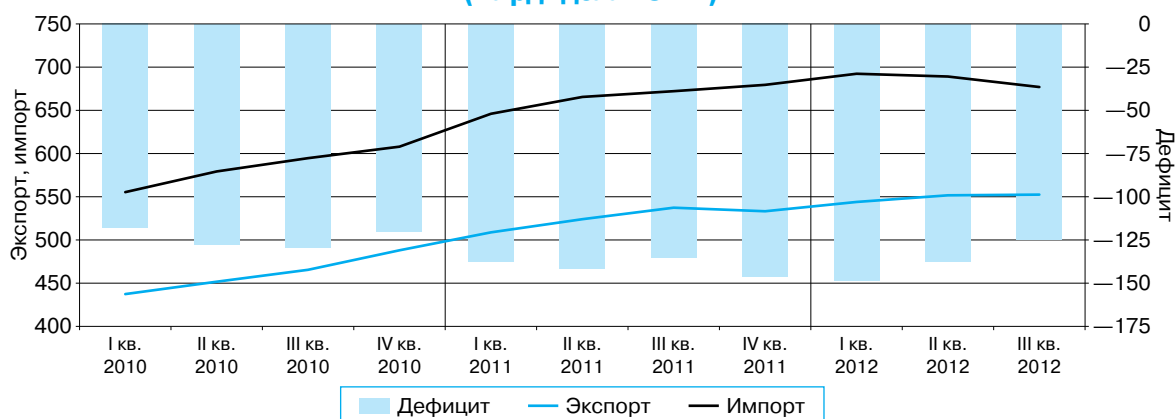
В торговле товарами еврозоны в январе—сентябре 2012 г. сложилось положительное сальдо в размере 53,7 млрд. евро (в соответствующий период 2011 г. наблюдался дефицит в размере 6,6 млрд. евро). Экспорт товаров увеличился на 8,3% (годом ранее — на 14,7%), импорт товаров возрос на 3,7% (на 16,4%). В III квартале положительное сальдо торговли товарами еврозоны составило 21,7 млрд. евро (во II квартале — 25,7 млрд. евро). Его сокращение обусловлено увеличением импорта при отсутствии роста экспорта.

В торговле товарами Китая в январе—сентябре 2012 г. сложилось положительное сальдо в размере 180,2 млрд. долл. (в первые девять месяцев 2011 г. — 124 млрд. долл.), экспорт товаров увеличился на 7,8% (на 22%), импорт — на 4,6% (на 27%). Положительное

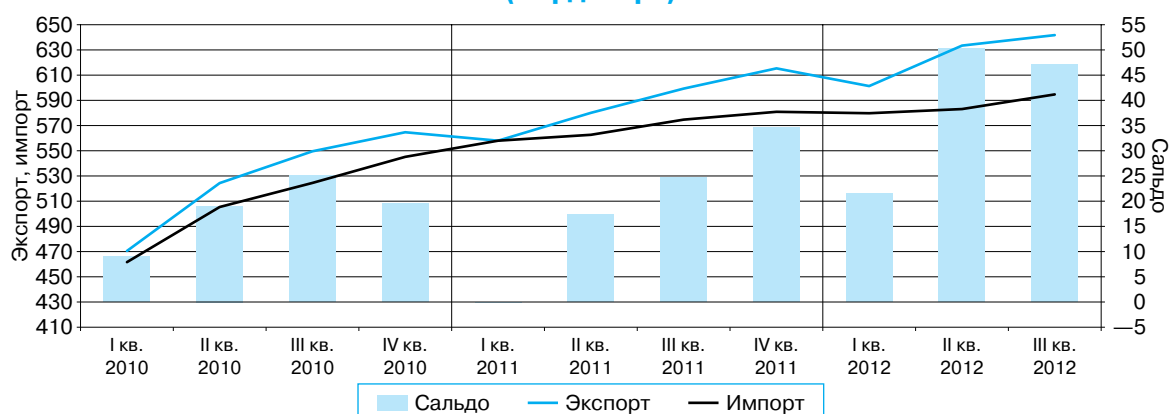
сальдо торговли товарами в III квартале возросло до 79,4 млрд. долл. по сравнению с 68,3 млрд. долл. во II квартале. Темпы увеличения экспорта резко снизились, но оставались более высокими по сравнению с темпами роста импорта.

Согласно прогнозам МВФ и Еврокомиссии (октябрь—ноябрь 2012 г.) темпы роста мировой экономики понизятся с 3,8% в 2011 г. до 3,1—3,3% в 2012 году. В 2013 г. они составят, по тем же прогнозам, 3,3—3,6%. МВФ, ОЭСР и Еврокомиссия прогнозируют рост ВВП США на 2,1—2,2% в 2012 г. и на 2,0—2,3% в 2013 г. (в 2011 г. данный показатель возрос на 1,8%). ВВП еврозоны согласно прогнозам в 2012 г. сократится на 0,4%, а в 2013 г. вероятно его изменение в диапазоне от сокращения на 0,1% до роста на 0,2% (в 2011 г. он возрос на 1,5%). ВВП Китая, как ожидается, возрастет на 7,5—7,8% в 2012 г. и на 7,7—8,5% в 2013 г. (в 2011 г. его рост составил 9,2%). Данные прогнозы, однако, можно рассматривать как сравнительно оптимистичные, поскольку они не учитывают последствий возможного выбора США в пользу жесткой бюджетной политики.

**Рисунок 4. Внешняя торговля товарами и услугами США в 2010–2012 гг. (млрд. долл. США)**



**Рисунок 5. Внешняя торговля товарами и услугами еврозоны в 2010–2012 гг. (млрд. евро)**





Продолжение инвестиционного спада, рост безработицы, сокращение государственных расходов указывают на вероятность уменьшения ВВП еврозоны в IV квартале 2012 г. и, возможно, в I квартале 2013 года. Совершенствование механизмов финансовой помощи странам — участницам еврозоны и успешная реструктуризация долга Греции уменьшают вероятность шоков, связанных с риском неплатежеспособности отдельных государств еврозоны. В то же время продолжение мероприятий по сокращению бюджетных дефицитов воздействует на внутренний спрос в сторону его понижения.

Существующие прогнозы предполагают уменьшение в 2013 г. ВВП отдельных стран еврозоны (Греции, Испании, Италии, Португалии, Словении). В течение года в еврозоне

ожидается снижение внутреннего спроса. Увеличение ВВП возможно за счет чистого экспорта. Соответственно динамика производства товаров и услуг будет в значительной мере зависеть от способности стран еврозоны увеличить экспорт своих товаров и услуг.

Перспективы мировой экономики в большой степени зависят от налогово-бюджетной политики США в 2013 году. Действующим законодательством предусмотрен секвестр государственных расходов в сочетании с отменой налоговых льгот. Это может привести в краткосрочной перспективе к существенному снижению деловой активности и сокращению ВВП США. Если будет принят менее жесткий вариант фискальной политики, сохранятся предпосылки к продолжению подъема экономики США в наступающем году.

27 декабря 2012 года

№ ОД-867

**ПРИКАЗ****Об отзыве лицензии на осуществление банковских операций у кредитной организации  
Небанковская кредитная организация Закрытое акционерное общество  
“Межрегиональный Клиринговый Центр” НКО ЗАО “МежрегионКлирингЦентр”  
(г. Москва)**

В связи с неисполнением кредитной организацией Небанковская кредитная организация Закрытое акционерное общество “Межрегиональный Клиринговый Центр” федеральных законов, регулирующих банковскую деятельность, а также нормативных актов Банка России, учитывая неоднократное применение в течение одного года мер, предусмотренных Федеральным законом “О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)”, руководствуясь статьей 19, пунктом 6 части первой статьи 20 Федерального закона “О банках и банковской деятельности”, частью третьей статьи 74 Федерального закона “О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)”,

ПРИКАЗЫВАЮ:

1. Отозвать с 27 декабря 2012 года лицензию на осуществление банковских операций у кредитной организации Небанковская кредитная организация Закрытое акционерное общество “Межрегиональный Клиринговый Центр” (регистрационный номер Банка России 3424-К, дата регистрации — 15.11.2002).

2. Прекращение деятельности кредитной организации Небанковская кредитная ор-

ганизация Закрытое акционерное общество “Межрегиональный Клиринговый Центр” осуществлять в соответствии с Федеральным законом “О банках и банковской деятельности” и нормативными актами Банка России.

3. Департаменту внешних и общественных связей Банка России опубликовать настоящий приказ в “Вестнике Банка России” в недельный срок со дня его регистрации и дать для средств массовой информации сообщение об отзыве лицензии на осуществление банковских операций у кредитной организации Небанковская кредитная организация Закрытое акционерное общество “Межрегиональный Клиринговый Центр”.

ПЕРВЫЙ  
ЗАМЕСТИТЕЛЬ  
ПРЕДСЕДАТЕЛЯ  
БАНКА РОССИИ,  
ПРЕДСЕДАТЕЛЬ  
КОМИТЕТА  
БАНКОВСКОГО  
НАДЗОРА

А.Ю. СИМАНОВСКИЙ

27 декабря 2012 года

№ ОД-868

**ПРИКАЗ****О назначении временной администрации по управлению кредитной организацией  
Небанковская кредитная организация Закрытое акционерное общество  
“Межрегиональный Клиринговый Центр” НКО ЗАО “МежрегионКлирингЦентр”  
(г. Москва) в связи с отзывом лицензии на осуществление банковских операций**

В соответствии с пунктом 2 статьи 17 Федерального закона “О несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций”, в связи с отзывом лицензии на осуществление банковских операций у кредитной организации Небанковская кредитная организация Закрытое акционерное общество “Межрегиональный Клиринговый Центр” (регистрационный номер Банка России 3424-К, дата регистрации — 15.11.2002) приказом Банка России от 27 декабря 2012 года № ОД-867

ПРИКАЗЫВАЮ:

1. Назначить с 27 декабря 2012 года временную администрацию по управлению кредитной организацией Небанковская кредитная организация Закрытое акционерное

общество “Межрегиональный Клиринговый Центр” сроком действия в соответствии с Федеральным законом “О несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций” до дня вынесения арбитражным судом решения о признании банкротом и об открытии конкурсного производства (утверждения конкурсного управляющего) или до дня вступления в законную силу решения арбитражного суда о назначении ликвидатора.

2. Назначить руководителем временной администрации по управлению кредитной организацией Небанковская кредитная организация Закрытое акционерное общество “Межрегиональный Клиринговый Центр” Губочкина Юрия Васильевича — главного экономиста

отдела контактного надзора № 3 Управления банковского надзора Московского ГТУ Банка России.

3. Утвердить состав временной администрации по управлению кредитной организацией Небанковская кредитная организация Закрытое акционерное общество “Межрегиональный Клиринговый Центр” согласно приложению к настоящему приказу.

4. В соответствии со статьями 22, 22.1, 23 Федерального закона “О несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций” приостановить на период деятельности временной администрации полномочия исполнительных органов кредитной организации Небанковская кредитная организация Закрытое акционерное общество “Межрегиональный Клиринговый Центр”.

5. Установить главными задачами временной администрации осуществление функций, предусмотренных статьей 22.1 Федерального закона “О несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций”, и иных полномочий, определенных федеральными законами “О несостоятельности (банкротст-

ве) кредитных организаций” и “О банках и банковской деятельности” и принятыми в соответствии с ними нормативными актами Банка России.

6. Руководителям территориальных учреждений Банка России довести в установленном порядке содержание настоящего приказа до сведения всех кредитных организаций, расположенных на подведомственной территории.

7. Департаменту внешних и общественных связей Банка России опубликовать настоящий приказ в “Вестнике Банка России” в десятидневный срок с момента принятия и дать для средств массовой информации соответствующее сообщение.

ПЕРВЫЙ  
ЗАМЕСТИТЕЛЬ  
ПРЕДСЕДАТЕЛЯ  
БАНКА РОССИИ,  
ПРЕДСЕДАТЕЛЬ  
КОМИТЕТА  
БАНКОВСКОГО  
НАДЗОРА А.Ю. СИМАНОВСКИЙ

**Приложение**  
к приказу Центрального банка  
Российской Федерации  
от 27 декабря 2012 г. № ОД-868

**Состав временной администрации по управлению кредитной организацией  
Небанковская кредитная организация Закрытое акционерное общество  
“Межрегиональный Клиринговый Центр”**

Руководитель временной администрации:  
Губочкин Юрий Васильевич — главный экономист отдела контактного надзора № 3 Управления банковского надзора Московского ГТУ Банка России.

Члены временной администрации:  
Боев Олег Викторович — ведущий юрисконсульт юридического отдела Отделения № 1 Московского ГТУ Банка России.

Мигачева Елена Валерьевна — экономист 1 категории отдела банковского надзора № 2 Отделения № 1 Московского ГТУ Банка России.

Зарегистрировано  
Министерством юстиции  
Российской Федерации  
21 декабря 2012 года  
Регистрационный № 26307

30 октября 2012 года

№ 2904-У

## УКАЗАНИЕ

### **Об основаниях для отказа в согласовании Комитетом банковского надзора Банка России предложения конкурсного управляющего кредитной организации, функции которого осуществляет государственная корпорация “Агентство по страхованию вкладов”, об осуществлении передачи имущества (активов) и обязательств кредитной организации или их части приобретателю (приобретателям) и в согласовании приобретателя (приобретателей) имущества (активов) и обязательств кредитной организации**

В соответствии со статьей 50<sup>33</sup> Федерального закона от 25 февраля 1999 года № 40-ФЗ “О несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций” (Собрание законодательства Российской Федерации, 1999, № 9, ст. 1097; 2001, № 26, ст. 2590; 2002, № 12, ст. 1093; 2004, № 31, ст. 3220; № 34, ст. 3536; 2006, № 52, ст. 5497; 2007, № 1, ст. 10; № 49, ст. 6064; 2008, № 30, ст. 3616; № 52, ст. 6225; 2009, № 18, ст. 2153; № 29, ст. 3632; 2011, № 7, ст. 905; № 27, ст. 3873; № 50, ст. 7351; 2012, № 31, ст. 4333) Банк России устанавливает основания для отказа в согласовании Комитетом банковского надзора Банка России предложения конкурсного управляющего кредитной организации, функции которого осуществляет государственная корпорация “Агентство по страхованию вкладов” (далее — Агентство), об осуществлении передачи имущества (активов) и обязательств кредитной организации или их части приобретателю (приобретателям) и в согласовании приобретателя (приобретателей) имущества (активов) и обязательств кредитной организации.

1. Комитет банковского надзора Банка России не позднее десяти рабочих дней со дня поступления предложения Агентства об осуществлении передачи имущества (активов) и обязательств кредитной организации или их части приобретателю (приобретателям) (далее — предложение Агентства) принимает решение об отказе в согласовании предложения Агентства по следующим основаниям:

представленные Агентством документы позволяют сделать вывод о том, что при передаче имущества (активов) и обязательств кредитной организации или их части приобретателю (приобретателям) могут быть не соблюдены принципы пропорциональности и очередности удовлетворения требований кредиторов, эквивалентности размера передаваемых обязательств стоимости передаваемого

имущества (активов) кредитной организации, защиты прав и законных интересов кредиторов, минимизации их потерь при реализации ими права получить удовлетворение своих законных требований, равенства кредиторов одной очереди;

отсутствие в предложении Агентства информации о составе и стоимости имущества (активов) и обязательств кредитной организации, результатах оценки передаваемого имущества и активов кредитной организации или их части и обоснования целесообразности передачи имущества (активов) и обязательств кредитной организации.

2. Комитет банковского надзора Банка России принимает решение об отказе в согласовании приобретателя (приобретателей) — кредитных организаций, направивших заявку на участие в отборе приобретателя (приобретателей) для передачи имущества (активов) и обязательств кредитной организации или их части (далее — приобретатель), по следующим основаниям:

финансовая устойчивость приобретателя признается Банком России недостаточной для исполнения получаемых обязательств, а также для выполнения обязательных нормативов и нормативов обязательных резервов, установленных Банком России, после передачи приобретателю активов и обязательств с учетом оценки передаваемого Агентством имущества и активов в соответствии с нормативными актами Банка России;

несоответствие приобретателя критериям 1 или 2 классификационной группы, установленным нормативными актами Банка России для оценки экономического положения кредитной организации;

отсутствие у приобретателя лицензии на привлечение во вклады денежных средств физических лиц и на открытие и ведение банковских счетов физических лиц, выданной Банком России;

осуществление приобретателем деятельности по привлечению во вклады денежных средств физических лиц менее трех лет;

применение Банком России в отношении приобретателя мер, предусмотренных пунктом 4 части второй статьи 74 Федерального закона от 10 июля 2002 года № 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, № 28, ст. 2790; 2003, № 2, ст. 157; № 52, ст. 5032; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3233; 2005, № 25, ст. 2426; № 30, ст. 3101; 2006, № 19, ст. 2061; № 25, ст. 2648; 2007, № 1, ст. 9, ст. 10; № 10, ст. 1151; № 18, ст. 2117; 2008, № 42, ст. 4696, ст. 4699; № 44, ст. 4982; № 52, ст. 6229, ст. 6231; 2009, № 1, ст. 25; № 29, ст. 3629; № 48, ст. 5731; 2010, № 45, ст. 5756; 2011, № 7, ст. 907; № 27, ст. 3873; № 43, ст. 5973);

применение Банком России в отношении приобретателя меры воздействия в виде ограничения на привлечение во вклады денежных средств физических лиц, открытие и ведение банковских счетов физических лиц;

наличие просроченных денежных обязательств перед Банком России, в том числе по кредитам Банка России и процентам по ним;

наличие недовзноса в обязательные резервы, неуплаченных штрафов за нарушение нормативов обязательных резервов, непред-

ставленного расчета размера обязательных резервов;

предложенный приобретателем период отсрочки исполнения обязательств перед Агентством как кредитором по обязательствам, перешедшим к Агентству в результате выплаты им страхового возмещения вкладчикам кредитной организации, больше периода отсрочки, предложенного другим приобретателем (другими приобретателями), направившим заявку на участие в отборе.

3. Не позднее двух рабочих дней со дня принятия Комитетом банковского надзора Банка России решения о согласовании (отказе в согласовании) предложения Агентства и решения о согласовании (отказе в согласовании) приобретателя (приобретателей) Банк России уведомляет Агентство о принятом решении.

4. Настоящее Указание вступает в силу по истечении 10 дней после дня его официального опубликования в "Вестнике Банка России".

ПРЕДСЕДАТЕЛЬ  
ЦЕНТРАЛЬНОГО  
БАНКА  
РОССИЙСКОЙ  
ФЕДЕРАЦИИ

С.М. ИГНАТЬЕВ

Зарегистрировано  
Министерством юстиции  
Российской Федерации  
18 декабря 2012 года  
Регистрационный № 26180

16 ноября 2012 года

№ 2911-У

## УКАЗАНИЕ

### О внесении изменений в приложение 1 к Указанию Банка России от 14 июля 2005 года № 1594-У "О перечне, формах и порядке составления и представления отчетности ликвидируемых кредитных организаций в Центральный банк Российской Федерации"

1. В соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от 9 ноября 2012 года № 22) внести в приложение 1 к Указанию Банка России от 14 июля 2005 года № 1594-У "О перечне, формах и порядке составления и представления отчетности ликвидируемых кредитных организаций в Центральный банк Российской Федерации", зарегистрированному Министерством юстиции Российской Федерации 2 августа 2005 года № 6861, 23 июля 2007 года № 9877, 13 декабря 2007 года № 10696, 4 июня 2008 года № 11792, 12 мая

2011 года № 20719 ("Вестник Банка России" от 19 августа 2005 года № 44, от 2 августа 2007 года № 44, от 26 декабря 2007 года № 71, от 11 июня 2008 года № 32, от 25 мая 2011 года № 29), следующие изменения.

1.1. В Порядке составления и представления отчетности по форме 0409359 "Сведения о формировании конкурсной массы, об итогах инвентаризации и оценки имущества (активов)":

в пункте 5:

абзац первый изложить в следующей редакции:

“5. В графе 5 отражается рыночная стоимость имущества (активов), определенная в соответствии с отчетом оценщика, в случае если такая оценка проводилась в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации.”;

абзац второй признать утратившим силу;

третье предложение пункта 7 исключить; дополнить пунктом 11 следующего содержания:

“11. В графе 6 по соответствующим строкам справочно приводятся сведения о балансовой и рыночной стоимости имущества (активов) кредитной организации, переданного приобретателю (приобретателям) в порядке, предусмотренном пунктами 1<sup>1</sup>—1<sup>13</sup> статьи 50.33 Федерального закона “О несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций”, при осуществлении Агентством функций конкурсного управляющего (ликвидатора).

Также в графе 6 по соответствующим строкам справочно приводятся данные о сумме переданного кредиторам имущества в счет погашения их требований путем предоставления отступного в порядке, предусмотренном пунктами 10—10<sup>4</sup> статьи 50.40 Федерального закона “О несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций.”.

1.2. Форму отчетности 0409360 “Сведения о требованиях кредиторов” изложить в редакции приложения к настоящему Указанию.

1.3. Порядок составления и представления отчетности по форме 0409360 “Сведения

о требованиях кредиторов” дополнить пунктами 8 и 9 следующего содержания:

“8. Данные граф 3 и 4 строк 1—2.7 корректируются (уменьшаются), соответственно, на количество кредиторов и сумму установленных требований кредиторов, обязательства перед которыми переданы приобретателю (приобретателям) в порядке, предусмотренном пунктами 1<sup>1</sup>—1<sup>13</sup> статьи 50.33 Федерального закона “О несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций”, при осуществлении Агентством функций конкурсного управляющего (ликвидатора). Данные о количестве кредиторов и сумме установленных требований кредиторов, обязательства перед которыми переданы приобретателю (приобретателям), отражаются справочно в графе 11 по соответствующим строкам.

9. Данные о количестве и сумме требований кредиторов, удовлетворенных в ходе ликвидационных процедур путем предоставления отступного в порядке, предусмотренном пунктами 10—10<sup>4</sup> статьи 50.40 Федерального закона “О несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций”, отражаются справочно в графе 11 по соответствующим строкам.”.

2. Настоящее Указание вступает в силу по истечении 30 дней после дня его официального опубликования в “Вестнике Банка России”.

ПРЕДСЕДАТЕЛЬ  
ЦЕНТРАЛЬНОГО БАНКА  
РОССИЙСКОЙ  
ФЕДЕРАЦИИ

С.М. ИГНАТЬЕВ



**Приложение**  
к Указанию Банка России  
от 16 ноября 2012 года № 2911-У  
“О внесении изменений в приложение 1  
к Указанию Банка России от 14 июля 2005 года № 1594-У  
“О перечне, формах и порядке составления и представления  
отчетности ликвидируемых кредитных организаций  
в Центральный банк Российской Федерации”

Банковская отчетность

Код территории по ОКATO	Код кредитной организации			
	по ОКПО	основной государственный регистрационный номер	регистрационный номер (порядковый номер)	БИК

**Сведения о требованиях кредиторов**  
за \_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Сокращенное фирменное наименование кредитной организации \_\_\_\_\_  
Почтовый адрес \_\_\_\_\_

Код формы 0409360  
Месячная  
(в тыс. руб.)

№ п/п	Очередность удовлетворения требований кредиторов	Установленные требования кредиторов		Требования кредиторов, удовлетворенные в ходе ликвидационных процедур			Процент удовлетворения требований кредиторов (всего)	Сумма неудовлетворенных требований кредиторов	Примечание	
		Количество кредиторов (всего)	Сумма		Количество кредиторов (всего)	Сумма				
			всего	в отчетном месяце		всего				в отчетном месяце
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1	Требования кредиторов, включенные в реестр требований кредиторов (всего)									
	в том числе:									
1.1	требования кредиторов первой очереди									
1.2	требования кредиторов второй очереди									
1.3	требования кредиторов третьей очереди									
	из них:									
1.3.1	требования кредиторов по обязательствам, обеспеченным залогом имущества кредитной организации, в пределах стоимости предмета залога									
1.3.2	требования других кредиторов (за исключением требований, указанных в строках 1.3.1 и 1.3.3), в том числе требования кредиторов по обязательствам, обеспеченным залогом имущества ликвидируемой кредитной организации, не удовлетворенные за счет средств, полученных от продажи предмета залога									
1.3.3	требования кредиторов (в том числе физических лиц) по возмещению убытков в форме упущенной выгоды, взысканию неустоек (штрафов, пеней) и применению иных финансовых санкций, в том числе за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязанностей по уплате обязательных платежей									

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
2	Требования кредиторов, не включенные в реестр требований кредиторов (всего)									
2.1	в том числе: требования кредиторов первой очереди									
2.2	требования кредиторов второй очереди									
2.3	требования конкурсных кредиторов и (или) уполномоченных органов, заявленные после закрытия реестра требований кредиторов									
2.4	требования кредиторов по сделкам, признанным недействительными на основании пункта 2 статьи 61.2 и пункта 3 статьи 61.3 Федерального закона от 26 октября 2002 года № 127-ФЗ									
2.5	требования руководителя кредитной организации, его заместителей, лиц, входящих в коллегиальный исполнительный орган кредитной организации, главного бухгалтера кредитной организации, его заместителей, руководителя филиала или представительства кредитной организации, его заместителей, главного бухгалтера филиала или представительства кредитной организации, его заместителей о выплате выходного пособия и (или) иных компенсаций, размер которых установлен соответствующим трудовым договором, в случае его прекращения в части, превышающей минимальный размер соответствующих выплат, установленный трудовым законодательством									
2.6	требования об оплате труда работающих или работавших по трудовому договору руководителя кредитной организации, его заместителей, лиц, входящих в коллегиальный исполнительный орган кредитной организации, главного бухгалтера кредитной организации, его заместителей, руководителя филиала, представительства кредитной организации, его заместителей, главного бухгалтера филиала, представительства кредитной организации, его заместителей в размере разницы между размером оплаты труда, увеличенным в течение шести месяцев до дня отзыва у кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций, и размером оплаты труда таких лиц, установленным до начала указанного срока, в случае принятия арбитражным судом соответствующего решения									
2.7	требования кредиторов по субординированным кредитам (депозитам, займам, облигационным займам), а также по финансовым санкциям за неисполнение обязательств по субординированным кредитам (депозитам, займам, облигационным займам)									
3	Итого требований кредиторов (строка 1 + строка 2)									

Справочно:

1) текущие обязательства, оплачиваемые вне очереди, на отчетную дату \_\_\_\_\_;

2) дата начала расчетов с кредиторами \_\_\_\_\_.

Уполномоченное лицо

(председатель ликвидационной комиссии,  
конкурсный управляющий (ликвидатор),  
представитель Агентства)

(Ф.И.О.)

М.П.

Исполнитель

(Ф.И.О.)

Телефон:

“\_\_\_” \_\_\_\_\_ Г.

Зарегистрировано  
Министерством юстиции  
Российской Федерации  
19 декабря 2012 года  
Регистрационный № 26188

16 ноября 2012 года

№ 2914-У

## УКАЗАНИЕ

### **О внесении изменений в Указание Банка России от 17 ноября 2004 года № 1517-У “Об осуществлении выплат Банка России по вкладам физических лиц в признанных банкротами банках, не участвующих в системе обязательного страхования вкладов физических лиц в банках Российской Федерации, и о порядке взаимодействия банков-агентов с Банком России”**

1. В связи с принятием Федерального закона от 28 июля 2012 года № 144-ФЗ “О внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации” (Собрание законодательства Российской Федерации, 2012, № 31, ст. 4333) и в соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от 9 ноября 2012 года № 22) внести в Указание Банка России от 17 ноября 2004 года № 1517-У “Об осуществлении выплат Банка России по вкладам физических лиц в признанных банкротами банках, не участвующих в системе обязательного страхования вкладов физических лиц в банках Российской Федерации, и о порядке взаимодействия банков-агентов с Банком России”, зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 22 декабря 2004 года № 6229, 29 августа 2006 года № 8180, 25 апреля 2007 года № 9342, 14 декабря 2007 года № 10747, 15 октября 2008 года № 12456 (“Вестник Банка России” от 31 декабря 2004 года № 74, от 6 сентября 2006 года № 49, от 3 мая 2007 года № 24, от 26 декабря 2007 года № 71, от 17 октября 2008 года № 58), следующие изменения.

1.1. Пункт 3.3 изложить в следующей редакции:

“3.3. Расчет размера выплат Банка России осуществляется Банком России исключительно на основании представленных конкурсным управляющим сведений в графах 7, 8, 10, 12 Реестра следующим образом. Сумма всех установленных требований каждого физического лица по договорам банковского вклада или договорам банковского счета (графа 7 Реестра), но не превышающая 700 000 рублей, уменьшается:

на сумму встречных требований банка-банкрота к вкладчику (графа 8 Реестра);

на сумму выплат по договорам банковского вклада или договорам банковского сче-

та, осуществленных конкурсным управляющим (графа 10 Реестра);

на сумму выплат по договорам банковского вклада или договорам банковского счета, осуществленных ликвидатором в ходе принудительной ликвидации кредитной организации (графа 12 Реестра).”

1.2. Пункт 4.1 после слов “опубликовывает в “Вестнике Банка России” дополнить словами “и включает в Единый федеральный реестр сведений о банкротстве”.

1.3. В приложении 2 пункты 5 и 6 после слов “предварительных выплат” дополнить словами “(ликвидатором при проведении принудительной ликвидации)”;

1.4. Приложение 3 изложить в редакции приложения к настоящему Указанию.

1.5. В приложении 4: слова “графа 12” в соответствующем падеже заменить словами “графа 14” в соответствующем падеже;

пункт 1 дополнить абзацем следующего содержания:

“При признании банкротом банка, в отношении которого осуществлялась принудительная ликвидация, требования кредиторов (графы 6 и 7 приложения 3 к настоящему Указанию) отражаются в размере, установленном ликвидатором.”;

в пункте 8.2:

подпункты 8.2.1, 8.2.3 и 8.2.4 после слов “в ходе предварительных выплат” дополнить словами “(в ходе выплат, осуществленных ликвидатором при проведении принудительной ликвидации)”;

подпункт 8.2.2 изложить в следующей редакции:

“8.2.2. При получении вкладчиком в ходе предварительных выплат (в ходе выплат, осуществленных ликвидатором при проведении принудительной ликвидации) денежных средств путем перечисления на счет в банке указывается местонахождение банка — полу-

чателя денежных средств в соответствии с поручением на перечисление денежных средств, данным вкладчиком конкурсному управляющему (ликвидатору) в ходе предварительных выплат (в ходе выплат, осуществленных ликвидатором при проведении принудительной ликвидации).”

2. Настоящее Указание вступает в силу по истечении 10 дней после дня его офици-

ального опубликования в “Вестнике Банка России”.

ПРЕДСЕДАТЕЛЬ  
ЦЕНТРАЛЬНОГО  
БАНКА  
РОССИЙСКОЙ  
ФЕДЕРАЦИИ

С.М. ИГНАТЬЕВ

**Приложение**

к Указанию Банка России от 16 ноября 2012 года № 2914-У  
 “О внесении изменений в Указание Банка России от 17 ноября 2004 года № 1517-У  
 “Об осуществлении выплат Банка России по вкладам физических лиц  
 в признанных банкротами банках, не участвующих в системе  
 обязательного страхования вкладов физических лиц в банках Российской Федерации,  
 и о порядке взаимодействия банков-агентов с Банком России”

**“Приложение 3**

к Указанию Банка России от 17 ноября 2004 года № 1517-У  
 “Об осуществлении выплат Банка России по вкладам физических лиц  
 в признанных банкротами банках, не участвующих в системе  
 обязательного страхования вкладов физических лиц в банках Российской Федерации,  
 и о порядке взаимодействия банков-агентов с Банком России”

**РЕЕСТР  
 ТРЕБОВАНИЙ КРЕДИТОРОВ ПЕРВОЙ ОЧЕРЕДИ  
 ДЛЯ ЦЕЛЕЙ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ПРЕДВАРИТЕЛЬНЫХ ВЫПЛАТ**

руб. коп.

Номер по порядку	Номер кредитора по реестру требований кредиторов	Фамилия, имя, отчество (полностью)	Адрес регистрации, адрес для почтовых уведомлений, контактный телефон, электронная почта (при наличии)	Вид и реквизиты документа, удостоверяющего личность	Установленные требования к банку		Сумма встречных требований банка к кредитору	Осуществленные конкурсным управляющим выплаты		Выплаты, осуществленные ликвидатором в ходе принудительной ликвидации		Оценка конкурсным управляющим размера выплаты Банка России	Место осуществления выплаты вкладчику
					общая сумма установленных требований кредитора	в том числе сумма установленных требований по договорам банковского вклада или договорам банковского счета		общая сумма выплат	в том числе сумма выплат по договорам банковского вклада или договорам банковского счета	общая сумма выплат	в том числе сумма выплат по договорам банковского вклада или договорам банковского счета		
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14
ИТОГО													

Конкурсный управляющий \_\_\_\_\_ (\_\_\_\_\_)  
 (подпись) (фамилия, имя, отчество)

“ \_\_\_ ” \_\_\_\_\_ 20\_\_ года М.П.

**Примечания.**

- Итоговые суммы рассчитываются по графам 6—13.
- В приложении к Реестру требований кредиторов первой очереди для целей осуществления предварительных выплат представляется информация о местах осуществления выплат вкладчику и присвоенных им номерах в целях заполнения графы 14 в порядке, определенном приложением 4 к настоящему Указанию.”

Зарегистрировано  
Министерством юстиции  
Российской Федерации  
21 декабря 2012 года  
Регистрационный № 26273

3 декабря 2012 года

№ 2919-У

## УКАЗАНИЕ

### Об оценке качества управления кредитной организацией, осуществляющей функции центрального контрагента

Настоящее Указание на основании статей 62, 72 Федерального закона от 10 июля 2002 года № 86-ФЗ “О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)” (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, № 28, ст. 2790; 2003, № 2, ст. 157, № 52, ст. 5032; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3233; 2005, № 25, ст. 2426; № 30, ст. 3101; 2006, № 19, ст. 2061; № 25, ст. 2648; 2007, № 1, ст. 9, ст. 10; № 10, ст. 1151; № 18, ст. 2117; 2008, № 42, ст. 4696, ст. 4699; № 44, ст. 4982; № 52, ст. 6229, ст. 6231; 2009, № 1, ст. 25; № 29, ст. 3629; № 48, ст. 5731; 2010, № 45, ст. 5756; 2011, № 7, ст. 907; № 27, ст. 3873; № 43, ст. 5973; № 48, ст. 6728), Федерального закона “О банках и банковской деятельности” (в редакции Федерального закона от 3 февраля 1996 года № 17-ФЗ) (Ведомости Съезда народных депутатов РСФСР и Верховного Совета РСФСР, 1990, № 27, ст. 357; Собрание законодательства Российской Федерации, 1996, № 6, ст. 492; 1998, № 31, ст. 3829; 1999, № 28, ст. 3459; ст. 3469; 2001, № 26, ст. 2586; № 33, ст. 3424; 2002, № 12, ст. 1093, 2003, № 27, ст. 2700; № 50, ст. 4855; № 52, ст. 5033, ст. 5037; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3233; 2005, № 1, ст. 18, ст. 45; № 30, ст. 3117; 2006, № 6, ст. 636; № 19, ст. 2061; № 31, ст. 3439; № 52, ст. 5497; 2007, № 1, ст. 9; № 22, ст. 2563; № 31, ст. 4011; № 41, ст. 4845; № 45, ст. 5425; № 50, ст. 6238; 2008, № 10, ст. 895; № 15, ст. 1447; 2009, № 1, ст. 23; № 9, ст. 1043; № 18, ст. 2153; № 23, ст. 2776; № 30, ст. 3739; № 48, ст. 5731; № 52, ст. 6428; 2010, № 8, ст. 775; № 19, ст. 2291; № 27, ст. 3432; № 30, ст. 4012; № 31, ст. 4193; № 47, ст. 6028; 2011, № 7, ст. 905; № 27, ст. 3873, ст. 3880; № 29, ст. 4291; № 48, ст. 6730; № 49, ст. 7069; № 50, ст. 7351; 2012, № 27, ст. 3588; № 31, ст. 4333), Федерального закона от 7 февраля 2011 года № 7-ФЗ “О клиринге и клиринговой деятельности” (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, № 7, ст. 904; № 48, ст. 6728; № 49, ст. 7040, ст. 7061) устанавливает порядок оценки качества управления кредитной организацией, осуществляющей функции центрального контрагента (далее — ЦК), на основании ходатайства ЦК о признании качества управления удовлетворительным, в целях применения кредитными организациями — участ-

никами клиринга в отношении их требований к ЦК, качество управления которого признано удовлетворительным, подходов, предусмотренных нормативным актом об обязательных нормативах банков, при расчете обязательных нормативов.

1. ЦК направляет в Банк России ходатайство о признании качества управления ЦК удовлетворительным (далее — ходатайство ЦК) по форме приложения 2 к настоящему Указанию.

К ходатайству ЦК прилагаются результаты внутренней оценки качества управления ЦК, осуществленной на основании методики, приведенной в приложении 1 к настоящему Указанию.

2. Для признания качества управления ЦК удовлетворительным Банк России осуществляет оценку качества управления ЦК в соответствии с методикой, приведенной в приложении 1 к настоящему Указанию.

3. В ходе осуществления оценки качества управления ЦК Банк России:

рассматривает результаты внутренней оценки качества управления ЦК;

при необходимости запрашивает у ЦК дополнительные документы и (или) информацию с указанием в запросе сроков их представления и (или) организует совещания с уполномоченными представителями ЦК.

4. По результатам оценки качества управления ЦК Банк России принимает решение о признании качества управления ЦК удовлетворительным либо об отказе в удовлетворении ходатайства ЦК.

5. Срок оценки качества управления ЦК и принятия решения Банком России о признании качества управления ЦК удовлетворительным либо об отказе в удовлетворении ходатайства ЦК не может превышать трех месяцев со дня получения Банком России ходатайства ЦК.

6. В случае принятия Банком России решения о признании качества управления ЦК удовлетворительным Банк России письменно информирует ЦК о принятом решении в срок не позднее трех рабочих дней с даты принятия такого решения.

7. Банк России размещает на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети “Интернет”, а так-



же публикует в «Вестнике Банка России» информацию о ЦК, в отношении которого Банком России принято решение о признании качества управления ЦК удовлетворительным, с указанием даты принятия такого решения, в срок, не превышающий 10 рабочих дней со дня принятия такого решения.

8. Банком России принимается решение об отказе в удовлетворении ходатайства ЦК по следующим основаниям:

наличие в представленных ходатайстве ЦК и (или) документах и (или) информации недостоверной или неполной информации;

несоответствие качества управления ЦК оценке «удовлетворительно»;

несоответствие учредительных документов ЦК требованиям законодательства Российской Федерации;

отказ ЦК от представления дополнительных документов и (или) информации в соответствии с пунктом 3 настоящего Указания.

9. В случае принятия Банком России решения об отказе в удовлетворении ходатайства ЦК Банк России письменно информирует ЦК о принятом решении с указанием оснований отказа, в срок не позднее трех рабочих дней с даты принятия такого решения.

10. Повторно представленное в Банк России ходатайство ЦК считается вновь поступившим и рассматривается в порядке, установленном пунктами 2—9 настоящего Указания.

11. ЦК, в отношении которого Банком России принято решение о признании качества управления ЦК удовлетворительным, должен обеспечивать качество управления ЦК на уровне, соответствующем оценке «удовлетворительно», и для подтверждения соответствия качества управления ЦК оценке «удовлетворительно» представлять в Банк России:

результаты внутренней оценки качества управления ЦК, осуществленной на основании методики, приведенной в приложении 1 к настоящему Указанию, на ежегодной основе, не позднее трех месяцев до наступления даты, соответствующей дате первоначально принятого решения о признании качества управления ЦК удовлетворительным;

сведения о планируемых изменениях в деятельности ЦК, касающиеся качества управления ЦК, с описанием соответствующих изменений — не позднее двух месяцев до их вступления в действие;

сведения о внесенных изменениях во внутренние документы и договоры, касающиеся качества управления ЦК, — не позднее 15 рабочих дней со дня внесения (утверждения) изменений с приложением указанных документов;

сведения о планируемых проектах по совершенствованию деятельности ЦК на следующий календарный год — не позднее 15 декабря текущего года;

сведения о совершенствовании качества управления ЦК за календарный год — не позднее 15 февраля текущего года.

12. Банк России осуществляет оценку качества управления ЦК, в отношении которого принято решение о признании качества управления ЦК удовлетворительным, с периодичностью не реже одного раза в год для подтверждения соответствия качества управления ЦК оценке «удовлетворительно».

13. В ходе осуществления оценки качества управления ЦК для подтверждения соответствия качества управления ЦК оценке «удовлетворительно» Банк России:

рассматривает документы и сведения, перечисленные в пункте 11 настоящего Указания;

при необходимости запрашивает у ЦК дополнительные документы и (или) информацию с указанием в запросе сроков их представления и (или) организует совещания с уполномоченными представителями ЦК.

14. Банк России вправе принять решение об отзыве решения о признании качества управления ЦК удовлетворительным, если Банком России выявлено несоответствие качества управления ЦК оценке «удовлетворительно», а также в случае непредставления или несвоевременного представления ЦК документов и сведений, перечисленных в пункте 11 настоящего Указания.

15. В случае принятия Банком России решения об отзыве решения о признании качества управления ЦК удовлетворительным Банк России письменно информирует ЦК о принятом решении с указанием оснований отзыва в срок не позднее трех рабочих дней с даты принятия такого решения.

16. Банк России размещает на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», а также публикует в «Вестнике Банка России» информацию о ЦК, в отношении которого Банком России принято решение об отзыве решения о признании качества управления ЦК удовлетворительным, с указанием даты принятия такого решения, в срок, не превышающий 10 рабочих дней со дня принятия такого решения.

17. Настоящее Указание подлежит официальному опубликованию в «Вестнике Банка России» и в соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от 30.11.2012 года № 23) вступает в силу с 1 января 2013 года.

ПРЕДСЕДАТЕЛЬ  
ЦЕНТРАЛЬНОГО  
БАНКА  
РОССИЙСКОЙ  
ФЕДЕРАЦИИ

С.М. ИГНАТЬЕВ

**Приложение 1**  
к Указанию Банка России  
от 3 декабря 2012 года № 2919-У  
“Об оценке качества управления  
кредитной организации, осуществляющей  
функции центрального контрагента”

## МЕТОДИКА ОЦЕНКИ КАЧЕСТВА УПРАВЛЕНИЯ ЦК

### 1. Общие положения

1.1. Оценка качества управления ЦК в соответствии с настоящей Методикой оценки качества управления ЦК (далее — Методика) осуществляется по результатам оценок качества системы управления рисками ЦК, внутреннего контроля и корпоративного управления ЦК.

1.2. Оценка качества внутреннего контроля и корпоративного управления ЦК осуществляется по результатам оценки показателя состояния внутреннего контроля и корпоративного управления ЦК (далее — ПВК).

1.3. Оценка качества системы управления рисками ЦК осуществляется по результатам оценок качества:

- управления рисками ЦК;
- управления правовым риском ЦК;
- управления кредитным риском ЦК;
- управления рыночным риском ЦК;
- управления риском ликвидности ЦК;
- управления операционным риском ЦК;
- управления риском потери деловой репутации ЦК.

1.4. Настоящая Методика применяется в отношении ЦК, являющегося клиринговой организацией, и в отношении клиринговой организации, с которой у ЦК заключен договор, определяющий обязанности сторон по управлению рисками и порядок их взаимодействия при осуществлении клиринга (далее — клиринговая организация).

1.5. Если ЦК не является клиринговой организацией, то при осуществлении оценки качества управления ЦК рассматриваются и документы клиринговой организации, указанной в пункте 1.4 настоящей Методики, определяющие порядок осуществления клиринга с участием такого ЦК, в том числе правила клиринга (далее — правила клиринга).

1.6. В целях настоящей Методики оценка качества управления ЦК осуществляется на основании внутренних документов ЦК и внутренних документов клиринговой организации, указанной в пункте 1.4 настоящей Методики (далее — внутренние документы ЦК).

### 2. Оценка качества внутреннего контроля и корпоративного управления ЦК

2.1. Показатель ПВК определяется на основании оценки ответов на вопросы, приведенные в таблице 1.

Таблица 1

#### ПОКАЗАТЕЛЬ СОСТОЯНИЯ ВНУТРЕННЕГО КОНТРОЛЯ И КОРПОРАТИВНОГО УПРАВЛЕНИЯ ЦК

№ п/п	Вопросы	Значение (в баллах)
1	2	3
1.	Существует ли в ЦК независимое подразделение или служащие, осуществляющие внутренний контроль?	
2.	Имеются ли у ЦК внутренние документы, регламентирующие правила организации системы внутреннего контроля?	
3.	Соответствуют ли внутренние документы ЦК, регламентирующие правила организации системы внутреннего контроля, законодательству Российской Федерации и нормативным актам Банка России?	
4.	Соблюдаются ли ЦК внутренние документы, регламентирующие правила организации системы внутреннего контроля?	
5.	Осуществляют ли органы управления ЦК внутренний контроль в соответствии с требованиями и полномочиями, определенными учредительными и внутренними документами ЦК?	
6.	По всем ли направлениям деятельности ЦК приняты внутренние документы, регламентирующие осуществление внутреннего контроля?	

1	2	3
7.	Позволяет ли организация службы внутреннего контроля ЦК эффективно осуществлять возложенные на нее функции?	
8.	Осуществляет ли совет директоров (наблюдательный совет) ЦК контроль за деятельностью службы внутреннего контроля ЦК?	
9.	Проводятся ли на постоянной основе в рамках системы внутреннего контроля мероприятия по контролю за уровнем принятых рисков ЦК?	
10.	Имеются ли у ЦК правила действий при выявлении службой внутреннего контроля нарушений процедур принятия решений и оценки рисков, предусмотренных утвержденными документами?	
11.	Соблюдаются ли ЦК правила действий при выявлении службой внутреннего контроля нарушений процедур принятия решений и оценки рисков?	
12.	Определен ли в ЦК в рамках системы внутреннего контроля порядок информирования службой внутреннего контроля органов управления ЦК о нарушениях (недостатках), выявленных при проверке выполнения установленных процедур управления рисками ЦК?	
13.	Осуществляет ли ЦК контроль за функционированием системы управления рисками ЦК на постоянной основе?	
14.	Имеется ли в ЦК общая стратегия развития ЦК и проводится ли ее мониторинг с учетом долгосрочных финансовых интересов ЦК, подверженности рискам и способности эффективно управлять ими?	
15.	Имеются ли в ЦК внутренние документы, определяющие организацию работы совета директоров (наблюдательного совета) и основные направления его деятельности?	
16.	Имеется ли в ЦК информационная политика с указанием периодичности раскрытия информации, степени детализации информации, перечня категорий лиц, на которых ориентировано раскрытие информации?	
17.	Рассматривает ли совет директоров (наблюдательный совет) ЦК выводы, сделанные внешним аудитором (внешними аудиторами) в ходе проведения аудита ЦК по вопросам оценки политики и практики корпоративного управления ЦК, адекватности и эффективности принципов и процедур внутреннего контроля и системы управления рисками ЦК?	

Примечания к заполнению таблицы 1.

К вопросу 12.

При оценке данного вопроса следует учитывать, что в случае отсутствия фактов выявления службой внутреннего контроля нарушений процедур принятия решений и оценки рисков ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно пункту 2.2 настоящей Методики.

2.2. Оценка ответов на вопросы таблицы 1 производится путем присвоения им значений по следующей шкале:

равное 0 — не выполняется (нет; отсутствует);

равное 1 — выполняется не в полном объеме (в основном да);

равное 2 — выполняется в полном объеме (да; присутствует).

2.3. Показатель ПВК представляет собой сумму значений оценок ответов на вопросы, приведенные в таблице 1.

Значение показателя ПВК признается удовлетворительным, если его результат равен 32 баллам и более.

2.4. При присвоении хотя бы одному ответу на вопросы, приведенные в таблице 1, значения, равного 0, показателю ПВК присваивается значение “неудовлетворительно”.

### 3. Оценка качества системы управления рисками ЦК

3.1. Оценка качества управления рисками ЦК осуществляется по результатам оценки показателя управления рисками ЦК (далее — ПУР).

3.1.1. Показатель ПУР определяется на основании оценки ответов на вопросы, приведенные в таблице 2.

Таблица 2

## ПОКАЗАТЕЛЬ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ ЦК

№ п/п	Вопросы	Значение (в баллах)
1	2	3
1.	Существует ли в ЦК независимое подразделение или служащие, осуществляющие управление рисками?	
2.	Имеются ли у ЦК внутренние документы, регламентирующие управление рисками, присущими деятельности ЦК?	
3.	Существует ли в ЦК внутренняя отчетность по оценке и мониторингу рисков ЦК?	
4.	Определен ли порядок представления информации, включая внутреннюю отчетность, совету директоров (наблюдательному совету), исполнительным органам, подразделениям и служащим ЦК по вопросам управления рисками ЦК?	
5.	Имеется ли в ЦК стратегия управления рисками, а также специализированный комитет по рискам на уровне совета директоров ЦК?	
6.	Существует ли в ЦК распределение полномочий и ответственности между советом директоров (наблюдательным советом), исполнительными органами, подразделениями и служащими в отношении реализации основных принципов управления рисками ЦК?	
7.	Имеются ли у ЦК риск-ориентированные модели для целей количественной оценки и комплексного учета рисков, присущих его деятельности?	
8.	Проводит ли ЦК тестирование используемых для оценки рисков моделей на основе модельных рядов данных?	
9.	Проводит ли ЦК на постоянной основе анализ качества функционирования используемых для оценки рисков моделей, в том числе бэк-тестирование, стресс-тестирование и обратное стресс-тестирование?	
10.	Проводит ли ЦК на постоянной основе улучшение используемых риск-ориентированных моделей путем калибровки параметров указанных моделей?	
11.	Проводит ли ЦК анализ чувствительности к отдельным риск-факторам, учитываемым в риск-ориентированных моделях?	
12.	Проводит ли ЦК комплексный сценарный стресс-анализ, учитывающий одновременное изменение нескольких риск-факторов?	
13.	Проводит ли ЦК стресс-тестирование достаточности собственных средств (капитала) ЦК и клирингового обеспечения не реже одного раза в квартал?	
14.	Применяет ли ЦК риск-ориентированные модели и параметры (либо специализированную систему) для определения размера клирингового обеспечения по каждому продукту, портфелю, типу рынков, на которых работает ЦК?	
15.	Проводит ли ЦК бэк-тестирование прогнозных моделей для определения размеров индивидуального и коллективного клирингового обеспечения не реже одного раза в 6 месяцев или в случае изменения параметров прогнозных моделей?	
16.	Имеются ли у ЦК меры, принимаемые в случаях, когда результаты бэк-тестирования прогнозных моделей свидетельствуют о низкой эффективности моделей?	

Примечания к заполнению таблицы 2.

К вопросу 2.

При оценке данного вопроса необходимо оценить, установлены ли внутренними документами ЦК принципы управления рисками ЦК, порядок выявления, оценки и определения приемлемого уровня рисков ЦК, а также меры по поддержанию рисков ЦК на приемлемом уровне.

3.1.2. Оценка ответов на вопросы таблицы 2 производится путем присвоения им значений по следующей шкале:

равное 0 — не выполняется или выполняется не в полном объеме (нет; отсутствует);

равное 2 — выполняется в полном объеме (да; присутствует).

3.1.3. Показатель ПУР представляет собой сумму значений оценок ответов на вопросы, приведенные в таблице 2.

3.1.4. Значение показателя ПУР признается удовлетворительным, если его результат равен 32 баллам.

3.2. Оценка качества управления правовым риском ЦК осуществляется по результатам оценки показателя управления правовым риском ЦК (далее — ППР).

3.2.1. Показатель ППР определяется на основании оценки ответов на вопросы, приведенные в таблице 3.

Таблица 3

## ПОКАЗАТЕЛЬ УПРАВЛЕНИЯ ПРАВОВЫМ РИСКОМ ЦК

№ п/п	Вопросы	Значение (в баллах)
1	2	3
1.	Соответствуют ли внутренние документы и договоры ЦК законодательству Российской Федерации и нормативным актам Банка России?	
2.	Определены ли во внутренних документах ЦК и договорах положения, касающиеся качества управления ЦК?	
3.	Определены ли во внутренних документах ЦК основные принципы управления правовым риском, порядок выявления, оценки, определения приемлемого уровня правового риска и мониторинга за управлением правовым риском, а также порядок осуществления контроля за эффективностью управления правовым риском?	
4.	Определены ли во внутренних документах ЦК внешние и внутренние факторы правового риска, методы выявления и оценки факторов возникновения правового риска?	
5.	Определены ли во внутренних документах ЦК критерии оценки правового риска с учетом факторов его возникновения?	
6.	Определены ли во внутренних документах ЦК правила и порядок осуществления мониторинга изменений в законодательстве Российской Федерации и нормативных актах Банка России, своевременность учета и отражения этих изменений во внутренних документах и обязанность их соблюдения?	
7.	Ведет ли ЦК аналитическую базу данных о потерях, вызванных правовым риском, по направлениям деятельности ЦК в целях количественной оценки правового риска?	

Примечания к заполнению таблицы 3.

К вопросу 2.

При оценке данного вопроса необходимо оценить, установлены ли внутренними документами ЦК:

юридическое закрепление процедуры неттинга, процедур, необходимых для обеспечения и исполнения обязательств, включенных в клиринговый пул;  
 порядок допуска к клирингу, осуществляемому с участием ЦК;  
 процедуры в отношении нарушившего обязательства участника клиринга;  
 процедуры передачи позиций клиентов участника клиринга в случае его несостоятельности (банкротства) другому участнику клиринга;  
 порядок взаимодействия с биржами, депозитариями, расчетными организациями, а также клиринговыми организациями, если ЦК взаимодействует с другими клиринговыми организациями;  
 порядок действий ЦК в случае недостаточности финансовых ресурсов для осуществления функций ЦК;  
 определение прав и обязанностей ЦК в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения своих обязательств иным юридическим лицом, выполняющим функции центрального контрагента, являющимся резидентом или нерезидентом, если ЦК взаимодействует с такой организацией;  
 юридическое закрепление обязанности клиринговой организации по обеспечению доступа ЦК к средствам индивидуального клирингового обеспечения, учитываемого на торговых и (или) клиринговых счетах, и коллективного клирингового обеспечения, учитываемого на клиринговых счетах (а также размер средств, которые обязана предоставить клиринговая организация ЦК), если такой ЦК не является клиринговой организацией.  
 В случае неприменимости пунктов, приведенных в абзацах девятом и десятом примечания к заполнению таблицы 3 к деятельности ЦК, ответу на данный пункт присваивается значение, равное 2.

3.2.2. Оценка ответов на вопросы таблицы 3 производится путем присвоения им значений по следующей шкале:

равное 0 — не выполняется (нет; отсутствует);

равное 1 — выполняется не в полном объеме (в основном да; отсутствует не более одного пункта из перечня в примечании к заполнению таблицы 3);

равное 2 — выполняется в полном объеме (да; присутствует).

3.2.3. Показатель ППР представляет собой сумму значений оценок ответов на вопросы, приведенные в таблице 3.

3.2.4. Значение показателя ППР признается удовлетворительным, если его результат равен не менее 12 баллов.

3.2.5. При присвоении хотя бы одному ответу на вопросы, приведенные в таблице 3, значения, равного 0, показателю ППР присваивается значение “неудовлетворительно”.

3.3. Оценка качества управления кредитным риском ЦК осуществляется по результатам оценок показателя финансовых ресурсов и кредитного риска (далее — ПКР1), включающего коэффициенты кредитного риска ЦК — КР1, КР2, КР3 и показателя управления кредитным риском ЦК (далее — ПКР2).

3.3.1. Коэффициент КР1 характеризует достаточность средств ЦК на покрытие потерь, вызванных неисполнением обязательств двух крупнейших участников клиринга на заданном рынке. Коэффициент КР1 определяется как отношение суммы величины собственных средств (капитала) ЦК и коллективного клирингового обеспечения на заданном рынке к величине возможных потерь:

$$КР1 = \frac{К + Ф}{П2} * 100\%,$$

где:

К — собственные средства (капитал) ЦК, определенные в соответствии с Положением Банка России от 10 февраля 2003 года № 215-П “О методике определения собственных средств (капитала) кредитных организаций”, зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 17 марта 2003 года № 4269, 17 июля 2006 года № 8091, 7 марта 2007 года № 9072, 26 июля 2007 года № 9910, 20 декабря 2007 года № 10778, 12 декабря 2008 года № 12840, 19 декабря 2008 года № 12905, 29 июня 2009 года № 14161, 11 декабря 2009 года № 15538, 18 мая 2012 года № 24217 (“Вестник Банка России” от 20 марта 2003 года № 15, от 26 июля 2006 года № 41, от 14 марта 2007 года № 14, от 2 августа 2007 года № 44, от 26 декабря 2007 года № 71, от 17 декабря 2008 года № 73, от 24 декабря 2008 года № 74, от 8 июля 2009 года № 40, от 16 декабря 2009 года № 72, от 25 мая 2012 года № 27);

Ф — размер коллективного клирингового обеспечения в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета, которое может быть использовано для исполнения обязательств ЦК перед добросовестными участниками клиринга;

П2 — возможные потери ЦК при неисполнении обязательств двух крупнейших участников клиринга, вызванные переоценкой открытых позиций:

$$П2 = \sum_k (\sum_t \text{CVaR}_{k,t}^T - \text{Об} * (1 - \text{Дисконт})),$$

где:

$\sum_k$  — сумма возможных потерь по двум участникам клиринга с наибольшим значением  $\sum_k \text{CVaR}_{k,t}^T - \text{Об} * (1 - \text{Дисконт})$ ;

суммирование по k ведется по всем нетто-наборам участника клиринга;

суммирование по t ведется по всем датам расчета сделок, заключенным участником клиринга;

$\text{CVaR}_{k,t}^T$  (условная стоимость под риском) — величина, характеризующая среднее значение по однопроцентной выборке наихудших негативных для ЦК изменений стоимости базового актива k-го нетто-набора участника клиринга за T дней в случае неисполнения обязательств данного участника клиринга;

Об — размер индивидуального клирингового обеспечения участника клиринга в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета;

T — количество рабочих дней, необходимых для закрытия позиции недобросовестного участника клиринга с момента невыполнения им своих обязательств (определяется согласно внутренним документам ЦК);



Нетто-набор — совокупность сделок по инструментам с одним и тем же базовым активом и одинаковой датой расчетов;

Дисконт — дисконт, рассчитанный аналогично  $CVaR_{k,t}^T$  для принятого обеспечения.

Глубина выборки для расчета  $CVaR_{k,t}^T$  должна быть не менее 12 месяцев и включать период с наибольшим месячным отрицательным изменением Индекса ММВБ и (или) Индекса РТС за последние 10 лет. При отсутствии данных за рассматриваемый период расчет  $CVaR_{k,t}^T$  следует проводить по финансовым инструментам со схожими параметрами, по которым имеются данные за указанный период.

В случае когда величина П2 меньше или равна нулю,  $KP1 = 100\%$ .

3.3.2. Коэффициент KP2 характеризует степень диверсифицированности средств коллективного клирингового обеспечения. Коэффициент KP2 рассчитывается как максимальная доля вида актива (иностранной валюты, выпуска ценной бумаги и другие) в коллективном клиринговом обеспечении:

$$KP2 = \max_k \frac{A_k}{\Phi} * 100\%,$$

где:

$\max_k$  — максимум по всем активам, находящимся в коллективном клиринговом обеспечении, за исключением денежных средств в рублях и (или) свободно конвертируемых валютах, государственных ценных бумаг Российской Федерации, казначейских бумаг или бумаг центральных банков стран Организации европейского экономического сотрудничества с рейтингом долгосрочной кредитоспособности в иностранной валюте международного рейтингового агентства "Standard & Poor's" на уровне не ниже "BBB+" или рейтингом других международных рейтинговых агентств или национальных рейтинговых агентств не ниже аналогичного согласно таблице соответствия кредитных рейтингов аккредитованных рейтинговых агентств, одобренной Экспертным советом по деятельности рейтинговых агентств при Министерстве финансов Российской Федерации и размещенной на официальном сайте Министерства финансов Российской Федерации в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет";

$A_k$  — рыночная стоимость принимаемого в коллективное клиринговое обеспечение вида актива в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета;

$\Phi$  — определяется и рассчитывается в соответствии с порядком расчета коэффициента KP1.

Расчет коэффициента KP2 проводится по каждой совокупности инструментов, обязательства по сделкам с которыми включены в клиринговый пул. Итоговый балл по результатам расчета коэффициента, рассчитанный по разным клиринговым пулам, равен минимальному из баллов, присвоенных данному коэффициенту для каждого клирингового пула.

В случае концентрации коллективного клирингового обеспечения только в денежных средствах в рублях и (или) свободно конвертируемых валютах KP2 полагается равным нулю.

3.3.3. Коэффициент KP3 характеризует распределение инвестиционных активов по их кредитному качеству. Коэффициент KP3 рассчитывается как доля всех инвестиционных активов с рейтингом эмитента (для ценных бумаг), контрагента (для денежных средств в рублях) и суверенным рейтингом страны (для денежных средств в иностранной валюте) не ниже "BBB-" по классификации рейтингового агентства "Standard & Poor's" или рейтингом других международных рейтинговых агентств или национальных рейтинговых агентств не ниже аналогичного согласно таблице соответствия кредитных рейтингов аккредитованных рейтинговых агентств, одобренной Экспертным советом по деятельности рейтинговых агентств при Министерстве финансов Российской Федерации и размещенной на официальном сайте Министерства финансов Российской Федерации в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", в общем объеме инвестиционных активов ЦК, умноженная на 100%. Инвестиционные активы включают в себя денежные средства ЦК, находящиеся на корреспондентских счетах в Банке России и банках-контрагентах в рублях и (или) иностранной валюте, а также портфели активов, сформированные из финансовых инструментов, включающих межбанковские депозиты, депозиты в Банке России, иностранную валюту и ценные бумаги.

3.3.4. Показатель ПКР1 представляет собой сумму значений коэффициентов, определенных в соответствии с подпунктами 3.3.1—3.3.3 настоящей Методики.

Балльные оценки коэффициентов KP1—KP3 приведены в приложении 3 к настоящему Указанию.

3.3.5. Значение показателя ПКР1 признается удовлетворительным, если его результат равен 6 баллам.

3.3.6. Показатель ПКР2 определяется на основании оценки ответов на вопросы, приведенные в таблице 4.

Таблица 4

## ПОКАЗАТЕЛЬ УПРАВЛЕНИЯ КРЕДИТНЫМ РИСКОМ ЦК

№ п/п	Вопросы	Значение (в баллах)
1	2	3
1.	Устанавливаются ли ЦК критерии допуска участников клиринга к операциям с ЦК?	
2.	Проводится ли ЦК оценка соответствия участников клиринга критериям допуска к операциям с ЦК не реже одного раза в квартал?	
3.	Используется ли ЦК механизм установления лимитов, ограничивающих риски по сделкам участников клиринга?	
4.	Осуществляется ли ЦК оценка уровня кредитного риска по отношению к участникам клиринга, а также к расчетным организациям не реже одного раза в день?	
5.	Осуществляется ли ЦК мониторинг финансовой устойчивости участников клиринга не реже одного раза в месяц?	
6.	Предоставляет ли ЦК участникам клиринга информацию о ключевых аспектах процедур мониторинга?	
7.	Осуществляется ли ЦК анализ и при необходимости пересмотр критериев допуска участников клиринга к операциям с ЦК не реже одного раза в год?	
8.	Содержат ли правила клиринга соответствующий законодательству порядок прекращения обязательств участника клиринга и ЦК в связи с банкротством участника клиринга и определения размера нетто-обязательства указанных лиц?	
9.	Содержат ли внутренние документы ЦК порядок покрытия кредитных потерь, возникающих в случае реализации стрессовых сценариев, так и при их отсутствии?	
10.	Предусмотрено ли в учредительных документах ЦК ограничение на открытие корреспондентских счетов?	
11.	Открыты ли торговые банковские и (или) клиринговые банковские и иные счета для учета денежных средств, которые могут быть использованы для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу?	
12.	Размещаются ли денежные средства коллективного клирингового обеспечения (в рублях и (или) иностранной валюте) во вклады в кредитных организациях?	
13.	Обеспечивается ли ведение клиринговой организацией отдельного внутреннего учета денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте участника клиринга и его клиентов?	
14.	Обеспечивается ли возможность ведения клиринговой организацией отдельного внутреннего учета денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте клиента участника клиринга, учитываемых на клиринговом банковском счете?	
15.	Учитывается ли коллективное клиринговое обеспечение на отдельном клиринговом счете?	
16.	Устанавливает ли ЦК предельную долю иностранной валюты и ценных бумаг, являющихся обеспечением исполнения обязательств (клиринговым обеспечением) участников клиринга, а также порядок определения соответствующих долей?	
17.	Использует ли ЦК при исполнении обязательств, включенных в клиринговый пул, механизм "поставка против платежа", "платеж против платежа"?	
18.	Проводит ли ЦК оценку потенциальных источников риска и осуществляет ли надлежащее управление ими?	
19.	Ограничивает ли ЦК использование в качестве обеспечения для исполнения обязательств участника клиринга ценных бумаг, эмитентом которых является этот участник клиринга или связанные с ним лица?	
20.	Предусмотрено ли в учредительных документах ЦК ограничение на размещение временно свободных денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте во вклады в кредитных организациях?	
21.	Предусмотрено ли в учредительных документах ЦК ограничение на размещение временно свободных денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте в финансовые инструменты?	
22.	Размещается ли клиринговое обеспечение в финансовые инструменты?	
23.	Предусмотрено ли в учредительных документах ЦК ограничение на размещение временно свободных денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте только в долговые ценные бумаги со сроком до погашения и (или) выкупа по оферте меньше 1,5 лет?	

1	2	3
24.	Инвестирует ли ЦК клиринговое обеспечение только в долговые ценные бумаги со сроком до погашения и (или) выкупа по оферте меньше 1,5 лет?	
25.	Открыты ли торговые и (или) клиринговые счета депо в депозитариях, удовлетворяющих одному из критериев, изложенных в Указании Банка России от 17 ноября 2011 года № 2732-У “Об особенностях формирования кредитными организациями резерва на возможные потери по операциям с ценными бумагами, права на которые удостоверяются депозитариями”, зарегистрированном Министерством юстиции Российской Федерации 12 декабря 2011 года № 22544, 1 августа 2012 года № 25070 (“Вестник Банка России” от 19 декабря 2011 года № 71, от 8 августа 2012 года № 44)?	

Примечания к заполнению таблицы 4.

К вопросу 10.

При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при наличии в учредительных документах ЦК ограничения на открытие корреспондентских счетов только в расчетных небанковских кредитных организациях и (или) банках-резидентах, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности в иностранной валюте одного из международных рейтинговых агентств на уровне не ниже суверенного рейтинга Российской Федерации, уменьшенного на четыре рейтинговые ступени, с минимальным шагом, соответствующим классификации рейтингов, согласно таблице соответствия кредитных рейтингов аккредитованных рейтинговых агентств, одобренной Экспертным советом по деятельности рейтинговых агентств при Министерстве финансов Российской Федерации и размещенной на официальном сайте Министерства финансов Российской Федерации в информационно-телекоммуникационной сети “Интернет”, а также открытие иных счетов для исполнения обязательств в банках-нерезидентах, имеющих аналогичный банкам-резидентам рейтинг одного из международных рейтинговых агентств, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.

К вопросу 11.

При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при открытии торговых банковских счетов в расчетных небанковских кредитных организациях, клиринговых банковских счетов в Банке России, и (или) расчетных небанковских кредитных организациях, и (или) банках-резидентах, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности в иностранной валюте одного из международных рейтинговых агентств на уровне не ниже суверенного рейтинга Российской Федерации, уменьшенного на четыре рейтинговые ступени, с минимальным шагом, соответствующим классификации рейтингов, согласно таблице соответствия кредитных рейтингов аккредитованных рейтинговых агентств, одобренной Экспертным советом по деятельности рейтинговых агентств при Министерстве финансов Российской Федерации и размещенной на официальном сайте Министерства финансов Российской Федерации в информационно-телекоммуникационной сети “Интернет”, а также открытию иных счетов для исполнения обязательств в банках-нерезидентах, имеющих аналогичный банкам-резидентам рейтинг одного из международных рейтинговых агентств и банках-резидентах стран — участников Содружества Независимых Государств, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.

К вопросу 12.

При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при открытии вкладов в банках-резидентах, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности в иностранной валюте одного из международных рейтинговых агентств на уровне не ниже суверенного рейтинга Российской Федерации, уменьшенного на четыре рейтинговые ступени, с минимальным шагом, соответствующим классификации рейтингов, согласно таблице соответствия кредитных рейтингов аккредитованных рейтинговых агентств, одобренной Экспертным советом по деятельности рейтинговых агентств при Министерстве финансов Российской Федерации и размещенной на официальном сайте Министерства финансов Российской Федерации в информационно-телекоммуникационной сети “Интернет”, и в банках-нерезидентах, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности в иностранной валюте международного рейтингового агентства Standard & Poor’s на уровне не ниже ВВВ– или рейтинг другого международного рейтингового агентства не ниже аналогичного, а также при наличии возможности изъятия такого вклада в случае необходимости, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.

В случае неприменимости вопроса 12 таблицы 4 к деятельности ЦК ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2.

К вопросу 20.

При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при наличии в учредительных документах ЦК ограничения на размещение временно свободных денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте только во вклады в банках-резидентах, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности в иностранной валюте одного из международных рейтинговых агентств на уровне не ниже суверенного рейтинга Российской Федерации, уменьшенного на четыре рейтинговые ступени, с минимальным шагом, соответствующим классификации рейтингов, согласно таблице соответствия кредитных рейтингов аккредитованных рейтинговых агентств, одобренной Экспертным советом по деятельности рейтинговых агентств при Министерстве финансов Российской Федерации и размещенной на официальном сайте Министерства финансов Российской Федерации в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", и в банках-нерезидентах, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности международного рейтингового агентства Standard & Poor's на уровне не ниже ВВВ- или рейтингом других международных рейтинговых агентств не ниже аналогичного, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.

К вопросу 21.

При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при наличии в учредительных документах ЦК ограничения на размещение временно свободных денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте только в финансовые инструменты с долгосрочным рейтингом эмитента (для ценных бумаг), контрагента (для денежных средств в рублях) и суверенным рейтингом страны (для денежных средств в иностранной валюте) одного из международных рейтинговых агентств на уровне не ниже суверенного рейтинга Российской Федерации, уменьшенного на четыре рейтинговые ступени, с минимальным шагом, соответствующим классификации рейтингов, согласно таблице соответствия кредитных рейтингов аккредитованных рейтинговых агентств, одобренной Экспертным советом по деятельности рейтинговых агентств при Министерстве финансов Российской Федерации и размещенной на официальном сайте Министерства финансов Российской Федерации в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", за исключением случаев приобретения активов, вызванных необходимостью закрытия сделок с участниками клиринга и случаев приобретения активов в рамках деятельности ЦК как стороны всех договоров, обязательства из которых подлежат включению в клиринговый пул, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.

К вопросу 22.

При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при размещении ЦК клирингового обеспечения в финансовые инструменты с долгосрочным рейтингом эмитента (для ценных бумаг), контрагента (для денежных средств в рублях) и суверенным рейтингом страны (для денежных средств в иностранной валюте) одного из международных рейтинговых агентств на уровне не ниже суверенного рейтинга Российской Федерации, уменьшенного на четыре рейтинговые ступени, с минимальным шагом, соответствующим классификации рейтингов, согласно таблице соответствия кредитных рейтингов аккредитованных рейтинговых агентств, одобренной Экспертным советом по деятельности рейтинговых агентств при Министерстве финансов Российской Федерации и размещенной на официальном сайте Министерства финансов Российской Федерации в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", за исключением случаев приобретения активов, вызванных необходимостью закрытия сделок с участниками клиринга и случаев приобретения активов в рамках деятельности ЦК как стороны всех договоров, обязательства из которых подлежат включению в клиринговый пул, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.

В случае неприменимости вопроса 22 таблицы 4 к деятельности ЦК ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2.

К вопросу 23.

При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при наличии в учредительных документах ЦК ограничения на размещение временно свободных денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте только в долговые ценные бумаги со сроком до погашения или досрочного выкупа (оферте) данного финансового инструмента меньше 1,5 лет, за исключением случаев приобретения указанных финансовых инструментов, вызванных необходимостью исполнения ЦК обязательств перед добросовестными участниками клиринга, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.

К вопросу 24.

При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при размещении ЦК клирингового обеспечения в долговые ценные бумаги со сроком до погашения или досрочного выкупа (оферте) данного финансового инструмента меньше 1,5 лет, за исключением случаев приобре-

тения указанных финансовых инструментов, вызванных необходимостью исполнения ЦК обязательств перед добросовестными участниками клиринга, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.

В случае неприменимости вопроса 24 таблицы 4 к деятельности ЦК ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2.

К вопросу 25.

В случае неприменимости вопроса 25 таблицы 4 к деятельности ЦК ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2.

3.3.7. Оценка ответов на вопросы таблицы 4 производится путем присвоения им значений по следующей шкале:

равное 0 — не выполняется или выполняется не в полном объеме (нет; отсутствует);

равное 2 — выполняется в полном объеме (да; присутствует).

3.3.8. Показатель ПКР2 представляет собой сумму значений оценок ответов на вопросы, приведенные в таблице 4.

3.3.9. Значение показателя ПКР2 признается удовлетворительным, если его результат равен 50 баллам.

3.4. Оценка качества управления рыночным риском ЦК осуществляется по результатам оценок показателя рыночного риска ЦК (далее — ПРР1), включающего коэффициенты рыночного риска — РР1, РР2, РР3, РР4, и показателя управления рыночным риском ЦК (далее — ПРР2).

3.4.1. Коэффициент РР1 характеризует качество модели расчета размера индивидуального клирингового обеспечения участников клиринга. Коэффициент РР1 рассчитывается как отношение количества случаев, когда фактические изменения цен финансовых инструментов, по которым осуществляется клиринг, превышали используемые в модели расчета размера индивидуального клирингового обеспечения параметры, ограничивающие изменение цен таких финансовых инструментов, к общему количеству фактических изменений параметров модели расчета значения индивидуального клирингового обеспечения:

$$PP1 = \frac{M1}{Sl} * 100\%,$$

где:

М1 — количество случаев, когда фактические изменения цен финансовых инструментов, по которым осуществляется клиринг, превышали используемые в модели расчета размера индивидуального клирингового обеспечения параметры, ограничивающие изменение цен таких финансовых инструментов;

Sl — общее количество фактических изменений параметров модели расчета значения индивидуального клирингового обеспечения.

Требования к расчету:

Глубина выборки для расчета коэффициента РР1 должна быть не менее 12 месяцев и включать периоды с наибольшим месячным отрицательным изменением Индекса ММВБ и (или) Индекса РТС за последние 10 лет.

Расчет производится по каждому финансовому инструменту, торгуемому на рынке с ЦК.

Значение РР1 принимается равным наибольшему из всех значений, рассчитанных по каждому финансовому инструменту, торгуемому на рынке с ЦК.

3.4.2. Коэффициент РР2 характеризует качество модели расчета размера индивидуального клирингового обеспечения участников клиринга в случае превышения фактического изменения цен финансовых инструментов, торгуемых на рынке с ЦК, над используемым в модели расчета размера индивидуального клирингового обеспечения параметром, ограничивающим изменение цен таких финансовых инструментов. Коэффициент РР2 рассчитывается как отношение суммы превышения фактического изменения в процентном выражении цен финансовых инструментов, торгуемых на рынке с ЦК, над параметрами (в процентах), используемыми в модели расчета размера индивидуального клирингового обеспечения, ограничивающими изменение цен таких финансовых инструментов, к общему количеству таких случаев:

$$PP2 = \frac{1}{M1} \sum_i \Delta_i,$$

где:

$\Delta_i$  — величина, характеризующая в процентном выражении разницу фактического изменения цен финансовых инструментов, торгуемых на рынке с ЦК, над параметрами (в процен-



тах), используемыми в модели расчета размера индивидуального клирингового обеспечения и ограничивающими изменение цен таких финансовых инструментов;

M1 — рассчитывается аналогично коэффициенту PP1;

$\sum_i$  — суммирование ведется по всем случаям, когда фактическое изменение цен финансовых инструментов, торгуемых на рынке с ЦК, превышало используемые в модели расчета значения индивидуального клирингового обеспечения параметры, ограничивающие изменение цен таких инструментов.

Требования к расчету:

Глубина выборки для расчета коэффициента PP2 должна быть не менее 12 месяцев и включать период с наибольшим месячным отрицательным изменением Индекса ММВБ и (или) Индекса РТС за последние 10 лет.

Расчет производится по каждому финансовому инструменту, торгуемому на рынке с ЦК.

Значение PP2 принимается равным наибольшему из всех значений, рассчитанных по каждому финансовому инструменту, торгуемому на рынке с ЦК.

3.4.3. Коэффициент PP3 характеризует чувствительность портфеля инвестиционных активов к рыночному риску. Коэффициент PP3 рассчитывается как отношение средних потерь, которые может понести ЦК по инвестиционным активам за 1 день, с вероятностью, не превышающей 99%, к рыночной стоимости таких активов. Инвестиционные активы включают в себя денежные средства ЦК, находящиеся на корреспондентских счетах в Банке России и банках-контрагентах в рублях и (или) иностранной валюте, а также портфели активов, сформированные из финансовых инструментов, включающих межбанковские депозиты, депозиты в Банке России, иностранную валюту и ценные бумаги. Коэффициент PP3 рассчитывается по следующей формуле:

$$PP3 = \frac{\sum_i CVaR_i^{1 \text{ день}}}{\sum_i A_i} * 100\%,$$

где:

$A_i$  — рыночная стоимость  $i$ -го актива ЦК в рублях;

суммирование ведется по всем инвестиционным активам ЦК;

$CVaR_i^{1 \text{ день}}$  (условная стоимость под риском) — величина, характеризующая среднее значение по однопроцентной выборке наихудших негативных для ЦК изменений стоимости  $i$ -го актива. Значение  $CVaR_i^{1 \text{ день}}$  для денежных средств в рублях равно нулю.

3.4.4. Коэффициент PP4 характеризует максимальную долю активов ЦК, хранящуюся в одном виде актива (иностранной валюте, выпуске ценной бумаги и других) в общем объеме инвестиционных активов ЦК в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета, умноженную на 100%. Коэффициент PP4 характеризует диверсифицированность инвестиционных активов ЦК и рассчитывается как максимум из отношений рыночной стоимости актива определенного типа в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета, к рыночной стоимости всех инвестиционных активов ЦК в рублевом эквиваленте, рассчитанном по аналогичному курсу:

$$PP4 = \max_k \frac{A_k}{IA} * 100\%,$$

где:

$A_k$  — рыночная стоимость  $k$ -го инвестиционного актива ЦК в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета, за исключением всех выпусков облигаций Банка России и облигаций федерального займа;

IA — рыночная стоимость всех инвестиционных активов ЦК в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета.

3.4.5. Показатель PPP1 представляет собой сумму балльных оценок значений коэффициентов, определенных в соответствии с подпунктами 3.4.1—3.4.4 настоящей Методики.

Балльные оценки коэффициентов PP1—PP4 приведены в приложении 3 к настоящему Указанию.

3.4.6. Значение показателя PPP1 признается удовлетворительным, если его результат равен 8 баллам.



3.4.7. Показатель PPP2 определяется на основании оценки ответов на вопросы, приведенные в таблице 5.

Таблица 5

## ПОКАЗАТЕЛЬ УПРАВЛЕНИЯ РЫНОЧНЫМ РИСКОМ ЦК

№ п/п	Вопросы	Значение (в баллах)
1	2	3
1.	Проводится ли ЦК постоянный контроль достаточности индивидуального клирингового обеспечения или соответствующего его уровня, установленного в правилах клиринга?	
2.	Имеются ли у ЦК соглашения с участниками клиринга о своевременном внесении дополнительного обеспечения?	
3.	Проводит ли ЦК оценку стоимости индивидуального и коллективного клирингового обеспечения не реже одного раза в день?	
4.	Проводит ли ЦК оценку стоимости открытых позиций участников клиринга не реже одного раза в день?	
5.	Имеются ли у ЦК механизмы, обеспечивающие закрытие позиций участников клиринга, не исполнивших обязательства, в срок, не превышающий двух торговых дней?	
6.	Установлен ли дисконт для активов, принимаемых в качестве обеспечения, с целью покрытия возможных изменений их стоимости в период между последней переоценкой обеспечения и временем их реализации?	
7.	Имеются ли у ЦК меры, направленные на снижение риска, при возникновении ситуации, когда прекращаемое обязательство участника клиринга обеспечено индивидуальным клиринговым обеспечением, составляющим имущество, отличное от объекта прекращаемого обязательства участника клиринга (за исключением денежных средств в рублях)?	

3.4.8. Оценка ответов на вопросы таблицы 5 производится путем присвоения им значений по следующей шкале:

равное 0 — не выполняется или выполняется не в полном объеме (нет, отсутствует);  
равное 2 — выполняется в полном объеме (да, присутствует).

3.4.9. Показатель PPP2 представляет собой сумму значений оценок ответов на вопросы, приведенные в таблице 5.

3.4.10. Значение показателя PPP2 признается удовлетворительным, если его результат равен 14 баллам.

3.5. Оценка качества управления риском ликвидности ЦК осуществляется по результатам оценок показателя риска ликвидности ЦК (далее — ПРЛ1), включающего коэффициенты риска ликвидности — РЛ1, РЛ2, РЛ3, РЛ4, и показателя управления риском ликвидности ЦК (далее — ПРЛ2).

3.5.1. Коэффициент РЛ1 характеризует возможность реализации индивидуального клирингового обеспечения на организованном биржевом рынке. Коэффициент РЛ1 рассчитывается как сумма отношений стоимостей активов в обеспечении, за исключением денежных средств в рублях, к величине оборота данного инструмента на биржевом рынке, взвешенных по стоимостной доле данного инструмента во всех пулах индивидуального клирингового обеспечения с учетом денежных средств в рублях:

$$РЛ1 = \sum_i \frac{A_i}{Оборот_i} * w_i * 100\%,$$

где:

суммирование ведется по всем активам, принимаемым в индивидуальное клиринговое обеспечение, исключая денежные средства в рублях;

$A_i$  — рыночная стоимость  $i$ -го актива, находящегося в индивидуальном клиринговом обеспечении, у всех участников клиринга, в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета;

Оборот <sub>$i$</sub>  — среднедневной оборот по итогам биржевых торгов по  $i$ -му типу актива, принимаемому в индивидуальное клиринговое обеспечение, определенный за прошедший месяц по всем торговым дням у всех участников клиринга в рублевом эквиваленте, который рассчитывается

ется по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета. Оборот<sub>i</sub> определяется по всем рынкам, на которых ЦК может реализовать актив;

$w_i$  — доля  $i$ -го актива в общем объеме индивидуального клирингового обеспечения с учетом денежных средств в рублях:

$$w_i = \frac{A_i}{\text{ИКО}},$$

где:

ИКО — рыночная стоимость индивидуального клирингового обеспечения всех участников клиринга в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета, включая денежные средства в рублях.

Требования к расчету:

Если в качестве индивидуального клирингового обеспечения выступают только денежные средства в рублях и (или) свободно конвертируемых валютах, ценные бумаги, включенные в Ломбардный список Банка России, то РЛ1 = 0.

Если в качестве индивидуального клирингового обеспечения выступают активы, средневзвешенный оборот по которым равен нулю, то коэффициент РЛ1 = 100%.

3.5.2. Коэффициент РЛ2 характеризует возможность реализации коллективного клирингового обеспечения на организованном биржевом рынке. Коэффициент РЛ2 рассчитывается как сумма отношений стоимостей активов, принимаемых в коллективное клиринговое обеспечение, за исключением денежных средств в рублях, к величине оборота данного инструмента на биржевом рынке, взвешенных по стоимостной доле данного актива в коллективном клиринговом обеспечении с учетом денежных средств в рублях:

$$\text{РЛ2} = \sum_i \frac{A_i}{\text{Оборот}_i} * v_i * 100\%,$$

где:

суммирование ведется по всем активам, находящимся в коллективном клиринговом обеспечении, исключая денежные средства в рублях;

$A_i$  — рыночная стоимость  $i$ -го актива, находящегося в коллективном клиринговом обеспечении в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета;

Оборот<sub>i</sub> — определяется и рассчитывается в соответствии с порядком расчета коэффициента РЛ1;

$v_i$  — доля  $i$ -го инструмента в общем объеме коллективного клирингового обеспечения с учетом денежных средств в рублях:

$$v_i = \frac{A_i}{\Phi},$$

где:

$\Phi$  — определяется и рассчитывается в соответствии с порядком расчета коэффициента КР1.

Требования к расчету:

Если в качестве коллективного клирингового обеспечения выступают только денежные средства в рублях и (или) свободно конвертируемых валютах, ценные бумаги, включенные в Ломбардный список Банка России, то РЛ2 = 0.

Если в качестве коллективного клирингового обеспечения выступают активы, средневзвешенный оборот по которым равен нулю, то коэффициент РЛ2 = 100%.

3.5.3. Коэффициент РЛ3 характеризует долю принятых активов в индивидуальное клиринговое обеспечение, под которые могут быть получены денежные средства в рублях в течение одного рабочего дня. Коэффициент РЛ3 рассчитывается как отношение рыночной стоимости индивидуального клирингового обеспечения, обладающего наибольшей ликвидностью в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета, к рыночной стоимости всего индивидуального клирингового обеспечения в рублевом эквиваленте, рассчитанном по аналогичному курсу:

$$\text{РЛ3} = \frac{C_i}{\text{ИКО}} * 100\%,$$

где:

Си — рыночная стоимость индивидуального клирингового обеспечения, являющегося: денежными средствами в рублях и (или) в свободно конвертируемых валютах, ценными бумагами, включенными в Ломбардный список Банка России в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета;

ИКО — определяется в соответствии с порядком расчета коэффициента РЛ1.

3.5.4. Коэффициент РЛ4 характеризует долю активов, принятых в коллективное клиринговое обеспечение, под которые могут быть получены денежные средства в рублях в течение одного рабочего дня. Коэффициент РЛ4 рассчитывается как отношение рыночной стоимости коллективного клирингового обеспечения обладающего наибольшей ликвидностью в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета, к рыночной стоимости всего коллективного клирингового обеспечения в рублевом эквиваленте, рассчитанном по аналогичному курсу:

$$РЛ4 = \frac{Ск}{Ф} * 100\%,$$

где:

Ск — рыночная стоимость коллективного клирингового обеспечения, являющегося: денежными средствами в рублях и (или) свободно конвертируемых валютах, активами, включенными в Ломбардный список Банка России в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, на дату расчета;

Ф — определяется и рассчитывается в соответствии с порядком расчета коэффициента КР1.

3.5.5. Показатель ПРЛ1 представляет собой сумму значений коэффициентов, определенных в соответствии с подпунктами 3.5.1—3.5.4 настоящей Методики.

Балльные оценки коэффициентов РЛ1—РЛ4 приведены в приложении 3 к настоящему Указанию.

3.5.6. Значение показателя ПРЛ1 признается удовлетворительным, если его результат равен 8 баллам.

3.5.7. Показатель ПРЛ2 определяется на основании оценки ответов на вопросы, приведенные в таблице 6.

Таблица 6

#### ПОКАЗАТЕЛЬ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ ЛИКВИДНОСТИ ЦК

№ п/п	Вопросы	Значение (в баллах)
1	2	3
1.	Принимаются ли в качестве индивидуального клирингового обеспечения только ценные бумаги из Ломбардного списка Банка России, а также долевые ценные бумаги резидентов, включенные в список для расчета Индекса ММВБ и (или) Индекса РТС?	
2.	Принимаются ли в качестве коллективного клирингового обеспечения только ценные бумаги из Ломбардного списка Банка России, казначейские бумаги или бумаги центральных банков стран Организации европейского экономического сотрудничества с рейтингом долгосрочной кредитоспособности в иностранной валюте международного рейтингового агентства Standard & Poor's на уровне не ниже ВВВ+ или рейтингом других международных рейтинговых агентств или национальных рейтинговых агентств не ниже аналогичного согласно таблице соответствия кредитных рейтингов аккредитованных рейтинговых агентств, одобренной Экспертным советом по деятельности рейтинговых агентств при Министерстве финансов Российской Федерации и размещенной на официальном сайте Министерства финансов Российской Федерации в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"?	
3.	Имеется ли у ЦК план по привлечению дополнительных источников собственных средств (капитала) ЦК и клирингового обеспечения (в случае существенного снижения величины собственных средств (капитала) ЦК (на 15%—20%) или нарушения обязательных нормативов кредитных организаций)?	

1	2	3
4.	Имеется ли у ЦК план по проведению реорганизационных процедур (в случае невозможности привлечения дополнительных источников собственных средств (капитала) ЦК)?	
5.	Имеются ли у ЦК процедуры и правила для осуществления своевременного исполнения обязательств в случае недостаточности ликвидности в непредвиденных обстоятельствах?	
6.	Проводит ли ЦК регулярный мониторинг и оценку ликвидности ЦК, необходимой для исполнения обязательств ЦК, связанных с осуществлением клиринга?	
7.	Имеются ли у ЦК процедуры и правила, обеспечивающие диверсификацию временно свободных денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте и клирингового обеспечения?	
8.	Проводит ли ЦК оценку финансовой устойчивости организаций, предоставляющих ликвидность ЦК не реже одного раза в квартал?	

Примечания к заполнению таблицы 6.

К вопросу 1.

При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при величине (весе) влияния долевых ценных бумаг, включенных в список для расчета Индекса ММВБ и (или) Индекса РТС, на данные индексы, равной одному проценту и более, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.5.8 настоящей Методики.

В случае неприменимости вопроса 1 таблицы 6 к деятельности ЦК ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2.

К вопросу 2.

В случае неприменимости вопроса 2 таблицы 6 к деятельности ЦК ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2.

3.5.8. Оценка ответов на вопросы таблицы 6 производится путем присвоения им значений по следующей шкале:

равное 0 — не выполняется или выполняется не в полном объеме (нет; отсутствует);

равное 2 — выполняется в полном объеме (да; присутствует).

3.5.9. Показатель ПРЛ2 представляет собой сумму значений оценок ответов на вопросы, приведенные в таблице 6.

3.5.10. Значение показателя ПРЛ2 признается удовлетворительным, если его результат равен 16 баллам.

3.6. Оценка качества управления операционным риском ЦК осуществляется по результатам оценок показателя операционного риска ЦК (далее — ПОР1), включающего коэффициенты операционного риска — ОР1, ОР2, и показателя управления операционным риском ЦК (далее — ПОР2).

3.6.1. Коэффициент ОР1 характеризует частоту проведения внутренних проверок устойчивости операционно-информационных систем. Коэффициент ОР1 рассчитывается как средний интервал времени между проведением внутренних проверок устойчивости операционно-информационных систем за последние три года.

3.6.2. Коэффициент ОР2 характеризует глубину временных рядов, содержащих данные по случаям реализации операционного риска в данном ЦК. Коэффициент ОР2 рассчитывается как отношение промежутка времени, в течение которого ведутся базы данных о потерях, вызванных операционным риском, к временному промежутку с момента возникновения ЦК:

$$ОР2 = \frac{T_{\text{Б}}}{T_{\text{ЦК}}} * 100\%,$$

где:

$T_{\text{Б}}$  — период ведения баз данных о потерях, вызванных операционным риском, — количество лет, в течение которого ведутся аналитические базы данных о потерях, вызванных операционным риском;

$T_{\text{ЦК}}$  — период деятельности ЦК — количество лет, в течение которых ЦК выполняет свои функции, являясь одной из сторон всех договоров, обязательства из которых подлежат включению в клиринговый пул.

В случае отсутствия у ЦК собственных баз данных и использования при расчете коэффициента ОР2 аналитических баз данных других ЦК о потерях, вызванных операционным риском, имеющим статистику за период более 1 года, коэффициент ОР2 = 80%.

В случае, если количество лет, в течение которых ведутся базы данных, отражающие потери, вызванные реализацией операционного риска, составляет меньше 1 года, то коэффициент ОР2 = 0%.

3.6.3. Показатель ПОР1 представляет собой сумму значений коэффициентов, определенных в соответствии с подпунктами 3.6.1—3.6.2 настоящей Методики.

Балльные оценки коэффициентов ОР1—ОР2 приведены в приложении 3 к настоящему Указанию.

3.6.4. Значение показателя ПОР1 признается удовлетворительным, если его результат равен 4 баллам.

3.6.5. Показатель ПОР2 определяется на основании оценки ответов на вопросы, приведенные в таблице 7.

Таблица 7

## ПОКАЗАТЕЛЬ УПРАВЛЕНИЯ ОПЕРАЦИОННЫМ РИСКОМ ЦК

№ п/п	Вопросы	Значение (в баллах)
1	2	3
1.	Существует ли в ЦК подразделение или служащие, ответственные за оценку уровня операционного риска?	
2.	Имеются ли у ЦК внутренние документы по управлению операционным риском?	
3.	Соблюдаются ли внутренние документы по вопросам управления операционным риском?	
4.	Определены ли во внутренних документах ЦК основные принципы управления операционным риском?	
5.	Определены ли во внутренних документах ЦК методы и порядок проведения оценки операционного риска?	
6.	Проводится ли в ЦК оценка операционного риска?	
7.	Проводится ли в ЦК мониторинг операционного риска?	
8.	Имеется ли в ЦК система индикаторов операционного риска в целях мониторинга операционного риска?	
9.	Проводятся ли ЦК проверки устойчивости ЦК к сбоям операционно-информационных систем не реже одного раза в год?	
10.	Имеются ли в ЦК планы по обеспечению непрерывности деятельности и (или) восстановлению деятельности ЦК?	
11.	Имеется ли в ЦК комплексная система мер по обеспечению непрерывности и (или) восстановлению деятельности ЦК, включая планы действий на случай непредвиденных обстоятельств?	
12.	Имеются ли в ЦК меры, направленные на предотвращение сбоев и ошибок при осуществлении функций ЦК?	
13.	Определен ли во внутренних документах ЦК порядок осуществления контроля за эффективностью управления операционным риском?	
14.	Определен ли во внутренних документах ЦК порядок регулирования операционного риска, связанный с привлечением иных организаций для оказания операционных услуг по обеспечению деятельности ЦК?	
15.	Проводится ли ЦК повышение квалификации служащих по вопросам управления операционным риском?	

3.6.6. Оценка ответов на вопросы таблицы 8 производится путем присвоения им значений по следующей шкале:

равное 0 — не выполняется или выполняется не в полном объеме (нет; отсутствует);

равное 2 — выполняется в полном объеме (да; присутствует).

3.6.7. Показатель ПОР2 представляет собой сумму значений оценок ответов на вопросы, приведенные в таблице 8.

3.6.8. Значение показателя ПОР2 признается удовлетворительным, если его результат равен 30 баллам.

3.7. Оценка качества управления риском потери деловой репутации ЦК осуществляется по результатам оценки показателя управления риском потери деловой репутации ЦК (далее — ПДР).

3.7.1. Показатель ПДР определяется на основании оценки ответов на вопросы, приведенные в таблице 8.

Таблица 8

ПОКАЗАТЕЛЬ УПРАВЛЕНИЯ РИСКОМ ПОТЕРИ ДЕЛОВОЙ РЕПУТАЦИИ ЦК

№ п/п	Вопросы	Значение (в баллах)
1	2	3
1.	Имеются ли у ЦК планы действий на случай реализации риска потери деловой репутации ЦК в целях поддержания непрерывного функционирования ЦК?	
2.	Проводится ли ЦК анализ доходов и расходов до введения новых инструментов?	
3.	Отсутствуют ли у ЦК нарушения пруденциальных норм деятельности и обязательств перед органом, осуществляющим регулирование ЦК, а также Банком России?	
4.	Имеются ли у ЦК меры, направленные на идентификацию, предотвращение и урегулирование конфликта интересов при осуществлении клиринга и совмещении функций ЦК с иными видами деятельности?	

3.7.2. Оценка ответов на вопросы таблицы 8 производится путем присвоения им значений по следующей шкале:

равное 0 — не выполняется (нет);

равное 1 — выполняется не в полном объеме (в основном да);

равное 2 — выполняется в полном объеме (да).

3.7.3. Показатель ПДР представляет собой сумму значений оценок ответов на вопросы, приведенные в таблице 8.

3.7.4. Значение показателя ПДР признается удовлетворительным, если его результат равен 7 баллам и более.

#### 4. Определение обобщающего результата оценки качества управления ЦК

4.1. Качество управления ЦК имеет оценку “удовлетворительно”, если:

все показатели качества системы управления рисками ЦК, внутреннего контроля и корпоративного управления ЦК имеют значение “удовлетворительно”;

отсутствуют основания для отказа в удовлетворении ходатайства ЦК, определенные пунктом 8 настоящего Указания.



**Приложение 2**  
к Указанию Банка России  
от 3 декабря 2012 года № 2919-У  
“Об оценке качества управления  
кредитной организации, осуществляющей  
функции центрального контрагента”

Председателю Банка России  
Инициалы, фамилия

**ХОДАТАЙСТВО  
О ПРИЗНАНИИ КАЧЕСТВА УПРАВЛЕНИЯ КРЕДИТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ,  
ОСУЩЕСТВЛЯЮЩЕЙ ФУНКЦИИ ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА,  
УДОВЛЕТВОРИТЕЛЬНЫМ**

---

(полное фирменное наименование кредитной организации, осуществляющей функции  
центрального контрагента, ее регистрационный номер, присвоенный Банком России,  
адрес (место нахождения) кредитной организации)

ходатайствует о признании качества управления центрального контрагента удовлетворительным

---

---

Приложение: результаты внутренней оценки качества управления центрального контрагента.

---

(наименование должности уполномоченного лица  
кредитной организации, осуществляющей  
функции центрального контрагента)

---

(личная подпись)

---

(инициалы,  
фамилия)

М.П.

“ ” \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.  
(дата подписания)

**Приложение 3**  
к Указанию Банка России  
от 3 декабря 2012 года № 2919-У  
“Об оценке качества управления  
кредитной организацией, осуществляющей  
функции центрального контрагента”

**БАЛЛЬНАЯ ОЦЕНКА ПОКАЗАТЕЛЕЙ КРЕДИТНОГО РИСКА, РЫНОЧНОГО РИСКА,  
РИСКА ЛИКВИДНОСТИ, ОПЕРАЦИОННОГО РИСКА ЦК**

№ п/п	Наименование показателя	Диапазон значений показателя (%) для присвоения 0 баллов	Диапазон значений показателя (%) для присвоения 2-х баллов
1	2	3	4
1.	Показатель ПКР1		
1.1.	Коэффициент КР1	<100	>=100
1.2.	Коэффициент КР2	>25	<=25
1.3.	Коэффициент КР3	<60	>=60
2.	Показатель ПРР1		
2.1.	Коэффициент РР1	>1	<=1
2.2.	Коэффициент РР2	>5	<=5
2.3.	Коэффициент РР3	>5	<=5
2.4.	Коэффициент РР4	>25	<=25
		>50 <sup>1</sup>	<=50 <sup>1</sup>
3.	Показатель ПРЛ1		
3.1.	Коэффициент РЛ1	>75	<=75
3.2.	Коэффициент РЛ2	>75	<=75
3.3.	Коэффициент РЛ3	<95	>=95
3.4.	Коэффициент РЛ4	<95	>=95
4.	Показатель ПОР1		
4.1.	Коэффициент ОР1	>1 года	<=1 год
4.2.	Коэффициент ОР2	<80	>=80

<sup>1</sup> Диапазон значений показателя РР4 для свободно конвертируемых валют.

Главные управления  
(национальные банки)  
Центрального банка  
Российской Федерации  
от 26.12.2012 № 182-Т

### О включении ценных бумаг в Ломбардный список Банка России

В соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от 21 декабря 2012 года № 26) в Ломбардный список Банка России включены следующие ценные бумаги:

государственные облигации Санкт-Петербурга, имеющие государственный регистрационный номер выпуска RU25039GSP0;

государственные облигации Краснодарского края 2012 года, имеющие государственный регистрационный номер выпуска RU34004KND0;

облигации Открытого акционерного общества "Агентство по ипотечному жилищному кредитованию", имеющие государственный регистрационный номер выпуска 4-24-00739-А;

облигации Открытого акционерного общества "Российский Сельскохозяйственный банк", имеющие государственные регистрационные номера выпусков 41703349В, 41803349В;

биржевые облигации Закрытого акционерного общества "ЮниКредит Банк", имеющие государственные регистрационные номера выпусков 4В020400001В, 4В020500001В;

облигации "Газпромбанк" (Открытое акционерное общество), имеющие государственные регистрационные номера выпусков 40700354В, 41000354В, 41100354В, 41200354В;

биржевые облигации Общества с ограниченной ответственностью "Русфинанс Банк", имеющие государственный регистрационный номер выпуска 4В020301792В;

биржевые облигации Закрытого акционерного общества "Банк Интеза", имеющие государственный регистрационный номер выпуска 4В020102216В;

биржевые облигации открытого акционерного общества коммерческий банк "Центр-инвест", имеющие государственный регистрационный номер выпуска 4В020202225В;

облигации Открытого акционерного общества междугородной и международной электрической связи "Ростелеком", имеющие государственные регистрационные номера выпусков 4-11-00124-А, 4-13-00124-А, 4-64-00124-А;

облигации Открытого акционерного общества "ВЭБ-лизинг", имеющие государственные регистрационные номера выпусков 4-10-43801-Н, 4-11-43801-Н, 4-12-43801-Н, 4-13-43801-Н;

облигации Открытого акционерного общества "Магнитогорский металлургический комбинат", имеющие государственный регистрационный номер выпуска 4-18-00078-А;

биржевые облигации Открытого акционерного общества "Московская объединенная электросетевая компания", имеющие государственный регистрационный номер выпуска 4В02-02-65116-Д;

облигации Федерального государственного унитарного предприятия "Почта России", имеющие государственные регистрационные номера выпусков 4-02-00005-Т, 4-03-00005-Т, 4-04-00005-Т;

облигации "Азиатско-Тихоокеанский Банк" (открытое акционерное общество), имеющие государственный регистрационный номер выпуска 40101810В;

облигации Акционерного коммерческого банка "РОССИЙСКИЙ КАПИТАЛ" (открытое акционерное общество), имеющие государственный регистрационный номер выпуска 40302312В;

облигации Открытого акционерного общества "Нефтяная компания "Роснефть", имеющие государственные регистрационные номера выпусков 4-04-00122-А, 4-05-00122-А;

обыкновенные акции Акционерной компании "АЛРОСА" (открытое акционерное общество); обыкновенные акции Открытого акционерного общества "СОЛЛЕРС";

долговые эмиссионные ценные бумаги, выпущенные юридическими лицами — нерезидентами Российской Федерации за пределами Российской Федерации, имеющие следующие коды ISIN: XS0783291221, XS0764253455, XS0764220017.

Настоящее письмо подлежит опубликованию в "Вестнике Банка России" и применяется начиная со дня его опубликования в "Вестнике Банка России".

Доведите содержание настоящего письма до сведения кредитных организаций.

ПРЕДСЕДАТЕЛЬ ЦЕНТРАЛЬНОГО БАНКА  
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

С.М. ИГНАТЬЕВ

**ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

# **ВЕСТНИК БАНКА РОССИИ**

**Нормативные акты и оперативная информация  
Центрального банка Российской Федерации**

**№ 77 (1395)**

**28 ДЕКАБРЯ 2012**

**МОСКВА**

## Редакционный совет изданий Банка России:

Председатель совета Г.И. Лунтовский

Заместитель председателя совета Т.Н. Чугунова

Члены совета:

С.А. Голубев, Г.С. Ефремова, Н.Ю. Иванова, В.И. Моргунов,  
А.Ю. Симановский, В.Н. Сменковский, М.И. Сухов, С.А. Швецов

Ответственный секретарь совета Е.Ю. Ключева

Учредитель – Центральный банк Российской Федерации  
107016, Москва, ул. Неглинная, 12

Адрес официального сайта Банка России: <http://www.cbr.ru>

Тел. 771-43-73, факс 623-83-77, e-mail: [mvg@cbr.ru](mailto:mvg@cbr.ru)

Издание зарегистрировано Федеральной службой по надзору в сфере связи, информационных технологий и массовых коммуникаций. Регистрационный номер ПИ № ФС77-47238

© Центральный банк Российской Федерации, 1994 г.

Издатель и распространитель: ЗАО «АЭИ «ПРАЙМ»

119021, Москва, Зубовский б-р, 4

Тел. 974-76-64, факс 637-45-60, [www.1prime.ru](http://www.1prime.ru), e-mail: [sales01@1prime.ru](mailto:sales01@1prime.ru)

Отпечатано в ООО «Типография ЛБЛ»  
125080, Москва, Ленинградское ш., 46/1