

ЗАТВЕРДЖУЮ

Заступник Голови

Національного банку України

_____ Сергій НІКОЛАЙЧУК

“ ___ ” _____ 2022

Методика

розрахунку показників таблиці “Складові розрахунку коефіцієнтів покриття ліквідністю (LCR) за всіма валютами та в іноземній валюті відповідно до Методики розрахунку коефіцієнта покриття ліквідністю”

відповідно до постанови Правління Національного банку України від 15 лютого 2018 року № 11 (зі змінами)

1. Показники таблиці “Складові розрахунку коефіцієнтів покриття ліквідністю (LCR) за всіма валютами та в іноземній валюті відповідно до Методики розрахунку коефіцієнта покриття ліквідністю (далі – Таблиця 1) формуються на підставі даних, що подаються банками до Національного банку України у файлі 6КХ “Дані щодо розрахунку коефіцієнта покриття ліквідністю (LCR)” відповідно до додатку 2 Правил організації статистичної звітності, що подається до НБУ, затверджених постановою Правління НБУ від 13.11.2018 №120 (зі змінами).

2. Показники Таблиці 1 розраховуються та зважуються (відповідно до коефіцієнтів врахування показника за національною та іноземною валютами) згідно з Методикою розрахунку коефіцієнта покриття ліквідністю (LCR), схваленою рішенням Правління Національного банку України від 15.02.2018 № 101 ріш (зі змінами), з урахуванням правил формування показників, що подаються у звітному файлі 6КХ, що містяться у файлі Description_6КХ¹.

3. Колонки Таблиці 1 містять наступні групи показників:

Обсяг високоякісних ліквідних активів (ВЛА) – колонки 3 – 24;

Очікувані відпливи грошових коштів – колонки 25 – 60;

Очікувані надходження грошових коштів – колонки 61 – 80;

Чистий очікуваний відплив – колонки 81 – 82;

Коефіцієнт покриття ліквідністю (LCR) – колонки 83 – 84.

Інформаційні рядки (1-й день, ..., останній день) Таблиці 1 містять розраховані та зважені показники за 30 календарних днів, які передують звітній даті. Наприклад, для звітної дати 04.01.2022 це період 05.12.2021 – 03.01.2022 (30 календарних днів), тобто робочі дні: 06.12.2021, 07.12.2021, 08.12.2021, ..., 31.12.2021 (19 робочих днів). У рядку «Звітна дата» заповнюються лише колонки 83 – 84 (Фактичне середньоарифметичне значення коефіцієнта покриття ліквідністю (LCR) за всіма валютами (LCR_{вв}) та в іноземній валюті (LCR_{ів}) відповідно.

¹ Файл розміщено на сторінці офіційного сайту НБУ “Статистика. Організація статистичної звітності. Реєстр показників статистичної звітності” за посиланням <https://bank.gov.ua/ua/statistic/nbureport/regindicator-statreport>



ДОКУМЕНТ СЕД НБУ АСКОД

Підписувач Ніколайчук Сергій Анатолійович

Сертифікат 36186A0FEAAD76B204000000DA140000C1450000

Дійсний до: 23.07.2023 12:54:33

Національний банк України



B/32-0007/21815

від 18.03.2022 17:37

Показники формуються за станом на перший робочий день місяця,
наступного за звітним періодом у всіх валютах та іноземною валютою (далі ІВ).



ДОКУМЕНТ СЕД НБУ АСКОД

Підписувач Ніколайчук Сергій Анатолійович

Сертифікат 36186A0FEAAD76B20400000DA140000C1450000

Дійсний до: 23.07.2023 12:54:33

Національний банк України



В/32-0007/21815
від 18.03.2022 17:37

Таблиця 1

(тис. грн)

№ з/п	Звітна дата	Обсяг високоякісних ліквідних активів (ВЛА)								Очікувані відпливи грошових коштів:						Очікувані надходження грошових коштів:						Назва показника 40		Назва показника 41	
		Назва показника 1		Назва показника 2		...		Назва показника 11		Назва показника 12		...		Назва показника 29		Назва показника 30		...		Назва показника 39					
		у всіх валютах	у іноземній валюті	у всіх валютах	у іноземній валюті	у всіх валютах	у іноземній валюті	у всіх валютах	у іноземній валюті	у всіх валютах	у іноземній валюті	у всіх валютах	у іноземній валюті	у всіх валютах	у іноземній валюті	у всіх валютах	у іноземній валюті	у всіх валютах	у іноземній валюті	у всіх валютах	у іноземній валюті	у всіх валютах	у іноземній валюті	у всіх валютах	у іноземній валюті
1	2	3	4	5	6	23	24	25	26	59	60	61	62	79	80	81	82	83	84
1	1-й день																								
2	2-й день																								
...	...																								
	Останній день																								
	Звітна дата	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X	X		

4. Враховуючи велику кількість колонок, Таблиця 1 містить лише першу та останню колонку груп показників (ВЛА, очікувані відпливи грошових коштів, очікувані надходження грошових коштів, чистий очікуваний відплив), а назви показників (в таблиці - нумерація показників 1, 2, ..., 41) та алгоритми їх розрахунку наведені в Таблиці 2.



ДОКУМЕНТ СЕД НБУ АСКОД

Підписувач Ніколайчук Сергій Анатолійович
 Сертифікат 36186A0FEAAD76B204000000DA140000C1450000
 Дійсний до: 23.07.2023 12:54:33

Національний банк України



B/32-0007/21815
 від 18.03.2022 17:37

Таблиця 2

№ колонки	Назва показника	Валюта	Алгоритм
3	банкноти і монети	всі валюти	B6K001-B6K002
4		IB	
5	кошти в Національному банку	всі валюти	B6K003 (тільки національна валюта)
6		IB	X
7	ОВДП та ОЗДП, що рефінансуються Національним банком України	всі валюти	A6K011+A6K012+A6K013+A6K014+A6K106
8		IB	A6K012+A6K013+A6K014+A6K106
9	облігації внутрішніх місцевих позик та підприємств, що рефінансуються Національним банком України	всі валюти	B6K030+B6K031+A6K108+A6K109
10		IB	X
11	депозитні сертифікати Національного банку України	всі валюти	B6K025
12		IB	X
13	депозити в Національному банку України до 1 дня	всі валюти	B6K026
14		IB	X
15	боргові цінні папери міжнародних фінансових організацій/державних органів країн G-7 з рейтингами не нижче AA-/Aa3	всі валюти	A6K097
16		IB	A6K015+A6K097
17	боргові цінні папери, емітовані міжнародними банками розвитку	всі валюти	B6K024
18		IB	
19	кошти на коррахунках в інших банках з рейтингом не нижче інвест.класу, зменшені на суму незнижувального залишку	всі валюти	A6K016-A6K017+A6K089-A6K090+A6K091
20		IB	
21	сума обов'язкових резервів згідно з Положенням №806	всі валюти	OP (обов'язкові резерви, дані файлу 20X)
22		IB	X
23	загальний обсяг високоякісних ліквідних активів (ВЛА)	всі валюти	A6K006
24		IB	A6K083
25	кошти фізичних осіб	всі валюти	B6K005+A6K020+A6K018+A6K019+A6K021+B6K006
26		IB	
27	кошти суб'єктів господарської діяльності	всі валюти	B6K007+A6K024+A6K022+A6K023+A6K025+B6K023
28		IB	
29	кошти інших банків	всі валюти	A6K026+B6K008+A6K027+B6K009
30		IB	
31	кошти бюджетних установ, виборчих фондів та фонду референдуму	всі валюти	B6K010+A6K028+B6K011+B6K012+A6K079
32		IB	
33	кошти небанківських фінансових установ	всі валюти	B6K013+A6K029+A6K030+B6K014
34		IB	
35	кошти НБУ		



ДОКУМЕНТ СЕД НБУ АСКОД

Підписувач Ніколайчук Сергій Анатолійович
Сертифікат 36186A0FEAAD76B204000000DA140000C1450000
Дійсний до:23.07.2023 12:54:33

Національний банк України



B/32-0007/21815
від 18.03.2022 17:37

36		ІВ	
37	кредити від міжнародних та інших фінансових організацій	всі валюти	А6К032+А6К033+В6К017+В6К028+В6К029+А6К098
38		ІВ	
39	цінні папери власного боргу	всі валюти	А6К034+А6К035+В6К018
40		ІВ	
41	субординований борг та капітальні інструменти з умовами списання/конверсії	всі валюти	А6К036+В6К019
42		ІВ	
43	безвідкличні зобов'язання з кредитування, що надані банком	всі валюти	А6К037+А6К038+А6К039+В6К020+А6К099
44		ІВ	
45	операції, пов'язані з торговим фінансуванням (акредитиви та гарантії)	всі валюти	А6К040
46		ІВ	
47	транзитні та клірингові рахунки	всі валюти	В6К021
48		ІВ	
49	операції з деривативами	всі валюти	А6К043+А6К042
50		ІВ	
51	кредиторська заборгованість	всі валюти	А6К044
52		ІВ	
53	інші балансові та позабалансові зобов'язання, за якими банк очікує відпливи	всі валюти	А6К041
54		ІВ	
55	забезпечене фондування	всі валюти	А6К045+А6К046+А6К047+В6К027+А6К101+А6К102
56		ІВ	
57	сума простроченої заборгованості за очікуваними відпливами	всі валюти	А6К048
58		ІВ	
59	сукупні очікувані відпливи грошових коштів	всі валюти	А6К007
60		ІВ	
61	кредити фізичним особам	всі валюти	А6К049+А6К050+А6К051+А6К052+А6К053
62		ІВ	
63	кредити суб'єктам господарської діяльності	всі валюти	А6К054+А6К055+А6К056+А6К057+А6К058+А6К059
64		ІВ	
65	кредити органам державної влади та місцевого самоврядування	всі валюти	А6К060+А6К061+А6К062
66		ІВ	
67	кошти в Національному банку (які не включені до ВЛІА)	всі валюти	В6К003 (тільки ІВ) +А6К063
68		ІВ	
69	кошти інших банків	всі валюти	А6К064-А6К065+А6К066+А6К067+ А6К068+А6К069+А6К070+А6К071+А6К088
70		ІВ	
71	операції з цінними паперами (які не включені до ВЛІА)	всі валюти	А6К072
72		ІВ	



ДОКУМЕНТ СЕД НБУ АСКОД

Підписувач Ніколайчук Сергій Анатолійович
Сертифікат 36186A0FEAAD76B204000000DA140000C1450000
Дійсний до: 23.07.2023 12:54:33

Національний банк України



В/32-0007/21815
від 18.03.2022 17:37

73	операції зворотнього репо	всі валюти	A6K073+A6K074+A6K075+A6K103+A6K104+A6K105
74		ІВ	
75	операції з деривативами та дебіторською заборгованістю	всі валюти	A6K077+A6K076
76		ІВ	
77	інші операції, за якими очікуються надходження	всі валюти	B6K022+A6K078+A6K080+A6K100
78		ІВ	
79	сукупні очікувані надходження грошових коштів	всі валюти	A6K008
80		ІВ	A6K085
81	Чистий очікуваний відплив грошових коштів	всі валюти	A6K009
82		ІВ	A6K086
83	Коефіцієнт покриття ліквідністю (LCR)	всі валюти	A6K010 - для звітного періоду, A6K081 - на звітну дату
84		ІВ	A6K087 - для звітного періоду, A6K082 - на звітну дату

Колонка 21 (Сума обов'язкових резервів, що підлягають зберіганню на кореспондентському рахунку банку в Національному банку в період утримання згідно з Положенням № 806) розраховується на кожен дату звітного періоду за даними файлу 20X.

5. Для Таблиці 1 одиниця виміру – тис. грн. (колонки 3 – 82), колонки 83 – 84 у процентах.

Директор Департаменту
статистики та звітності

Юрій Половнєв

Директор Департаменту
фінансової стабільності

Первін Дадашова



ДОКУМЕНТ СЕД НБУ АСКОД

Підписувач Ніколайчук Сергій Анатолійович
Сертифікат 36186A0FEAAD76B204000000DA140000C1450000
Дійсний до: 23.07.2023 12:54:33

Національний банк України



B/32-0007/21815
від 18.03.2022 17:37