

ПОСТАНОВЛЕНИЕ
о внесении изменений в Инструкцию о порядке предоставления
банками отчетов COREP в целях надзора, утвержденную Постановлением
Исполнительного комитета Национального банка Молдовы № 117/2018

№ 75 от 26.03.2026
(в силу 01.10.2026)

Мониторул Официал ал Р. Молдова № 146-147 ст. 261 от 02.04.2026

* * *

На основании ст.84 Закона о деятельности банков № 202/2017 (Официальный монитор Республики Молдова, 2017, № 434-439, ст.727), с последующими изменениями, Исполнительный комитет Национального банка Молдовы

ПОСТАНОВЛЯЕТ:

Настоящее постановление частично перелагает часть (1) ст.5 и приложение I Регламента по применению (ЕС) 2024/3117 Комиссии от 29 ноября 2024 об установлении технических стандартов для применения Регламента (ЕС) № 575/2013 Европейского Парламента и Совета относительно отчетности в целях надзора учреждений и отмены Регламента по применению (ЕС) № 2021/451 Комиссии, CELEX: 32024R3117, опубликованного в Официальном журнале Европейского Союза L от 27 декабря 2024.

1. В Инструкцию о предоставлении банками отчетов COREP в целях надзора, утвержденную Постановлением Исполнительного комитета Национального банка Молдовы № 117/2018 (Официальный монитор Республики Молдова, 2018, № 183-194, ст.907), зарегистрированным в Министерстве юстиции Республики Молдовы под № 1337/2018, с последующими изменениями, внести следующие изменения:

1.1. Формулу гармонизации дополнить текстом ", формуляры С 34.01 – С34.04, С 34.06 и С 34.08 – С 34.10 приложения I Регламента по применению (ЕС) 2024/3117 Комиссии от 29 ноября 2024 об установлении технических стандартов для применения Регламента (ЕС) № 575/2013 Европейского Парламента и Совета относительно отчетности в целях надзора учреждений и отмены Регламента по применению (ЕС) № 2021/451 (CELEX: 32024R3117).";

1.2. Пункт 14 дополнить подпунктом 8) следующего содержания:

"8) отчет о требованиях к собственным средствам для покрытия кредитного риска контрагента, как указано в формулярах С 34.01 – С34.04, С34.06 и С 34.08 – С 34.10 (приложение 10^{1.1}), в соответствии с инструкциями по их заполнению – ежеквартально. Формуляр С 34.06 заполняется ежеквартально при применении стандартизированного подхода (SA-CCR) и раз в полгода при применении упрощенного стандартизированного подхода или метода первоначальной подверженности (ОЕМ);";

1.3. Дополнить приложением 10^{1.1} следующего содержания:

„Приложение 10¹⁻¹
к Инструкции о предоставлении банками
отчетов COREP в целях надзора

ИНСТРУКЦИИ ПО ЗАПОЛНЕНИЮ ФОРМУЛЯРОВ ОЦЕНКИ КРЕДИТНОГО РИСКА КОНТРАГЕНТА

1. Формуляры оценки кредитного риска контрагента должны включать информацию о рисках, связанных с кредитным риском контрагента, в соответствии с Регламентом о техниках снижения кредитного риска, используемых банками, утвержденным Постановлением Исполнительного комитета Национального банка Молдовы № 112/2018 (далее – Регламент о техниках снижения кредитного риска, используемых банками № 112/2018) и Регламентом об отношении к кредитному риску контрагента для банков, утвержденным Постановлением Исполнительного комитета Национального банка Молдовы № 220/2025 (далее – Регламент об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025).

2. Формуляры исключают требования к собственным средствам для риска корректировки кредитной оценки для банков (далее – CVA) в соответствии с положениями, касающимися положений о собственных средствах банков и требованиях к капиталу, а также требования, связанные с трактовкой риска корректировки кредитной оценки для банков, которые отражаются в форме риска CVA.

3. Подверженности, связанные с кредитным риском контрагента перед центральными контрагентами, как это предусмотрено Регламентом о техниках снижения кредитного риска, используемых банками № 112/2018, и в Главе VIII "Требования к собственным средствам для подверженностей перед центральным контрагентом" Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, включаются в данные о кредитном риске контрагента, если не указано иное. Однако взносы в гарантийный фонд, рассчитанные в соответствии с пунктами 149-155 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, не включаются в формуляры кредитного риска контрагента, за исключением формуляра С 34.10, в частности, соответствующих строк. Взвешенные по риску суммы подверженностей, связанные с взносами в гарантийный фонд, отражаются непосредственно в формуляре С 02.00, в строке 0460.

ОБЗОР ОТЧЕТНОСТИ ПО КРЕДИТНОМУ РИСКУ КОНТРАГЕНТА: ОБЪЕМ ОПЕРАЦИЙ С ПРОИЗВОДНЫМИ ФИНАНСОВЫМИ ИНСТРУМЕНТАМИ

4. В соответствии с пунктами 20-24, 34 и 35 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, банк рассчитывает величину подверженности по своим позициям по производным финансовым инструментам в соответствии с методом, изложенным в главе IV "Упрощенный стандартизированный подход к оценке кредитного риска контрагента" и главе V "Метод первоначальной подверженности" Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, при условии, что объем его балансовых и внебалансовых операций с производными инструментами, соответственно, меньше или равен установленным пороговым значениям. Соответствующая оценка проводится ежемесячно с использованием данных за последний день месяца. Данный формуляр содержит данные о соблюдении пороговых значений и важную информацию об объеме операций с производными финансовыми инструментами.

5. Месяц 1, месяц 2 и месяц 3 относятся к первому, второму и, соответственно, последнему месяцу квартала, за который осуществляется отчетность. Информация предоставляется только за конец месяцев, следующих за датой 1 октября 2026 года.

Формуляр отчета
С 34.01 КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА: ОБЪЕМ ОПЕРАЦИЙ С
ПРОИЗВОДНЫМИ ФИНАНСОВЫМИ ИНСТРУМЕНТАМИ (CCR 1)

		МЕСЯЦ 1			МЕСЯЦ 2			МЕСЯЦ 3			КАЧЕСТВЕННАЯ ИНФОРМАЦИЯ
		ДЛИННЫЕ ПОЗИЦИИ ПО ПРОИЗВОДНЫМ ФИНАНСОВЫМ ИНСТРУМЕНТАМ	КОРОТКИЕ ПОЗИЦИИ ПО ПРОИЗВОДНЫМ ФИНАНСОВЫМ ИНСТРУМЕНТАМ	ИТОГО	ДЛИННЫЕ ПОЗИЦИИ ПО ПРОИЗВОДНЫМ ФИНАНСОВЫМ ИНСТРУМЕНТАМ	КОРОТКИЕ ПОЗИЦИИ ПО ПРОИЗВОДНЫМ ФИНАНСОВЫМ ИНСТРУМЕНТАМ	ИТОГО	ДЛИННЫЕ ПОЗИЦИИ ПО ПРОИЗВОДНЫМ ФИНАНСОВЫМ ИНСТРУМЕНТАМ	КОРОТКИЕ ПОЗИЦИИ ПО ПРОИЗВОДНЫМ ФИНАНСОВЫМ ИНСТРУМЕНТАМ	ИТОГО	
		0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	
0010	Объем операций с производным и финансовыми инструментами										X
0020	Производные финансовые инструменты, отражаемые на балансе и вне баланса										X
0030	(-) Кредитные деривативы, которые признаются внутренними										X

	хеджирующие ми инструментам и против кредитного риска вне торгового портфеля										
00 40	Итого активы	X	X		X	X		X	X		X
00 50	Процент от общей суммы активов	X	X		X	X		X	X		X
Отступление от правил в соответствии с пунктом 24 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025											
00 60	Выполняются ли условия, изложенные в пункте 24 Регламента об отношении к кредитному рisku контрагента для банков № 220/2025 с, включая одобрение Национальног о банка Молдовы?	X	X	X	X	X	X	X	X	X	
00 70	Метод расчета значений	X	X	X	X	X	X	X	X	X	

	подверженнос тей на консолидиров анном уровне										
--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

Порядок заполнения отчета

С 34.01 – КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА: ОБЪЕМ ОПЕРАЦИЙ С ПРОИЗВОДНЫМИ ФИНАНСОВЫМИ ИНСТРУМЕНТАМИ (CCR 1)

Инструкции для конкретных позиций

Графы	
0010, 0040, 0070	ДЛИННЫЕ ПОЗИЦИИ ПО ПРОИЗВОДНЫМ ФИНАНСОВЫМ ИНСТРУМЕНТАМ Пункты 22 и 23 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Отражается сумма абсолютных рыночных значений длинных позиций по производным финансовым инструментам по состоянию на последний день месяца.
0020, 0050, 0080	КОРОТКИЕ ПОЗИЦИИ ПО ПРОИЗВОДНЫМ ФИНАНСОВЫМ ИНСТРУМЕНТАМ Пункты 22 и 23 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Отражается сумма абсолютных рыночных значений коротких позиций по производным финансовым инструментам по состоянию на последний день месяца.
0030, 0060, 0090	ИТОГО Подпункт 22.2. Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Сумма абсолютных значений длинных позиций по финансовым деривативам и абсолютных значений коротких позиций по финансовым деривативам.

Строки	
0010	Объём операций с производными финансовыми инструментами Пункты 22 и 23 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Включаются все балансовые и внебалансовые производные инструменты, за исключением кредитных производных инструментов, которые признаются в качестве внутреннего хеджирования от кредитного риска вне торгового портфеля.
0020	Производные финансовые инструменты, отражаемые на балансе и вне баланса Подпункты 22.1. и 22.2. Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. В отчете отражается общая рыночная стоимость балансовых и внебалансовых позиций по производным финансовым инструментам по состоянию на последний день месяца. Если рыночная стоимость позиции недоступна на эту дату, банки используют справедливую стоимость позиции на эту дату; если рыночная и справедливая стоимость позиции недоступны на эту

	дату, банки берут наиболее актуальную из рыночной и справедливой стоимости данной позиции.
0030	<p>(-) Кредитные деривативы, которые признаются внутренними хеджирующими инструментами против кредитного риска вне торгового портфеля</p> <p>Подпункт 22.3. Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Общая рыночная стоимость кредитных деривативов, признанных в качестве инструментами внутреннего хеджирования против кредитного риска вне торгового портфеля.</p>
0040	<p>Итого активы</p> <p>Общие активы в соответствии с Международными стандартами финансовой отчетности (МСФО).</p> <p>В случае консолидированной отчетности банк отчитывается об общей сумме активов с соблюдением пруденциального периметра консолидации в соответствии с положениями, касающимися надзора за банками на консолидированной основе.</p>
0050	<p>Процент от общей суммы активов</p> <p>Ставка рассчитывается путем деления объема операций с производными финансовыми инструментами (строка 0010) на общую сумму активов (строка 0040).</p> <p>Полученная ставка отображается с двумя знаками после запятой и без знака (%).</p>
<p>Отступление от правил в соответствии с пунктом 24 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025</p>	
0060	<p>Выполняются ли условия, изложенные в пункте 24 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025?</p> <p>Пункт 24 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Банки, превышающие пороговые значения для использования упрощенного подхода к оценке кредитного риска контрагента, но все еще использующие такой подход в соответствии с пунктом 24 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, должны указать (Да/Нет), соответствуют ли они всем условиям, изложенным в этой статье. Этот элемент должен быть указан только банками, применяющими исключение, предусмотренное пунктом 24 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>
0070	<p>Метод расчета значений подверженностей на консолидированном уровне</p> <p>Пункт 24 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Метод расчета значений подверженностей по производным финансовым инструментам на консолидированной основе,</p>

<p>используемый также на уровне отдельных субъектов в соответствии с пунктом 24 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025:</p> <ul style="list-style-type: none">- OEM: первоначальный метод расчета риска;- SA-CCR упрощенный: упрощенный стандартизированный подход к оценке кредитного риска контрагента. <p>Данный пункт подлежит отчетности только со стороны банков, применяющих исключение, предусмотренное пунктом 24 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>

ОБЗОР ОТЧЕТНОСТИ О КРЕДИТНОМ РИСКЕ КОНТРАГЕНТА:

Подверженности к кредитному риску контрагента в зависимости от подхода

6. Банки заполняют отдельный формуляр для всех подверженностей, связанных с кредитным риском контрагента, за исключением рисков, связанных с центральными контрагентами (ЦКА), как определено в формуляре С 34.10.

**Формуляр отчета
С 34.02 КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА: ПОДВЕРЖЕННОСТИ
К ССР В ЗАВИСИМОСТИ ОТ ПОДХОДА (ССР 2)**

Подверженности

	КОЛИЧЕСТВО КОНТРАГЕНТОВ	КОЛИЧЕСТВО СДЕЛОК	УСЛОВНЫЕ СУММЫ	ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНАЯ СТОИМОСТЬ (СМV) – ПОЛОЖИТЕЛЬНАЯ	ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНАЯ СТОИМОСТЬ (СМV) – ОТРИЦАТЕЛЬНАЯ	МАРЖА ИЗМЕНЕНИЯ (VM) – ПОЛУЧЕННАЯ	МАРЖА ИЗМЕНЕНИЯ (VM) – ПРЕДСТАВЛЕННАЯ	ЧИСТАЯ НЕЗАВИСИМАЯ СУММА ОБЕСПЕЧЕНИЯ (НИСА), ПОЛУЧЕННАЯ	ЧИСТАЯ НЕЗАВИСИМАЯ СУММА РЕАЛЬНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ (НИСА) – ПРЕДСТАВЛЕННАЯ	СТОИМОСТЬ ЗАМЕНИ (RC)	ПОТЕНЦИАЛЬНАЯ БУДУЩАЯ ПОДВЕРЖЕННОСТЬ (PFE)	ТЕКУЩАЯ ПОДВЕРЖЕННОСТЬ	ЕЕ РЕ	ALFA ИСПОЛЪЗУЕМАЯ ДЛЯ РАСЧЕТА РЕГУЛИРУЕМОГО СТОИМОСТЬ ПОДВЕРЖЕННОСТИ	СТОИМОСТЬ ПОДВЕРЖЕННОСТИ ДО ПРИМЕНЕНИЯ МЕТОДОВ CRM	СТОИМОСТЬ ПОСЛЕ ПРИМЕНЕНИЯ МЕТОДОВ CRM	СТОИМОСТЬ ПОДВЕРЖЕННОСТИ		СТОИМОСТЬ ПОДВЕРЖЕННОСТИ С УЧЕТОМ РИСКА		МИНИМАЛЬНЫЙ ПОРОГ, КАСАЮЩИЙСЯ ТРЕБОВАНИЙ К КАПИТАЛУ				
																	ПОЗИЦИИ, РАССМАТРИВАЕМЫЕ В СООТВЕТСТВИИ СО СТАНДАРТИЗИРОВАННЫМ ПОДХОДОМ CR	ПОЗИЦИИ, РАССМАТРИВАЕМЫЕ В СООТВЕТСТВИИ С ПОДХОДОМ CR IRB	ПОЗИЦИИ, РАССМАТРИВАЕМЫЕ В СООТВЕТСТВИИ СО СТАНДАРТИЗИРОВАННЫМ ПОДХОДОМ CR	ПОЗИЦИИ, РАССМАТРИВАЕМЫЕ В СООТВЕТСТВИИ С ПОДХОДОМ CR IRB	СУММА ПОДВЕРЖЕННОСТИ ДЛЯ РАСЧЕТА S-TREA	S-TREA	ЭЛЕМЕНТЫ МЕМОРАНДУМА: RWEA В ОТНОШЕНИИ ВЛИЯНИЯ ПРИМЕНЕНИЯ НОРМАТИВНЫХ ТРЕБОВАНИЙ К СОБСТВЕННЫМ СРЕДСТВАМ И ТРЕБОВАНИЯМ К КАПИТАЛУ БАНКОВ.		
	0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200	0210	0220	0230	0240	0250
0010	Метод первоначальной подверженности (для производных финансовых инструментов)	X				X	X	X	X			X	X	1.4	X	X		X			X	X			X

00 20	Упрощенный стандартизированный подход к оценке кредитного риска контрагента (SA-CCR, упрощенный для производных финансовых инструментов)	X											X	X	1.4	X	X			X			X	X		X
00 30	Стандартизированный подход к оценке кредитного риска контрагента (SA-CCR для производных финансовых инструментов)	X											X	X	1.4	X	X			X			X	X		X
00 40	ММІ (для производных финансовых инструментов и SFT)	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
00 50	Комплекты взаимозачета для операций финансирования финансовых инструментов	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X

0060	Комплекты взаимозачета для производных финансовых инструментов и сделок с долгосрочными расчетами	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
0070	Из договорных соглашений о компенсации между различными продуктами	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
0080	Простой метод финансового обеспечения (для SFT)	X					X	X	X	X	X	X	X	X	X			X			X	X			X		
0090	Расширенный метод финансового обеспечения (для SFT)	X					X	X	X	X	X	X	X	X	X			X			X	X			X		
0100	VAR для SFT	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X
0110	Итого						X	X	X	X	X	X	X	X	X			X			X						
0120	Из них: позиции, подверженные определенному риску неблагоприятной корреляции (SWWR)	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	

01 30	Маржинальн ые операции	X					X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X		X	X		X	X			
01 40	Операции без маржи	X					X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X		X	X		X	X			

Порядок заполнения отчета

**С 34.02 – КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА:
ПОДВЕРЖЕННОСТИ К ССР В ЗАВИСИМОСТИ ОТ ПОДХОДА
(ССР 2)**

Инструкции по конкретным позициям

Графы		
0010	КОЛИЧЕСТВО КОНТРАГЕНТОВ Количество отдельных контрагентов, в отношении которых банк имеет подверженности по кредитному риску контрагента.	
0020	КОЛИЧЕСТВО СДЕЛОК Количество сделок, подверженных кредитному риску контрагента на отчетную дату. Обратить внимание, что для сделок с СРС данные не должны включать притоки или оттоки средств, а должны отражать общие позиции в портфеле СРС на отчетную дату. Кроме того, производный инструмент или SFT, разделенная на две или более частей (как минимум) для целей моделирования, все равно должна рассматриваться как единая сделка.	
0030	УСЛОВНЫЕ СУММЫ Условная сумма по производным инструментам и SFT до взаимозачета и без каких-либо корректировок в соответствии с пунктами 72-74 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.	
0040	ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНАЯ СТОИМОСТЬ (СМV) – ПОЛОЖИТЕЛЬНАЯ Пункт 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Сумма текущих рыночных стоимостей (СМV) для всех наборов взаимозачета с положительной СМV, как определено в пункте 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.	
0050	ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНАЯ СТОИМОСТЬ (СМV) – ОТРИЦАТЕЛЬНАЯ Пункт 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Сумма абсолютных текущих рыночных значений (СМV) для всех наборов взаимозачета с отрицательным значением СМV, как определено в пункте 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.	

0060	<p>МАРЖА ИЗМЕНЕНИЯ (VM) – ПОЛУЧЕННАЯ</p> <p>Пункты 50-54 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Сумма величин маржи изменения (VM) всех контрактов с маржой, для которых получаются VM, рассчитанная в соответствии с пунктами 52-54 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>	
0070	<p>МАРЖА ИЗМЕНЕНИЯ (VM) – ПРЕДОСТАВЛЕННАЯ</p> <p>Пункты 50-54 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Сумма величин маржи изменения (VM) всех маржинальных контрактов, по которым предоставлена VM, рассчитанная в соответствии с пунктами 52-54 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>	
0080	<p>ЧИСТАЯ НЕЗАВИСИМАЯ СУММА ОБЕСПЕЧЕНИЯ (NICA) – ПОЛУЧЕННАЯ</p> <p>Пункты 3 и 51-54 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Сумма чистых независимых залоговых сумм (NICA) по всем маржинальным контрактам, по которым получена NICA, рассчитанная в соответствии с пунктами 52-54 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>	
0090	<p>ЧИСТАЯ НЕЗАВИСИМАЯ СУММА РЕАЛЬНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ (NICA) – ПРЕДОСТАВЛЕННАЯ</p> <p>Пункты 3 и 51-54 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Сумма чистых независимых реальных обеспечение сумм (NICA) по всем маржинальным контрактам, по которым предоставляется NICA, рассчитанная в соответствии с пунктами 52-54 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>	
0100	<p>СТОИМОСТЬ ЗАМЕНЫ (RC)</p> <p>Пункты 49-51 и 99-105 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Стоимость замены (RC) для каждого набора взаимозачета рассчитывается в соответствии с:</p> <ul style="list-style-type: none"> - пунктам 103 Регламента об отношении к 	

	<p>кредитному риску контрагента для банков № 220/2025 при использовании метода первоначальной подверженности;</p> <p>- пунктами 99 и 100 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025 для упрощенной SA-CCR;</p> <p>- пунктами 49-51 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Банк отражает сумму стоимости замены для наборов взаимозачета в соответствующей строке.</p>	
0110	<p>ПОТЕНЦИАЛЬНАЯ БУДУЩАЯ ПОДВЕРЖЕННОСТЬ (PFE)</p> <p>Пункты 66-68 и 99-105 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Потенциальная будущая подверженность (PFE) для каждого набора взаимозачета рассчитывается в соответствии с:</p> <p>- пунктам 103 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025 при использовании метода первоначальной подверженности;</p> <p>- пунктами 99 и 100 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025 для упрощенной SA-CCR;</p> <p>- пунктами 66-68 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025 для SA-CCR</p> <p>Банк отражает сумму всех потенциальных подверженностей для наборов взаимозачета в соответствующей строке.</p>	
0120	ТЕКУЩАЯ ПОДВЕРЖЕННОСТЬ	заблокировано
0130	ОЖИДАЕМАЯ ПОЛОЖИТЕЛЬНАЯ ЭФФЕКТИВНАЯ ПОДВЕРЖЕННОСТЬ (EERE)	заблокировано
0140	<p>ALFA ИСПОЛЬЗУЕМАЯ ДЛЯ РАСЧЕТА РЕГУЛИРУЕМОГО СТОИМОСТЬ ПОДВЕРЖЕННОСТИ</p> <p>Пункты 41, 99 и 102 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Значение α установлено равным 1,4 в строках, соответствующих методу первоначальной подверженности, упрощенному методу SA-CCR и методу SA-CCR в соответствии с пунктами 41, 99 и 102 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>	

0150	СТОИМОСТЬ ПОДВЕРЖЕННОСТИ ДО ПРИМЕНЕНИЯ МЕТОДОВ CRM	заблокировано
0160	СТОИМОСТЬ ПОДВЕРЖЕННОСТИ ПОСЛЕ ПРИМЕНЕНИЯ МЕТОДОВ CRM	заблокировано
0170	<p>СТОИМОСТЬ ПОДВЕРЖЕННОСТИ</p> <p>Сумма подверженности для наборов взаимозачета кредитного риска контрагента, рассчитанная в соответствии с методами, предусмотренными Регламентом о техниках снижения кредитного риска, используемых банками № 112/2018 и Регламентом об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, представляет собой сумму, имеющую значение для расчета взвешенных по риску сумм подверженностей, то есть после применения техник снижения кредитного риска, применимых в соответствии с Регламентом о техниках снижения кредитного риска, используемых банками № 112/2018 и Регламентом об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025 и с учетом вычета убытка, полученного в результате корректировки стоимости кредита в соответствии с пунктами 13-15 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>В случаях, когда для одного контрагента используется более одного подхода к оценке кредитного риска, убыток, возникающий в результате корректировки кредитного риска и вычитаемый на уровне контрагента, должен быть отнесен к стоимости риска различных наборов взаимозачета для каждого подхода к оценке кредитного риска контрагента, отражая долю стоимости риска этих наборов взаимозачета после снижения кредитного риска по отношению к общей стоимости риска контрагента после снижения кредитного риска. Банк указывает сумму всех значений подверженностей в соответствующей строке.</p>	
0180	<p>Позиции, рассматриваемые в соответствии со стандартизированным подходом CR</p> <p>Значение подверженности к кредитному риску контрагента, соответствующее позициям, которые рассматриваются в соответствии со стандартизированным подходом к кредитному риску в соответствии с Регламентом о техниках снижения кредитного риска, используемых банками № 112/2018 и Регламентом об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>	

0190	Позиции, рассматриваемые в соответствии с подходом CR IRB	заблокировано
0200	СТОИМОСТЬ-ПОДВЕРЖЕННОСТИ С УЧЕТОМ РИСКА Взвешенные по риску суммы подверженности кредитному риску контрагента, как определено в положениях о собственных средствах и требованиях к капиталу банков, рассчитываются в соответствии с методом, изложенным в положениях, касающихся подхода к кредитному риску для банков в соответствии со стандартизированным подходом. Учитываются факторы поддержки ИММ и инфраструктуры, упомянутые в правилах, касающихся подхода к кредитному риску для банков в соответствии со стандартизированным подходом.	
0210	ПОЗИЦИИ, РАССМАТРИВАЕМЫЕ В СООТВЕТСТВИИ СО СТАНДАРТИЗИРОВАННЫМ ПОДХОДОМ CR Взвешенные по риску суммы кредитных рисков контрагентов, которые рассматриваются в соответствии со стандартизированным подходом к кредитному риску в соответствии с правилами, касающимися учета кредитного риска для банков в соответствии со стандартизированным подходом.	
0220	ПОЗИЦИИ, РАССМАТРИВАЕМЫЕ В СООТВЕТСТВИИ С ПОДХОДОМ CR IRB	заблокировано
0230-0250	МИНИМАЛЬНЫЙ ПОРОГ, КАСАЮЩИЙСЯ ТРЕБОВАНИЙ К КАПИТАЛУ Для банков, подлежащих установлению минимального порога требований к капиталу в соответствии с положениями Регламентом о собственных средствах банков и требованиях капитала № 109/2018.	
0230	СУММА ПОДВЕРЖЕННОСТИ ДЛЯ РАСЧЕТА S-TREA Сумма подверженности для подверженностей к кредитному риску контрагента, включенных в расчет общей суммы подверженности к риску в соответствии со стандартизированными подходами (S-TREA), выполненным в соответствии с правилами, регулирующим собственные средства и требования к капиталу банков.	
0240	S-TREA Общая сумма подверженности к риску в соответствии со стандартизированными подходами (S-TREA) для кредитного риска	

	контрагента, рассчитанная в соответствии с правилами, регулирующим собственные средства и требования к капиталу банков.	
0250	ЭЛЕМЕНТЫ МЕМОРАНДУМ: RWEA В ОТНОШЕНИИ ВЛИЯНИЯ ПРИМЕНЕНИЯ НОРМАТИВНЫХ ТРЕБОВАНИЙ К СОБСТВЕННЫМ СРЕДСТВАМ И ТРЕБОВАНИЯМ К КАПИТАЛУ БАНКОВ. Сообщается разница между RWEA без применения переходных положений и RWEA с применением переходных положений.	

Строка		
0010	<p>МЕТОД ПЕРВОНАЧАЛЬНОЙ ПОДВЕРЖЕННОСТИ (ДЛЯ ПРОИЗВОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ)</p> <p>Производные финансовые инструменты и сделки с длительным сроком расчета, для которых банк рассчитывает стоимость подверженности в соответствии с главой V "Метод первоначальной подверженности" Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Этот упрощенный метод расчета стоимости подверженности может использоваться только банком, который выполняет условия, предусмотренные пунктом 21 или 24 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>	
0020	<p>УПРОЩЕННЫЙ СТАНДАРТИЗИРОВАННЫЙ ПОДХОД К ОЦЕНКЕ КРЕДИТНОГО РИСКА КОНТРАГЕНТА (SA-CCR, УПРОЩЕННЫЙ ДЛЯ ПРОИЗВОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ)</p> <p>Производные финансовые инструменты и сделки с длительным сроком расчета, для которых банк рассчитывает стоимость подверженности в соответствии с главой IV "Упрощенный стандартизированный подход к кредитному риску контрагента" Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Этот упрощенный стандартизированный подход к расчету суммы риска может использоваться только банком, который выполняет условия, предусмотренные пунктом 20 или 24 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>	
0030	СТАНДАРТИЗИРОВАННЫЙ ПОДХОД К ОЦЕНКЕ КРЕДИТНОГО РИСКА	

	<p>КОНТРАГЕНТА (SA-CCR ДЛЯ ПРОИЗВОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ) Производные финансовые инструменты и сделки с длительным сроком расчета, для которых банк рассчитывает стоимость подверженности в соответствии с главой III "Стандартизованный подход к кредитному риску контрагента" Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>	
0040	ММИ (ДЛЯ ПРОИЗВОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ И SFT)	заблокировано
0050	Комплекты взаимозачета для операций финансирования финансовых инструментов	заблокировано
0060	Комплекты взаимозачета для производных финансовых инструментов и сделок с долгосрочными расчетами	заблокировано
0070	Из договорных соглашений о компенсации между различными продуктами	заблокировано
0080	<p>ПРОСТОЙ МЕТОД ФИНАНСОВОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ (ДЛЯ SFT) Раздел IV "Расчет эффекта снижения кредитного риска", Глава VIII "Расчет эффекта в случае финансируемой защиты кредита", Часть 4 "Простой метод финансовых гарантий" Регламента о техниках снижения кредитного риска, используемых банками № 112/2018. Сделки по выкупу, сделку дачи или получения ценных бумаг или товаров займа, сделки с длительным сроком расчета и сделки по маргинальному кредитованию, для которых банк решил определить сумму подверженности в соответствии с Разделом IV "Расчет эффекта снижения кредитного риска", Главой VIII "Расчет эффекта в случае финансируемой защиты кредита", Частью 4 "Простой метод финансовых гарантий" Регламента о техниках снижения кредитного риска, используемых банками № 112/2018, вместо использования Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>	
0090	<p>РАСШИРЕННЫЙ МЕТОД ФИНАНСОВОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ (для SFT) Регламент о техниках снижения кредитного риска, используемых банками № 112/2018. Сделки по выкупу, сделку дачи или получения ценных бумаг или товаров займа, сделки с длительным сроком расчета и сделки по маргинальному кредитованию, для которых</p>	

	банк решил определить сумму подверженности в соответствии с Регламентом о техниках снижения кредитного риска, используемых банками № 112/2018, вместо использования Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.	
0100	<p>VAR ДЛЯ SFT</p> <p>Регламент о техниках снижения кредитного риска, используемых банками № 112/2018. Сделки по выкупу, сделку дачи или получения ценных бумаг или товаров займа, сделки с длительным сроком расчета и сделки по маргинальному кредитованию или другие операции, скорректированные с учетом условий рынка капитала, кроме сделок с производными финансовыми инструментами, для которых, в соответствии с Регламентом о техниках снижения кредитного риска, используемых банками № 112/2018, и при условии получения одобрения Национального банка Молдовы, стоимость подверженности рассчитывается с использованием подхода, основанного на внутренних моделях, который учитывает эффекты корреляции между позициями по ценным бумагам, подпадающим под рамочное соглашение о взаимозачете, а также ликвидность соответствующих инструментов.</p>	заблокировано
0110	ИТОГО	
0120	Из них: позиции, подверженные определенному риску неблагоприятной корреляции (SWWR)	заблокировано
0130	<p>Маргинальные операции</p> <p>Пункт 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Подверженности по кредитному риску контрагента, которые покрываются маржей, а именно наборы взаимозачетов, которые являются предметом маргинального договора в соответствии с пунктом 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>	
0140	<p>Операции без маржи</p> <p>Подверженности к кредитному риску контрагента, которые не отражаются в строке 0130.</p>	

**ОБЩЕЕ ПРЕДСТАВЛЕНИЕ ОТЧЕТНОСТИ ПО КРЕДИТНОМУ РИСКУ
КОНТРАГЕНТА:
ПОДВЕРЖЕННОСТИ ПО ССР, ОБРАБАТЫВАЕМЫЕ С ПОМОЩЬЮ
СТАНДАРТИЗИРОВАННЫХ ПОДХОДОВ: SA-ССР ИЛИ**

УПРОЩЕННАЯ ВЕРСИЯ SA-CCR (CCR 3)

7. Банки заполняют отдельный формуляр для отчетности по подверженностям к кредитному риску контрагента, рассчитанным в соответствии с SA-CCR или упрощенной SA-CCR, в зависимости от случая.

**Формуляр отчета
С 34.03 КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА: ПОДВЕРЖЕННОСТИ К
CCR,
ОБРАБАТЫВАЕМЫЕ С ПОМОЩЬЮ СТАНДАРТИЗИРОВАННЫХ
ПОДХОДОВ:
SA-CCR ИЛИ УПРОЩЕННАЯ ВЕРСИЯ SA-CCR (CCR 3)**

Подход CCR

КАТЕГОРИИ РИСКА	ВАЛ ЮТА	ВТО РАЯ ВАЛ ЮТА В ПАРЕ	КОЛИЧЕ СТВО СДЕЛОК	УСЛОВ НЫЕ СУММ Ы	ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНАЯ СТОИМОСТ Ь (СМУ), ПОЛОЖИТ ЕЛЬНАЯ	ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНА Я СТОИМОС ТЬ (СМУ), ОТРИЦАТЕ ЛЬНАЯ	УВЕЛИЧ ЕНИЕ
	0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070
00 10	ИТОГО	X	X				
00 20	из которых: Отнесены к 2 категориям риска	X	X				X
00 30	из которых: Отнесены к 3 категориям риска	X	X				X
00 40	из которых: Относящиеся к более чем 3 категориям риска	X	X				X
00 50	РИСК ПРОЦЕНТНО Й СТАВКИ	X	X				
00 60	из которых: Относящиеся исключительн о в категории риска процентной ставки	X	X				X
00 70	из которых: Самая важная валюта		X				
00 80	из которых: Вторая по		X				

	значимости валюта							
00 90	из которых: Третья по значимости валюта		X					
01 00	из которых: Четвертая по значимости валюта		X					
01 10	из которых: Пятая по значимости валюта		X					
01 20	ВАЛЮТНЫЙ РИСК	X	X					
01 30	из которых: Относящиеся исключительн о к категории валютного риска	X	X					X
01 40	из которых: Наиболее важная валютная пара							
01 50	из которых: Вторая валютная пара по значимости							
01 60	из которых: Третья валютная пара по значимости							
01 70	из которых: Четвертая валютная пара по значимости							
01 80	из которых: Пятая валютная пара по значимости							
01 90	КРЕДИТНЫЙ РИСК	X	X					
02 00	из которых: Относящиеся исключительн о к категории кредитного риска	X	X					X
02 10	Сделки на основе одной подписи	X	X					X

02 20	Сделки на основе нескольких подписей	X	X					X
02 30	РИСК ОБЕСЦЕНЕН ИЯ АКЦИЙ	X	X					
02 40	из которых: Исключительн о в категории риска обесценения акций	X	X					X
02 50	Сделки на основе одной подписи	X	X					X
02 60	Сделки на основе нескольких подписей	X	X					X
02 70	РИСК ТОВАРА	X	X					
02 80	из которых: Относящиеся исключительн о к категории риска товара	X	X					X
02 90	Энергия	X	X					
03 00	Металлы	X	X					
03 10	Сельскохозяйс твенная продукция	X	X					
03 20	Климатически е условия	X	X					
03 30	Прочие товары	X	X					
03 40	ПРОЧИЕ РИСКИ	X	X					

Порядок заполнения отчета

**С 34.03 КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА:
ПОДВЕРЖЕННОСТИ ПО ССР, ОБРАБАТЫВАЕМЫЕ
С ИСПОЛЬЗОВАНИЕМ СТАНДАРТИЗИРОВАННЫХ
ПОДХОДОВ:
SA-CCR или УПРОЩЕННАЯ ВЕРСИЯ SA-CCR (CCR 3)**

Инструкции по конкретным позициям

Графы	
0010	<p>ВАЛЮТА В случае сделок, относящихся к категории риска процентной ставки, указывается валюта, в которой деноминирована сделка. В случае сделок, относящихся к категории валютного риска, указывается валюта, в которой деноминирован один из двух сегментов сделки. Банки должны вводить валюты в валютной паре в алфавитном порядке, например, для пары доллар США/евро укажите EUR в этой колонке и USD в колонке 0020. Используются коды валют ISO.</p>
0020	<p>ВТОРАЯ ВАЛЮТА В ПАРЕ В случае сделок, относящихся к категории валютного риска, указывается валюта, в которой деноминирован другой сегмент операции (по сравнению с тем, который указан в колонке 0010). Банки должны вводить валюты в валютной паре в алфавитном порядке в колонке 0010, например, для пары доллар США/евро укажите USD в этой колонке и EUR в колонке 0010. Используются коды валют ISO.</p>
0030	<p>КОЛИЧЕСТВО СДЕЛОК Смотреть инструкции для графы 0020 в формуляре С 34.02.</p>
0040	<p>УСЛОВНЫЕ СУММЫ Смотреть инструкции для графы 0030 в формуляре С 34.02.</p>
0050	<p>ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНАЯ СТОИМОСТЬ (CMV) – ПОЛОЖИТЕЛЬНАЯ Сумма текущих рыночных стоимостей (CMV) для всех наборов хеджирования риска с положительной CMV в соответствующей категории риска. CMV на уровне набора хеджирования риска определяется путем компенсации положительных и отрицательных рыночных значений сделок в рамках одного набора</p>

	хеджирования риска, включая любое обеспечение, находящееся в собственности или предоставленное.
0060	<p>ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНАЯ СТОИМОСТЬ (СМV) – ОТРИЦАТЕЛЬНАЯ</p> <p>Сумма абсолютных текущих рыночных стоимостей (СМV) для всех наборов хеджирования риска с отрицательной СМV в соответствующей категории риска.</p> <p>СМV на уровне набора хеджирования риска определяется путем компенсации положительных и отрицательных рыночных значений сделок в рамках одного набора хеджирования риска, включая любое обеспечение, находящееся в собственности или предоставленное.</p>
0070	<p>УВЕЛИЧЕНИЕ</p> <p>Пункты 78-98 и 100 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Банк сообщает сумму всех надбавок в рамках соответствующего набора хеджирования риска/соответствующей категории риска.</p> <p>Надбавка для каждой категории риска, которая используется для определения потенциальной будущей подверженности набора взаимозачета в соответствии с пунктом 66 или подпунктом 100.6. Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, рассчитывается в соответствии с пунктами 78-98 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Для упрощенной SA-CCR применяются положения, предусмотренные пунктом 100 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>

Строки	
0050,0120, 0190, 0230, 0270, 0340	<p>КАТЕГОРИИ РИСКА</p> <p>Пункты 55-65 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Сделки классифицируются в соответствии с категорией риска, к которой они относятся, в соответствии с пунктами 55-58 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Отнесение сделок к наборам хеджирования рисков в соответствии с категорией риска осуществляется в соответствии с пунктами 59-65 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Для упрощенной SA-CCR применяются положения, предусмотренные в пункте 100 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>
0020-0040	<p>Из которых – отнесенные к нескольким категориям риска</p> <p>Пункт 57 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p> <p>Сделки с производными финансовыми инструментами с более чем одним значимым фактором риска, относящимся к</p>

	<p>двум (0020), трем (0030) или более чем трем (0040) категориям риска на основе наиболее значимых факторов риска в каждой категории риска в соответствии с пунктом 57 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>
0070-0110 и 0140-0180	<p>Валюта и наиболее важная валютная пара Эта классификация осуществляется на основе CMV портфеля банка, который подпадает под подход SA-CCR или, в зависимости от случая, под упрощенный подход SA-CCR для сделок, относящихся к категории риска процентной ставки и, соответственно, к категории валютного риска. Для целей данной классификации суммируются абсолютные значения CMV, относящиеся к позициям.</p>
0060,0130, 0200,0240, 0280	<p>Эксклюзивное размещение Пункты 55 и 56 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Сделки с производными финансовыми инструментами, классифицированными исключительно в одной категории риска в соответствии с пунктами 55 и 56 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Исключаются сделки, относящиеся к различным категориям риска в соответствии с пунктом 57 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>
0210, 0250	<p>Сделки на основе одной подписи Сделки, основанные на одной подписи, которые относятся к категории кредитного риска и, соответственно, к категории риска обесценения ценных бумаг.</p>
0220, 0260	<p>Сделки на основе нескольких подписей Сделки, основанные на нескольких подписях, которые относятся к категории кредитного риска и, соответственно, к категории риска обесценивания ценных бумаг.</p>
0290-0330	<p>Наборы хеджирования для категории риска товара Сделки с производными финансовыми инструментами, которые относятся к наборам хеджирования риска для категории риска товара, перечисленных в подпункте 59.5. Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.</p>

**Формуляр отчета
С 34.04 КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА: ПОДВЕРЖЕННОСТИ
К ССР С ИСПОЛЬЗОВАНИЕМ МЕТОДА ПЕРВОНАЧАЛЬНОЙ
ПОДВЕРЖЕННОСТИ (ОЕМ) (ССР 4)**

КАТЕГОРИИ РИСКА		КОЛИЧЕСТВО СДЕЛОК	УСЛОВНЫЕ СУММЫ	ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНАЯ СТОИМОСТЬ (СМV), ПОЛОЖИТЕЛЬНАЯ	ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНАЯ СТОИМОСТЬ (СМV), ОТРИЦАТЕЛЬНАЯ	ПОТЕНЦИАЛЬНАЯ БУДУЩАЯ ПОДВЕРЖЕННОСТЬ (PFE)
		0010	0020	0030	0040	0050
0010	ИТОГО					
0020	РИСК ПРОЦЕНТНОЙ СТАВКИ					
0030	ВАЛЮТНЫЙ РИСК					
0040	КРЕДИТНЫЙ РИСК					
0050	РИСК ОБЕСЦЕНЕНИЯ АКЦИЙ					
0060	РИСК ТОВАРА					
0070	из них: электроэнергия					

Порядок заполнения отчета

**С 34.04 – КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА:
ПОДВЕРЖЕННОСТИ К ССР С ИСПОЛЬЗОВАНИЕМ МЕТОДА
ПЕРВОНАЧАЛЬНОЙ ПОДВЕРЖЕННОСТИ (ОЕМ) (ССР 4)**

Инструкции по конкретным позициям

Графы	
0010	Инструкции для граф 0010 и 0020 соответствуют инструкциям для формуляра С 34.02.
–	
0020	

0030	ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНАЯ СТОИМОСТЬ (CMV) – ПОЛОЖИТЕЛЬНАЯ Сумма текущих рыночных стоимостей (CMV) для всех сделок с положительной CMV в соответствующей категории риска.
0040	ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНАЯ СТОИМОСТЬ (CMV) – ОТРИЦАТЕЛЬНАЯ Сумма абсолютных текущих рыночных значений (CMV) для всех сделок с отрицательным CMV в соответствующей категории риска.
0050	ПОТЕНЦИАЛЬНАЯ БУДУЩАЯ ПОДВЕРЖЕННОСТЬ (PFE) Банк сообщает сумму потенциальных будущих подверженностей по всем сделкам, относящимся к одной и той же категории риска.

Строки	
0020	КАТЕГОРИИ РИСКА
–	Сделки с производными финансовыми инструментами, которые относятся к категориям риска, перечисленным в подпункте 104.2. Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.
0070	

ОБЩЕЕ ПРЕДСТАВЛЕНИЕ ОТЧЕТНОСТИ ПО КРЕДИТНОМУ РИСКУ КОНТРАГЕНТА: ПЕРВЫЕ ДВАДЦАТЬ КОНТРАГЕНТОВ (CCR 6)

8. Банки сообщают информацию о 20 наиболее значимых контрагентах, по которым они имеют наибольшую подверженность к кредитному риску контрагента. Классификация осуществляется с использованием стоимости подверженности к кредитному риску контрагента, как указано в графе 0120 настоящего формуляра, для всех наборов взаимозачетов с соответствующими контрагентами. Внутригрупповые подверженности или другие подверженности, которые создают риск кредитного риска контрагента, но для которых банки присваивают весовой коэффициент риска, равный нулю, для расчета требований к собственным средствам в соответствии с правилами, относящимися к учету кредитного риска для банков в соответствии со стандартизированным подходом, все же учитываются при составлении списка 20 наиболее значимых контрагентов.

9. Банки, применяющие стандартизированный подход (SA-CCR) для расчета подверженности к кредитному риску контрагента в соответствии с главой III "Стандартизированный подход к риску кредитного риска контрагента" Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, заполняют этот формуляр ежеквартально. Банки, применяющие упрощенный стандартизированный подход или метод первоначальной подверженности (ОЕМ) для расчета риска кредитного риска контрагента в соответствии с главой IV "Упрощенный стандартизированный подход к риску кредитного риска контрагента" и главой V "Метод первоначальной подверженности" Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, должны отчитываться по данной форме ежеквартально.

**Формуляр отчета
С 34.06 КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА:
ПЕРВЫЕ ДВАДЦАТЬ КОНТРАГЕНТОВ (CCR 6)**

НАЗ ВАН ИЕ	К О Д	Т И П К О Д А	НАЦ ИОН А- ЛЬН ЫЙ КОД	СЕК ТОР НТР А- ГЕН ТА	ТИ П КО НТР А- ГЕН ТА	МЕСТ ОНА- ХОЖД ЕНИЕ КОНТР АГЕНТ А	КО ЛИ- ЧЕ СТ ВО СД ЕЛ ОК	УСЛ ОВН ЫЕ СУМ МЫ	ТЕКУ ЩАЯ РЫНО ЧНАЯ СТОИ МОСТ Ь (СМV) – ПОЛО ЖИ- ТЕЛЬ НАЯ	ТЕКУ ЩАЯ РЫНО ЧНАЯ СТОИ МОСТ Ь (СМV) – ОТРИ ЦА- ТЕЛЬ НАЯ	СУММ А ПОДВ ЕР- ЖЕНН ОСТИ ПОСЛ Е ПРИМ ЕНЕН ИЯ ТЕХН ИК CRM	СУМ МА ПОД ВЕР- ЖЕН НОС ТИ	СУМ МА ПОД ВЕР- ЖЕН НОС ТИ С УЧЕТ ОМ РИСК А
0010	00 20	00 30	0035	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130
											X		

Порядок составления отчета

**С 34.06 – КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА: ПЕРВЫЕ
ДВАДЦАТЬ КОНТРАГЕНТОВ (CCR 6)**

Инструкции по конкретным позициям

Графы		
0010	НАЗВАНИЕ В случае идентификации индивидуального контрагента указывается имя и фамилия физического лица в соответствии с документом, удостоверяющим личность, или название юридического лица в соответствии с документом, подтверждающим государственную регистрацию юридического лица.	
0020	КОД Код, входящий в идентификационный номер строки, должен быть уникальным для каждого	

	<p>субъекта, подлежащего отчетности. Для резидентных и нерезидентных банков указывается код SWIFT, присвоенный банку. Для других субъектов указывается код IDNO Для других нерезидентных субъектов указывается идентификационный/государственный регистрационный номер или налоговый код, присвоенный уполномоченным органом страны происхождения нерезидента, с предшествующим кодом ISO 3166-1-альфа-2 страны регистрации, в которой зарегистрирован нерезидентный субъект.</p>	
0030	<p>ТИП КОДА Банки должны указать тип кода, отображаемый в столбце 0020, как "SWIFT-код" или "не-SWIFT-код". Тип кода указывается всегда.</p>	
0035	<p>НАЦИОНАЛЬНЫЙ КОД Государственный идентификационный номер контрагента будет указываться следующим образом: - для физических лиц-резидентов – государственный идентификационный номер (IDNP) физического лица или серия и номер документа, удостоверяющего личность, в случаях, когда в соответствии с действующим законодательством они используются/присваиваются в качестве личного идентификационного номера; - для юридических и физических лиц-резидентов, осуществляющих предпринимательскую деятельность – государственный идентификационный номер (IDNO) юридического/физического лица, осуществляющего предпринимательскую деятельность, или налоговый код, присвоенный налоговым органом, – если юридическое лицо-резидент в соответствии с действующими законодательными актами не имеет IDNO; - для физических лиц-резидентов, оказывающих профессиональные услуги, а также для лиц, осуществляющих профессиональную деятельность в сфере правосудия и здравоохранения – государственный идентификационный номер (IDNP) лица, оказывающего профессиональные услуги, а также лица, осуществляющего профессиональную деятельность в сфере правосудия и здравоохранения; - для физических лиц-нерезидентов – государственный идентификационный номер</p>	

	<p>лица, присвоенный уполномоченными органами страны проживания, а в случае его отсутствия в документе, удостоверяющем личность, указывается серия и номер представленного документа, удостоверяющего личность, с добавлением двух букв, обозначающих страну, в которой зарегистрирован нерезидент;</p> <p>- для юридических лиц-нерезидентов и физических лиц-нерезидентов, осуществляющих предпринимательскую деятельность, указывается идентификационный/государственный регистрационный номер или налоговый код, присвоенный уполномоченным органом страны происхождения нерезидента, с добавлением альфа-2 кода страны, в которой зарегистрирован нерезидент;</p> <p>- для физических лиц-нерезидентов, оказывающих профессиональные услуги, а также лиц, осуществляющих профессиональную деятельность в сфере правосудия и здравоохранения – указывается идентификационный/регистрационный номер или налоговый код, присвоенный уполномоченным органом страны происхождения нерезидента, с указанием альфа-2 кода страны, в которой зарегистрирован нерезидент, если в соответствии с законодательством страны происхождения такой код существует. В противном случае указывается серия и номер удостоверения личности лица, оказывающего профессиональные услуги, а также лица, осуществляющего профессиональную деятельность в сфере правосудия и здравоохранения, с указанием кода альфа-2 страны, в которой зарегистрирован нерезидент. Для связанных групп клиентов государственный идентификационный номер не указывается.</p>	
0040	<p>СЕКТОР КОНТРАГЕНТОВ</p> <p>Для каждого контрагента выбирается сектор на основе следующих классов секторов экономики в рамках FINREP:</p> <ul style="list-style-type: none"> - центральные банки; - государственные органы; - банки; - инвестиционные компании, как определено в Законе № 171/2012 о рынке капитала; - другие финансовые компании (за исключением инвестиционных компаний); - нефинансовые компании. 	

0050	<p>ТИП КОНТРАГЕНТА Банк указывает тип контрагента, а именно: - СРСС: когда контрагент является квалифицированным СРС; - NON-СРСС: когда контрагент является неквалифицированным СРС; - не является СРС: когда контрагент не является СРС.</p>	
0060	<p>МЕСТОНАХОЖДЕНИЕ КОНТРАГЕНТА Следует использовать код ISO 3166-1-alpha-2 страны регистрации контрагента (включая псевдокоды ISO для международных организаций, доступные в Справочнике по платежному балансу, опубликованном Eurostat, с изменениями).</p>	
0070	<p>КОЛИЧЕСТВО СДЕЛОК Смотреть инструкции для графы 0020 формуляра С 34.02.</p>	
0080	<p>УСЛОВНЫЕ СУММЫ Смотреть инструкции для графы 0030 формуляра С 34.02.</p>	
0090	<p>ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНАЯ СТОИМОСТЬ (СМV) – положительная Смотреть инструкции для графы 0040 формуляра С 34.02. Банк сообщает сумму неттинговых наборов с положительным значением СМV, если для одного и того же контрагента существует несколько неттинговых наборов.</p>	
0100	<p>ТЕКУЩАЯ РЫНОЧНАЯ СТОИМОСТЬ (СМV) – отрицательная Смотреть инструкции для графы 0040 формуляра С 34.02. Банк сообщает абсолютную сумму неттинговых наборов с отрицательным значением СМV, если для одного и того же контрагента существует несколько неттинговых наборов.</p>	
0110	<p>СУММА ПОДВЕРЖЕННОСТИ ПОСЛЕ ПРИМЕНЕНИЯ ТЕХНИК CRM</p>	заблокировано
0120	<p>СУММА ПОДВЕРЖЕННОСТИ Смотреть инструкции для графы 0170 формуляра С 34.02.</p>	
0130	<p>СУММЫ ПОДВЕРЖЕННОСТЕЙ С УЧЕТОМ РИСКА Смотреть инструкции для графы 0020 формуляра С 34.02.</p>	

**ОБЗОР ОТЧЕТНОСТИ ПО КРЕДИТНОМУ РИСКУ КОНТРАГЕНТА:
 Состав обеспечения для подверженностей к кредитному риску контрагента**

10. Данный формуляр должен быть заполнен справедливой стоимостью обеспечения (предоставленного или полученного), используемого в подверженностях к кредитному риску контрагента, связанного с производными финансовыми инструментами, долгосрочными расчетными сделками или SFT, независимо от того, компенсируются ли эти сделки центральным контрагентом или нет, и независимо от того, предоставляется ли обеспечение центральному контрагенту или нет.

Формуляр отчета
С 34.08 КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА: СОСТАВ РЕАЛЬНОГО
ОБЕСПЕЧЕНИЯ ДЛЯ ПОДВЕРЖЕННОСТЕЙ К CCR (CCR 8)

ВИД РЕАЛЬНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ		РЕАЛЬНОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ, ИСПОЛЪЗУЕМОЕ В СДЕЛКАХ С ПРОИЗВОДНЫМИ ФИНАНСОВЫМИ ИНСТРУМЕНТАМИ								РЕАЛЬНОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ, ИСПОЛЪЗУЕМОЕ В SFT									
		СПРАВЕДЛИВАЯ СТОИМОСТЬ ПОЛУЧЕННОГО РЕАЛЬНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ				СПРАВЕДЛИВАЯ СТОИМОСТЬ ПРЕДОСТАВЛЕННОГО РЕАЛЬНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ				СПРАВЕДЛИВАЯ СТОИМОСТЬ ПОЛУЧЕННОГО РЕАЛЬНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ					СПРАВЕДЛИВАЯ СТОИМОСТЬ ПРЕДОСТАВЛЕННОГО РЕАЛЬНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ				
		СЕГРЕГИРОВАН НОЕ		НЕСЕГРЕГИРОВАН НОЕ		СЕГРЕГИРОВАН НОЕ		НЕСЕГРЕГИРОВАН НОЕ		СЕГРЕГИРОВАН НОЕ		НЕСЕГРЕГИРОВАННОЕ			SEGREGATE		NESEGREGATE		
		ПЕРВОН А- ЧАЛЬНА Я МАРЖА	МАРЖ А ИЗМЕ- НЕНИ Я	ПЕРВОНА- ЧАЛЬНАЯ МАРЖА	МАРЖ А ИЗМЕ- НЕНИ Я	ПЕРВОН А- ЧАЛЬНА Я МАРЖА	МАРЖ А ИЗМЕ- НЕНИ Я	ПЕРВОНА- ЧАЛЬНАЯ МАРЖА	МАРЖ А ИЗМЕ- НЕНИ Я	ПЕРВОН А- ЧАЛЬНА Я МАРЖА	МАРЖ А ИЗМЕ- НЕНИ Я	ПЕРВОН А- ЧАЛЬН АЯ МАРЖА	МАРЖ А ИЗМЕ- НЕНИ Я	ЦЕНН ЫЕ БУМАГ Е В РАМКА Х SFT	ПЕРВОН А- ЧАЛЬН АЯ МАРЖА	МАРЖ А ИЗМЕ- НЕНИ Я	ПЕРВОН А- ЧАЛЬН АЯ МАРЖА	МАРЖ А ИЗМЕ- НЕНИ Я	ЦЕНН ЫЕ БУМА ГЕ В РАМКА Х SFT
		0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180
001	Наличные – национальная валюта																		
002	Наличные – другие валюты																		
003	Внутренний суверенный долг																		
004	Прочий суверенный долг																		
005	Долговые ценные бумаги, выпущенные государственными учреждениями																		
006	Корпоративные облигации																		
007	Капитальные ценные бумаги																		
008	Прочее реальное обеспечение																		
009	Итого																		

Порядок составления отчета

С 34.08 – КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА: СОСТАВ РЕАЛЬНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ ДЛЯ ПОДВЕРЖЕННОСТЕЙ К CCR (CCR 8)

Инструкции по конкретным позициям

Графы	
0010 – 0080	Реальное обеспечение, используемое в сделках с производными финансовыми инструментами Банки сообщают о реальном обеспечении (включая реальное обеспечение, соответствующее первоначальной марже и маржой изменения), используемом в рамках кредитного риска контрагента, связанного с любым производным финансовым инструментом, указанным в приложении № 1 к Регламенту о подходе к рыночному риску согласно стандартизированному подходу № 114/2018, или любой долгосрочной расчетной сделкой, как определено в пункте 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, которая не может считаться SFT.
0090 – 0180	Реальное обеспечение, используемое в SFT Банки предоставляют информацию об реальных обеспечении (включая реальное обеспечение, соответствующее первоначальной и маржой изменения, а также реальное обеспечение, фигурирующее в качестве ценных бумаг в сделках SFT), используемом для покрытия кредитного риска контрагента, связанного с любой сделкой SFT или любой долгосрочной расчетной сделкой, которая не квалифицируется как производный финансовый инструмент.
0010, 0020, 0050, 0060, 0090, 0100, 0140, 0150	Сегрегированное Пункт 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Банки сообщают о реальном обеспечении, которое окажется недоступным в случае банкротства, как это определено в пункте 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, с подробным описанием реального обеспечения в виде первоначальной маржи или маржой изменения.
0030, 0040, 0070, 0080, 0110, 0120, 0130, 0160, 0170, 0180	Несегрегированное Пункт 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Банки сообщают о реальном обеспечении, которое окажется недоступным в случае банкротства, как это определено в пункте 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, с подробным описанием реального обеспечения в виде первоначальной маржи, маржой изменения или ценных бумаг в рамках SFT.

0010, 0030, 0050, 0070, 0090, 0110, 0140, 0160	Первоначальная маржа Нормативные акты, касающиеся отношения к кредитному риску для банков согласно стандартизированному подходу. Банки сообщают справедливую стоимость полученного или предоставленного реального обеспечения в качестве первоначальной маржи.
0020, 0040, 0060, 0080, 0100, 0120, 0150, 0170	Маржа изменения Банки сообщают справедливую стоимость полученного или предоставленного реального обеспечения в качестве маржи изменения.
0130, 0180	Ценные бумаги в рамках SFT Банки сообщают справедливую стоимость реального обеспечения в виде ценных бумаг в рамках SFT (например, сегмент SFT, представленный ценной бумагой, которая была получена, в случае колонки 0130, или предоставлена, в случае колонки 0180).

Строки	
0010 – 0080	Вид реального обеспечения Разбивка по различным видам обеспечения.

**Формуляр отчета
С 34.09 КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА: ПОДВЕРЖЕННОСТИ ИЗ КРЕДИТНЫХ
ПРОИЗВОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ (CCR 9)**

Вид продукта		УСЛОВНЫЕ СУММЫ		СПРАВЕДЛИВЫЕ СТОИМОСТИ	
		ПРИОБРЕТЕННА Я ЗАЩИТА	ПРОДАННА Я ЗАЩИТА	ПРИОБРЕТЕННА Я ЗАЩИТА	ПРОДАННА Я ЗАЩИТА
		0010	0020	0030	0040
001 0	Инструменты кредитных дефолтных свопов, основанные на единой подписи				
002 0	Инструменты кредитных дефолтных свопов, основанные на индексах				
003 0	Инструменты типа тотального возврата своп				
004 0	Варианты кредитования				
005 0	Другие кредитные деривативы				
006 0	Итого				
РАЗБИВКА СПРАВЕДЛИВОЙ СТОИМОСТИ					
007 0	Положительна я справедливая стоимость (активы)	X	X		
008 0	Отрицательная справедливая стоимость (обязательства)	X	X		

Порядок составления отчета

**С 34.09 – КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА:
ПОДВЕРЖЕННОСТИ ИЗ КРЕДИТНЫХ ПРОИЗВОДНЫХ
ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ (CCR 9)**

Инструкции по конкретным позициям

Графы	
0010-0040	ЗАЩИТА КРЕДИТНЫХ ДЕРИВАТИВНЫХ ИНСТРУМЕНТОВ Приобретенная или проданная защита кредитных деривативных инструментов
0010, 0020	УСЛОВНЫЕ СУММЫ Сумма номинальных объемов производных финансовых инструментов до взаимозачета, с разбивкой по типам продуктов.
0030, 0040	СПРАВЕДЛИВЫЕ СТОИМОСТИ Сумма справедливых стоимостей с разбивкой по приобретенной и проданной защите

Строки	
0010	Вид продукта
–	Разбивка по типам кредитных деривативов
0050	
0060	Итого Сумма всех типов продуктов
0070, 0080	Справедливые стоимости Справедливая стоимость с разбивкой по видам продуктов, а также по активам (положительная справедливая стоимость) и обязательствам (отрицательная справедливая стоимость)

**ОБЗОР ОТЧЕТНОСТИ О КРЕДИТНОМ РИСКЕ КОНТРАГЕНТА:
ВОЗМОЖНОСТИ, ПОДВЕРЖЕННОСТИ ПЕРЕД СРС (CCR 10)**

11. Банки предоставляют информацию о подверженностях перед СРС, а именно о контрактах и сделках, перечисленных в пунктах 125 и 126 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, в течение всего периода их действия с СРС, а также о подверженностях, связанных со сделками с СРС, в соответствии с пунктом 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, для которых требования к собственным средствам рассчитываются в соответствии с главой VIII "Требования к собственным средствам для подверженностей перед центральным контрагентом" Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.

**Формуляр отчета
С 34.10 КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА:
ПОДВЕРЖЕННОСТИ ПЕРЕД ЦКА (CCR 10)**

		СТОИМОСТЬ ПОДВЕРЖЕННОСТИ	СУММА ПОДВЕРЖЕННОСТИ С УЧЕТОМ РИСКА
		0010	0020
0010	Подверженности перед СРСС (итого)	X	
0020	Подверженности для сделок в СРСС (за исключением первоначальной маржи и взносов в фонд гарантирования); из которых:		
0030	(i) внебиржевые производные финансовые инструменты		
0040	(ii) производные финансовые инструменты, торгуемые на бирже		
0050	(iii) SFT		
0060	(iv) наборы взаимозачета, для которых утверждена компенсация между различными продуктами		
0070	Сегрегированная первоначальная маржа		X
0080	Несегрегированная первоначальная маржа		
0090	Предварительные взносы в гарантийный фонд		
0100	Необеспеченные взносы в гарантийный фонд		
0110	Подверженности перед квалифицированными СРС (итого)	X	
0120	Подверженности для сделок в неквалифицированных		

	СРС (за исключением первоначальной маржи и взносов в фонд гарантирования); из которых:		
0130	(i) внебиржевые производные финансовые инструменты		
0140	(ii) производные финансовые инструменты, торгуемые на бирже		
0150	(iii) SFT		
0160	(iv) наборы взаимозачета, для которых утверждена компенсация между различными продуктами		
0170	Сегрегированная первоначальная маржа		X
0180	Несегрегированная первоначальная маржа		
0190	Предварительные взносы в гарантийный фонд		
0200	Необеспеченные взносы в гарантийный фонд		

Порядок составления отчета

С 34.10 – КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА: ПОДВЕРЖЕННОСТИ ПЕРЕД СРС (CCR 10)

Инструкции по конкретным позициям

Графы	
0010	СТОИМОСТЬ ПОДВЕРЖЕННОСТИ Сумма подверженности по сделкам, подпадающим под действие Главы VIII "Требования к собственным средствам для подверженностей перед центральным контрагентом" Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025, рассчитывается в соответствии с соответствующими методами, изложенными в Главе VIII "Требования к собственным средствам для подверженностей перед центральным контрагентом" Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Указанная сумма подверженности должна соответствовать

	сумме, необходимой для расчета требований к собственным средствам в соответствии с главой VIII "Требования к собственным средствам для подверженностей перед центральным контрагентом" Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Подверженность может представлять собой подверженность по сделкам, как определено в пункте 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.
0020	СУММА ПОДВЕРЖЕННОСТИ С УЧЕТОМ РИСКА Определены взвешенные по риску суммы подверженности риску в соответствии с главой VIII "Требования к собственным средствам для подверженностей перед центральным контрагентом" Регламента № 220/2025 о подходе к риску кредитного риска контрагента для банков.

Строки	
0010-0100	Квалифицированный центральный контрагент (СРСС) Квалифицированный центральный контрагент, или "СРСС", как определено в пункте 3 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.
0070, 0080, 0170, 0180	Первоначальная маржа Смотреть инструкции для формуляра С 34.08. В целях данного формуляра первоначальная маржа не включает взносы в СРС для соглашений о взаимном распределении убытков (например, если СРС использует первоначальную маржу для взаимного распределения убытков между участниками клиринга, это следует рассматривать как подверженность фонда гарантирования).
0090, 0190	Предварительные взносы в гарантийный фонд Пункты 150-154 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025.
0100, 0200	Необеспеченные взносы в гарантийный фонд сч Пункты 153-155 Регламента об отношении к кредитному риску контрагента для банков № 220/2025. Банки отчитываются о взносах, которые банк, выступающий в качестве клирингового участника, обязался в соответствии с договором предоставить СРС после того, как последний исчерпал свой резервный фонд для покрытия убытков, понесенных в результате неплатежеспособности одного или нескольких своих клиринговых участников.
0070, 0170	Сегрегированное Смотреть инструкции для формуляра С 34.08.
0080, 0180	Несегрегированное Смотреть инструкции для формуляра С 34.08.'".

2. Первое представление отчетов, упомянутых в подпункте 8) пункта 14 инструкции, указанной в пункте 1, будет произведено по состоянию на 31 декабря 2026 года в случае отчетности на индивидуальном уровне и, соответственно, по состоянию на 31 декабря 2027 года в случае отчетности на консолидированной основе.

3. Настоящее постановление вступает в силу 1 октября 2026 года.

ПРЕДСЕДАТЕЛЬ

ИСПОЛНИТЕЛЬНОГО КОМИТЕТА

Анка-Дана ДРАГУ

№ 75. Кишинэу, 26 марта 2026 г.