

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

РАСЧЕТ ПОКАЗАТЕЛЯ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ ("БАЗЕЛЬ III")

по состоянию на " __ " _____ г.

Сокращенное фирменное наименование кредитной организации _____

Почтовый адрес _____

Код формы по ОКУД 0409 _____

Месячная

Раздел 1. Информация о компонентах расчета показателя краткосрочной ликвидности

(тыс. руб.)

Номер строки	Наименование показателя	Величина требований (обязательств)	Весовой коэффициент	Взвешенная величина требований (обязательств)
1	2	3	4	5
1.	Высоколиквидные активы, скорректированные с учетом ограничений на структуру высоколиквидных активов (ВЛА-ВК), итого, в том числе	X	X	
1.1.	ВЛА-1, итого, в том числе		X	
1.1.1.	Наличная валюта и чеки (в т.ч. дорожные чеки)		1,00	

1.1.2.	Средства на счетах кредитных организаций (филиалов) по кассовому обслуживанию структурных подразделений, а также средства для кассового обслуживания кредитных организаций (филиалов), которое осуществляется не по месту открытия корреспондентского счета (субсчета)		1,00	
1.1.3.	Средства в Банке России и в уполномоченных органах других стран, в том числе суммы, депонированные в учреждениях Банка России для получения следующим днем наличных денежных средств, средства на корреспондентском и депозитных счетах в Банке России до востребования и с оставшимся сроком до погашения один день, суммы переплаты, подлежащие возврату банку со счетов по учету обязательных резервов в Банке России и в уполномоченных органах других стран		1,00	
1.1.4.	Долговые ценные бумаги, выпущенные или полностью обеспеченные гарантиями правительств, центральных банков стран, имеющих страновую оценку «0» или «1», а также стран с высоким уровнем доходов, являющиеся членами ОЭСР и (или) Еврзоны, международных финансовых организаций и международных банков развития		1,00	
1.1.5.	Долговые ценные бумаги, выпущенные или полностью обеспеченные гарантиями организаций, которым в соответствии с законодательством стран, имеющих страновую оценку «0» или «1», а также стран с высоким уровнем доходов, являющимися членами ОЭСР и (или) Еврзоны, предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства		1,00	
1.1.6.	Долговые ценные бумаги, номинированные в рублях, выпущенные Правительством Российской Федерации или Банком России		1,00	
1.1.7.	Долговые ценные бумаги, номинированные в иностранной валюте, выпущенные Правительством Российской Федерации или Банком России		1,00	
1.1.8	Долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами, центральными банками стран, не имеющих страновую оценку «0»		1,00	

	или «1», а также не являющихся странами с высоким уровнем доходов, являющимися членами ОЭСР и (или) Еврозоны, выпущенные в валюте страны-эмитента			
1.2.	ВЛА-2А, итого, в том числе		X	
1.2.1.	Долговые ценные бумаги, выпущенные или полностью обеспеченные гарантиями правительств, центральных банков стран, имеющих страновую оценку «2», и международных банков развития, требования к которым отнесены во II группу активов		0,85	
1.2.2.	Долговые ценные бумаги, выпущенные или полностью обеспеченные гарантиями организаций, которым в соответствии с законодательством стран, имеющих страновую оценку «2», предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства		0,85	
1.2.3.	Долговые ценные бумаги, выпущенные нефинансовыми организациями, имеющими рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной шкале, присвоенный рейтинговыми агентствами на уровне не ниже «АА-» по классификации рейтинговых агентств «Standard & Poor's» или «Fitch Ratings» либо «Аа3» по классификации рейтингового агентства «Moody's Investors Service»		0,85	
1.2.4.	Облигации с ипотечным покрытием, выпущенные банками		0,85	
1.3.	ВЛА-2Б, итого, в том числе		X	
1.3.1.	Жилищные облигации с ипотечным покрытием, выпущенные юридическими лицами – нерезидентами		0,75	
1.3.2.	Долговые ценные бумаги (кроме ипотечных ценных бумаг), выпущенные нефинансовыми организациями, имеющими рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной шкале, присвоенный рейтинговыми агентствами на уровне от «А+» до «ВВВ-» по классификации рейтинговых агентств «Standard & Poor's» или «Fitch Ratings» либо «А1» до «Ваа3» по классификации рейтингового агентства «Moody's Investors Service»		0,5	
1.3.3.	Обыкновенные акции, включенные организатором торговли (фондовой		0,5	

	биржей) в списки для расчета Индекса ММВБ 50 и Индекса РТС 50, а также индексов акций, указанных в приложении 7 к Инструкции Банка России № 139-И			
1.4.	ВК 15	X	X	
1.5.	Итого ВЛА-2Б после корректировки	X	X	
1.6.	ВК 40	X	X	
1.7.	Итого ВЛА-2 после корректировки	X	X	
2.	Ожидаемые оттоки денежных средств, итого, в том числе	X	X	
2.1.	Ожидаемый отток денежных средств физических лиц, итого, в том числе		X	
2.1.1.	стабильные средства физических лиц, итого, в том числе		0,05	
2.1.1.1.	на банковских счетах, на которые осуществляется перечисление заработной платы или иных выплат, связанных с выполнением трудовых обязанностей, итого, в том числе		0,05	
2.1.1.1.1.	со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней		0,05	
2.1.1.1.2.	со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней		0,05	
2.1.1.2.	на счетах физических лиц, имеющих установленные взаимоотношения с банком, итого, в том числе		0,05	
2.1.1.2.1.	со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней		0,05	
2.1.1.2.2.	со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней		0,05	
2.1.2.	нестабильные средства физических лиц, итого, в том числе		0,10	
2.1.2.1.	денежные средства, превышающие максимальный размер возмещения по вкладам при наступлении страхового случая, установленный Федеральным законом от 23.12.2003 № 177-ФЗ «О страховании вкладов физических лиц в банках Российской Федерации» ¹ , итого, в том числе		0,10	
2.1.2.1.1.	со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней		0,10	
2.1.2.1.2.	со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней		0,10	
2.1.2.2.	прочие денежные средства физических лиц, которые не могут быть отнесены к стабильным, в том числе средства на банковских счетах, открытых дистанционным способом, квалифицированных инвесторов, по		0,10	

	брокерским операциям, связанных с банком лиц и депозитах клиентов, имеющих в банке счета по брокерским операциям, итого, в том числе			
2.1.2.2.1.	со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней		0,10	
2.1.2.2.2.	со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней		0,10	
2.2.	Ожидаемый отток денежных средств клиентов, привлеченных без обеспечения, итого, в том числе		X	
2.2.1.	Депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса		0,10	
2.2.2.	Операционные депозиты, итого, в том числе		0,25	
2.2.2.1.	юридических лиц, за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса		0,25	
2.2.2.2	финансовых организаций		0,25	
2.2.2.3	субъектов малого бизнеса		0,25	
2.2.2.4.	Федерального Казначейства Российской Федерации и Банка России		0,25	
2.2.2.5.	субъектов Российской Федерации, муниципальных образований Российской Федерации, бюджетных и внебюджетных фондов Российской Федерации		0,25	
2.2.2.6.	правительств и центральных банков иностранных государств, организаций, которым в соответствии с законодательством стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, международных банков развития		0,25	
2.2.3.	Депозиты и прочие привлеченные средства юридических лиц (за исключением финансовых организаций) и государственных органов, итого, в том числе		0,40	
2.2.3.1.	юридических лиц, за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса		0,40	
2.2.3.2.	Федерального Казначейства Российской Федерации и Банка России		0,40	
2.2.3.3.	субъектов Российской Федерации, муниципальных образований Российской Федерации, бюджетных и внебюджетных фондов Российской Федерации		0,40	
2.2.3.4.	правительств иностранных государств, международных банков развития, организаций, которым в соответствии с		0,40	

	законодательством стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства			
2.2.3.5.	средства субъектов малого бизнеса, не включенных в расчет ожидаемого оттока денежных средств клиентов, привлеченных без обеспечения, в соответствии с абзацем восемь подпункта 3.3.5 пункта 3.3 Положения Банка России №		0,40	
2.2.4.	Депозиты и прочие привлеченные денежные средства связанных с банком юридических лиц		1,00	
2.2.5.	Прочие привлеченные денежные средства без обеспечения , итого, в том числе		1,00	
2.2.5.1.	средства выгодоприобретателей по операциям банка		1,00	
2.2.5.2.	средства специализированных финансовых обществ (компаний специального назначения)		1,00	
2.2.5.3.	средства, привлеченные по выпущенным долговым ценным бумагам (включая облигации и векселя)		1,00	
2.2.5.4	средства, привлеченные банком в результате предоставления услуг по брокерскому обслуживанию на финансовом рынке		1,00	
2.2.5.5	просроченная задолженность и просроченные проценты по кредитам, депозитам и прочим привлеченным средствам, прочие неисполненные в срок обязательства		1,00	
2.2.6.	Средства, подлежащие депонированию на счетах по учету обязательных резервов и (или) внесению на корреспондентский счет банка в Банке России		1,00	
2.3.	Ожидаемый отток денежных средств, привлеченных под обеспечение активами банка, а также по операциям займа ценных бумаг итого, в том числе		X	
2.3.1.	Обязательства банка, обеспеченным активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1, кроме операций с Банком России		0,00	
2.3.2.	Обязательства банка по операциям с Банком России вне зависимости от вида предоставленного обеспечения, итого, в том числе		0,00	
2.3.2.1.	денежные средства, привлеченные под обеспечение активами, удовлетворяющими		0,00	

	критериям, предъявляемым к ВЛА-1			
2.3.2.2.	денежные средства, привлеченные под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2		0,00	
2.3.2.3.	денежные средства, привлеченные под обеспечение прочими активами		0,00	
2.3.3.	Обязательства банка, обеспеченные активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А, кроме операций с Банком России		0,15	
2.3.4.	Обязательства банка, обеспеченные активами (кроме активов, удовлетворяющих критериям, предъявляемым к ВЛА-1 или ВЛА-2А), по операциям с Федеральным Казначейством Российской Федерации, международными финансовыми организациями и международными банками развития		0,25	
2.3.5.	Обязательства банка, обеспеченные жилищными облигациями с ипотечным покрытием), удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме операций с Банком России, Федеральным Казначейством Российской Федерации, международными финансовыми организациями и международными банками развития		0,25	
2.3.6.	Обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, за исключением жилищных облигаций с ипотечным покрытием, кроме операций с Банком России, Федеральным Казначейством Российской Федерации, международными финансовыми организациями и международными банками развития		0,50	
2.3.7.	Обязательства банка по операциям со связанными с банком юридическими лицами вне зависимости от вида предоставленного обеспечения		1,00	
2.3.8.	Прочие привлеченные средства под обеспечение активами, кроме операций с Банком России, Федеральным Казначейством Российской Федерации, международными финансовыми организациями и международными банками развития		1,00	
2.4.	Дополнительные ожидаемые оттоки денежных средств, итого, в том числе		X	

2.4.1.	Ожидаемые оттоки денежных средств по производным финансовым инструментам		1,00	
2.4.2.	Оценка дополнительной потребности в ликвидности по обязательствам банка, производным финансовым инструментам и прочим договорам (контрактам), связанной со снижением рейтинга долгосрочной кредитоспособности банка или другими отлагательными условиями		1,00	
2.4.3.	Оценка дополнительной потребности в ликвидности, связанной с потенциальным изменением стоимости предоставленного банком обеспечения		1,00	
2.4.4.	Ожидаемый отток денежных средств, обусловленный правом клиента на возврат части предоставленного банку обеспечения, входящего в единый пул обеспечения		1,00	
2.4.5.	Ожидаемый отток денежных средств по операциям, предусматривающим предоставление банком обеспечения, которое контрагент имеет право потребовать в соответствии с условиями договора		1,00	
2.4.6.	Ожидаемые оттоки денежных средств по операциям, условия которых предусматривают возможность замещения клиентами банка обеспечения на активы, не соответствующие критериям ВЛА-1, ВЛА-2А и ВЛА-2Б		1,00	
2.4.7.	Дополнительная потребность в ликвидности (ожидаемые оттоки денежных средств), связанная с изменением рыночной стоимости производных финансовых инструментов		1,00	
2.4.8.	Ожидаемый отток денежных средств, связанный с осуществлением платежей, установленных условиями выпуска ценных бумаг, обеспеченных поступлениями денежных средств по активам		1,00	
2.4.9.	Ожидаемый отток денежных средств по ценным бумагам, обеспеченным активами и выпущенным специализированными финансовыми обществами в интересах банка		1,00	
2.4.10.	Ожидаемый отток денежных средств по обязательствам банка по неиспользованным безотзывным и условно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности, итого, в том числе		X	

2.4.10.1.	кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные физическим лицам и субъектам малого бизнеса		0,05	
2.4.10.2.	кредитные линии, предоставленные юридическим лицам (за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса); правительствам и организациям, которым в соответствии с законодательством предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства; центральным банкам; международным финансовым организациям и международным банкам развития		0,10	
2.4.10.3.	линии ликвидности, предоставленные юридическим лицам (за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса); правительствам и организациями, которым в соответствии с законодательством предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства; центральным банкам; международным финансовым организациям и международным банкам развития		0,30	
2.4.10.4.	кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные кредитным организациям (в том числе банкам - нерезидентам)		0,40	
2.4.10.5.	кредитные линии, предоставленные финансовым организациям (кроме кредитных организаций)		0,40	
2.4.10.6.	линии ликвидности, предоставленные финансовым организациям (кроме кредитных организаций)		1,00	
2.4.10.7.	линии ликвидности и кредитные линии, предоставленные прочим клиентам		1,00	
2.4.11.	Ожидаемый отток денежных средств по безусловно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности		1,00	
2.4.12.	Ожидаемый отток денежных средств по обязательствам банка по предоставлению денежных средств на проведение сделок торгового финансирования		1,00	
2.4.13.	Ожидаемый отток денежных средств по предоставленным гарантиям, не относящимся к торговому финансированию		1,00	
2.4.14.	Прочие контрактные обязательства банка по предоставлению средств в ближайшие 30 календарных дней, итого, в том числе	X	X	

2.4.14.1.	обязательства по предоставлению денежных средств финансовым организациям		1,00	
2.4.14.2.	обязательства по предоставлению средств клиентам (кроме финансовых организаций), в том числе		X	X
2.4.14.2.1.	обязательства по предоставлению денежных средств физическим лицам		X	X
2.4.14.2.2.	обязательства по предоставлению денежных средств субъектам малого бизнеса		X	X
2.4.14.2.3.	обязательства по предоставлению денежных средств нефинансовым организациям		X	X
2.4.14.2.4.	обязательства по предоставлению денежных средств прочим клиентам		X	X
2.4.14.3.	величина превышения обязательств по предоставлению средств клиентам (кроме финансовых организаций) над величиной контрактных притоков денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций), не включенной в расчет ожидаемых притоков денежных средств		1,00	
2.4.14.4	Обязательства по предоставлению средств связанным с банком лицам		1,00	
2.4.15.	Оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, по предоставлению средств связанным с банком юридическим лицам		1,00	
2.4.16.	Оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, по предоставлению средств по договору о совместной деятельности или юридическим лицам, на деятельность которых банк прямо или косвенно оказывает существенное влияние, а также в уставном капитале которых банк имеет миноритарные (неконсолидированные) доли участия		1,00	
2.4.17.	Иные оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, в том числе, итого, в том числе		X	
2.4.17.1.	обязательства, проистекающие из потенциальных требований к банку по досрочному выкупу выпущенных долговых обязательств (включая облигации и векселя) или досрочному погашению (частичному погашению) обязательств, возникающих в рамках размещения долговых ценных бумаг в		1,00	

	интересах банка			
2.4.17.2.	обязательства по досрочному выкупу собственных долговых ценных бумаг сроком до погашения свыше 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ у финансовых организаций - профессиональных участников рынка ценных бумаг, являющихся связанными с банком лицами		1,00	
2.4.17.3.	обязательства по структурированным операциям		1,00	
2.4.17.4.	обязательства, связанные с деятельностью банка по управлению активами		1,00	
2.4.17.5.	обязательства по покрытию коротких позиций клиентов за счет обеспечения, предоставленного другими клиентами		1,00	
2.4.17.6.	прочие оценочные обязательства (оттоки)		1,00	
2.4.18.	Ожидаемые оттоки денежных средств в ближайшие 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, не включенные в другие категории оттоков денежных средств		1,00	
3.	Ожидаемый приток денежных средств, итого, в том числе		X	
3.1.	Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение активами, включая операции обратного репо, итого, в том числе		X	
3.1.1.	Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение активами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), в случае если полученные в обеспечение ценные бумаги не были реализованы, итого, в том числе		X	
3.1.1.1.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1		0,00	
3.1.1.2.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А		0,15	
3.1.1.3.	под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б		0,25	
3.1.1.4.	под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным		0,50	

	покрытием			
3.1.1.5.	требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение активами, не относящимися к ВЛА-1 и ВЛА-2		0,50	
3.1.1.6.	под обеспечение прочими ценными бумагами		1,00	
3.1.2.	Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение активами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо) в случае если полученные в обеспечение ценные бумаги были реализованы, итого, в том числе		X	
3.1.2.1.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1		0,00	
3.1.2.2.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А		0,00	
3.1.2.3.	под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б		0,00	
3.1.2.4.	под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием		0,00	
3.1.2.5	требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение активами, не относящимися к ВЛА-1 и ВЛА-2		0,00	
3.1.2.6.	под обеспечение прочими ценными бумагами		0,00	
3.2.	Ожидаемый приток денежных средств по неиспользованным кредитным линиям, неиспользованным лимитам по получению средств в виде «овердрафт» и под «лимит задолженности», линиям ликвидности и прочим условным требованиям		0,00	
3.3.	Контрактные притоки денежных средств по прочим операциям размещения средств в зависимости от вида контрагента, итого, в том числе		X	
3.3.1.	поступления от операций с финансовыми		X	

	организациями, итого, в том числе			
3.3.1.1.	по размещенным операционным депозитам		0,00	
3.3.1.2	от операций по предоставлению средств связанным с банком финансовым организациям		1,00	
3.3.1.3.	по прочим операциям		1,00	
3.3.2.	ожидаемый приток денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций), итого, в том числе		X	
3.3.2.1.	ожидаемый приток денежных средств от физических лиц		0,50	
3.3.2.2.	ожидаемый приток денежных средств от субъектов малого бизнеса		0,50	
3.3.2.3.	ожидаемый приток денежных средств от юридических лиц, за исключением субъектов малого бизнеса		0,50	
3.3.2.4.	ожидаемый приток денежных средств от Банка России		1,00	
3.3.2.5.	ожидаемый приток денежных средств по операциям с прочими клиентами, включая Министерство финансов Российской Федерации, субъекты Российской Федерации, муниципальные образования Российской Федерации, бюджетные и внебюджетные фонды Российской Федерации, правительства, международные банки развития, а также организации, которым в соответствии с законодательством стран, предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства		0,50	
3.3.2.6.	поступления денежных средств по операциям со связанными с банком лицами		0,50	
3.4.	Поступления денежных средств в течение срока, не превышающего 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, от ценных бумаг, не включенных в ВЛА-1 и ВЛА-2		1,00	
3.5.	Ожидаемый приток денежных средств по производным финансовым инструментам		1,00	
3.6.	Прочие ожидаемые притоки денежных средств (иные контрактные притоки денежных средств)		1,00	
4.	Ожидаемый приток денежных средств после применения ограничения на максимальную допустимую величину	X	X	
5.	Чистый ожидаемый отток денежных средств (ЧООДС)	X	X	
6.	ПКЛ	X	X	

Раздел 2. Дополнительная информация к расчету показателя краткосрочной ликвидности

			(тыс. руб.)
Номер строки	Наименование статьи	Величина денежных средств	
1	2	3	
1.	Величина ВЛА-1скорр		
2.	Величина ВЛА-2Аскорр		
3.	Величина ВЛА-2Бскорр		
4.	Оценочная величина денежных средств, которые могут быть привлечены от Банка России в рамках проведения операций рефинансирования, итого, в том числе:		
4.1.	средства, которые могут быть привлечены под обеспечение ценными бумагами, входящими в Ломбардный список		
4.2.	средства, которые могут быть привлечены по кредитам, обеспеченным активами (кроме ценных бумаг, включенных в Ломбардный список)		
4.3.	средства, которые могут быть привлечены по кредитам, обеспеченным золотом		
5.	Величина активов, соответствующих всем критериям высоколиквидных активов, но не включенных в расчет ПКЛ в связи с превышением величины активов, номинированных в соответствующей иностранной валюте, над величиной чистых ожидаемых оттоков денежных средств в той же иностранной валюте, в соответствии с пунктом 2.9 Положения Банка России № ____-П, итого, в том числе:		
5.1.	ВЛА-1, не включенные в расчет ПКЛ		
5.2.	ВЛА-2А, не включенные в расчет ПКЛ		
5.3.	ВЛА-2Б, не включенные в расчет ПКЛ		
6.	Величина вложений в активы, исключенные из расчета числителя ПКЛ, в связи с невыполнением условий, установленных пунктом 2.1 Положения Банка России № ____-П		

Раздел 3. Информация об ожидаемых притоках денежных средств по договорам (контрактам) и активам (требованиям) банка, отнесенным к II категории качества

					(тыс. руб.)
Номер строки	Наименование показателя	Величина требований (обязательств)	Коэффициент взвешивания	Взвешенная величина требований (обязательств)	
1	2	3	4	5	
1.	Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение, включая операции обратного репо, а также по операциям займа ценных		X		

	бумаг, итого, в том числе			
1.1.	Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение активами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без прекращения признания (операции обратного репо), не формирующим короткую позицию в соответствии с пунктом 4.4 Положения Банка России № ____-П, итого, в том числе		X	
1.1.1.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1		0,00	
1.1.2.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым кВЛА-2А		0,15	
1.1.3.	под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б		0,25	
1.1.4.	под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием		0,50	
1.1.5.	требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение		0,50	
1.1.6.	под обеспечение прочими активами		1,00	
1.2.	Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение активами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), формирующим короткую позицию в соответствии с пунктом 4.4 Положения Банка России № ____-П, итого, в том числе		X	
1.2.1.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1		0,00	
1.2.2.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А		0,00	
1.2.3.	под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям,		0,00	

	предъявляемым к ВЛА-2Б			
1.2.4.	под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием		0,00	
1.2.5.	под обеспечение прочими ценными бумагами		0,00	
1.2.6.	требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение активами, не относящиеся к ВЛА-1 и ВЛА-2		0,00	
2.	Ожидаемый приток денежных средств по неиспользованным кредитным линиям, неиспользованным лимитам по получению средств в виде «овердрафт» и под «лимит задолженности», линиям ликвидности и прочим условным требованиям		0,00	
3.	Контрактные притоки денежных средств по прочим операциям размещения средств в зависимости от вида контрагента, итого, в том числе		X	
3.1.	поступления от операций с финансовыми организациями, итого, в том числе		X	
3.1.1.	от операций размещения операционных депозитов		0,00	
3.1.2.	от прочих операций размещения средств		1,00	
3.2.	ожидаемый приток денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций), итого, в том числе		X	
3.2.1.	ожидаемый приток денежных средств от физических лиц		0,50	
3.2.2.	ожидаемый приток денежных средств от субъектов малого бизнеса		0,50	
3.2.3.	ожидаемый приток денежных средств от юридических лиц, за исключением субъектов малого бизнеса		0,50	
3.2.4.	ожидаемый приток денежных средств от Банка России		1,00	
3.2.5.	ожидаемый приток денежных средств по операциям с прочими клиентами, включая Министерство финансов Российской Федерации, субъекты Российской Федерации, муниципальные образования Российской Федерации, бюджетные и внебюджетные фонды Российской Федерации, правительства, международные банки развития, а также		0,50	

	организации, которым в соответствии с законодательством стран, предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства			
3.2.6.	поступления денежных средств по операциям со связанными с банком лицами		0,00	
4.	Поступления денежных средств в течение срока, не превышающего 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, от ценных бумаг, не включенных в ВЛА-1 и ВЛА-2		1,00	
5.	Ожидаемый приток денежных средств по производным финансовым инструментам		1,00	
6.	Прочие ожидаемые притоки денежных средств (иные контрактные притоки денежных средств)		1,00	
7.	Совокупный ожидаемый приток денежных средств		X	

Должностное лицо, уполномоченное
подписывать Отчет (Ф.И.О.)

М.П.

Исполнитель (Ф.И.О.)

Телефон:

"__" _____ г.

Порядок
составления и представления отчетности по форме 0409____
«Расчет показателя краткосрочной ликвидности («Базель III»)»

1. Отчетность по форме 0409____ «Расчет показателя краткосрочной ликвидности («Базель III»)» (далее – Отчет) составляется в соответствии с Положением Банка России от __ _____ 2014 года № __-П «О порядке расчета показателя краткосрочной ликвидности («Базель III»)», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации __ _____ 2014 года № _____ («Вестник Банка России» от __ _____ 2014 года №____) (далее – Положение Банка России № ____-П) и заполняется с учетом приведенных ниже таблиц.

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

Номер строки	Наименование показателя	Пункт (подпункт) Положения Банка России № ___-П или иной порядок, в соответствии с которым производится заполнение строки
1.	Высоколиквидные активы, скорректированные с учетом ограничений на структуру высоколиквидных активов (ВЛА-ВК), итого, в том числе	Сумма строк 1.1 и 1.7
1.1.	ВЛА-1, итого, в том числе	Сумма строк с 1.1.1 по 1.1.8
1.1.1.	Наличная валюта и чеки (в т.ч. дорожные чеки)	2.5.1
1.1.2.	Средства на счетах кредитных организаций (филиалов) по кассовому обслуживанию структурных подразделений, а также средства для кассового обслуживания кредитных организаций (филиалов), которое осуществляется не по месту открытия корреспондентского счета (субсчета)	2.5.1
1.1.3.	Средства в Банке России и в уполномоченных органах других стран, в том числе суммы, депонированные в учреждениях Банка России для получения следующим днем наличных денежных средств, средства на корреспондентском и депозитных счетах в Банке России до востребования и с оставшимся сроком до погашения один день, суммы переплаты, подлежащие возврату банку со счетов по учету обязательных резервов в Банке России и в уполномоченных органах других стран	2.5.2
1.1.4.	Долговые ценные бумаги, выпущенные или полностью обеспеченные гарантиями правительств, центральных банков стран, имеющих страновую оценку «0» или «1», а также стран с высоким уровнем доходов, являющиеся членами ОЭСР и (или) Еврозоны, международных финансовых организаций и международных банков развития	2.5.3
1.1.5.	Долговые ценные бумаги, выпущенные или полностью обеспеченные гарантиями организаций, которым в соответствии с законодательством стран, имеющих страновую оценку «0» или «1», а также стран с высоким уровнем доходов, являющимися членами ОЭСР и (или) Еврозоны, предоставлено право осуществлять заимствования от имени	2.5.3

	государства	
1.1.6.	Долговые ценные бумаги, номинированные в рублях, выпущенные Правительством Российской Федерации или Банком России	2.5.3
1.1.7.	Долговые ценные бумаги, номинированные в иностранной валюте, выпущенные Правительством Российской Федерации или Банком России	2.5.3
1.1.8	Долговые ценные бумаги, выпущенные правительствами, центральными банками стран, не имеющих страновую оценку «0» или «1», а также не являющихся странами с высоким уровнем доходов, являющимися членами ОЭСР и (или) Еврзоны, выпущенные в валюте страны-эмитента	2.5.3
1.2.	ВЛА-2А, итого, в том числе	Сумма строк с 1.2.1 по 1.2.4
1.2.1.	Долговые ценные бумаги, выпущенные или полностью обеспеченные гарантиями правительств, центральных банков стран, имеющих страновую оценку «2», и международных банков развития	2.6
1.2.2.	Долговые ценные бумаги, выпущенные или полностью обеспеченные гарантиями организаций, которым в соответствии с законодательством стран, имеющих страновую оценку «2», предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства	2.6
1.2.3.	Долговые ценные бумаги, выпущенные нефинансовыми организациями, имеющими рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной шкале, присвоенный рейтинговыми агентствами на уровне не ниже «АА-» по классификации рейтинговых агентств «Standard & Poor's» или «Fitch Ratings» либо «Аа3» по классификации рейтингового агентства «Moody's Investors Service»	2.6
1.2.4.	Облигации с ипотечным покрытием, выпущенные банками	2.6
1.3.	ВЛА-2Б, итого, в том числе	Сумма строк 1.3.1, 1.3.2, 1.3.3
1.3.1.	Жилищные облигации с ипотечным покрытием, выпущенные юридическими лицами – нерезидентами	2.7.1
1.3.2.	Долговые ценные бумаги (кроме ипотечных ценных бумаг), выпущенные нефинансовыми организациями, имеющими рейтинг долгосрочной кредитоспособности по международной шкале, присвоенный	2.7.2

	рейтинговыми агентствами на уровне от «А+» до «BBB-» по классификации рейтинговых агентств «Standard & Poor's» или «Fitch Ratings» либо «А1» до «Вaa3» по классификации рейтингового агентства «Moody's Investors Service»	
1.3.3.	Обыкновенные акции, включенные организатором торговли (фондовой биржей) в списки для расчета Индекса ММВБ 50 и Индекса РТС 50, а также индексов акций, указанных в приложении 7 к Инструкции Банка России от 13 декабря 2012 года № 139-И «Об обязательных нормативах банков» ²	2.7.3
1.4.	ВК 15	2.12
1.5.	Итого ВЛА-2Б после корректировки	Строка 1.3 минус строка 1.4
1.6.	ВК 40	2.12
1.7.	Итого ВЛА-2 после корректировки	Сумма строк 1.2 и 1.5 минус строка 1.6
2.	Ожидаемые оттоки денежных средств, итого, в том числе	Сумма строк с 2.1 по 2.4
2.1.	Ожидаемый отток денежных средств физических лиц, итого, в том числе	Сумма строк 2.1.1, 2.1.2
2.1.1.	стабильные средства физических лиц, итого, в том числе	Сумма строк 2.1.1.1, 2.1.1.2
2.1.1.1.	на банковских счетах, на которые осуществляется перечисление заработной платы или иных выплат, связанных с выполнением трудовых обязанностей, итого, в том числе	Сумма строк 2.1.1.1.1, 2.1.1.1.2
2.1.1.1.1.	со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней	3.2.3
2.1.1.1.2.	со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней	3.2.3
2.1.1.2.	на счетах физических лиц, имеющих установленные взаимоотношения с банком, итого, в том числе	Сумма строк 2.1.1.2.1, 2.1.1.2.2
2.1.1.2.1.	со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней	3.2.3
2.1.1.2.2.	со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней	3.2.3
2.1.2.	нестабильные средства физических лиц, итого, в том числе	Сумма строк 2.1.2.1, 2.1.2.2
2.1.2.1.	денежные средства, превышающие максимальный размер возмещения по вкладам при наступлении страхового случая, установленный Федеральным законом 177-ФЗ, итого, в том числе	Сумма строк 2.1.2.1.1, 2.1.2.1.2
2.1.2.1.1.	со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней	3.2.4

2.1.2.1.2.	со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней	3.2.4
2.1.2.2.	прочие денежные средства физических лиц, которые не могут быть отнесены к стабильным, в том числе средства на банковских счетах, открытых дистанционным способом, квалифицированных инвесторов, по брокерским операциям, связанных с банком лиц и депозитах клиентов, имеющих в банке счета по брокерским операциям, итого, в том числе	Сумма строк 2.1.2.2.1, 2.1.2.2.2
2.1.2.2.1.	со сроком исполнения обязательств в ближайшие 30 календарных дней	3.2.4
2.1.2.2.2.	со сроком исполнения обязательств, превышающим 30 календарных дней	3.2.4
2.2.	Ожидаемый отток денежных средств клиентов, привлеченных без обеспечения, итого, в том числе	Сумма строк с 2.2.1 по 2.2.6
2.2.1.	Депозиты и прочие привлеченные средства субъектов малого бизнеса	3.3.5
2.2.2.	Операционные депозиты, итого, в том числе	Сумма строк с 2.2.2.1 по 2.2.2.6
2.2.2.1.	юридических лиц, за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса	3.3.6 - 3.3.9
2.2.2.2.	финансовых организаций	3.3.6 - 3.3.9
2.2.2.3.	субъектов малого бизнеса	3.3.6 - 3.3.9
2.2.2.4.	Федерального Казначейства Российской Федерации и Банка России	3.3.6 - 3.3.9
2.2.2.5.	субъектов Российской Федерации, муниципальных образований Российской Федерации, бюджетных и внебюджетных фондов Российской Федерации	3.3.6 - 3.3.9
2.2.2.6.	правительств и центральных банков иностранных государств, организаций, которым в соответствии с законодательством стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства, международных банков развития	3.3.6 - 3.3.9
2.2.3.	Депозиты и прочие привлеченные средства юридических лиц (за исключением финансовых организаций) и государственных органов, итого, в том числе	Сумма строк с 2.2.3.1 по 2.2.3.5
2.2.3.1.	юридических лиц, за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса	3.3.11
2.2.3.2.	Федерального Казначейства Российской Федерации и Банка России	3.3.11
2.2.3.3.	субъектов Российской Федерации, муниципальных образований Российской Федерации, бюджетных и внебюджетных фондов Российской Федерации	3.3.11

2.2.3.4.	правительств иностранных государств, международных банков развития, организаций, которым в соответствии с законодательством стран предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства	3.3.11
2.2.3.5.	средства субъектов малого бизнеса, не включенных в расчет ожидаемого оттока денежных средств клиентов, привлеченных без обеспечения, в соответствии с абзацем восьмью подпункта 3.3.5 пункта 3.3 Положения Банка России № _____	3.3.11, абзац восьмой пункта 3.3.5
2.2.4.	Депозиты и прочие привлеченные денежные средства связанных с банком юридических лиц	3.3.12
2.2.5.	Прочие привлеченные денежные средства без обеспечения , итого, в том числе	Сумма строк с 2.2.5.1 по 2.2.5.5
2.2.5.1.	средства выгодоприобретателей по операциям банка	3.3.13
2.2.5.2.	средства специализированных финансовых обществ	3.3.13
2.2.5.3.	средства, привлеченные по выпущенным долговым ценным бумагам (включая облигации и векселя)	3.3.13
2.2.5.4.	средства, привлеченные банком в результате предоставления услуг по брокерскому обслуживанию на финансовом рынке	3.3.13
2.2.5.5.	просроченная задолженность и просроченные проценты по кредитам, депозитам и прочим привлеченным средствам, прочие неисполненные в срок обязательства	3.3.13
2.2.6.	Средства, подлежащие депонированию на счетах по учету обязательных резервов и (или) внесению на корреспондентский счет банка в Банке России	3.3.14
2.3.	Ожидаемый отток денежных средств, привлеченных под обеспечение активами банка, а также по операциям займа ценных бумаг итого, в том числе	Сумма строк с 2.3.1 по 2.3.8
2.3.1.	Обязательства банка по операциям, обеспеченным активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1, кроме операций с Банком России	3.4.5 (строка 1 Таблицы)
2.3.2.	Обязательства банка по операциям с Банком России вне зависимости от вида предоставленного обеспечения, итого, в том числе	Сумма строк 2.3.2.1, 2.3.2.2, 2.3.2.3
2.3.2.1.	денежные средства, привлеченные под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1	3.4.5 (строка 2 Таблицы)
2.3.2.2.	денежные средства, привлеченные под	3.4.5 (строка 2 Таблицы)

	обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2	
2.3.2.3.	денежные средства, привлеченные под обеспечение прочими активами	3.4.5 (строка 2 Таблицы)
2.3.3.	Обязательства банка, обеспеченные активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А, кроме операций с Банком России	3.4.5 (строка 3 Таблицы)
2.3.4.	Обязательства банка, обеспеченные активами (кроме активов, удовлетворяющих критериям, предъявляемым к ВЛА-1 или ВЛА-2А), по операциям с Федеральным Казначейством Российской Федерации, международными финансовыми организациями и международными банками развития	3.4.5 (строка 4 Таблицы)
2.3.5.	Обязательства банка, обеспеченные жилищными облигациями с ипотечным покрытием), удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме операций с Банком России, Федеральным Казначейством Российской Федерации, международными финансовыми организациями и международными банками развития	3.4.5 (строка 5 Таблицы)
2.3.6.	Обязательства банка, обеспеченные ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, за исключением жилищных облигаций с ипотечным покрытием, кроме операций с Банком России, Федеральным Казначейством Российской Федерации, международными финансовыми организациями и международными банками развития	3.4.5 (строка 6 Таблицы)
2.3.7.	Обязательства банка по операциям со связанными с банком юридическими лицами вне зависимости от вида предоставленного обеспечения	3.4.5 (строка 7 Таблицы)
2.3.8.	Прочие привлеченные средства под обеспечение активами, кроме операций с Банком России, Федеральным Казначейством Российской Федерации, международными финансовыми организациями и международными банками развития	3.4.5 (строка 8 Таблицы)
2.4.	Дополнительные ожидаемые оттоки денежных средств, итого, в том числе	Сумма строк с 2.4.1 по 2.4.18
2.4.1.	Ожидаемый отток денежных средств по производным финансовым инструментам	3.5.1 - 3.5.3
2.4.2.	Оценка дополнительной потребности в ликвидности по обязательствам банка, производным финансовым инструментам и прочим договорам (контрактами), связанной со	3.5.4

	снижением рейтинга долгосрочной кредитоспособности банка или другими отлагательными условиями	
2.4.3.	Оценка дополнительной потребности в ликвидности, связанной с потенциальным изменением стоимости предоставленного банком обеспечения	3.5.5
2.4.4.	Ожидаемый отток денежных средств, обусловленный правом клиента на возврат части предоставленного банку обеспечения, входящего в единый пул обеспечения	3.5.6
2.4.5.	Ожидаемый отток денежных средств по операциям, предусматривающим предоставление банком обеспечения, которое контрагент имеет право потребовать в соответствии с условиями договора	3.5.7
2.4.6.	Ожидаемые отток денежных средств по операциям, условия которых предусматривают возможность замещения клиентами банка обеспечения на активы, не соответствующие критериям ВЛА-1, ВЛА-2А и ВЛА-2Б	3.5.8
2.4.7.	Дополнительная потребность в ликвидности (ожидаемый отток денежных средств), связанная с изменением рыночной стоимости производных финансовых инструментов	3.5.9
2.4.8.	Ожидаемый отток денежных средств, связанный с осуществлением платежей, установленных условиями выпуска ценных бумаг, обеспеченных поступлениями денежных средств по активам	3.5.10
2.4.9.	Ожидаемый отток денежных средств по ценным бумагам, обеспеченным активами и выпущенным специализированными финансовыми обществами в интересах банка	3.5.11
2.4.10.	Ожидаемый отток денежных средств по обязательствам банка по неиспользованным безотзывным и условно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности, итого, в том числе	Сумма строк с 2.4.10.1 по 2.4.10.7
2.4.10.1.	кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные физическим лицам и субъектам малого бизнеса	3.5.15 (строка 1 Таблицы)
2.4.10.2.	кредитные линии, предоставленные юридическим лицам (за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса); правительствам и организациям, которым в соответствии с законодательством предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства; центральным банкам;	3.5.15 (строка 2 Таблицы)

	международным финансовым организациям и международным банкам развития	
2.4.10.3.	линии ликвидности, предоставленные юридическим лицам (за исключением финансовых организаций и субъектов малого бизнеса); правительствам и организациями, которым в соответствии с законодательством предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства; центральным банкам; международным финансовым организациям и международным банкам развития	3.5.15 (строка 3 Таблицы)
2.4.10.4.	кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные кредитным организациям (в том числе банкам - нерезидентам)	3.5.15 (строка 4 Таблицы)
2.4.10.5.	кредитные линии, предоставленные финансовым организациям (кроме кредитных организаций)	3.5.15 (строка 5 Таблицы)
2.4.10.6.	линии ликвидности, предоставленные финансовым организациям (кроме кредитных организаций)	3.5.15 (строка 6 Таблицы)
2.4.10.7.	линии ликвидности и кредитные линии, предоставленные прочим клиентам	3.5.15 (строка 7 Таблицы)
2.4.11.	Ожидаемый отток денежных средств по безусловно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности	3.5.16
2.4.12.	Ожидаемый отток денежных средств по обязательствам банка по предоставлению денежных средств на проведение сделок торгового финансирования	3.5.17
2.4.13.	Ожидаемый отток денежных средств по предоставленным гарантиям, не относящимся к торговому финансированию	3.5.18
2.4.14.	Прочие контрактные обязательства банка по предоставлению средств в ближайшие 30 календарных дней, итого, в том числе	Сумма строк 2.4.14.1, 2.4.14.3, 2.4.14.4
2.4.14.1.	обязательства по предоставлению денежных средств финансовым организациям	3.5.19
2.4.14.2.	обязательства по предоставлению средств клиентам (кроме финансовых организаций), в том числе	Сумма строк с 2.4.14.2.1 по 2.4.14.2.4
2.4.14.2.1.	обязательства по предоставлению денежных средств физическим лицам	3.5.19
2.4.14.2.2.	обязательства по предоставлению денежных средств субъектам малого бизнеса	3.5.19
2.4.14.2.3.	обязательства по предоставлению денежных средств нефинансовым организациям	3.5.19
2.4.14.2.4.	обязательства по предоставлению денежных средств прочим клиентам	3.5.19
2.4.14.3.	величина превышения обязательств по	МАКС(0;Строка 2.4.14.2

	предоставлению средств клиентам (кроме финансовых организаций) над величиной контрактных притоков денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций), не включенной в расчет ожидаемых притоков денежных средств	минус разница данных графы 3 и графы 5 строки 3.3.2.)
2.4.14.4	Обязательства по предоставлению средств связанным с банком лицам	3.5.19
2.4.15.	Оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, по предоставлению средств связанным с банком юридическим лицам	3.5.20
2.4.16.	Оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, по предоставлению средств по договору о совместной деятельности или юридическим лицам, на деятельность которых банк прямо или косвенно оказывает существенное влияние, а также в уставном капитале которых банк имеет миноритарные (неконсолидированные) доли участия	3.5.21
2.4.17.	Иные оценочные обязательства банка, не установленные условиями договора, в том числе, итого, в том числе	Сумма строк с 2.4.17.1 по 2.4.17.6
2.4.17.1.	обязательства, проистекающие из потенциальных требований к банку по досрочному выкупу выпущенных долговых обязательств (включая облигации и векселя) или досрочному погашению (частичному погашению) обязательств, возникающих в рамках размещения долговых ценных бумаг в интересах банка	3.5.22
2.4.17.2.	обязательства по досрочному выкупу собственных долговых ценных бумаг сроком до погашения свыше 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ у финансовых организаций - профессиональных участников рынка ценных бумаг, являющихся связанными с банком лицами	3.5.22
2.4.17.3.	обязательства по структурированным операциям	3.5.22
2.4.17.4.	обязательства, связанные с деятельностью банка по управлению активами	3.5.22
2.4.17.5.	обязательства по покрытию коротких позиций клиентов за счет обеспечения, предоставленного другими клиентами	3.5.22
2.4.17.6.	прочие оценочные обязательства	3.5.22
2.4.18.	Ожидаемый отток денежных средств в ближайшие 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, не включенные в другие	3.5.24

	категории оттоков денежных средств	
3.	Ожидаемые притоки денежных средств, итого, в том числе	Сумма строк с 3.1 по 3.6
3.1.	Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение активами, включая операции обратного репо, итого, в том числе	Сумма строк 3.1.1, 3.1.2
3.1.1.	Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение активами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), в случае если полученные в обеспечение ценные бумаги не были реализованы, итого, в том числе	Сумма строк с 3.1.1.1 по 3.1.1.6
3.1.1.1.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1	4.4 (строка 1 Таблицы)
3.1.1.2.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А	4.4 (строка 2 Таблицы)
3.1.1.3.	под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б	4.4 (строка 3 Таблицы)
3.1.1.4.	под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием	4.4 (строка 4 Таблицы)
3.1.1.5.	требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение активами, не относящимися к ВЛА-1 и ВЛА-2	абзац третий пункта 4.4
3.1.1.6.	под обеспечение прочими ценными бумагами	4.4 (строка 5 Таблицы)
3.1.2.	Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение активами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), в случае если полученные в обеспечение ценные бумаги были реализованы, итого, в том числе	Сумма строк с 3.1.2.1 по 3.1.2.6
3.1.2.1.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1	абзац четвертый пункта 4.4
3.1.2.2.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А	абзац четвертый пункта 4.4
3.1.2.3.	под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б	абзац четвертый пункта 4.4
3.1.2.4.	под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям,	абзац четвертый пункта 4.4

	предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием	
3.1.2.5.	требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение активами, не относящихся к ВЛА-1 и ВЛА-2	абзац четвертый пункта 4.4
3.1.2.6.	под обеспечение прочими ценными бумагами	абзац четвертый пункта 4.4
3.2.	Ожидаемый приток денежных средств по неиспользованным кредитным линиям, неиспользованным лимитам по получению средств в виде «овердрафт» и под «лимит задолженности», линиям ликвидности и прочим условным требованиям	4.5
3.3.	Контрактные притоки денежных средств по прочим операциям размещения средств в зависимости от вида контрагента, итого, в том числе	Сумма строк 3.3.1, 3.3.2, 3.3.3
3.3.1.	поступления от операций с финансовыми организациями, итого, в том числе	Сумма строк 3.3.1.1, 3.3.1.2
3.3.1.1.	от операций размещения операционных депозитов	4.6.2
3.3.1.2	от операций по предоставлению средств связанным с банком финансовым организациям	4.6.2
3.3.1.3.	от прочих операций размещения денежных средств	4.6.2
3.3.2.	ожидаемый приток денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций), итого, в том числе	Сумма строк с 3.3.2.1 по 3.3.2.6
3.3.2.1.	ожидаемый приток денежных средств от физических лиц	4.6.1
3.3.2.2.	ожидаемый приток денежных средств от субъектов малого бизнеса	4.6.1
3.3.2.3.	ожидаемый приток денежных средств от юридических лиц, за исключением субъектов малого бизнеса	4.6.2
3.3.2.4.	ожидаемый приток денежных средств от Банка России	4.6.2
3.3.2.5.	ожидаемый приток денежных средств по операциям с Министерством финансов Российской Федерации, субъекты Российской Федерации, муниципальные образования Российской Федерации, бюджетные и внебюджетные фонды Российской Федерации, правительства, международные банки развития, а также организации, которым в соответствии с законодательством стран, предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства	4.6.2
3.3.2.6.	ожидаемый приток денежных средств по	4.6.3

	операциям со связанными с банком лицами	
3.4.	Поступления денежных средств в течение срока, не превышающего 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, от ценных бумаг, не включенных в ВЛА-1 и ВЛА-2	4.7
3.5.	Ожидаемый приток денежных средств по производным финансовым инструментам	4.8
3.6.	Прочие ожидаемые притоки денежных средств (иные контрактные притоки денежных средств)	4.9
4.	Ожидаемый приток денежных средств после применения ограничения на максимальную допустимую величину	1.3
5.	Чистый ожидаемый отток денежных средств (ЧООДС)	Строка 2 минус строка 4
6.	ПКЛ	Отношение строки 1 и строки 5

Раздел 2. Дополнительная информация к расчету ПКЛ

Номер строки	Наименование статьи	Пункт (подпункт) Положения Банка России № ___-П или иной порядок, в соответствии с которым производится заполнение строки
1	Величина ВЛА-1скорр	2.11
2	Величина ВЛА-2Аскорр	2.11
3	Величина скорректированных высоколиквидных активов уровня 2Б (ВЛА-2Бскорр)	2.11
4	Оценочная величина денежных средств, которые могут быть привлечены от Банка России в рамках проведения операций рефинансирования, итого, в том числе:	Сумма строк 4.1, 4.2, 4.3
4.1	средства, которые могут быть привлечены под обеспечение ценными бумагами, входящими в Ломбардный список	5.1.1
4.2	средства, которые могут быть привлечены по кредитам, обеспеченным активами (кроме ценных бумаг, включенных в Ломбардный список)	5.1.1
4.3	средства, которые могут быть привлечены по кредитам, обеспеченным золотом	5.1.1

5	Величина активов, соответствующих всем критериям высоколиквидных активов, но не включенных в расчет ПКЛ в связи с превышением величины активов, номинированных в соответствующей иностранной валюте, над величиной чистого ожидаемого оттока денежных средств в той же иностранной валюте, в соответствии с пунктом 2.9 Положения Банка России № ____-П, итого, в том числе:	Сумма строк 5.1, 5.2, 5.3
5.1	ВЛА-1, не включенные в расчет ПКЛ	5.1.2
5.2	ВЛА-2А, не включенные в расчет ПКЛ	5.1.2
5.3	ВЛА-2Б, не включенные в расчет ПКЛ	5.1.2
6	Величина вложений в активы, исключенные из расчета числителя ПКЛ, в связи с невыполнением условий, установленных пунктом 2.1 Положения Банка России № ____-П	5.1.3

Раздел 3. Информация об ожидаемых притоках денежных средств по договорам (контрактам) и активам (требованиям) банка, отнесенным к II категории качества

Номер строки	Наименование статьи	Пункт (подпункт) Положения Банка России № ____-П или иной порядок, в соответствии с которым производится заполнение строки
1.	Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение активами, включая операции обратного репо, а также по операциям займа ценных бумаг, итого, в том числе	Сумма строк 1.1, 1.2
1.1.	Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение активами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), не формирующим короткую позицию в соответствии с пунктом 4.4 Положения Банка России № ____-П, итого, в том числе	Сумма строк с 1.1.1 по 1.1.6
1.1.1.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1	5.1.4, 4.4 (строка 1 Таблицы), с учетом абзаца четвертого п.4.4
1.1.2.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А	5.1.4, 4.4 (строка 2 Таблицы), с учетом абзаца четвертого п.4.4
1.1.3.	под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б	5.1.4, 4.4 (строка 3 Таблицы), с учетом абзаца четвертого п.4.4
1.1.4.	под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием	5.1.4, 4.4 (строка 4 Таблицы), с учетом абзаца четвертого пункта

		4.4
1.1.5.	требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение активами	5.1.4, 4.4, с учетом абзаца четвертого пункта 4.4
1.1.6.	под обеспечение прочими ценными бумагами	5.1.4, 4.4 (строка 5 Таблицы), с учетом абзаца четвертого пункта 4.4
1.2.	Ожидаемый приток денежных средств по операциям предоставления средств под обеспечение активами, включая сделки, совершаемые на возвратной основе с ценными бумагами, полученными без первоначального признания (операции обратного репо), формирующим короткую позицию в соответствии с пунктом 4.4 Положения Банка России № _____-П, итого, в том числе	Сумма строк с 1.2.1 по 1.2.6
1.2.1.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-1	5.1.4, 4.4
1.2.2.	под обеспечение активами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2А	5.1.4, 4.4
1.2.3.	под обеспечение жилищными облигациями с ипотечным покрытием, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б	5.1.4, 4.4
1.2.4.	под обеспечение ценными бумагами, удовлетворяющими критериям, предъявляемым к ВЛА-2Б, кроме жилищных облигаций с ипотечным покрытием	5.1.4, 4.4
1.2.5.	под обеспечение прочими ценными бумагами	5.1.4, 4.4
1.2.6.	требования по операциям предоставления клиентам в заем денежных средств для совершения сделок купли-продажи ценных бумаг под обеспечение активами, не относящееся к ВЛА-1 и ВЛА-2	5.1.4, 4.4
2.	Ожидаемый приток денежных средств по неиспользованным кредитным линиям, неиспользованным лимитам по получению средств в виде «овердрафт» и под «лимит задолженности», линиям ликвидности и прочим условным требованиям	5.1.4, 4.5
3.	Контрактные притоки денежных средств по прочим операциям размещения средств в зависимости от вида контрагента, итого, в том числе	Сумма строк 3.1, 3.2
3.1.	Поступления от операций с финансовыми организациями, итого, в том числе	Сумма строк 3.1.1, 3.1.2
3.1.1.	от операций размещения операционных депозитов	5.1.4, 4.6.2
3.1.2.	от прочих операций размещения денежных средств	5.1.4, 4.6.2
3.2.	ожидаемый приток денежных средств клиентов (кроме финансовых организаций), итого, в том числе	Сумма строк с 3.2.1 по 3.2.6
3.2.1.	ожидаемый приток денежных средств от физических лиц	5.1.4, 4.6.1
3.2.2.	ожидаемый приток денежных средств от субъектов малого бизнеса	5.1.4, 4.6.1
3.2.3.	ожидаемый приток денежных средств от юридических лиц, за исключением субъектов малого бизнеса	5.1.4, 4.6.2
3.2.4.	ожидаемый приток денежных средств от Банка России	5.1.4, 4.6.2

3.2.5.	ожидаемый приток денежных средств по операциям с Министерством финансов Российской Федерации, субъекты Российской Федерации, муниципальные образования Российской Федерации, бюджетные и внебюджетные фонды Российской Федерации, правительства, международные банки развития, а также организации, которым в соответствии с законодательством стран, предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства	5.1.4, 4.6.2
3.2.6.	поступления денежных средств по операциям со связанными с банком лицами	5.1.4, 4.6.3
4.	Поступления денежных средств в течение срока, не превышающего 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ, от ценных бумаг, не включенных в ВЛА-1 и ВЛА-2	5.1.4, 4.7
5.	Притоки денежных средств по производным финансовым инструментам	5.1.4, 4.8
6.	Прочие ожидаемые притоки денежных средств (иные контрактные притоки денежных средств)	5.1.4, 4.9
7.	Совокупный ожидаемый приток денежных средств	Сумма строк 1 - 6

2. Отчет формируется банком по операциям во всех национальных валютах, в рублях и каждой значимой иностранной валюте. Суммы в иностранной валюте в отчетности по форме 0409___ указываются в рублевом эквиваленте, определяемом по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России.

3. В Отчете отражаются активы, ожидаемые притоки и ожидаемые оттоки денежных средств в рублях по официальному курсу соответствующей иностранной валюты, установленному Банком России на дату расчета ПКЛ.

4. В строках 1.2.1 – 1.2.4 Раздела 1 Отчета отражаются высоколиквидные активы, включенные в высоколиквидные активы уровня 2А, с учетом ограничения, установленного пунктом 2.9 Положения Банка России № ___-П, до корректировки величины ВЛА-2 в соответствии с пунктом 2.10 Положения Банка России № ___-П.

5. В строках 1.3.1 – 1.3.3 Раздела 1 Отчета отражаются высоколиквидные активы, включенные в высоколиквидные активы уровня 2Б, с учетом ограничения, установленного пунктом 2.9 Положения Банка России № ___-П, до корректировки величины ВЛА-2 и ВЛА-2Б в соответствии с пунктом 2.10 Положения Банка России № ___-П.

6. В строке 2.4.14.3 Раздела 1 Отчета отражаются обязательства по предоставлению денежных средств клиентам (кроме финансовых организаций), рассчитанные в соответствии с пунктом 3.5.19 Положения Банка России № ___-П.

Пример заполнения строк 2.4.14.2 и 2.4.14.3. Величина обязательств по предоставлению денежных средств клиентам - нефинансовым организациям в течение ближайших 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ составляет 200 рублей (отражается в строке 2.4.14.2 Раздела 1 Отчета), величина контрактных притоков денежных средств – 100 рублей (отражаются в графе 3 строки 3.3.2 Раздела 1 Отчета). Величина притока денежных средств с учетом коэффициента 50 процентов составляет 50 рублей (отражается в графе 5 строки 3.3.2 Раздела 1 Отчета). Величина поступлений денежных средств, не включенная в расчет притоков денежных средств, составляет 50 рублей (100 рублей минус 50 рублей). Для определения величины оттока денежных средств рассчитывается разность между обязательствами в размере 200 рублей и 50 рублями, что составляет 150 рублей (отражаются в строке 2.4.14.3 Раздела 1 Отчета).

7. В Разделе 2 Отчета отражается дополнительная информация к расчету ПКЛ в соответствии с Главой 5 Положения Банка России № ____-П.

7.1. В строках 1 - 3 Раздела 2 Отчета отражаются величины скорректированных высоколиквидных активов первого уровня, уровней 2А и 2Б, рассчитанные с учетом сделок, в результате исполнения которых в течение ближайших 30 календарных дней с даты расчета ПКЛ происходит изменение величины высоколиквидных активов соответствующего уровня (ВЛА-1 скорр, ВЛА-2Аскорр, ВЛА-2Бскорр) в соответствии с пунктом 2.10 Положения Банка России № ____-П.

7.2. В строках 4.1 - 4.3 Раздела 2 Отчета отражаются оценочные величины денежных средств, которые могут быть привлечены от Банка России в рамках проведения операций рефинансирования в соответствующей валюте.

7.3. В строках 5.1 – 5.3 Раздела 2 Отчета отражаются величины активов, номинированных в долларах США, евро, японских йенах, английских фунтах стерлингов, швейцарских франках, и соответствующих всем критериям высоколиквидных активов, но не включенных в расчет ПКЛ в соответствии с пунктом 2.9 Положения Банка России № ____-П. Информация предоставляется в разрезе уровней высоколиквидных активов.

7.4. В строке 6 Раздела 2 Отчета отражается величина вложений в активы, не включенные в расчет числителя ПКЛ в соответствии с условиями пункта 2.1 Положения Банка России № ____-П.

7.5. В Разделе 3 Отчета отражаются притоки денежных средств по договорам (контрактам) и активам (требованиям) банка (включая процентные платежи), указанным в пункте 5.1.4 Главы 5 Положения Банка России № ____-П.

8. Отчет представляется в целом по кредитной организации (за исключением небанковских кредитных организаций) по состоянию на 1-е число месяца, следующего за отчетным периодом, в территориальные учреждения Банка России:

кредитными организациями (за исключением крупных кредитных организаций с широкой сетью подразделений) – не позднее 10-го рабочего дня месяца, следующего за отчетным;

крупными кредитными организациями с широкой сетью подразделений – не позднее 18-го рабочего дня месяца, следующего за отчетным.

¹ Федеральный закон от 23.12.2003 № 177-ФЗ «О страховании вкладов физических лиц в банках Российской Федерации» (Собрание законодательства Российской Федерации, 2003, № 52, ст. 5029; 2004, № 34, ст. 3521; 2005, № 1, ст. 23; № 43, ст. 4351; 2006, № 31, ст. 3449; 2007, № 12, ст. 1350; 2008, № 42, ст. 4699; № 52, ст. 6225; 2009, № 48, ст. 5731; 2011, № 1, ст. 49; № 27, ст. 3873; № 29, ст. 4262, 2013, № 19, ст. 2308).

² Инструкция Банка России от 13 декабря 2012 года № 139-И «Об обязательных нормативах банков», зарегистрированной Министерством юстиции Российской Федерации 13 декабря 2012 года № 26104, 29 ноября 2013 года № 30498 («Вестник Банка России» от 21 декабря 2012 года № 74, от 30 ноября 2013 года № 69).