

ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

УКАЗАНИЕ

от _____ 2015 года

№ _____

г. Москва

**О внесении изменений
в Положение Банка России от 28 сентября 2012 года № 387-П
«О порядке расчета кредитными организациями
величины рыночного риска»**

1. В соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от _____ 2015 года № ___) внести в Положение Банка России от 28 сентября 2012 года № 387-П «О порядке расчета кредитными организациями величины рыночного риска», зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 9 ноября 2012 года № 25783, 29 ноября 2013 года № 30496, 11 декабря 2014 года № 35134 («Вестник Банка России» от 21 ноября 2012 года № 66, от 30 ноября 2013 года № 69, от 22 декабря 2014 года № 112), следующие изменения.

1.1. Абзацы двенадцатый и тринадцатый пункта 2.5 исключить.

1.2. Пункт 2.6 дополнить абзацами следующего содержания:

«ценные бумаги, эмитированные банками, созданными по законодательству стран, имеющих страновые оценки «3», «4», «5», «6»;

ценные бумаги, эмитированные юридическими лицами (за исключением банков);

ценные бумаги, эмитированные юридическими лицами, исполнение обязательств по которым полностью обеспечивается банковской гарантией, поручительством банков, созданных по законодательству стран, имеющих страновые оценки «3», «4», «5», «6».

1.3. Пункт 2.7 изложить в следующей редакции:

«2.7. Ценные бумаги с высоким риском:

ценные бумаги, при расчете кредитного риска по которым применяется показатель ПК с коэффициентом 1,5 в соответствии с Инструкцией Банка России № 139-И;

иные ценные бумаги, не указанные в пунктах 2.4 - 2.6 настоящего Положения.».

1.4. Пункт 2.9 исключить.

2. Настоящее Указание подлежит официальному опубликованию в «Вестнике Банка России» и вступает в силу с 1 января 2016 года.

Председатель Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. НАБИУЛЛИНА