**Контроль файлу 6HX**

**Технологічний контроль (первинний на рівні XSD-схеми)**

1. Перевірка належності значень параметрів R030, S210, S080\_1, S080\_2, S083, F074, F077, F078, F102, K021 до відповідних довідників.

2. Значення НРП Q003\_2, Q003\_4, Q007\_1 та К020 мають бути заповнені.

3. Значення НРП Q017 може складатися з кодів довжиною тільки в чотири символи та в якості розділового знаку може використовуватися тільки крапка з комою «;» або не заповнюється.

4. Значення НРП Q027 та НРП Q035 може складатися з кодів довжиною тільки в дев’ять символів та в якості розділового знаку може використовуватися тільки крапка з комою «;» або не заповнюється.

5. Значення НРП Q034 може складатися з кодів довжиною тільки в два символи та в якості розділового знаку може використовуватися тільки крапка з комою «;» або не заповнюється.

6. Перевірка на правильність заповнення НРП К020: довжина НРП К020 має складати 10 знаків.

7. Перевірка правильності надання коду ознаки ідентифікаційного/реєстраційного коду/номеру контрагента/повʼязаної з банком особи (НРП К021). НРП К021 не дорівнює "#, E".

8. Перевірка правильності надання коду валюти (R030). Параметр R030 не дорівнює "#".

9. Перевірка правильності надання метрики Т100\_1, значення метрики має бути від 0 до 1 (до п’яти знаків після коми).

10. Перевірка правильності надання метрик Т100\_2 та Т100\_3, значення метрики має бути від 0 до 1 (до двох знаків після коми).

11. Контроль на дублюючі записи. Перевірка на відсутність більше одного запису з однаковими значеннями K020 (код контрагента/повʼязаної з банком особи), R030 (код валюти), Q003\_2 (унікальний умовний порядковий номер договору), Q003\_4 (унікальний умовний порядковий номер траншу).

**Логічний контроль (вторинний)**

1. Перевірка правильності надання значення НРП К020 (код контрагента/повʼязаної з банком особи):

1.1. Якщо значення супутнього параметру НРП К021 = 3, то значення НРП К020 перевіряється на його належність довіднику RCUKRU, при невиконанні умови надається повідомлення: "Код банку [НРП К020] не знайдено у довіднику банків. Для аналізу: К020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=… ".

1.2. Якщо значення супутнього параметру НРП К021 = 4, то значення НРП К020 перевіряється на його належність довіднику RC\_BNK, при невиконанні умови надається повідомлення: "Код банку-нерезидента [НРП К020] не знайдено у довіднику зарубіжних банків. Для аналізу: К020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=… ". Помилка не є критичною.

1.3. Якщо значення супутнього параметру НРП К021 = 1 або К021 = G, то за значенням НРП К020 розраховується його контрольний розряд для перевірки правильності надання коду ЄДРПОУ. Якщо в коді допущена помилка, то надається повідомлення: "Помилковий код ЄДРПОУ: у коді установи [K020] контрольне число = [...], а має бути = [...]. Для аналізу: K020=… K021=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=… ". Помилка не є критичною.

1.4. Якщо значення супутнього параметру НРП К021 = 1 або К021 = 2 або К021 = G, то НРП К020 може містити тільки цифри. При невиконанні умови надається повідомлення: "Код ЄДРПОУ/реєстраційний номер облікової картки платника податків може містити тільки цифри. Для аналізу: K020=… K021=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=… ".

1.5. Якщо значення супутнього параметру НРП К021 = 7 або К021 = 8 або К021 = 9 або К021 = B або К021 = C, то НРП К020 повинен починатися на латинську літеру"I". При невиконанні умови надається повідомлення: "Ідентифікаційний/реєстраційний код/номер нерезидента повинен починатися на латинську літеру «I». Для аналізу: K020=… K021=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=… ".

2. Дата виникнення заборгованості/наданих банком фінансових зобов’язань (НРП Q007\_1) не повинна перевищувати дату кінцевого погашення заборгованості/наданих банком фінансових зобов’язань (НРП Q007\_2). При недотримані умови надається повідомлення: "Дата виникнення заборгованості/наданих банком фінансових зобов’язань Q007\_1 = [Q007\_1] більше дати кінцевого погашення заборгованості/наданих банком фінансових зобов’язань [Q007\_2]. Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=…". Помилка не є критичною.

3. Дата виникнення заборгованості/наданих банком фінансових зобов’язань (НРП Q007\_1) не повинна перевищувати звітну дату. При недотримані умови надається повідомлення: "Дата виникнення заборгованості/наданих банком фінансових зобов’язань Q007\_1=[Q007\_1] більше звітної дати [REPORTDATE]. Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=…".

4. НРП Q017 (код ознаки, який свідчить про високий кредитний ризик) повинен дорівнювати одному з кодів з довідника F075 (відкритих на звітну дату) або містити перелік з цих кодів з використанням розділового знаку «;» без пробілів. При недотримані умови надається повідомлення: "Помилковий код у переліку кодів ознак, які свідчать про високий кредитний ризик Q017=[Q017]. Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=…".

5. НРП Q027 (код ознаки, який свідчить про подію дефолту) повинен дорівнювати одному з кодів з довідника F076 (відкритих на звітну дату) або містити перелік з цих кодів з використанням розділового знаку «;» без пробілів. При недотримані умови надається повідомлення: "Помилковий код у переліку кодів ознак, які свідчать про подію дефолту Q027=[Q027]. Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=…".

6. НРП Q034 (код ознаки, що відповідає фактору, на підставі якого скоригований клас контрагента/пов’язаної з банком особи) повинен дорівнювати одному з кодів з довідника F079 (відкритих на звітну дату) або містити перелік з цих кодів з використанням розділового знаку «;» без пробілів. При недотримані умови надається повідомлення: "Помилковий код у переліку кодів ознак, що відповідають фактору, на підставі якого скоригований клас контрагента/пов’язаної з банком особи Q034=[Q034]. Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=…".

7. НРП Q035 (код ознаки події дефолту) повинен дорівнювати одному з кодів з довідника F080 (відкритих на звітну дату) або містити перелік з цих кодів з використанням розділового знаку «;» без пробілів. При недотримані умови надається повідомлення: "Помилковий код у переліку кодів ознак події дефолту Q035=[Q035]. Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=…".

8. Якщо за контрагентом/пов`язаною з банком особою значення супутнього параметру НРП К021 становить 1 або 8, або C за одним договором (НРП Q003\_2)/траншем (НРП Q003\_4)/валютою (R030), то виконується наступна перевірка даних файлів 6НX та 6IX.

Якщо щодо активної операції у файлі 6HX за НРП Q027 зазначено код “164100000”, при цьому у файлі 6IX дані про цю операцію відображені за одним з показників A6I001-A6I003 з використанням одного з балансових рахунків: 2010 А, 2020 А, 2030 А, 2040 А, 2041 А, 2042 А, 2043 А, 2044 А, 2045 А, 2060 А, 2063 А, 2071 А, 2083 А, 2301 А, 2303 А, 2310 А, 2311 А, 2320 А, 2321 А, 2330 А, 2331 А, 2340 А, 2341 А, 2351 А, 2353 А, 2390 А, 2391 А, 2392 А, 2393 А, 2394 А, 2395 А, 2600 А, 2650 А, то параметр F077 (код ознаки своєчасності сплати боргу) за цієї операцією у файлі 6HX повинен дорівнювати “593” (прострочення боргу більше 91 дня). При недотримані умови надається повідомлення: “Помилковий код ознаки своєчасності сплати боргу F077 =[F077] для юридичної особи, яка відповідно до підпункту 1 пункту 164 Положення № 351 має ознаку, яка свідчить про подію дефолту. Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=…”.

9. Якщо значення супутнього параметру НРП К021 = 1 або К021 = 8 або К021 = C та значення параметру F077 = 591, то параметр S080\_2 (код скоригованого класу контрагента/пов'язаної з банком особи) повинен дорівнювати «E» або «F» або «G» або «H» або «I» або «J». При недотримані умови надається повідомлення: "Помилковий код скоригованого класу контрагента/пов'язаної з банком особи S080\_2 =[ S080\_2] для юридичної особи, яка відповідно до пункту 59 Положення № 351 має ознаку, яка свідчить про прострочення боргу від 31 до 60 днів. Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=… K021=… ".

10. Якщо значення супутнього параметру НРП К021 = 1 або К021 = 8 або К021 = C та значення параметру F077 = 592, то параметр S080\_2 (код скоригованого класу контрагента/пов'язаної з банком особи) повинен дорівнювати «H» або «I» або «J». При недотримані умови надається повідомлення: "Помилковий код скоригованого класу контрагента/пов'язаної з банком особи S080\_2 =[ S080\_2] для юридичної особи, яка відповідно до пункту 59 Положення № 351 має ознаку, яка свідчить про прострочення боргу від 61 до 90 днів. Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=… K021=… ". Помилка не є критичною.

11. Якщо значення супутнього параметру НРП К021 = 1 або К021 = 8 або К021 = C та значення параметру F077 = 593, то параметр S080\_2 (код скоригованого класу контрагента/пов'язаної з банком особи) повинен дорівнювати «J». При недотримані умови надається повідомлення: "Помилковий код скоригованого класу контрагента/пов'язаної з банком особи S080\_2 =[ S080\_2] для юридичної особи, яка відповідно до пункту 59 Положення № 351 має ознаку, яка свідчить про прострочення боргу більше 91 дня. Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=… K021=… ".

12. Якщо значення параметру S080\_1 = # та значення НРП Q027 не містить код «164216517», то параметр S080\_2 (код скоригованого класу контрагента/пов'язаної з банком особи) повинен дорівнювати «#». При недотримані умови надається повідомлення: "Помилковий код скоригованого класу S080\_2 =[ S080\_2] для контрагента/пов'язаної з банком особи у якої код класу (S080\_1) дорівнює «#» та код ознаки, яка свідчить про подію дефолту (Q027) не дорівнює «164216517». Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=… Q027=…".

13. Якщо значення параметру S080\_1 = # та значення НРП Q027 містить код «164216517», то параметр S080\_2 (код скоригованого класу контрагента/пов'язаної з банком особи) повинен дорівнювати «J» або «Q». При недотримані умови надається повідомлення: "Помилковий код скоригованого класу S080\_2 =[ S080\_2] для контрагента/пов'язаної з банком особи у якої код класу (S080\_1) дорівнює «#» та код ознаки, яка свідчить про подію дефолту (Q027) дорівнює «164216517». Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=…".

14. Перевірка можливих значень метрики Т100\_1 відповідно до можливих сполучень значень параметрів S083, К021, R030, S080\_1 та S080\_2 за таблицею KOD\_6HX\_2. Якщо параметри S083, К021, R030, S080\_1 та S080\_2 набувають значень з таблиці KOD\_6HX\_2, то значення метрики Т100\_1 повинно знаходитися в діапазоні, зазначеному в колонці Т100\_1 таблиці KOD\_6HX\_2. Повідомлення у разі невиконання умови: «Помилкове значення коефіцієнта PD T100\_1=[T100\_1], а має бути відповідно до таблиці KOD\_6HX\_2 [діапазон значень з колонки T100\_1 таблиці KOD\_6HX\_2], порядковий номер можливого сполучення = [значення з колонки порядковий номер таблиці KOD\_6HX\_2]. Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=… S083=… К021=… R030=… S080\_1=… S080\_2=… ".

**Таблиця KOD\_6HX\_2**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Порядковий номер** | **S083** | **К021** | **R030** | **S080\_1** | **S080\_2** | **T100\_1** |
| 1 | 1 | 2 | 980 | ≠# | M | 0,0000≤ T100\_1<0,1599 |
| 2 | 1 | 2 | ≠980 | ≠# | M | 0,0000≤ T100\_1<0,1799 |
| 3 | 1 | 3 | будь-яке значення за параметром R030 | ≠# | M | 0,0000≤ T100\_1<0,1300 |
| 4 | 1 | 4 | будь-яке значення за параметром R030 | ≠# | M | 0,0000≤ T100\_1<0,0015 |
| 5 | 1 | G | будь-яке значення за параметром R030 | ≠# | M | 0,0000≤ T100\_1<0,0500 |
| 6 | 1 | 2 | 980 | ≠# | N | 0,1300≤ T100\_1<0,4099 |
| 7 | 1 | 2 | ≠980 | ≠# | N | 0,1400≤ T100\_1<0,4499 |
| 11 | 1 | 2 | 980 | ≠# | O | 0,3300≤ T100\_1<0,7699 |
| 12 | 1 | 2 | ≠980 | ≠# | O | 0,3600≤ T100\_1<0,8099 |
| 16 | 1 | 2 | 980 | ≠# | P | 0,6300≤ T100\_1<0,9999 |
| 17 | 1 | 2 | ≠980 | ≠# | P | 0,6900≤ T100\_1<0,9999 |
| 18 | 1 | 3 | будь-яке значення за параметром R030 | ≠# | P | 0,3700≤ T100\_1<1,0000 |
| 19 | 1 | 4 | будь-яке значення за параметром R030 | ≠# | P | 0,5000≤ T100\_1<1,0000 |
| 21 | 1 | 2, 3, 4, G | будь-яке значення за параметром R030 | ≠# | Q | 1,0000 |
| 22 | 2 | будь-яке значення за параметром K021 | будь-яке значення за параметром R030 | K | K | 0,0000≤ T100\_1<1,0000 |
| 23 | 2 | будь-яке значення за параметром K021 | будь-яке значення за параметром R030 | L | L | 1,0000 |
| 24 | 0 | будь-яке значення за параметром K021 | будь-яке значення за параметром R030 | # | # | 0 |

15. Перевірка правильності надання значень параметра S080\_2 та метрики Т100\_1 відповідно до можливих сполучень значень НРП Q027 та Q035 за таблицею KOD\_6HX\_3. Якщо НРП Q027 та Q035 набувають значень з таблиці KOD\_6HX\_3, то значення метрики Т100\_1 повинно дорівнювати «1» та значення параметра S080\_2 повинно дорівнювати «J» або «Q». Повідомлення у разі невиконання умови: «Помилкове значення коефіцієнта PD T100\_1=[T100\_1] та/або параметра S080\_2=[S080\_2]. Значення метрики Т100\_1 має дорівнювати «1» та значення параметра S080\_2 має дорівнювати «J» або «Q», порядковий номер можливого сполучення = [значення з колонки порядковий номертаблиці KOD\_6HX\_3]. Для аналізу: K020=… Q003\_2=… R030=… Q003\_4=… Q027=… Q035=… ".

**Таблиця KOD\_6HX\_3**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Порядковий номер** | **Q027** | **Q035** | **S080\_2** | **T100\_1** |
| 1 | 164216601 | не заповнюється | J або Q | 1 |
| 2 | 164216602 | не заповнюється | J або Q | 1 |
| 3 | 164216603 | не заповнюється | J або Q | 1 |
| 4 | 164216604 | не заповнюється | J або Q | 1 |
| 5 | 164216605 | не заповнюється | J або Q | 1 |
| 6 | 164216606 | не заповнюється | J або Q | 1 |
| 7 | 164216607 | не заповнюється | J або Q | 1 |
| 8 | 164216608 | не заповнюється | J або Q | 1 |
| 9 | 164216609 | не заповнюється | J або Q | 1 |

16. Перевірка правильності надання НРП К020 та НРП Q003\_2 у файлі 6HX. Значення НРП К020 та НРП Q003\_2, які надано у файлі 6HX, повинні бути присутнім у файлі 6GX на відповідну звітну дату. При недотримані умови надається повідомлення: "Дані за валютами та траншами за договором НРП Q003\_2=[Q003\_2] з контрагентом/пов’язаною з банком особою НРП К020=[К020], які надано у файлі 6HX, відсутні у файлі 6GX на відповідну звітну дату".

17. Перевірка правильності надання НРП К020 та НРП Q003\_2 у файлі 6HX. Значення НРП К020 та НРП Q003\_2 у файлі 6GX на звітну дату повинно бути присутнім у файлі 6HX на відповідну звітну дату. При недотримані умови надається повідомлення: "Дані за договором НРП Q003\_2=[Q003\_2] з контрагентом/пов’язаною з банком особою НРП К020=[К020], які надані у файлі 6GX, відсутні у файлі 6HX на відповідну звітну дату".