**Правила формування показників,**

**що подаються у звітному файлі 6NX “Дані щодо розрахунку коефіцієнта чистого стабільного фінансування (NSFR)”.**

1. Показники щодо наявного стабільного фінансування A6N005-A6N015, B6N003-B6N012, B6N014 розраховуються згідно з вимогами розділу ІІІ Методики розрахунку коефіцієнта чистого стабільного фінансування (NSFR), затвердженої рішенням Правління Національного банку України № 1001-рш (далі – Методика №1001). За цими показниками відображається сума до зважування на відповідний коефіцієнт ASF згідно з Додатком 1 до Методики №1001.

2. Показники щодо необхідного стабільного фінансування A6N016-A6N037, A6N040-A6N044, B6N001-B6N002, B6N013 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.

3. До показників A6N017-A6N028, A6N030-A6N032, A6N040-A6N044 включаються активи, які відповідають вимогам щодо повністю працюючих активів згідно з Методикою розрахунку коефіцієнта покриття ліквідністю (LCR), схваленою рішенням Правління Національного банку України від 15.02.2018 № 101-рш (зі змінами).

4. Під час розрахунку необхідного стабільного фінансування (RSF) активи та позабалансові зобов’язання уключаються за вирахуванням резервів/зносу. При цьому, сума резерву за окремою активною операцією не повинна перевищувати сукупної суми інших складових балансової вартості цієї операції.

**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).

**Правила формування показників.**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № з/п | ASF/RSF | ID показника | Правило формування показника |
| 1 | – | A6N001 | **Коефіцієнт чистого стабільного фінансування (NSFR) (NSFRВВ)**1. Показник розраховується відповідно до розділу ІІ Методики №1001. |
| 2 | – | A6N002 | **Коефіцієнт чистого стабільного фінансування (NSFR) (NSFRНВ)**1. Показник розраховується відповідно до підпункту 2 пункту 2 постанови Правління Національного банку України від 24.12.2019 № 158.2. Показник розраховується за всіма активами та зобов'язаннями банку, які здійснені в національній валюті.3. Під час розрахунку показника:1) до обсягу наявного стабільного фінансування (ASF) включається регулятив­ний капітал, розрахований згідно з Інструкцією № 368;2) обсяг необхідного стабільного фінансування (RSF) зменшується на суму непокритого кредитного ризику, визначену згідно з Інструкцією № 368. |
| 3 | – | A6N003 | **Коефіцієнт чистого стабільного фінансування (NSFR) (NSFRІВ)**1. Показник розраховується відповідно до підпункту 2 пункту 2 постанови Правління Національного банку України від 24.12.2019 № 158.2. Показник розраховується в гривневому еквіваленті за всіма активами та зобов'язаннями банку, які здійснені в іноземній валюті. Усі складові чисельника та знаменника NSFRІВ розраховуються в гривневому еквіваленті за офіційним курсом гривні до кожної з іноземної валюти, установленим Національним банком на відповідну дату.3. Під час розрахунку показника:1) розрахунок обсягу наявного стабільного фінансування (ASF) здійснюється без урахування регулятивного капіталу;2) обсяг необхідного стабільного фінансування (RSF) не зменшується на суму непокритого кредитного ризику. |
| 4 | ASF | A6N005 | **Кредити, отримані від міжнародних нефінансових організацій**1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – кредити, отримані від міжнародних нефінансових організацій |
| з урахуванням: | R020(2701)/T020(2) |
| R020(2706)/T020(1,2) |
| R020(2708)/T020(2) |
| R020(3660)/T020(2). |
| 5 | ASF | A6N006 | **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 A6N005. |
| 6 | ASF | A6N007 | **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 A6N005. |
| 7 | ASF | A6N004 | **Сума капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року, на які зменшується регулятивний капітал під час розрахунку NSFR**1. Показник є розрахунковим та визначається як сума таких складових, включених до регулятивного капіталу: 1) сума капітальних інструментів із залишко­вим строком погашення до 1 року, які погаша­ються в останній рік дії угоди (договору), зважена на розмір амортизації 20% згідно з пунктом 5.7 глави 5 розділу ІІІ Інструкції №368;2) сума капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року, які погашаються згідно з графіком поступового повернення коштів раніше, ніж в останній рік дії угоди (договору), зважена на відповідний розмір амортизації згідно з пунктом 5.7 глави 5 розділу ІІІ Інструкції №368 у разі її застосування. |
| 8 | ASF | A6N008 | **Сума амортизації за капітальними інструментами із залишковим строком погашення від 1 до 4 років, яка не включається до розрахунку регулятивного капіталу банку (Н1)**1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума амортизації за капітальними інструментами із залишковим строком погашення від 1 до 4 років, яка не включається до розрахунку регулятивного капіталу банку (Н1)  |
| з урахуванням:  | R020(3660)/T020(2) |
| R020(3661)/T020(2). |
| 9 | ASF | A6N009 | **Сума** **капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від фізичних осіб)**1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від фізичних осіб)  |
| з урахуванням: | R020(GR=366)/T020(1,2) |
| R020(GR=368)/T020(1,2). |
| 10 | ASF | A6N010 | **Сума капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від суб’єктів господарювання та бюджетних установ)**1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від суб’єктів господарювання (далі – СГД) та бюджетних установ)  |
| з урахуванням:  | балансових рахунків, зазначених в показнику A6N009. |
| 11 | ASF | A6N011 | **Сума капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від міжнародних банків розвитку)**1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від міжнародних банків розвитку)  |
| з урахуванням:  | балансових рахунків, зазначених в показнику A6N009. |
| 12 | ASF | A6N012 | **Сума капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від міжнародних нефінансових організацій)**1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від міжнародних нефінансових організацій)  |
| з урахуванням: | балансових рахунків, зазначених в показнику A6N009. |
| 13 | ASF | A6N013 | **Сума капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від інших міжнародних фінансових організацій)**1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від інших міжнародних фінансових організацій)  |
| з урахуванням: | балансових рахунків, зазначених в показнику A6N009. |
| 14 | ASF | A6N014 | **Сума капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від банків та небанківських фінансових установ)**1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – сума капітальних інструментів із залишковим строком погашення до 1 року (кошти, залучені від банків та небанківських фінансових установ) |
| з урахуванням: | балансових рахунків, зазначених в показнику A6N009. |
| 15 | ASF | A6N015 | **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)/R110(R013=4) |
| R020(5011)/T020(2)/R110(R013=2) |
| R020(5100)/T020(2)/R110(R013=5) |
| 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). |
| 16 | ASF | B6N003 | **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 | B6N004 | **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)/R110(R011=1) |
| R020(2618)/T020(2)/R110(R011=1) |
| R020(2932)/T020(2) |
| та з урахуванням: | R020(3660)/T020(2). |
| 18 | ASF | B6N005 | **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 | B6N006 | **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(2701)/T020(2) |
| R020(2706)/T020(1,2) |
| R020(2708)/T020(2) |
| R020(3660)/T020(2). |
| 20 | ASF | B6N007 | **Кошти Національного банку**1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – кошти НБУ  |
| за балансовими рахунками: | R020(GR=130)/T020(2) |
| R020(GR=133)/T020(1,2) |
| R020(1922)/T020(2). |
| 21 | ASF | B6N008 | **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)/R110(R011=1,3) |
| R020(1628)/T020(2)/R110(R011=1,3) |
| R020(1932)/T020(2) |
| та з урахуванням: | R020(3660)/T020(2). |
| 22 | ASF | B6N009 | **Цінні папери власного боргу, крім ощадних (депозитних) сертифікатів**1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – цінні папери власного боргу, крім ощадних (депозитних) 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 | B6N010 | **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)/R110(R011=2) |
| R020(2618)/T020(2)/R110(R011=2). |
| 24 | ASF | B6N011 | **Операції з Національним банком (забезпечене фінансування)**1. Сума за складовою наявного стабільного забезпеченого фінансування – операції з НБУ (забезпечене фінансування)  |
| за балансовими рахунками:  | R020(GR=131)/T020(1,2) |
| R020(GR=132)/T020(1,2). |
| 25 | ASF | B6N012 | **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)/R110(R011=2) |
| R020(1628)/T020(2)/R110(R011=2) |
| R020(1912)/T020(2). |
| 26 | ASF | B6N014 | **Ощадні (депозитні) сертифікати**1. Сума за складовою наявного стабільного фінансування – ощадні (депозитні) сертифікати  |
| за балансовими рахунками:  | R020(GR=332)/T020(1,2)  |
| R020(GR=333)/T020(1,2). |
| 27 | ASF | A6N038 | **Обсяг наявного стабільного фінансування (ASF)**1. Показник розраховується відповідно до розділу ІІІ Методики №1001 та включає суму всіх складових наявного стабільного фінансування (ASF) [регулятивного капіталу та зобов’язань банку], зважених на відповідні коефіцієнти ASF, визначені в таблиці Додатку 1 до Методики № 1001. |
| 28 | RSF | A6N016 | **Банківські метали**1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – банківські метали  |
| з урахуванням: | R020(GR=110)/T020(1) |
| R020(1190)/T020(2). |
| 29 | RSF | A6N017 | **Кошти в Національному банку та депозитні сертифікати Національного банку**1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – кошти в НБУ та депозитні сертифікати НБУ  |
| з урахуванням:  | R020(GR=120)/T020(1) |
| R020(1212)/T020(1) |
| R020(1216)/T020(1,2)/R110(R011=2) |
| R020(1218)/T020(1)/R110(R011=2) |
| R020(GR=143)/T020(1,2) |
| R020(GR=144)/T020(1,2)  |
| R020(GR=145)/T020(1,2) |
| R020(1832)/T020(1)/R110(R011=4,5,9,A) |
| R020(1839)/T020(2)/R110(R011=4,5). |
| 30 | RSF | A6N018 | **Цінні папери, які є високоякісними ліквідними активами**1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – цінні папери, які є високоякісними ліквідними активами (далі – ВЛА) [з урахуванням суми дебіторської заборгованості за облігаціями внутрішньої державної позики(далі – 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)/R110(R013=3). |
| 31 | RSF | A6N019 | **Транзитні та клірингові рахунки за операціями з клієнтами банку**1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – транзитні та клірингові рахунки за операціями з клієнтами банку  |
| з урахуванням:  | R020(GR=292)/T020(1) |
| R020(3705)/T020(1) |
| R020(3710)/T020(1)  |
| R020(3739)/T020(1). |
| 32 | RSF | A6N020 | **Операції зворотного репо з Національним банком**1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – операції зворотного репо з НБУ  |
| з урахуванням: | R020(1211)/T020(1) |
| R020(1216)/T020(1,2)/R110(R011=1) |
| R020(1218)/T020(1)/R110(R011=1). |
| 33 | RSF | A6N021 | **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)/R110(R011=4) |
| R020(GR=233)/T020(1,2) |
| R020(2393/T020(1) |
| R020(2396)/T020(1,2)/R110(R011=6) |
| R020(2397)/T020(1,2)/R110(R011=6) |
| R020(2398)/T020(1)/R110(R011=6). |
| 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. |
| 34 | RSF | A6N022 | **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=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)/R110(R011=1,2,3,4,5,7,8,9) |
| R020(2397)/T020(1,2)/R110(R011=1,2,3,4,5,7,8,9) |
| R020(2398)/T020(1)/R110(R011=1,2,3,4,5,7,8,9) |
| 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=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)/R110(R011=1,3) |
| R020(3566)/T020(1,2)/R110(R011=1,3) |
| R020(3568)/T020(1)/R110(R011=1,3) |
| R020(3569)/T020(2)/R110(R011=1,3). |
| 35 | RSF | A6N023 | **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 A6N022. |
| 36 | RSF | A6N024 | **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)/R110(R011=1,2) |
| R020(1401)/T020(1)/R110(R011=3) |
| 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)/R110(R011=2) |
| R020(1411)/T020(1)/R110(R011=3) |
| 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)/R110(R011=2) |
| R020(1421)/T020(1)/R110(R011=3) |
| 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). |
| 37 | RSF | A6N025 | **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). |
| 38 | RSF | A6N026 | **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)/R110(R011=3,4) |
| R020(1528)/T020(1)/R110(R011=3,4) |
| R020(1529)/T020(2)/R110(R011=3,4) |
| R020(1532)/T020(1) |
| R020(1535)/T020(1,2)/R110(R011=1,2) |
| R020(1536)/T020(1,2)/R110(R011=1,2) |
| R020(1538)/T020(1)/R110(R011=1,2) |
| R020(1542)/T020(1) |
| R020(1545)/T020(1,2)/R110(R011=1,2) |
| R020(1546)/T020(1,2)/R110(R011=1,2) |
| R020(1548)/T020(1)/R110(R011=1,2) |
| R020(1549)/T020(2)/R110(R011=1,2). |
| 39 | RSF | A6N027 | **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 A6N026. |
| 40 | RSF | A6N028 | **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)/R110(R011=1,2,5,6) |
| R020(1528)/T020(1)/R110(R011=1,2,5,6) |
| R020(1529)/T020(2)/R110(R011=1,2,5,6) |
| R020(1533)/T020(1) |
| R020(1535)/T020(1,2)/R110(R011=3,4) |
| R020(1536)/T020(1,2)/R110(R011=3,4) |
| R020(1538)/T020(1)/R110(R011=3,4) |
| R020(1543)/T020(1) |
| R020(1545)/T020(1,2)/R110(R011=3,4) |
| R020(1546)/T020(1,2)/R110(R011=3,4) |
| R020(1548)/T020(1)/R110(R011=3,4) |
| R020(1549)/T020(2)/R110(R011=3,4) |
| R020(1600)/T020(1) |
| R020(1607)/T020(1) |
| R020(1609)/T020(2) |
| R020(1832)/T020(1)/R110(R011=2,3,6,7,8,B) |
| R020(1839)/T020(2)/R110(R011=2,3,6). |
| 41 | RSF | A6N029 | **Усі інші активи**1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – усі інші активи, які не включені до показників A6N016-A6N028, A6N030-A6N037, B6N001-B6N002, B6N013,  |
| 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=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(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)/R110(R011=2) |
| R020(4609)/T020(2)/R110(R011=2) |
| R020(5011)/T020(1)/R110(R013=1) |
| R020(5102)/T020(1) |
| R020(5104)/T020(1) |
| R020(5106)/T020(1) |
| R020(5107)/T020(1) |
| R020(9200)/T020(1). |
| 42 | RSF | A6N030 | **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). |
| 43 | RSF | A6N031 | **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. |
| 44 | RSF | A6N032 | **Інші безвідкличні позабалансові зобов'язання**1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – інші безвідкличні позабалансові зобов'язання, які не включені до показників A6N030 та A6N031,  |
| з урахуванням: | R020(GR=369)/T020(2) |
| R020(GR=900)/T020(1) |
| R020(9100)/T020(1) |
| R020(9122)/T020(1) |
| R020(9129)/T020(1)/R110(R013=1) |
| R020(9300)/T020(1). |
| 45 | RSF | A6N033 | **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 A6N030-A6N032 у разі, якщо вони не відповідають вимогам щодо повністю працюючих. |
| 46 | RSF | A6N034 | **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 НБУ від 26.12.2018 № 153. |
| 47 | RSF | A6N040 | **Депозитні сертифікати Національного банку, які відповідають характеристикам та вимогам до високоякісних ліквідних активів, але є обтяженими на період до 6 місяців**1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – депозитні сертифікати Національного банку, які відповідають характеристикам та вимогам до ВЛА, але є обтяженими на період до 6 місяців |
| з урахуванням: | R020(GR=143)/T020(1,2) |
| R020(GR=144)/T020(1,2) |
| R020(GR=145)/T020(1,2) |
| 48 | RSF | A6N041 | **Депозитні сертифікати Національного банку, які відповідають характеристикам та вимогам до високоякісних ліквідних активів, але є обтяженими на період від 6 місяців до 1 року**1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – депозитні сертифікати Національного банку, які відповідають характеристикам та вимогам до ВЛА, але є обтяженими на період від 6 місяців до 1 року |
| з урахуванням: | R020(GR=143)/T020(1,2) |
| R020(GR=144)/T020(1,2) |
| R020(GR=145)/T020(1,2) |
| 49 | RSF | A6N042 | **Інші цінні папери, які відповідають характеристикам та вимогам до високоякісних ліквідних активів, але є обтяженими на період до 6 місяців**1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – інші цінні папери, які відповідають характеристикам та вимогам до ВЛА, але є обтяженими на період до 6 місяців |
| з урахуванням: | балансових рахунків, які використовуються для формування показників A6N018 |
| 50 | RSF | A6N043 | **Інші цінні папери, які відповідають характеристикам та вимогам до високоякісних ліквідних активів, але є обтяженими на період від 6 місяців до 1 року**1. Сума за складовою необхідного стабільного фінансування – інші цінні папери, які відповідають характеристикам та вимогам до ВЛА, але є обтяженими на період від 6 місяців до 1 року |
| з урахуванням: | балансових рахунків, які використовуються для формування показників A6N018 |
| 51 | RSF | A6N044 | **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 A6N017, A6N019-A6N028, A6N030-A6N032 |
| з урахуванням: | балансових рахунків, які використовуються для формування показників A6N017, A6N019-A6N028, A6N030-A6N032. |
| 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 A6N017, A6N019-A6N028, A6N030-A6N032. |
| 52 | RSF | A6N035 | **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 A6N017-A6N029. |
| 53 | RSF | A6N036 | **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 A6N017-A6N028, та |
| за балансовими рахунками: | R020(3542)/T020(1). |
| 54 | RSF | A6N037 | **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 A6N017-A6N029. |
| 55 | RSF | B6N001 | **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). |
| 56 | RSF | B6N002 | **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). |
| 57 | RSF | B6N013 | **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). |
| 58 | RSF | A6N039 | **Обсяг необхідного** **стабільного фінансування (RSF)**1. Показник розраховується відповідно до 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. |