**Правила формування показників,**

**що подаються у звітному файлі 6SX “Дані щодо визначення банками мінімального розміру ризику розрахунку”**

1. Дані файла 6SX “Дані щодо визначення банками мінімального розміру ризику розрахунку” (далі – файл 6SX) є інформаційними даними щодо визначення банками мінімального розміру ризику розрахунку згідно з Положенням про порядок визначення банками України та банківськими групами мінімального розміру ризику розрахунку, затвердженим постановою Правління Національного банку України від 23.12.2024 № 158 (далі – Положення № 158).

Терміни та скорочення, які використані в цих Правилах, відповідають термінам та скороченням, визначеним у Положенні № 158.

2. Банк заповнює показники файла 6SX відповідно до встановлених цими Правилами вимог, ґрунтуючись на даних файла з показниками статистичної звітності 01Х “Дані про залишки на рахунках” та додаткових даних.

3. Банк визначає дані для заповнення показників файла 6SX з урахуванням вимог Положення № 158.

**Особливості правил формування показників**

**Опис параметрів**

**Метрика Т070 –** сума

**Параметр S135 –** код операції з купівлі / продажу / обміну (довідник S135)

**Параметр S590** – вид актива за операцією для визначення мінімального розміру ризику розрахунку (довідник S590)

**Правила формування показників**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № з/п | Складова визначення мінімального розміру розрахунку ризику розрахунку | ID показника | Правило формування показника |
| 1 | - | A6S001 | **Мінімальний розмір ризику розрахунку (РРоз)**1. Показник розраховується відповідно до пункту 8 розділу І Положення № 158. |
| 2 | Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати” | A6S002 | **Розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати”, за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 10% (торгова книга)**1. Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями з купівлі / продажу / обміну цінними паперами (крім операцій репо та зворотного репо), іноземної валюти, товарів, що утримуються в торговій книзі, розрахунки за якими проводяться за принципом “поставка проти оплати”, та за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 10%.Розмір ризику розрахунку визначається за кожною операцією відповідно до пункту 10 розділу ІІ Положення № 158. |
| 3 | Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати” | A6S003 | **Розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати”, за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 10% (банківська книга)**1. Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями з купівлі / продажу / обміну цінними паперами (крім операцій репо та зворотного репо), іноземної валюти, товарів, що утримуються в банківській книзі, розрахунки за якими проводяться за принципом “поставка проти оплати”, та за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 10%.Розмір ризику розрахунку визначається за кожною операцією відповідно до пункту 10 розділу ІІ Положення № 158. |
| 4 | Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати” | A6S004 | **Розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати”, за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 50% (торгова книга)**1. Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями з купівлі / продажу / обміну цінними паперами (крім операцій репо та зворотного репо), іноземної валюти, товарів, що утримуються в торговій книзі, розрахунки за якими проводяться за принципом “поставка проти оплати”, та за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 50%.Розмір ризику розрахунку визначається за кожною операцією відповідно до пункту 10 розділу ІІ Положення № 158. |
| 5 | Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати” | A6S005 | **Розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати”, за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 50% (банківська книга)**1. Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями з купівлі / продажу / обміну цінними паперами (крім операцій репо та зворотного репо), іноземної валюти, товарів, що утримуються в банківській книзі, розрахунки за якими проводяться за принципом “поставка проти оплати”, та за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 50%.Розмір ризику розрахунку визначається за кожною операцією відповідно до пункту 10 розділу ІІ Положення № 158. |
| 6 | Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати” | A6S006 | **Розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати”, за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 75% (торгова книга)**1. Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями з купівлі / продажу / обміну цінними паперами (крім операцій репо та зворотного репо), іноземної валюти, товарів, що утримуються в торговій книзі, розрахунки за якими проводяться за принципом “поставка проти оплати”, та за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 75%.Розмір ризику розрахунку визначається за кожною операцією відповідно до пункту 10 розділу ІІ Положення № 158. |
| 7 | Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати” | A6S007 | **Розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати”, за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 75% (банківська книга)**1. Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями з купівлі / продажу / обміну цінними паперами (крім операцій репо та зворотного репо), іноземної валюти, товарів, що утримуються в банківській книзі, розрахунки за якими проводяться за принципом “поставка проти оплати”, та за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 75%.Розмір ризику розрахунку визначається за кожною операцією відповідно до пункту 10 розділу ІІ Положення № 158. |
| 8 | Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати” | A6S008 | **Розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати”, за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 100% (торгова книга)**1. Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями з купівлі / продажу / обміну цінними паперами (крім операцій репо та зворотного репо), іноземної валюти, товарів, що утримуються в торговій книзі, розрахунки за якими проводяться за принципом “поставка проти оплати”, та за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 100%. Розмір ризику розрахунку визначається за кожною операцією відповідно до пункту 10 розділу ІІ Положення № 158. |
| 9 | Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати” | A6S009 | **Розмір ризику розрахунку за операціями за принципом “поставка проти оплати”, за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 100% (банківська книга)**1. Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями з купівлі / продажу / обміну цінними паперами (крім операцій репо та зворотного репо), іноземної валюти, товарів, що утримуються в банківській книзі, розрахунки за якими проводяться за принципом “поставка проти оплати”, та за якими застосовується значення мультиплікатора ризику 100%. Розмір ризику розрахунку визначається за кожною операцією відповідно до пункту 10 розділу ІІ Положення № 158. |
| 10 | Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями без принципу “поставка проти оплати” | A6S010 | **Розмір ризику розрахунку за операціями без принципу “поставка проти оплати” зі строком невиконання контрагентами зобов’язань до чотирьох робочих днів (торгова книга)**1. Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями з купівлі / продажу / обміну цінними паперами, іноземної валюти, товарів, що утримуються в торговій книзі, розрахунки за якими проводяться без принципу “поставка проти оплати”, та за якими кількість робочих днів невиконання контрагентами зобов’язань становить до чотирьох робочих днів після встановленої договорами дати виконання контрагентами зобов’язань щодо оплати, поставки / обміну активами.Розмір ризику розрахунку визначається за кожною операцією відповідно до пункту 16 розділу ІІ Положення № 158. |
| 11 | Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями без принципу “поставка проти оплати” | A6S011 | **Розмір ризику розрахунку за операціями без принципу “поставка проти оплати” зі строком невиконання контрагентами зобов’язань до чотирьох робочих днів (банківська книга)**1. Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями з купівлі / продажу / обміну цінними паперами, іноземної валюти, товарів, що утримуються в банківській книзі, розрахунки за якими проводяться без принципу “поставка проти оплати”, та за якими кількість робочих днів невиконання контрагентами зобов’язань становить до чотирьох робочих днів після встановленої договорами дати виконання контрагентами зобов’язань щодо оплати, поставки / обміну активами.Розмір ризику розрахунку визначається за кожною операцією відповідно до пункту 16 розділу ІІ Положення № 158. |
| 12 | Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями без принципу “поставка проти оплати” | A6S012 | **Розмір ризику розрахунку за операціями без принципу “поставка проти оплати” зі строком невиконання контрагентами зобов’язань п’ять та більше робочих днів (торгова книга)**1. Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями з купівлі / продажу / обміну цінними паперами, іноземної валюти, товарів, що утримуються в торговій книзі, розрахунки за якими проводяться без принципу “поставка проти оплати”, та за якими кількість робочих днів невиконання контрагентами зобов’язань становить п’ять та більше робочих днів після встановленої договорами дати виконання контрагентами зобов’язань щодо оплати, поставки / обміну активами.Розмір ризику розрахунку визначається за кожною операцією відповідно до пункту 16 розділу ІІ Положення № 158. |
| 13 | Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями без принципу “поставка проти оплати” | A6S013 | **Розмір ризику розрахунку за операціями без принципу “поставка проти оплати” зі строком невиконання контрагентами зобов’язань п’ять та більше робочих днів (банківська книга)**1. Сукупний розмір ризику розрахунку за операціями з купівлі / продажу / обміну цінними паперами, іноземної валюти, товарів, що утримуються в банківській книзі, розрахунки за якими проводяться без принципу “поставка проти оплати”, та за якими кількість робочих днів невиконання контрагентами зобов’язань становить п’ять та більше робочих днів після встановленої договорами дати виконання контрагентами зобов’язань щодо оплати, поставки / обміну активами.Розмір ризику розрахунку визначається за кожною операцією відповідно до пункту 16 розділу ІІ Положення № 158. |