

ЗАТВЕРДЖУЮ

Заступник Голови

Національного банку України

_____ Сергій НІКОЛАЙЧУК

“ ___ ” _____ 2023

Методика

розрахунку показників таблиці “Складові розрахунку коефіцієнта покриття ліквідністю (LCR) за всіма валютами ($LCR_{\text{ВВ}}$) та в іноземній валюті ($LCR_{\text{ІВ}}$) 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 коефіцієнта покриття ліквідністю (LCR) за всіма валютами ($LCR_{\text{ВВ}}$) та в іноземній валюті ($LCR_{\text{ІВ}}$) 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 Національного банку України, затверджених постановою Правління Національного банку України 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-рш (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 грошових коштів – колонки 81 – 82;

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

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/32-0007/49229

від 26.04.2023 18:54

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.

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 36186A0FEAAD76B204000000DA140000C1450000

Дійсний до: 23.07.2023 12:54:33

Національний банк України



В/32-0007/49229

від 26.04.2023 18:54

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 вплив грошових коштів), 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/32-0007/49229
від 26.04.2023 18:54

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	A6K015+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+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	+A6K092
27	кошти суб'єктів господарської діяльності	всі валюти	B6K007+A6K024+A6K022+A6K023+A6K025+B6K023
28		IB	+A6K093
29	кошти інших банків	всі валюти	A6K026+B6K008+A6K027+B6K009+A6K107
30		IB	
31	кошти бюджетних установ, виборчих фондів та фонду референдуму	всі валюти	B6K010+A6K028+B6K011+B6K012+A6K079
32		IB	



ДОКУМЕНТ СЕД НБУ АСКОД

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

Національний банк України



B/32-0007/49229
від 26.04.2023 18:54

33	кошти небанківських фінансових установ	всі валюти	B6K013+A6K029+A6K030+B6K014+A6K094+A6K095
34		IB	
35	кошти НБУ	всі валюти	B6K015+A6K031+B6K016
36		IB	
37	кредити від міжнародних та інших фінансових організацій	всі валюти	A6K032+A6K033+B6K017+B6K028+B6K029+A6K098
38		IB	
39	цінні папери власного боргу	всі валюти	A6K034+A6K035+B6K018+A6K096
40		IB	
41	субординований борг та капітальні інструменти з умовами списання/конверсії	всі валюти	A6K036+B6K019
42		IB	
43	безвідкличні зобов'язання з кредитування, що надані банком	всі валюти	A6K037+A6K038+A6K039+B6K020+A6K099
44		IB	
45	операції, пов'язані з торговим фінансуванням (акредитиви та гарантії)	всі валюти	A6K040
46		IB	
47	транзитні та клірингові рахунки	всі валюти	B6K021
48		IB	
49	операції з деривативами	всі валюти	A6K043+A6K042
50		IB	
51	кредиторська заборгованість	всі валюти	A6K044
52		IB	
53	інші балансові та позабалансові зобов'язання, за якими банк очікує відпливи	всі валюти	A6K041
54		IB	
55	забезпечене фондування	всі валюти	A6K045+A6K046+A6K047+B6K027+A6K101+A6K102
56		IB	
57	сума простроченої заборгованості за очікуваними відпливами	всі валюти	A6K048
58		IB	
59	сукупні очікувані відпливи грошових коштів	всі валюти	A6K007
60		IB	
61	кредити фізичним особам	всі валюти	A6K049+A6K050+A6K051+A6K052+A6K053
62		IB	
63	кредити суб'єктам господарської діяльності	всі валюти	A6K054+A6K055+A6K056+A6K057+A6K058+A6K059
64		IB	
65	кредити органам державної влади та місцевого самоврядування	всі валюти	A6K060+A6K061+A6K062
66		IB	



ДОКУМЕНТ СЕД НБУ АСКОД

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

Національний банк України



B/32-0007/49229
від 26.04.2023 18:54

67	кошти в Національному банку (які не включені до ВЛА)	всі валюти	B6K003 (тільки IB) +A6K063+B6K032
68		IB	B6K003+A6K063+B6K032
69	кошти інших банків	всі валюти	A6K064-A6K065+A6K066+A6K067+
70		IB	A6K068+A6K069+A6K070+A6K071+A6K088
71	операції з цінними паперами (які не включені до ВЛА)	всі валюти	A6K072
72		IB	
73	операції зворотнього репо	всі валюти	A6K073+A6K074+A6K075+A6K103+A6K104+A6K105
74		IB	
75	операції з деривативами та дебіторською заборгованістю	всі валюти	A6K077+A6K076
76		IB	
77	інші операції, за якими очікуються надходження	всі валюти	B6K022+A6K078+A6K080+A6K100
78		IB	
79	сукупні очікувані надходження грошових коштів	всі валюти	A6K008
80		IB	A6K085
81	Чистий очікуваний вплив грошових коштів	всі валюти	A6K009
82		IB	A6K086
83	Коефіцієнт покриття ліквідністю (LCR)	всі валюти	A6K010 - для звітного періоду, A6K081 - на звітну дату
84		IB	A6K087 - для звітного періоду, A6K082 - на звітну дату

Колонка 21 (Сума обов'язкових резервів, що підлягають формуванню та зберіганню у період утримання згідно з Положенням про порядок формування та зберігання обов'язкових резервів банками України та філіями іноземних банків в Україні, затвердженим постановою Правління Національного банку України від 11 грудня 2014 року № 806 (зі змінами)) розраховується на кожну дату звітного періоду за даними файлу 20X.

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

Заступник директора
Департаменту статистики
та звітності

Віталій БАТКОВСЬКИЙ



ДОКУМЕНТ СЕД НБУ АСКОД
Підписувач Ніколайчук Сергій Анатолійович
Сертифікат 36186A0FEAAD76B204000000DA140000C1450000
Дійсний до:23.07.2023 12:54:33

Директор Департаменту
фінансової стабільності

Первін ДАДАШОВА



В/32-0007/49229
від 26.04.2023 18:54