

Порядок расчета ставок межбанковского кредитного рынка MIACR, MIACR-IG, MIACR-B и соответствующих им оборотов операций

Показатели ставок межбанковского кредитного рынка MIACR, MIACR-IG и MIACR-B рассчитываются на основе информации о сделках, заключенных на рынке межбанковского кредитования кредитными организациями города Москвы и Московской области, представляющими отчетность по форме 0409701 «Отчет об операциях на валютных и денежных рынках» в Банк России в соответствии с Указанием Банка России от 8 октября 2018 года № 4927-У «О перечне, формах и порядке составления и представления форм отчетности кредитных организаций в Центральный банк Российской Федерации».

Средневзвешенные фактические ставки межбанковского кредитования MIACR, MIACR-IG и MIACR-B — это средневзвешенные процентные ставки в годовом исчислении, рассчитанные в разбивке по сроку и взвешенные с учетом объема сделок по кредитам:

— предоставленным московскими банками банкам-резидентам и банкам-нерезидентам Российской Федерации (MIACR);

— предоставленным московскими банками российским банкам с высоким кредитным рейтингом — не ниже Вaa3 по оценке агентства Moody's, BBB- по оценке агентств Fitch и Standard&Poor's по состоянию на 01.08.2014 (MIACR-IG);

— предоставленным московскими банками российским банкам со спекулятивным кредитным рейтингом — от B3 до B1 по оценке агентства Moody's или от B- до B+ по оценке агентств Fitch и Standard&Poor's по состоянию на 01.08.2014 (MIACR-B).

Начиная с января 2015 года из расчета ставок MIACR, MIACR-IG, MIACR-B исключаются сделки, объем которых в 10 раз превышает максимальный суммарный дневной объем аналогичных сделок банка (с учетом валюты и срока) за последние шесть месяцев.

Начиная с августа 2015 года при расчете ставок MIACR, MIACR-IG, MIACR-B сделки кредитной организации, заключенные с одним контрагентом по одинаковой ставке (с учетом срока и валюты), учитываются как одна сделка.

Начиная с февраля 2016 года из расчета ставок MIACR, MIACR-IG, MIACR-B исключаются сделки между кредитными организациями, в отношении которых осуществляются меры по предупреждению банкротства, и соответствующими кредитными организациями — инвесторами.

В случае если полученная для расчета ставки MIACR, MIACR-IG или MIACR-B выборка (с учетом валюты и срока) содержит менее трех сделок, соответствующий показатель не рассчитывается.

При расчете ставок MIACR, MIACR-IG или MIACR-B исключаются обороты по сделкам с наибольшими ставками (10% от общего объема операций с учетом типа ставки, валюты и срока) и наименьшими ставками (10% от общего объема операций с учетом типа ставки, валюты и срока).

Показатели оборотов операций по сделкам межбанковского кредитования соответствуют оборотам операций, на основании которых рассчитываются ставки MIACR, MIACR-IG и MIACR-B.

Список банков-заемщиков с высоким кредитным рейтингом для расчета ставки MIACR-IG

11.03.2019

Список банков-заемщиков со спекулятивным кредитным рейтингом для расчета ставки MIACR-B

11.03.2019

Последнее обновление страницы: 15.03.2019