**Правила формування показників,**

**що подаються у звітному файлі 6NC “Дані щодо розрахунку на консолідованій основі коефіцієнта чистого стабільного фінансування (NSFRк)”**

1. Показники файла 6NC розроблено з метою отримання інформації щодо розрахунку на консолідованій основі коефіцієнта чистого стабільного фінансування (NSFRк).

Терміни та скорочення, які використані в цих Правилах, відповідають термінам та скороченням, визначеним у Методиці розрахунку коефіцієнта чистого стабільного фінансування (NSFR), схваленій рішенням Правління Національного банку України № 1001-рш від 24.12.2019 (зі змінами) (далі – Методика № 1001).

2. Під час формування показників файла 6NC слід керуватися Положенням про порядок регулювання діяльності банківських груп, затвердженим постановою Правління Національного банку України від 20.06.2012 № 254, зареєстрованим у Міністерстві юстиції України 12.07.2012 за № 1178/21490 (зі змінами) (далі ­– Положення № 254), Методикою № 1001, Методикою розрахунку коефіцієнта покриття ліквідністю (LCR), схваленою рішенням Правління Національного банку України від 15.02.2018 № 101-рш (зі змінами) (далі – Методика № 101), Інструкцією про порядок складання та оприлюднення фінансової звітності банків України, затвердженою постановою Правління Національного банку України від 24.10.2011 № 373, зареєстрованою в Міністерстві юстиції України 10.11.2011 за № 1288/20026 (зі змінами), та внутрішніми положеннями банківської групи, розробленими відповідно до пункту 2.2 глави 2 розділу VІ Положення № 254 та підпункту 3 постанови Правління Національного банку України від 05.01.2024 № 2 “Про схвалення Змін до деяких нормативно-правових актів Національного банку України”.

3. Показники щодо наявного стабільного фінансування A6NC005-A6NC027, A6NC059, A6NC060, A6NC061 розраховуються згідно з вимогами розділу ІІІ Методики № 1001. За цими показниками відображається сума до зважування на відповідний коефіцієнт ASF згідно з Додатком 1 до Методики № 1001.

4. Показники щодо необхідного стабільного фінансування A6NC030- A6NC055 розраховуються згідно з вимогами розділу ІV Методики № 1001. За цими показниками відображається сума до зважування на відповідний коефіцієнт RSF згідно з додатком 2 до Методики № 1001.

До показників A6NC032-A6NC043, A6NC045-A6NC047, A6NC049- A6NC052, A6NC054 включаються активи, які відповідають вимогам щодо повністю працюючих активів згідно з Методикою № 101-рш.

5. До показників щодо наявного та необхідного стабільного фінансування іноземних учасників A6NC028, A6NC058 включаються складові наявного стабільного фінансування та необхідного стабільного фінансування іноземних учасників кредитно-інвестиційної підгрупи банківської групи, до яких відповідними державними органами іноземних держав, що здійснюють нагляд за іноземними учасниками, установлені більш консервативні вимоги порівняно з вимогами, встановленими Національним банком. Ці складові включаються згідно з вимогами пункту 10 глави 5 розділу ІІІ Положення № 254 після зважування на відповідні коефіцієнти ASF та RSF.

6. Під час розрахунку необхідного стабільного фінансування (RSF) активи та позабалансові зобов’язання уключаються за вирахуванням резервів/зносу.

Сума резерву за окремою активною операцією не повинна перевищувати сукупної суми інших складових балансової вартості цієї операції.

7. Показники файлу 6NC наявного та необхідного стабільного фінансування, значення коефіцієнта чистого стабільного фінансування (NSFRк) банківської групи заповнюються за:

* кредитно-інвестиційною підгрупою банківської групи зі значенням “2” довідника F058;
* підгрупою банківської групи, визначеною за географічним критерієм [за учасниками підгрупи в цілому (крім страхових компаній)] зі значенням “4” довідника F058.

8. У разі застосування відповідальною особою банківської групи права, визначеного пунктом 16 розділу I Положення № 254, подається нульовий файл.

**Особливості правил формування показників**

**Опис параметрів**

**Параметр R030** – код валюти (довідник R030).

**Параметр S242** – коди строків до погашення (стабільне фінансування) (довідник S242).

**Параметр S320** – коди строків обтяження активу (довідник S320).

**Параметр F083A** – код складової балансової вартості (довідник F083A).

**Параметр F058** – код підгрупи банківської групи (довідник F058).

**НРП Q003\_2** – порядковий номер підгрупи банківської групи. Номер необхідно доповнити ведучими нулями до 2 знаків; для кредитно-інвестиційної підгрупи завжди (=01).

**Правила формування показників**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| № з/п | ASF/RSF | ID показника | Правило формування показника | |
| 1 | – | A6NC001 | **Коефіцієнт чистого стабільного фінансування (NSFRк) за всіма валютами**  1. Показник розраховується відповідно до глави 5 розділу ІІІ Положення № 254 та розділу ІІ Методики № 1001. | |
| 2 | – | A6NC002 | **Коефіцієнт чистого стабільного фінансування (NSFRк) в національній валюті**  1. Показник розраховується відповідно до глави 5 розділу ІІІ Положення № 254 та розділу ІІ Методики № 1001.  2. Показник розраховується за всіма активами та зобов’язаннями банку, які здійснені в національній валюті. | |
| 3 | – | A6NC003 | **Коефіцієнт чистого стабільного фінансування (NSFRк) за іноземними валютами**  1. Показник розраховується відповідно до глави 5 розділу ІІІ Положення № 254 та розділу ІІ Методики № 1001.  2. Показник розраховується в гривневому еквіваленті за всіма активами та зобов’язаннями банку, які здійснені в іноземній валюті.  Усі складові чисельника та знаменника NSFRк в іноземних валютах розраховуються в гривневому еквіваленті за офіційним курсом гривні до кожної з іноземної валюти, установленим Національним банком на відповідну дату. | |
| 4 | ASF | A6NC004 | **Обсяг наявного стабільного фінансування (ASF)**  1. Показник розраховується відповідно до глави 5 розділу ІІІ Положення № 254 та розділу ІІІ Методики №1001 та включає суму всіх складових наявного стабільного фінансування (ASF), зважених на відповідні коефіцієнти ASF, визначені в таблиці Додатку 1 до Методики № 1001.  2. До показника включається сума за такими показниками: A6NC005- A6NC028. | |
| 5 | ASF | A6NC005 | **Кредити, отримані від міжнародних нефінансових організацій**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – кредити, отримані від міжнародних нефінансових організацій, | |
| з урахуванням: | R020(GR=270)/T020(1,2) |
| R020(3660)/T020(2) |
| 6 | ASF | A6NC006 | **Кредити, отримані від міжнародних банків розвитку**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – кредити, отримані від міжнародних банків розвитку, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, зазначених в показнику A6NC005 |
| 7 | ASF | A6NC007 | **Кредити, отримані від інших міжнародних фінансових організацій**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – кредити, отримані від інших міжнародних фінансових організацій, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, зазначених в показнику A6NC005 |
| 8 | ASF | A6NC008 | **Сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до 1 року, на яку зменшуються складові капіталу під час розрахунку NSFRк**  1. Показник є розрахунковим та визначається як сума (вартість) власних інструментів капіталу (включаючи власні інструменти у складі частки меншості) із залишко­вим строком погашення до 1 року, включених до регулятивного капіталу кредитно-інвестиційної підгрупи банківської групи згідно з вимогами Положення № 254. | |
| 9 | ASF | A6NC009 | **Сума амортизації за власними інструментами капіталу із залишковим строком погашення від 1 до 4 років, яка не включається до розрахунку складових капіталу**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума амортизації за власними інструментами капіталу із залишковим строком погашення від 1 до 4 років, яка не включається до розрахунку складових капіталу, | |
| з урахуванням: | R020(GR=366)/T020(1,2) |
| 10 | ASF | A6NC010 | **Сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від фізичних осіб)**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від фізичних осіб), за винятком інструментів, уключених до показників A6NC059, A6NC060, | |
| з урахуванням: | R020(GR=366)/T020(1,2) |
| R020(GR=368)/T020(1,2) |
| 11 | ASF | A6NC011 | **Сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від суб’єктів господарювання та бюджетних установ)**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від СГД та бюджетних установ), за винятком інструментів, уключених до показників A6NC059, A6NC060, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, зазначених в показнику A6NC010 |
| 12 | ASF | A6NC012 | **Сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від міжнародних банків розвитку)**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від міжнародних банків розвитку), за винятком інструментів, уключених до показників A6NC059, A6NC060, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, зазначених в показнику A6NC010 |
| 13 | ASF | A6NC013 | **Сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від міжнародних нефінансових організацій)**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від міжнародних нефінансових організацій), за винятком інструментів, уключених до показників A6NC059, A6NC060, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, зазначених в показнику A6NC010 |
| 14 | ASF | A6NC014 | **Сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від інших міжнародних фінансових організацій)**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від інших міжнародних фінансових організацій), за винятком інструментів, уключених до показників A6NC059, A6NC060, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, зазначених в показнику A6NC010 |
| 15 | ASF | A6NC015 | **Сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від банків та небанківських фінансових установ)**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від банків та небанківських фінансових установ), за винятком інструментів, уключених до показників A6NC059, A6NC060, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, зазначених в показнику A6NC010 |
| 16 | ASF | A6NC016 | **Кошти фізичних осіб**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – кошти фізичних осіб, | |
| за балансовими рахунками: | R020(2620)/T020(2) |
| R020(2621)/T020(2) |
| R020(2622)/T020(2) |
| R020(2624)/T020(2) |
| R020(2628)/T020(2) |
| R020(GR=263)/T020(1,2) |
| R020(2942)/T020(2) |
| та з урахуванням: | R020(3660)/T020(2) |
| 17 | ASF | A6NC017 | **Кошти суб’єктів господарювання**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – кошти СГД, | |
| за балансовими рахунками: | R020(2600)/T020(2) |
| R020(2601)/T020(2) |
| R020(2602)/T020(2) |
| R020(2603)/T020(2) |
| R020(2604)/T020(2) |
| R020(2606)/T020(2) |
| R020(2608)/T020(2) |
| R020(2610)/T020(2) |
| R020(2616)/T020(1,2) |
| R020(2618)/T020(2) |
| R020(2932)/T020(2) |
| та з урахуванням: | R020(3660)/T020(2) |
| 18 | ASF | A6NC018 | **Кошти бюджетних установ**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – кошти бюджетних установ, | |
| за балансовими рахунками: | R020(GR=251)/T020(2) |
| R020(GR=252)/T020(2) |
| R020(GR=253)/T020(2) |
| R020(GR=254)/T020(2) |
| R020(GR=255)/T020(2) |
| R020(GR=256)/T020(2) |
| R020(GR=257)/T020(2) |
| R020(GR=264)/T020(2) |
| та з урахуванням: | R020(3660)/T020(2) |
| 19 | ASF | A6NC019 | **Кошти небанківських фінансових установ**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – кошти небанківських фінансових установ, | |
| за балансовими рахунками: | R020(2650)/T020(2) |
| R020(2651)/T020(2) |
| R020(2652)/T020(2) |
| R020(2654)/T020(2) |
| R020(2656)/T020(1,2) |
| R020(2658)/T020(2) |
| R020(2952)/T020(2) |
| та з урахуванням: | R020(GR=270)/T020(1,2) |
| R020(3660)/T020(2) |
| 20 | ASF | A6NC020 | **Кошти Національного банку**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – кошти Національного банку, | |
| за балансовими рахунками: | R020(GR=130)/T020(2) |
| R020(GR=133)/T020(1,2) |
| R020(1922)/T020(2) |
| 21 | ASF | A6NC021 | **Кошти інших банків**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – кошти інших банків, | |
| за балансовими рахунками: | R020(1500)/T020(2) |
| R020(1507)/T020(2) |
| R020(1600)/T020(2) |
| R020(1602)/T020(2) |
| R020(1608)/T020(2) |
| R020(GR=161)/T020(1,2) |
| R020(1621)/T020(2) |
| R020(1623)/T020(2) |
| R020(1626)/T020(1,2) |
| R020(1628)/T020(2) |
| R020(1932)/T020(2) |
| та з урахуванням: | R020(3660)/T020(2) |
| 22 | ASF | A6NC022 | **Цінні папери власного боргу, крім ощадних сертифікатів**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – цінні папери власного боргу, крім ощадних сертифікатів, | |
| за балансовими рахунками: | R020(GR=330)/T020(1,2) |
| R020(GR=331)/T020(1,2) |
| та з урахуванням: | R020(3661)/T020(2) |
| 23 | ASF | A6NC023 | **Ощадні сертифікати**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – ощадні сертифікати, | |
| за балансовими рахунками: | R020(GR=332)/T020(1,2) |
| R020(GR=333)/T020(1,2) |
| 24 | ASF | A6NC024 | **Операції репо з суб’єктами господарювання (забезпечене фінансування)**  1. Сума за складовою наявного стабільного забезпеченого фінансування – операції репо з СГД (забезпечене фінансування), | |
| за балансовими рахунками: | R020(2611)/T020(2) |
| R020(2616)/T020(1,2) |
| R020(2618)/T020(2) |
| 25 | ASF | A6NC025 | **Операції з Національним банком (забезпечене фінансування)**  1. Сума за складовою наявного стабільного забезпеченого фінансування – операції з Національного банку (забезпечене фінансування), | |
| за балансовими рахунками: | R020(GR=131)/T020(1,2) |
| R020(GR=132)/T020(1,2) |
| 26 | ASF | A6NC026 | **Операції репо з банками (забезпечене фінансування)**  1. Сума за складовою наявного стабільного забезпеченого фінансування – операції репо з банками (забезпечене фінансування), | |
| за балансовими рахунками: | R020(1622)/T020(2) |
| R020(1626)/T020(1,2) |
| R020(1628)/T020(2) |
| R020(1912)/T020(2) |
| 27 | ASF | A6NC027 | **Усі інші зобов'язання**  1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – усі інші зобов'язання, | |
| з урахуванням: | R020(1911)/T020(2) |
| R020(1919)/T020(2) |
| R020(GR=290)/T020(2) |
| R020(GR=292)/T020(2) |
| R020(GR=337)/T020(1,2) |
| R020(GR=338)/T020(1,2) |
| R020(3600)/T020(2) |
| R020(GR=361)/T020(2) |
| R020(GR=362)/T020(2) |
| R020(3631)/T020(2) |
| R020(GR=364)/T020(2) |
| R020(GR=365)/T020(2) |
| R020(GR=367)/T020(2) |
| R020(3705)/T020(2) |
| R020(3720)/T020(2) |
| R020(3739)/T020(2) |
| R020(5004)/T020(2) |
| R020(5011)/T020(2) |
| R020(5100)/T020(2) |
| R020(5101)/T020(2) |
| R020(5102)/T020(2) |
| R020(5103)/T020(2) |
| R020(5104)/T020(2) |
| R020(5105)/T020(2) |
| R020(5106)/T020(2) |
| R020(5107)/T020(2) |
| R020(5108)/T020(2) |
| R020(5200)/T020(2) |
| R020(5300)/T020(2) |
| R020(GR=903)/T020(2) |
| R020(9041)/T020(2) |
| R020(GR=911)/T020(2) |
| R020(9210)/T020(2) |
| R020(9310)/T020(2) |
| R020(9360)/T020(2) |
| 28 | ASF | A6NC028 | **Обсяг наявного стабільного фінансування (ASF) іноземних учасників, до яких встановлені консервативні вимоги**  1. Сума за всіма складовими наявного стабільного фінансування іноземних учасників, до яких відповідними державними органами іноземних держав, що здійснюють нагляд за іноземними учасниками, установлені більш консервативні вимоги порівняно з вимогами, встановленими Національним банком, зважена на відповідні коефіцієнти ASF.  2. Якщо установлені відповідними державними органами іноземних держав, що здійснюють нагляд за іноземними учасниками, вимоги до складових наявного стабільного фінансування не є більш консервативними порівняно з вимогами, встановленими Національним банком, показник A6NC028 не заповнюється, а наявне стабільне фінансування іноземного учасника включаються до показників A6NC005-A6NC027. | |
| 29 | RSF | A6NC029 | **Обсяг необхідного** **стабільного фінансування (RSF)**  1. Показник розраховується відповідно до глави 5 розділу ІІІ Положення № 254 та розділу ІV Методики № 1001 та включає суму всіх складових необхідного стабільного фінансування (RSF), зважених на відповідні коефіцієнти RSF, визначені в таблицях 1-3 додатку 2 до Методики № 1001.  2. До показника включається сума за такими показниками: A6NC030- A6NC058. | |
| 30 | RSF | A6NC030 | **Банкноти та монети**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – банкноти та монети, | |
| за балансовими рахунками: | R020(GR=100)/T020(1) |
| R020(1090)/T020(2) |
| 31 | RSF | A6NC031 | **Банківські метали**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – банківські метали, | |
| з урахуванням: | R020(GR=110)/T020(1) |
| R020(1190)/T020(2) |
| 32 | RSF | A6NC032 | **Кошти в Національному банку та депозитні сертифікати Національного банку**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – кошти в Національному банку та депозитні сертифікати Національного банку, | |
| з урахуванням: | R020(GR=120)/T020(1) |
| R020(1212)/T020(1) |
| R020(1216)/T020(1,2) |
| R020(1218)/T020(1) |
| R020(GR=143)/T020(1,2) |
| R020(GR=144)/T020(1,2) |
| R020(GR=145)/T020(1,2) |
| R020(1832)/T020(1) |
| R020(1839)/T020(2) |
| 33 | RSF | A6NC033 | **Цінні папери, які є високоякісними ліквідними активами**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – цінні папери, які є ВЛА [з урахуванням суми дебіторської заборгованості за ОВДП, придбаними на первинному ринку (у Міністерства фінансів України), строк якої не перевищує двох робочих днів], | |
| з урахуванням: | R020(1400)/T020(1) |
| R020(1401)/T020(1) |
| R020(1402)/T020(1) |
| R020(1403)/T020(1) |
| R020(1405)/T020(1,2) |
| R020(1406)/T020(1,2) |
| R020(1408)/T020(1) |
| R020(1410)/T020(1) |
| R020(1411)/T020(1) |
| R020(1412)/T020(1) |
| R020(1413)/T020(1) |
| R020(1415)/T020(1,2) |
| R020(1416)/T020(1,2) |
| R020(1418)/T020(1) |
| R020(1419)/T020(2) |
| R020(1420)/T020(1) |
| R020(1421)/T020(1) |
| R020(1422)/T020(1) |
| R020(1423)/T020(1) |
| R020(1426)/T020(1,2) |
| R020(1428)/T020(1) |
| R020(1429)/T020(2) |
| R020(3010)/T020(1) |
| R020(3012)/T020(1) |
| R020(3013)/T020(1) |
| R020(3015)/T020(1,2) |
| R020(3016)/T020(1,2) |
| R020(3018)/T020(1) |
| R020(3110)/T020(1) |
| R020(3112)/T020(1) |
| R020(3113)/T020(1) |
| R020(3115)/T020(1,2) |
| R020(3116)/T020(1,2) |
| R020(3118)/T020(1) |
| R020(3119)/T020(2) |
| R020(3210)/T020(1) |
| R020(3212)/T020(1) |
| R020(3213)/T020(1) |
| R020(3216)/T020(1,2) |
| R020(3218)/T020(1) |
| R020(3219)/T020(2) |
| R020(3541)/T020(1) |
| R020(9500)/T020(1) |
| 34 | RSF | A6NC034 | **Транзитні та клірингові рахунки за операціями з клієнтами**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – транзитні та клірингові рахунки за операціями з клієнтами, | |
| з урахуванням: | R020(GR=292)/T020(1) |
| R020(3705)/T020(1) |
| R020(3706)/T020(1) |
| R020(3710)/T020(1) |
| R020(3739)/T020(1). |
| 35 | RSF | A6NC035 | **Операції зворотного репо з Національним банком**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – операції зворотного репо з Національним банком, | |
| з урахуванням: | R020(1211)/T020(1) |
| R020(1216)/T020(1,2) |
| R020(1218)/T020(1) |
| 36 | RSF | A6NC036 | **Вимоги за операціями факторингу**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – вимоги за операціями факторингу, | |
| з урахуванням: | R020(GR=203)/T020(1,2) |
| R020(2042)/T020(1) |
| R020(2049)/T020(2) |
| R020(GR=233)/T020(1,2) |
| R020(2393/T020(1) |
| R020(2396)/T020(1,2) |
| R020(2397)/T020(1,2) |
| R020(2398)/T020(1) |
| 2. Якщо за операціями факторингу залишко­вий строк погашення набуває значення параметра S242=1 (на вимогу), такі операції включаються до розрахунку RSF з коефіцієнтом, визначеним в таблиці 1 додатку 2 до Методики № 1001 для операцій із залишковим строком погашення до 6 місяців. | |
| 37 | RSF | A6NC037 | **Кредити, надані клієнтам (крім банків), зі ступенем ризику активів 35% та менше**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – кредити, надані клієнтам (крім банків), зі ступенем ризику активів 35% та менше, | |
| з урахуванням: | R020(GR=201)/T020(1,2) |
| R020(GR=202)/T020(1,2) |
| R020(GR=206)/T020(1,2) |
| R020(GR=207)/T020(1,2) |
| R020(GR=208)/T020(1,2) |
| R020(GR=210)/T020(1,2) |
| R020(GR=211)/T020(1,2) |
| R020(GR=212)/T020(1,2) |
| R020(GR=213)/T020(1,2) |
| R020(GR=220)/T020(1,2) |
| R020(GR=221)/T020(1,2) |
| R020(GR=222)/T020(1,2) |
| R020(GR=223)/T020(1,2) |
| R020(GR=226)/T020(1,2) |
| R020(GR=230)/T020(1,2) |
| R020(GR=231)/T020(1,2) |
| R020(GR=232)/T020(1,2) |
| R020(GR=234)/T020(1,2) |
| R020(GR=235)/T020(1,2) |
| R020(GR=236)/T020(1,2) |
| R020(GR=237)/T020(1,2) |
| R020(GR=238)/T020(1,2) |
| R020(2390)/T020(1) |
| R020(2391)/T020(1) |
| R020(2392)/T020(1) |
| R020(2394)/T020(1) |
| R020(2395)/T020(1) |
| R020(2396)/T020(1,2) |
| R020(2397)/T020(1,2) |
| R020(2398)/T020(1) |
| R020(GR=240)/T020(1,2) |
| R020(GR=241)/T020(1,2) |
| R020(GR=242)/T020(1,2) |
| R020(GR=243)/T020(1,2) |
| R020(GR=244)/T020(1,2) |
| R020(GR=245)/T020(1,2) |
| R020(2600)/T020(1) |
| R020(2607)/T020(1) |
| R020(2609)/T020(2) |
| R020(2620)/T020(1) |
| R020(2621)/T020(1) |
| R020(2627)/T020(1) |
| R020(2629)/T020(2) |
| R020(2650)/T020(1) |
| R020(2657)/T020(1) |
| R020(2659)/T020(2) |
| R020(3560)/T020(1) |
| R020(3566)/T020(1,2) |
| R020(3568)/T020(1) |
| R020(3569)/T020(2) |
| 38 | RSF | A6NC038 | **Кредити, надані клієнтам (крім банків), зі ступенем ризику активів більше ніж 35%**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – кредити, надані клієнтам (крім банків), зі ступенем ризику активів більше ніж 35%, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, зазначених в показнику A6NC037 |
| 39 | RSF | A6NC039 | **Боргові цінні папери, які не є високоякісними ліквідними активами**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – боргові цінні папери, які не є ВЛА, | |
| з урахуванням: | R020(1400)/T020(1) |
| R020(1401)/T020(1) |
| R020(1402)/T020(1) |
| R020(1403)/T020(1) |
| R020(1404)/T020(1) |
| R020(1405)/T020(1,2) |
| R020(1406)/T020(1,2) |
| R020(1408)/T020(1) |
| R020(1410)/T020(1) |
| R020(1411)/T020(1) |
| R020(1412)/T020(1) |
| R020(1413)/T020(1) |
| R020(1414)/T020(1) |
| R020(1415)/T020(1,2) |
| R020(1416)/T020(1,2) |
| R020(1418)/T020(1) |
| R020(1419)/T020(2) |
| R020(1420)/T020(1) |
| R020(1421)/T020(1) |
| R020(1422)/T020(1) |
| R020(1423)/T020(1) |
| R020(1424)/T020(1) |
| R020(1426)/T020(1,2) |
| R020(1428)/T020(1) |
| R020(1429)/T020(2) |
| R020(3010)/T020(1) |
| R020(3011)/T020(1) |
| R020(3012)/T020(1) |
| R020(3013)/T020(1) |
| R020(3014)/T020(1) |
| R020(3015)/T020(1,2) |
| R020(3016)/T020(1,2) |
| R020(3018)/T020(1) |
| R020(3110)/T020(1) |
| R020(3111)/T020(1) |
| R020(3112)/T020(1) |
| R020(3113)/T020(1) |
| R020(3114)/T020(1) |
| R020(3115)/T020(1,2) |
| R020(3116)/T020(1,2) |
| R020(3118)/T020(1) |
| R020(3119)/T020(2) |
| R020(GR=321)/T020(1,2) |
| 40 | RSF | A6NC040 | **Акції, які пройшли процедуру лістингу на фондовій біржі**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – акції, які пройшли процедуру лістингу на фондовій біржі, | |
| з урахуванням: | R020(GR=300)/T020(1,2) |
| R020(GR=310)/T020(1,2) |
| 41 | RSF | A6NC041 | **Операції зворотного репо з банками, забезпечені високоякісними ліквідними активами**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – операції зворотного репо з банками, забезпечені ВЛА, | |
| з урахуванням: | R020(1522)/T020(1) |
| R020(1526)/T020(1,2) |
| R020(1528)/T020(1) |
| R020(1529)/T020(2) |
| R020(1532)/T020(1) |
| R020(1535)/T020(1,2) |
| R020(1536)/T020(1,2) |
| R020(1538)/T020(1) |
| R020(1542)/T020(1) |
| R020(1545)/T020(1,2) |
| R020(1546)/T020(1,2) |
| R020(1548)/T020(1) |
| R020(1549)/T020(2) |
| 42 | RSF | A6NC042 | **Операції зворотного репо з банками, забезпечені активами, які не є високоякісними ліквідними активами**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – операції зворотного репо з банками, забезпечені активами, які не є ВЛА, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, зазначених в показнику A6NC041 |
| 43 | RSF | A6NC043 | **Кошти в інших банках**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – кошти в інших банках, | |
| з урахуванням: | R020(1500)/T020(1) |
| R020(1502)/T020(1) |
| R020(1508)/T020(1) |
| R020(1509)/T020(2) |
| R020(GR=151)/T020(1,2) |
| R020(1520)/T020(1) |
| R020(1521)/T020(1) |
| R020(1524)/T020(1) |
| R020(1526)/T020(1,2) |
| R020(1528)/T020(1) |
| R020(1529)/T020(2) |
| R020(1533)/T020(1) |
| R020(1535)/T020(1,2) |
| R020(1536)/T020(1,2) |
| R020(1538)/T020(1) |
| R020(1543)/T020(1) |
| R020(1545)/T020(1,2) |
| R020(1546)/T020(1,2) |
| R020(1548)/T020(1) |
| R020(1549)/T020(2) |
| R020(1600)/T020(1) |
| R020(1607)/T020(1) |
| R020(1609)/T020(2) |
| R020(1832)/T020(1) |
| R020(1839)/T020(2) |
| 44 | RSF | A6NC044 | **Усі інші активи**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – усі інші активи, які не включені до показників A6NC030-A6NC043, A6NC045-A6NC055, A6NC056-A6NC058, | |
| з урахуванням: | R020(GR=101)/T020(1) |
| R020(GR=181)/T020(1) |
| R020(1890)/T020(2) |
| R020(GR=204)/T020(1,2) |
| R020(GR=214)/T020(1,2) |
| R020(GR=224)/T020(1,2) |
| R020(GR=280)/T020(1) |
| R020(2890)/T020(2) |
| R020(GR=340)/T020(1) |
| R020(GR=341)/T020(1) |
| R020(GR=342)/T020(1) |
| R020(GR=351)/T020(1) |
| R020(GR=352)/T020(1) |
| R020(3540)/T020(1) |
| R020(3542)/T020(1) |
| R020(3548)/T020(1) |
| R020(3500)/T020(1) |
| R020(GR=355)/T020(1) |
| R020(GR=357)/T020(1) |
| R020(GR=359)/T020(2) |
| R020(GR=410)/T020(1) |
| R020(GR=420)/T020(1) |
| R020(4321)/T020(1) |
| R020(GR=440)/T020(1,2) |
| R020(GR=441)/T020(1,2) |
| R020(GR=443)/T020(1) |
| R020(GR=450)/T020(1,2) |
| R020(4530)/T020(1) |
| R020(4600)/T020(1) |
| R020(4609)/T020(2) |
| R020(5011)/T020(1) |
| R020(5102)/T020(1) |
| R020(5104)/T020(1) |
| R020(5105)/T020(1) |
| R020(5106)/T020(1) |
| R020(5107)/T020(1) |
| R020(9200)/T020(1) |
| 45 | RSF | A6NC045 | **Операції, пов'язані з торговим фінансуванням**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – операції, пов'язані з торговим фінансуванням, | |
| з урахуванням: | R020(GR=369)/T020(2) |
| R020(GR=900)/T020(1) |
| R020(9100)/T020(1) |
| R020(9122)/T020(1) |
| 46 | RSF | A6NC046 | **Активи до отримання за спотовими контрактами (за операціями з облігаціями внутрішньої державної позики та валютними операціями, крім операцій з банківськими металами)**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – активи до отримання за спотовими контрактами (за операціями з ОВДП та валютними операціями, крім операцій з банківськими металами), | |
| з урахуванням: | R020(9350)/T020(1) |
| R020(9200)/T020(1) |
| 2. До показника включається сума операцій, строк яких не перевищує двох робочих днів. | |
| 47 | RSF | A6NC047 | **Інші безвідкличні позабалансові зобов'язання**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – інші безвідкличні позабалансові зобов'язання, які не включені до показників A6NC045 та A6NC046, | |
| з урахуванням: | R020(GR=369)/T020(2) |
| R020(GR=900)/T020(1) |
| R020(9100)/T020(1) |
| R020(9122)/T020(1) |
| R020(9129)/T020(1) |
| R020(9300)/T020(1) |
| R020(9350)/T020(1) |
| 48 | RSF | A6NC048 | **Інші позабалансові зобов'язання, які не відповідають вимогам щодо повністю працюючих**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – інші позабалансові зобов'язання, які не відповідають вимогам щодо повністю працюючих, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, які використовуються для формування показників A6NC045-A6NC047 у разі, якщо вони не відповідають вимогам щодо повністю працюючих. |
| 49 | RSF | A6NC049 | **Активи, розміщені як початкова та додаткова маржа за операціями з деривативами**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – активи, розміщені як початкова та додаткова маржа за операціями з деривативами (без урахування операцій з біржовими деривативами за дорученням клієнтів) визначається з урахуванням вимог Інструкції з бухгалтерського обліку операцій з похідними фінансовими інструментами в банках України, затвердженої постановою Правління Національного банку України від 26.12.2018 № 153 (зі змінами). | |
| 50 | RSF | A6NC050 | **Депозитні сертифікати Національного банку, які відповідають характеристикам та вимогам до високоякісних ліквідних активів, але є обтяженими**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – депозитні сертифікати Національного банку, які відповідають характеристикам та вимогам до ВЛА, але є обтяженими, | |
| з урахуванням: | R020(GR=143)/T020(1,2) |
| R020(GR=144)/T020(1,2) |
| R020(GR=145)/T020(1,2) |
| 51 | RSF | A6NC051 | **Інші цінні папери, які відповідають характеристикам та вимогам до високоякісних ліквідних активів, але є обтяженими**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – інші цінні папери, які відповідають характеристикам та вимогам до ВЛА, але є обтяженими, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, які використовуються для формування показника A6NC033 |
| 52 | RSF | A6NC052 | **Активи, які є обтяженими на невизначений строк та до яких застосовується коефіцієнт RSF 50%**  1. Сума за складовими необхідного стабільного фінансування – активи, які є обтяженими на невизначений строк (крім гарантійних депозитів учасників платіжних систем), з урахуванням балансових рахунків, які використовуються для формування показників A6NC032, A6NC034-A6NC043, A6NC045-A6NC047, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, які використовуються для формування показників A6NC032, A6NC034-A6NC043, A6NC045-A6NC047. |
| 2. До показника включаються активи у разі, якщо до них застосовується коефіцієнт RSF 50% згідно з таблицею 2 додатку 2 до Методики № 1001. | |
| 3. Активи, що є обтяженими на невизначений строк, до яких застосовуються коефіцієнти RSF як до аналогічних активів, що є необтяженими, включаються до показників A6NC032, A6NC034-A6NC043, A6NC045-A6NC047. | |
| 53 | RSF | A6NC053 | **Активи, які є обтяженими на період більше 1 року та не відповідають вимогам щодо повністю працюючих**  1. Сума за складовими необхідного стабільного фінансування – активи, які є обтяженими на період більше 1 року та не відповідають вимогам щодо повністю працюючих, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, які використовуються для формування показників A6NC032-A6NC044 |
| 54 | RSF | A6NC054 | **Активи, які є обтяженими на період більше 1 року та відповідають вимогам щодо повністю працюючих**  1. Сума за складовими необхідного стабільного фінансування – активи, які є обтяженими на період більше 1 року та відповідають вимогам щодо повністю працюючих, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, які використовуються для формування показників A6NC032-A6NC043, та |
| за балансовими рахунками: | R020(3542)/T020(1) |
| 55 | RSF | A6NC055 | **Активи, які не є обтяженими або є обтяженими на період до 1 року та не відповідають вимогам щодо повністю працюючих**  1. Сума за складовими необхідного стабільного фінансування – активи, які не є обтяженими або є обтяженими на період до 1 року та не відповідають вимогам щодо повністю працюючих, | |
| з урахуванням: | балансових рахунків, які використовуються для формування показників A6NC032-A6NC044. |
| 56 | RSF | A6NC056 | **Загальна сума позитивного результату переоцінки (актив) за деривативами**  1. Сума для розрахунку складової необхідного стабільного фінансування – загальна сума позитивного результату переоцінки (актив) за деривативами, | |
| за балансовими рахунками: | R020(GR=304)/T020(1) |
| R020(GR=314)/T020(1) |
| 57 | RSF | A6NC057 | **Загальна сума від’ємого результату переоцінки (зобов'язання) за деривативами**  1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – загальна сума від'ємного результату переоцінки (зобов'язання) за деривативами, | |
| за балансовими рахунками: | R020(GR=335)/T020(2) |
| R020(GR=336)/T020(2) |
| 58 | RSF | A6NC058 | **Обсяг необхідного стабільного фінансування (RSF) іноземних учасників, до яких встановлені консервативні вимоги**  1. Сума за всіма складовими необхідного стабільного фінансування іноземних учасників, до яких відповідними державними органами іноземних держав, що здійснюють нагляд за іноземними учасниками, установлені більш консервативні вимоги порівняно з вимогами, встановленими Національним банком, зважена на відповідні коефіцієнти RSF.  2. Якщо установлені відповідними державними органами іноземних держав, що здійснюють нагляд за іноземними учасниками, вимоги до складових необхідного стабільного фінансування не є більш консервативними порівняно з вимогами, встановленими Національним банком, показник A6NC058 не заповнюється, а необхідне стабільне фінансування іноземного учасника включаються до показників A6NC030-A6NC057. | |
| 59 | ASF | A6NC059 | **Власні інструменти капіталу із залишковим строком погашення до одного року, які включені до частки меншості, яка включена до капіталу кредитно-інвестиційної підгрупи банківської групи, але не включена до складових капіталу**  1. Сума власних інструментів капіталу із залишковим строком погашення до одного року, які включені до частки меншості, яка включена до капіталу кредитно-інвестиційної підгрупи банківської групи згідно з Положенням № 254, але не включена до складових капіталу згідно з підпунктом 1 пункту 81 розділу ІІІ Методики № 1001. | |
| 60 | ASF | A6NC060 | **Власні інструменти капіталу, які включені до частки меншості, але не включені до капіталу кредитно-інвестиційної підгрупи банківської групи**  1. Сума власних інструментів капіталу, які включені до частки меншості, але не включені до капіталу кредитно-інвестиційної підгрупи банківської групи згідно з Положенням № 254. | |
| 61 | ASF | A6NC061 | **Інші складові частки меншості, які не включені до капіталу кредитно-інвестиційної підгрупи банківської групи**  1. Сума інших складових частки меншості, які не включені до капіталу кредитно-інвестиційної підгрупи банківської групи згідно з Положенням № 254. | |