

СОВРЕМЕННАЯ ОТЧЕТНОСТЬ: ПРАКТИЧЕСКИЕ СОВЕТЫ И ИНСТРУМЕНТЫ

Игорь Шабанин,
заместитель директора по развитию
прикладных решений департамента
«Экономика данных»

ПЛАН ВЕБИНАРА



Изменения в отчетности



Формы 0409401 и 0409410



Форма 0409129



Форма 0409110



Форма 0409634



Рыночный риск



Форма 0409122



Вопросы, ответы

ОПЫТ «ДИАСОФТ» В РЕГУЛЯТОРНОЙ ОТЧЕТНОСТИ

48

отчетных готовых форм ЦБ РФ,
реализованных для нескольких
платформ:

- Oracle
- Greenplum (Arenadata)
- Digital Q.DataBase
- PostgreSQL

15

ЛЕТ

опыт автоматизации обязательной
отчетности

24

РЕАЛИЗОВАННЫХ ПРОЕКТА

по автоматизации процессов
подготовки отчетности

600

**+ ГОТОВЫХ ПРАВИЛ
ПРОВЕРКИ ДАННЫХ**

развитая система контроля
качества данных

ИЗМЕНЕНИЯ В ОТЧЕТНОСТИ

Новый номер отчетности 6800-У

67 ФОРМ
УПОМЯНУТО
В УКАЗАНИИ

24 ИЗМЕНЕНИЯ
В ФОРМЕ

110, 115, 123, 128, 129, 155, 159,
264, 265, 301, 302, 303, 310, 316
345, 401, 407, 410, 501, 603, 634
704, 808, 814

2 НОВЫЕ
ФОРМЫ

718, 730

2 ФОРМЫ
УТРАТИЛИ
СИЛУ

717, 729

ПОДДЕРЖКА ЗАКОНОДАТЕЛЬСТВА

ЧТО ПОДДЕРЖИВАЕМ

- Изменение нормативных актов
- Программы Банка России
- Разъяснение, ответы на запросы

КАК ПОДДЕРЖИВАЕМ

- Существует одна версия отчета для всех клиентов
- Разночтения алгоритма регулируются настройками
- Поддержка законодательства до даты первого применения или в течение 20 дней со дня публикации

ФОРМА 0409401

Отчет уполномоченного банка об иностранных операциях

Татьяна Титоренко,
ведущий бизнес-аналитик департамента
«Экономика данных»

ПОДДЕРЖКА ЗАКОНОДАТЕЛЬСТВА (ФОРМЫ 0409401 И 0409410)

№ 6406-У (№6800-У – НА ЭКСПЕРТИЗЕ)

- «О формах, сроках, порядке составления и представления отчетности кредитных организаций (банковских групп) в Банк России, а также о перечне информации о деятельности кредитных организаций (банковских групп)»
- Изменение расчета и настроек форм на **01.02.2025**

№ 809-П

- «О Плане счетов бухгалтерского учета для кредитных организаций и порядке его применения»
- Изменение расчета и настроек форм при добавлении новых балансовых счетов

МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ (№ 5-МР ОТ 11.03.2024)

- «Методические рекомендации по формированию показателей разделов 1 и 2 формы отчетности 0409401 «Отчет уполномоченного банка об иностранных операциях»
- Изменение расчета и настроек форм на **01.04.2024**

СЕМИНАРЫ ОТ БАНКА РОССИИ И РАЗЪЯСНЕНИЯ

- На платформах:
 - Ассоциация «Россия»
 - АНО ДПО «БизнесШколаКонсультант»
 - Сайт: <https://www.cbr.ru/>
- Изменение расчета и настроек форм оперативно по мере поступления информации, включая целевые разъяснения от БР

МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ

Используемые для расчета форм, реализованы через настроечные таблицы (далее – НТ)

- ✓ Методические рекомендации по формированию показателей разделов 1 и 2 формы отчетности **0409401** от 11.03.2024 **№ 5-МР** (на 01.04.2024).
Реализация через НТ «Форма 401 - Настройка счетов»).
- ✓ Методические рекомендации об отражении операций в форме отчетности **0409401** от 26 июня 2019 года **№ 19-МР**.
Реализация через НТ «Форма 401 - Настройка граф (универсальная)» и НТ «Форма 401 - Настройка граф»).
- ✓ Методические рекомендации о расчете нераспределенной прибыли (убытка) отчитывающегося банка в форме отчетности **0409401 № 5-МР** от 18 февраля 2016 года.
Реализация через НТ «Форма 401 - Расчет прибыли»).

ОПИСАНИЕ ОСНОВНЫХ НАСТРОЕЧНЫХ ТАБЛИЦ ФОРМЫ (НТ)

Наименование НТ	Кратко смысл/ используемые атрибуты
Форма 401 – Общие настройки	Для регулирования параметров расчета. Например, Формирование детализации; Расчет реестров проводок, данных отнесения к строкам; Расчет итоговой формы; расчет по конкретному подразделению (ГО или Филиалу); использование ежедневного или ежемесячного баланса; Переопределение срока по процентам; Расчёт с учетом СПОД (на основании ф.102); Расчет долговых ЦБ (501, 502, 504) по рыночной стоимости и т.п. и т.п.
Форма 401 и 410 - Настройка счетов	Настройка строк Формы с учетом БС и соответствующих атрибутов (25 штук)
Форма 401 - Участие в капитале	Для регулирования параметров расчета по участию нерезидентов в Капитале: Дата начала/окончания действия доли/суммы; Доля участия банка/нерезидента; Код валюты прибыли; Лицевой Счет (ЛС) нерезидента; Код сектора 401 (при заполнении ЛС); Код сектора 410 (при заполнении ЛС); Код страны (при заполнении ЛС); Нерезидент (наименование).
Форма 401 - Настройка граф (универсальная)	Для регулирования параметров расчета граф (стандартный расчет) с учетом атрибутов: Номер графы; Основной счет; Корр. счет; Назначение корр. счета; Назначение осн. счета; Основание проводки; Признак резидента корр. счета; Признак резидента осн. счета; Код валюты корр. счета; Код валюты корр. счета; Роль корр. счета; Роль осн. счета; Признак вхождения в отчет; Сторона проводки.
Форма 401 - Атрибуты отчета	Для определения атрибутов по определенным БС, валютам и клиентам Банка: Группа счетов; Код валюты; Клиент; Признак резидента клиента; Код сектора ф.401; Код сектора ф.410; Код страны; Признак вхождения в отчет.
Форма 401 - Настройка сумм по отдельным строкам	Для определения стоимости инвестиционных паев: Аналитический счет; Дата начала/окончания действия; Код валюты; Количество паев; Стоимость пая и т.п.
Форма 401 - Расчет прибыли	Для расчета прибыли (убытка): Символ формы 102; Знак; Сумма по символу; Нераспределенная прибыль; Текущий налог на прибыль.
Форма 401 и 410 - Код срочности по БС	Для отдельных случаев, когда сделку можно идентифицировать по БС с учетом срочности: БС; Код срочности по остаточному сроку; Приоритет

ИЗМЕНЕНИЯ В ФОРМЕ

До 01.01.2025

После 01.01.2025

В Отчет включаются данные

В разделы 1 и 2 включаются данные: головного офиса и его филиалов

Головного офиса и его филиалов в агрегированном (объединенном) виде

Показатели разделов 1 и 2 представляются в разрезе

- типа нерезидента
- принадлежности нерезидента к институциональному сектору экономики
- страны регистрации нерезидента

- типа нерезидента
- принадлежности нерезидента к институциональному сектору экономики
- страны регистрации нерезидента
- валют, в которых номинированы иностранные активы и пассивы
- остаточного срока погашения финансового инструмента

Код «валюта актива» и «валюта пассива»

Проставлялся **только** для нерезидентов, связанных с уполномоченным банком отношениями в рамках прямого инвестирования (ОРПИ)

Добавлен для активов и обязательств по отношению **ко всем контрагентам** кредитных организаций – **нерезидентам**.

В заголовочной части разделов 1 и 2 в поле «Код нерезидента»

Указывается код нерезидента, состоящий из **пяти** частей (кодов)

Указывается код нерезидента, состоящий из **семи** частей (кодов)

ИЗМЕНЕНИЯ В ФОРМЕ

До 01.01.2025

После 01.01.2025

Код Сектор нерезидента

- 100 - Иностранные банки, кроме центральных банков
- 200 - Центральные банки, в том числе Европейский центральный банк (European Central Bank)
- 500 - Прочие нерезиденты (включая международные организации, в том числе международные финансовые организации), кроме физических лиц
- 540 - Физические лица

- 100 - Иностранные банки, кроме центральных банков
- 200 - Центральные банки, в том числе Европейский центральный банк (European Central Bank)
- 400 - Международные организации
- 510 - Небанковские финансовые организации
- 520 - Органы государственного управления
- 530 - Нефинансовые корпорации
- 540 - Физические лица
- 550 - Сектор не определен

Показатель «Код Валюты»

В расчет участвует ограниченная группа валют, Остальные группировались в код 999. В заголовочной части раздела 1 в поле «Код валюты актива» и раздела 2 в поле «Код валюты пассива» указывается один из следующих кодов валют:

- | | |
|----------------------------|--|
| ▪ 643 - Российский рубль; | ▪ 392 - Иена; |
| ▪ 840 - Доллар США; | ▪ 933 - Белорусский рубль; |
| ▪ 978 - Евро; | ▪ 398 - Тенге; |
| ▪ 826 - Фунт стерлингов; | ▪ 156 - Юань; |
| ▪ 756 - Швейцарский франк; | ▪ 999 - Прочие иностранные валюты и ДМ |

В заголовочной части раздела 1 в поле «Код валюты актива» и раздела 2 в поле «Код валюты пассива» указывается трехзначный цифровой код валюты иностранного актива (обязательства) в соответствии с **Общероссийским классификатором валют (ОКВ)**.

Для драгоценных металлов (кроме драгоценных металлов в физической форме), а также в случае отсутствия информации о валюте, в которой номинирован иностранный актив (обязательство), указывается код «999».

ИЗМЕНЕНИЯ В ФОРМЕ

До 01.01.2025

После 01.01.2025

Введен новый показатель:

Код срочности по остаточному сроку до погашения:

- ST - до 1 года включительно;
- MT - от 1 года до 2 лет;
- LT - свыше 2 лет;
- UT - срок погашения неизвестен.

Остаточный срок до погашения для целей составления Отчета представляет собой временной интервал между отчетной датой и датой полного (окончательного) погашения финансового инструмента в соответствии с договором.

ИТОГ ОСНОВНЫХ ИЗМЕНЕНИЙ В ФОРМЕ ОТЧЕТНОСТИ 0409401

- ✓ Упразднена филиальная разбивка представляемых в Банк России данных для разделов 1 и 2.
- ✓ Код «валюта актива» и «валюта пассива» в соответствии с ОКВ добавлен для активов и обязательств по отношению ко всем контрагентам кредитных организаций – нерезидентам, не связанным с отчитывающимися кредитными организациями отношениями прямого инвестирования (ОРПИ). Ранее код «валюта актива» и «валюта пассива» проставлялся составителями отчетности только для нерезидентов, связанных с отчитывающимся банком ОРПИ.
- ✓ Расширен перечень кодов секторов контрагентов кредитных организаций – нерезидентов и приведен в соответствие с перечнем, использовавшимся для упраздненных показателей раздела 1 формы 0409410.
- ✓ Введены коды срочности по остаточному сроку погашения фин. инструментов.
- ✓ Изменен внешний вид формы:
 - в заголовочной части разделов 1 и 2 в поле «Код нерезидента» добавлено два новых кода: валюта актива / пассива и срок погашения;
 - строка А15 Раздела 1 (изменилась формулировка и содержание: добавлены в расчет не погашенный в срок проценты);
 - строка П14 Раздела 2 (изменилась формулировка и содержание: добавлены в расчет не погашенный в срок проценты);
 - удалены строки А16 Раздела 1 и П15 раздела 2.

ФОРМА 0409401

АТТРИБУТИВНЫЙ СОСТАВ

- Форма 401 – **17 + 1 НОВЫЙ**
- Форма 401 - Реестр данных (обороты) – **89**
- Форма 401 и **410** - Реестр данных (остатки) – **120 + 2 НОВЫХ**
- Форма 401 – Отнесение данных в отчет – **122 + 2 НОВЫХ**
- Форма 401 Детализация - Раздел 3 – **19**
- Форма 401 Раздел 3 Подраздел 3.1 – **16**
- Форма 401 Раздел 3 Подраздел 3.2 – **15**

РАССЧИТАННЫЕ/ОБОГАЩЕННЫЕ ДАННЫЕ

- Определение номера графы
- Признак процента и Знак (проценты)
- Расчет сумм в долларах США
- Определение знака
- Выполняем обогащение/ переопределение атрибутов клиента
- Интервал срока
- Дата изменения срока
- Расчет СС по ЦБ, имуществу и договорам аренды
- Расчет данных для П12,П13
- Сумма акций нерезидента в рублях
- Общая сумма акций в рублях
- Доля участия нерезидента в капитале банка
- Общая сумма субординированных кредитов в рублях
- Код валюты (с 01.01.2025 показываем все валюты в соответствии ОКВ. Для драгоценных металлов, а также в случае отсутствия информации о валюте, указывается код «999»). «Тип кода валюты» (возможные значения: «Валюта», «Металл»)
- Тип нерезидента
- Код вида деятельности
- Код сектора 401 (с 01.01.2025 расширен до уровня кодов секторов формы отчетности 410 (+ 5 новых кодов))
- Код страны
- Признак просрочки
- Признак зарубежного филиала
- Признак национальной валюты зарубежного филиала
- Расчет А12, А13 и А14
- Расчет А30 и П30
- Код «срок погашения» = «Код срочности по остаточному сроку» - новый показатель с 01.01.2025

ОТНЕСЕНИЕ ДАННЫХ В ОТЧЕТ (Ч.1)

Форма 401 - Отнесение данных в отчет

Скрыть параметры поиска

Дата с* 31.12.2016 .. Версия расчета 1

Дата по* 31.12.2016 .. Просмотр исходных данных

Филиал Акционері X 0001

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

Номер раздела	Номер строки	БС	Аналитически...	Наименование счета	Группа валют	Код сектора для ф401	Код страны	Графа1 в долларах	Графа2 в долларах	Графа3 в долларах	Графа3 (расчетная) в долларах	Графа4 в долларах	Графа5 в долларах	Графа6 в долларах	Интервал срока	Дата изменения срока	Признак вхождения в отчет	Тип нерезидента	Вид ценной бумаги	Тип суммы	Роль счета	Наименование
1	1							0.00				0.00			До1ГодаВключ		Да	нерезидент, не связанный с банком отношениями ОРПИ				
2	2													131.74	До1ГодаВключ		Да	нерезидент, не связанный с банком отношениями ОРПИ	ОД	Основной		
2	2							0.00	0.17			0.00		До1ГодаВключ		Да	нерезидент, не связанный с банком отношениями ОРПИ	ОД	Основной			
2	2							0.00	62.16			0.00		До1ГодаВключ		Да	нерезидент, не связанный с банком отношениями ОРПИ	ОД	Основной			
2	2							0.00	243.12			0.00		До1ГодаВключ		Да	нерезидент, не связанный с банком отношениями ОРПИ	ОД	Основной			
2	2								0.05			0.00		До1ГодаВключ		Да	нерезидент, не связанный с банком отношениями ОРПИ	ОД	Основной			
2	2							0.00	326 160.34	90 579.02		0.00		Более1Года		Да	нерезидент, не связанный с банком отношениями ОРПИ	Корпоративная облигация	Проценты	НКД		
2	2							0.00	683.90			0.00		До1ГодаВключ		Да	нерезидент, не связанный с банком отношениями ОРПИ	ОД	Основной			
1	1							0.00	0.16			0.00		До1ГодаВключ		Да	нерезидент, не связанный с банком отношениями ОРПИ	ОД	Основной			
1	1							0.00				0.00		До1ГодаВключ		Да	нерезидент, не связанный с банком отношениями ОРПИ					
2	2											0.00		До1ГодаВключ		Да	нерезидент, не связанный с банком отношениями ОРПИ	ОД	Основной			

Всего найдено: 35

Графа4 в валюте счета	Графа5 в валюте счета	Графа6 в валюте счета	ИД сделки	Номер договора	ИД клиента	Капитал в долларах	Капитал в рублях	БИК/SWIFT Код банка	Кросс-курс	Курс валюты	Курс
0.00				-2	1000000			RU0000000000	0.0159	1.0000	
		8 143.06	1000000000	100	10000000	0		RU0000000000	0.0159	1.0000	
0.00	10.45		2000000000	0000 000	7990 20000000				0.0159	1.0000	
0.00	3 901.00		2000000000	1000 000	719 20000000				0.0159	1.0000	
0.00	15 257.46		2000000000	10000 000-000	7 20000000				0.0159	1.0000	
	3.38		2000000000	10000 000	20000000	100			0.0159	1.0000	
0.00	20 468 681.06	5 680 143.38	2000000000	0	1000000000	1000			0.0159	1.0000	
0.00	42 919.00		2000000000	10000 000	1 20000000	000			0.0159	1.0000	

ФОРМА 401 (СВОДНАЯ ТАБЛИЦА)

Форма 401 × Форма 401 (сводная таблица) × Форма 401 - Отнесение данных в отчет × Форма 401 - Атрибуты отчета × Форма 401 и 410 - Настройка счетов ×

Скрыть параметры поиска ?

Дата с* 31.07.2024 .. Версия расчета 1

Дата по* 31.07.2024 .. Просмотр исходных данных

Филиал X

Перетащите сюда заголовки полей фильтров

Гра... Гра... Гра... Гра... Гра... Гра...

Перетащите сюда заголовки полей столбцов

				Итого					
Но... ▲	Но... ▲ ▼	Код страны ... ▲ ▼	Код сектор... ▼	Графа01 [COL01]	Графа02 [COL02]	Графа03 [COL03]	Графа04 [COL04]	Графа05 [COL05]	Графа06 [COL06]
▼ 1	▼ A1	▼ 756	200	1 946,082	0,000	30,369	-31,181	1 945,270	0,000
		▼ 840	200	120 295,994	-215,957	-2,999	1 712,482	121 789,520	0,000
	▼ A15	▼	500	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000
		▼	100	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000
		▼ 756	200	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000
		▼ 840	200	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000
	▼ A9	▼	500	42 217,861	124,310	-281,364	0,000	42 060,807	124,310
		▼	100	6 436,617	18,671	-42,901	0,000	6 412,387	18,671
▼ 2	▼ П14	▼	100	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000	0,000
	▼ П16	▼	100	237,420	23 052,305	37,172	0,000	23 326,897	0,000
	▼ П50	▼	100	237,420	23 052,305	37,172	0,000	23 326,897	0,000

НТ НАСТРОЙКА СЧЕТОВ

Форма 401

Форма 401 и 410 - Настройка счетов

Скрыть параметры поиска ?



Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Номер формы	Номер раздела	Номер строки	Наименование строки	Комментарий	Признак резидентности клиента	Признак резидентности эм
<input type="checkbox"/>	401	2	П14.1	Просроченная задолженность - не погашенный в срок ОД		Нет	
<input type="checkbox"/>	401	1	A17	Прочие требования к НР (краткосрочные)		Нет	<Не определено>
<input type="checkbox"/>	401	1	A17	Прочие требования к НР (краткосрочные)		Нет	<Не определено>

<input type="checkbox"/>	401	Признак резидентности эмитента	Вид сделки РЕПО	Вид ценной бумаги	Финансовый инструмент	Исключаемый финансовый инструмент	Знак	Признак просрочки	Признак вхождения в отчет	Тип ссуды	Групп
<input type="checkbox"/>	401								Да		№
<input type="checkbox"/>	401						Да	Да			№
<input type="checkbox"/>	401							Да			№
<input type="checkbox"/>	401							Да			№

<input type="checkbox"/>	401	<Не определено>	Группа счетов	Интервал срока	Учитывать проценты актива	Банковская ячейка	Исключаемая валюта	Признак зарубежного филиала	Признак национальной валюты зарубежного филиала	Кс
<input type="checkbox"/>	401 <td><Не определено></td> <td>▶ №№47410</td> <td>...</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>	<Не определено>	▶ №№47410	...						
<input type="checkbox"/>	401 <td><Не определено></td> <td>№№47410</td> <td>...</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>	<Не определено>	№№47410	...						
<input type="checkbox"/>	401 <td></td> <td>№№47418</td> <td>...</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>		№№47418	...						
<input type="checkbox"/>	401 <td></td> <td>№№47422</td> <td>...</td> <td>Более1Года</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>		№№47422	...	Более1Года					
<input type="checkbox"/>	401 <td>Нет</td> <td>№№47422</td> <td>...</td> <td>До1ГодаВключ</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>	Нет	№№47422	...	До1ГодаВключ					
<input type="checkbox"/>	401 <td>Нет</td> <td>№№47424</td> <td>...</td> <td>До1ГодаВключ</td> <td><Не определено></td> <td><Не определено></td> <td></td> <td></td> <td></td>	Нет	№№47424	...	До1ГодаВключ	<Не определено>	<Не определено>			
<input type="checkbox"/>	401 <td>Нет</td> <td>№№47424</td> <td>...</td> <td>Более1Года</td> <td><Не определено></td> <td><Не определено></td> <td></td> <td></td> <td></td>	Нет	№№47424	...	Более1Года	<Не определено>	<Не определено>			
<input type="checkbox"/>	401 <td></td> <td>№№47501, 47503, 47814, 47815, 47441, 47442...</td> <td>...</td> <td>Более1Года</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>		№№47501, 47503, 47814, 47815, 47441, 47442...	...	Более1Года					
<input type="checkbox"/>	401 <td></td> <td>№№47602, 47605, 31703</td> <td>...</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>		№№47602, 47605, 31703	...						
<input type="checkbox"/>	401 <td></td> <td>№№49601, 49602</td> <td>...</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>		№№49601, 49602	...						
<input type="checkbox"/>	401 <td></td> <td>№№50108, 50109, 50110, 50208, 50209, 50210...</td> <td>...</td> <td>Более1Года</td> <td><Не определено></td> <td><Не определено></td> <td></td> <td></td> <td></td>		№№50108, 50109, 50110, 50208, 50209, 50210...	...	Более1Года	<Не определено>	<Не определено>			

Всего найдено: 129

НТ НАСТРОЙКА ГРАФ (УНИВЕРСАЛЬНАЯ)

Форма 401 - Настройка граф (универсальная)

Скрыть параметры поиска ?

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Номер графы	Сторона проводки	Основной счет (равен)	Основной счет (не равен)	Корр счет (равен)	Корр счет (не равен)	Основание проводки	Код валюты
<input type="checkbox"/>	3				NULL		переоценка остатка	
<input type="checkbox"/>	4		20202					
<input type="checkbox"/>	4		20208,20209					
<input type="checkbox"/>	4	дебет	47407		61210			
<input type="checkbox"/>	4	кредит	47408		601			
<input type="checkbox"/>	4		50	50118,50218,50418,50618,50718	47408			
<input type="checkbox"/>	4	<Не определено>	50110,50407,50108,50109,50209,50210,50211,504...	50118,50218,50418,50618,507...	61210	50118,50218,50418...		
<input type="checkbox"/>	3		50120,50121,50220,50221,50620,50621,50720,50721			612		
<input type="checkbox"/>	4	дебет	601		47408			
<input type="checkbox"/>	4	кредит	61210		47407			
<input type="checkbox"/>	3		70603,70604,70608,70609,10603,10605					
<input type="checkbox"/>	3		9		9999		курсовой разницы	

✓ [Профиль отчетной формы] = '25203'

Всего найдено: 22

Всего страниц: 1

ИТ АТТРИБУТЫ ОТЧЕТА

Форма 401 x Форма 401 (сводная таблица) x Форма 401 - Отнесение данных в отчет x Форма 401 - Атрибуты отчета x

Скрыть параметры поиска ?

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Код вал...	Код сектора ф.401...	Код сектора ф.410 ...	Код стра...	Клиент [CLIE...	Признак резидента к...	Признак вхож...	Группа ... /	Профиль отчетной ...	Профиль отчетной
<input type="checkbox"/>		200	200				Да	№№ 20202	Добавлено 25.09.20...	
<input type="checkbox"/>	949	200	200	792		<Не определено>	Да	№№ 20202	Добавлено 25.09.20...	
<input type="checkbox"/>	978	200	200	276			Да	№№ 20202	Добавлено 25.09.20...	
<input type="checkbox"/>	949	200	200	792		<Не определено>	Да	№№ 20208	Добавлено 25.09.20...	
<input type="checkbox"/>		200	200				Да	№№ 20208	Добавлено 25.09.20...	
<input type="checkbox"/>	978	200	200	276			Да	№№ 20208	Добавлено 25.09.20...	
<input type="checkbox"/>			700				Да	№№ 30102	Добавлено 25.09.20...	
<input type="checkbox"/>			700				Да	№№ 30210	Добавлено 25.09.20...	
<input type="checkbox"/>			700				Да	№№ 32901	Добавлено 25.09.20...	
<input type="checkbox"/>		510	510	056	S.W.I.F.T.	<Не определено>	Да	№№ 60204	Добавлено 25.09.20...	

[Профиль отчетной формы [RFFORMPROFILEID]] = '31905' И (([Код валюты [CURRENCYCODE]] = '949' Или [Код валюты [CURRENCYCODE]] = '978' Или Равен null или пуст([Код... Конструктор фильтра...

ФОРМА 0409410

Сведения об активах и пассивах кредитной организации по отношению к дебиторам (кредиторам), о конечных контролирующих инвесторах кредитной организации, а также о требованиях и обязательствах банковской группы на консолидированной основе

Татьяна Титоренко,
ведущий бизнес-аналитик департамента
«Экономика данных»

МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ

Используемые для расчета формы 0409410, реализованы через настроечные таблицы (далее – НТ)



Методические рекомендации по формированию показателей раздела 2 «Активы и пассивы отчитывающегося банка по отношению к дебиторам (кредиторам) – резидентам» формы отчетности 0409410 от 31 июля 2019 года № 23-МР (Методические рекомендации будут обновлены в 2024 году).

Реализация через НТ «Форма 401 и 410 - Настройка счетов»).



Методические рекомендации для формирования разделов 3 и 4 формы отчетности 0409410 находятся в процессе разработки у Банка России.

Реализация через НТ «Форма 401 и 410 - Настройка счетов»).

ИЗМЕНЕНИЯ В ФОРМЕ

До 01.01.2025

После 01.01.2025

Раздел 1

Активы и пассивы кредитной организации по отношению к дебиторам (кредиторам) - нерезидентам

Активы и пассивы кредитной организации по отношению к дебиторам (кредиторам) - нерезидентам по производным финансовым инструментам и отдельным срочным сделкам

Показатели раздела 1

Включают части накопленных остатков по показателям А1 – А18 и П1 – П17 формы 0409401 на ежеквартальной основе, в том числе:

- А19 «Требования к дебиторам-нерезидентам по производным финансовым инструментам и отдельным срочным сделкам»;
- П18 «Обязательства перед кредиторами-нерезидентами по производным финансовым инструментам и отдельным срочным сделкам».

«Активы и пассивы кредитной организации по отношению к дебиторам (кредиторам) – нерезидентам» (А1 – А18 и П1 – П17 формы 0409401) исключены из формы 0409410, за исключением показателей:

- А19 «Требования к дебиторам-нерезидентам по производным финансовым инструментам и отдельным срочным сделкам»;
- П18 «Обязательства перед кредиторами-нерезидентами по производным финансовым инструментам и отдельным срочным сделкам».

ИЗМЕНЕНИЯ В ФОРМЕ

До 01.01.2025

После 01.01.2025

Расшифрован расчет показателей А19 и П18: (реализовано с 01.01.2024):

Сумма значений в графе 8 Показателя А19 равна сумме значений следующих граф раздела 3 формы 0409401:

- графы 13 по строкам 3.1.1, 3.1.3, 3.1.5, 3.1.7, 3.1.9, 3.1.11 подраздела 3.1;
- граф 9 и 14 по строкам 3.2.1, 3.2.5, 3.2.9, 3.2.13, 3.2.17, 3.2.21 подраздела 3.2.

Сумма значений в графе 8 показателя П18 равна сумме значений следующих граф раздела 3 формы 0409401:

- графы 8 по строкам 3.1.1, 3.1.3, 3.1.5, 3.1.7, 3.1.9, 3.1.11 подраздела 3.1;
- граф 9 и 14 по строкам 3.2.2, 3.2.6, 3.2.10, 3.2.14, 3.2.18, 3.2.22 подраздела 3.2.

Графа 7 раздела 1 «Срок погашения финансового инструмента» **не** заполняется (для показателей А19 и П18).

ИЗМЕНЕНИЯ В ФОРМЕ

До 01.01.2025

После 01.01.2025

Показатель «Валюта актива (пассива)»

В расчет участвует ограниченная группа валют, Остальные группировались в код 999.

В графе 6 «Валюта актива (пассива)» указывается один из следующих кодов валют:

- 643 - Российский рубль
- 840 - Доллар США
- 978 - Евро
- 826 - Фунт стерлингов
- 756 - Швейцарский франк
- 392 - Иена;
- 933 - Белорусский рубль;
- 398 - Тенге;
- 156 - Юань;
- 999 - Прочие иностранные валюты и ДМ

В графе 6 «Валюта актива (пассива)» указывается трехзначный цифровой код валюты актива (обязательства) в соответствии с **Общероссийским классификатором валют (ОКВ)**.

В случае отсутствия информации о валюте, в которой номинирован актив (пассив), указывается код «999».

Уточнение по атрибуту «Код страны дебитора (кредитора) (реализовано изначально):

Для требований (обязательств) по отношению к резидентам Российской Федерации проставляется код «643».

Цифровые финансовые активы (далее – ЦФА)

На данный момент практика предоставления и получения кредитных средств, а также инвестирования посредством ЦФА является ограниченной и многие типы сделок совершаются впервые, поэтому порядок отражения отдельных видов операций с ЦФА в показатели Отчетов 0409401 и 0409410 определяется индивидуально с каждым заказчиком с учетом дополнительной информации об условиях выпуска соответствующих ЦФА:

- в зависимости от видов финансовых инструментов, права на которые удостоверяют данные ЦФА.
- анализа характеристик конкретных операций Банка исходя из условий выпуска ЦФА и их распределения по лицевым счетам в бухгалтерском учете Банка
- исходя из общих подходов, изложенных в Порядках составления и представления Отчетов.

ФОРМА 0409410

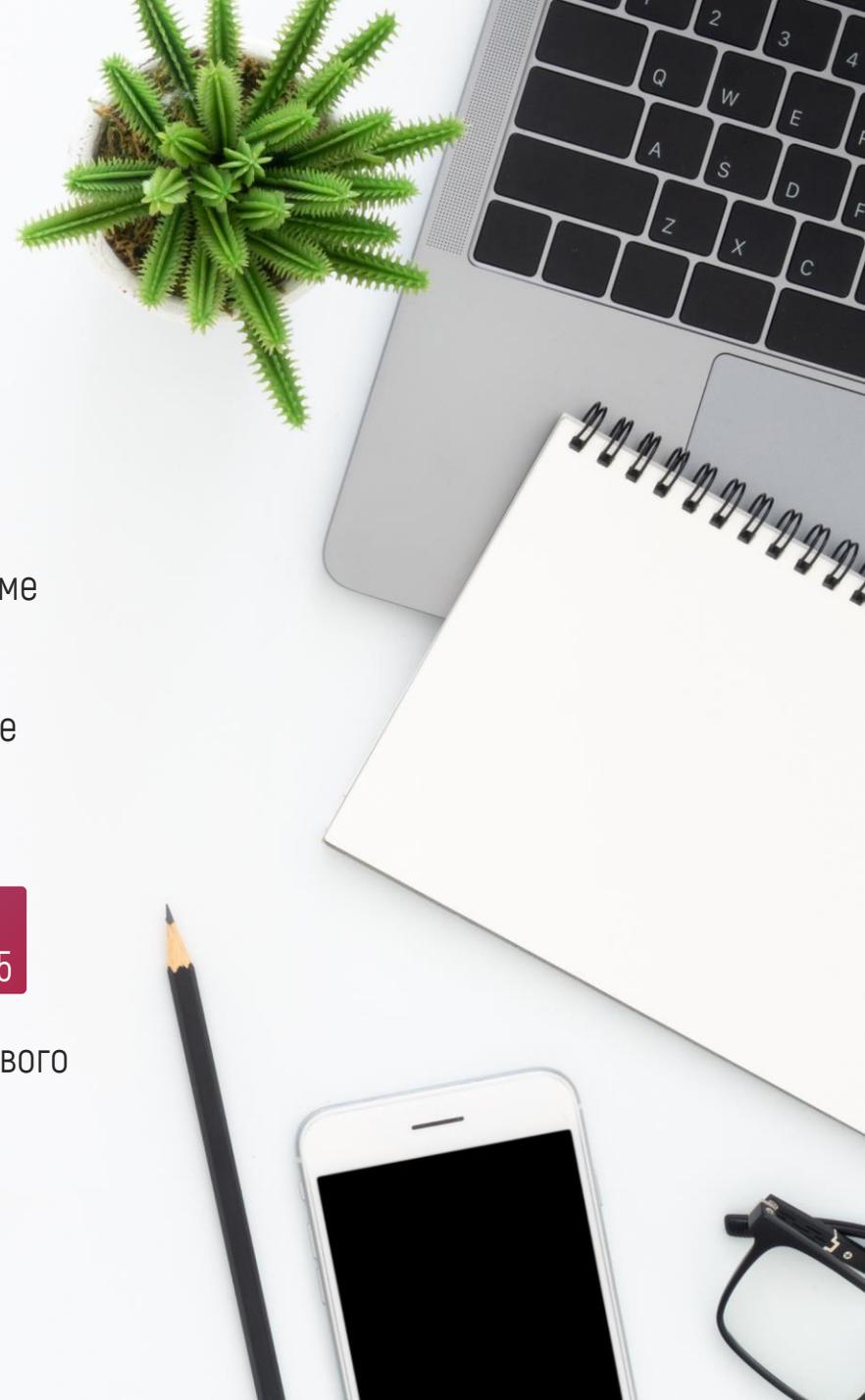
АТТРИБУТИВНЫЙ СОСТАВ ФОРМЫ

- Форма 401 и 410 - Реестр данных (остатки) – **122**
- Форма 410 – Отнесение данных в отчет – **81**
- Форма 410 – **12**



РАССЧИТАННЫЕ/ОБОГАЩЕННЫЕ ДАнные

- ✓ Признак зарубежного филиала
- ✓ Признак национальной валюты зарубежного филиала
- ✓ Признак резидента клиента (для зарубежного филиала)
- ✓ Признак резидента эмитента (для зарубежного филиала)
- ✓ Код финансового инструмента (номер строки ф. 410) - для разделов 1 и 2
- ✓ Код вида требования (обязательства) - для раздела 3
- ✓ Признак 501 или 603
- ✓ Код сектора дебитора (кредитора) - кроме раздела 4
- ✓ Код страны дебитора (кредитора) - кроме разделов 2 и 4
- ✓ Валюта актива (пассива) -
[с 01.01.2025 показываем все валюты в соответствии ОКВ] - кроме разделов 4 и 5
- ✓ Остаточный срок до погашения финансового инструмента
- ✓ Код срочности по остаточному сроку до погашения - для разделов 3 и 4



ИТ НАСТРОЙКА СЧЕТОВ (Ч.1)

Файл СПО Реестры данных Справочники Отчетные формы Отчеты Глобальные настройки Шаблон

Форма 401 x Форма 410 x

Базовые реестры

- Реестр активов
- Реестр пассивов
- Реестр сделок

Исходные данные

- Форма 401 и 410 - Реестр данных

Расчитанные данные

- Форма 410 - Отнесение данных в отчет (остатки)
- Форма 410

Детализация

- Форма 410 - Детализация - сверка

Настроечные таблицы

- Форма 410 - Настройки расчета
- Форма 401 и 410 - Настройка счетов
- Форма 410 - Настройка Раздел 5
- Форма 410 - Код срочности по БС
- Форма 410 - Параметры XML

Форма 410 - Отнесение данных в отчет (остатки) x Форма 410 x Форма 401 и 410 - Настройка счетов x Форма 410 - Настройка Раздел 5 x Форма 410 - Код срочности по БС x

Скрыть параметры поиска ?



Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Номер формы...	Номер разд...	Код вида требования (обязательст...	Код вал...	Группа счетов [RFACCGROUPID_V]	Признак зарубежного филиал...
<input type="checkbox"/>	410	3	O1	810	№№ 47460	Нет
<input type="checkbox"/>	410	3	O2		№№ 47460	Да
<input type="checkbox"/>	410	4	O1	810	№№ 47460	Нет
<input type="checkbox"/>	410	4	O2		№№ 47460	Да
<input type="checkbox"/>	410	3	T3		№№ 50104, 50105, 50106, 50107, 50116, 50140	Нет
<input checked="" type="checkbox"/>	410	3	T4		№№ 50104, 50105, 50106, 50107, 50116, 50140	Да
<input type="checkbox"/>	410	3	T5	810	№№ 50104, 50105, 50106, 50107, 50116, 50140	Нет
<input type="checkbox"/>	410	3	T6		№№ 50104, 50105, 50106, 50107, 50116, 50140	Да
<input type="checkbox"/>	410	3	T1		№№ 50108, 50109, 50110, 50118, 50140	Нет
<input type="checkbox"/>	410	3	T2		№№ 50108, 50109, 50118, 50140	Да
<input type="checkbox"/>	410	3	T2		№№ 50110, 50211, 50405, 50406, 50407, 50905	Да

[Номер формы [FORMCODE]] = '410' И ([Номер раздела [SECTIONNUM]] = '3' Или [Номер раздела [SECTIONNUM]] = '4' Или Равен null или пуст ([Номер раздела [... Конструктор фильтра...

Всего найдено: 215

Всего страниц: 1 < 1 >

ИТ НАСТРОЙКА СЧЕТОВ (Ч.2)

Признак национальной валюты зарубежного филиала ...	Признак имущество за рубежом...	Комментарий ...	Признак резидентности клиента [...]	Вид ценной бумаги [...]	Финансовый инструмент [...]
			Да		
Да			Да		
			Да		
Да			Да		
▶ Нет					
Да					

[Номер формы [FORMCODE\]] -
 Всего найдено: 215

Финансовый инструмент [...]	Исключаемый финансовый инструмент [...]	Зна...	Признак просрочки...	Признак вхождения в отчет [...]	Тип суммы [S...]	Исключаемая валюта [C...]	Профиль отчетной формы [RFFORMPI]
				Да			0409410 ИЗ с 13.03.2024
				Да			0409410 ИЗ с 13.03.2024
				Да			0409410 ИЗ с 13.03.2024
				Да			0409410 ИЗ с 13.03.2024
				Да			0409410 ИЗ с 13.03.2024
				Да			0409410 ИЗ с 13.03.2024
				Да			0409410 ИЗ с 13.03.2024
				Нет			0409410 ИЗ с 13.03.2024
				Нет			0409410 ИЗ с 13.03.2024
				Да			0409410 ИЗ с 13.03.2024
				Да			0409410 ИЗ с 13.03.2024

[Номер формы [FORMCODE\]] = '410' И ([Номер раздела [SECTIONNUM\]] = '3' Или [Номер раздела [SECTIONNUM\]] = '4' Или Равен null или пуст ([Номер раздела [SECTIONNUM\]])) И [Проф... Конструктор фильтра...
 Всего найдено: 215

Всего страниц: 1 < 1 >

ФОРМА 410 – ОТНЕСЕНИЕ ДАННЫХ В ОТЧЕТ (ОСТАТКИ) (Ч.1)

Форма 410 - Отнесение данных в отчет (остатки) Ж Форма 410 Ж

Скрыть параметры поиска ?

Дата с* 31.12.2023
Дата по* 31.12.2023
Фирмал

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

	Фирмал	Номер раздела	Номер строки	Финансовый инструмент	БС	Номер договора	Аналитический счет	Наименование счета	Тип ссуды	Группа валют	Валюта	Признак резидента клиента	Код страны	Кросс-курс	Курс валюты	Курс доллара
<input type="checkbox"/>	00040	2	2П20	ФИ_Депозиты	42301	423	4230181К	Шт	ОД	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2П20	ФИ_РасчетныеСчета	40817	40	4081	Сч	ОД	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	3		ФИ_Кредиты	45507	621	45507	Ссудный счет	ОД	643	810	Да	643	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	3		ФИ_Кредиты	47427	В625	474278	Проценты по креди...	Проценты	643	810	Да	643	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2А30	ФИ_Цессы	45511	В926	455118	Права требования ...	ОД	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2А20	ФИ_Кредиты	47427	КК-4	474278	Текущие проценты ...	Проценты	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2П20	ФИ_Депозиты	40817	4081	4081781В	Маст	ОД	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2А20	ФИ_Кредиты	47427	КК	474278	Текущие проценты ...	Проценты	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	3		ФИ_Цессы	45511	В926	455118	Права требования ...	ОД	643	810	Да	643	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	3		ФИ_Кредиты	47427	КК-4	474278	Текущие проценты ...	Проценты	643	810	Да	643	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	3		ФИ_Кредиты	47427	КК-4	4742781	Текущие проценты ...	Проценты	643	810	Да	643	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2А20	ФИ_Кредиты	45915	КК-	4591581	Просроченные проц...	Проценты	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2А20	ФИ_Кредиты	47427	В62	474278	Проценты по креди...	Проценты	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2А20	ФИ_Кредиты	45507	621	4550781	Ссудный счет по д...	ОД	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2П20	ФИ_Депозиты	42306	423	423068	Е	ОД	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2А20	ФИ_Кредиты	45509	КК-.....	455098	Основной долг для...	ОД	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2А20	ФИ_Кредиты	47427	63	474278	Проценты на теку...	Проценты	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	3		ФИ_Кредиты	45915	КК-	459158	Просроченные проц...	Проценты	643	810	Да	643	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2П20	ФИ_РасчетныеСчета	40817	40101	408178	Хал	ОД	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2П20	ФИ_Депозиты	40817	4081781	408178	Масте	ОД	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2А20	ФИ_Кредиты	45507	62	455078	Ссудный счет по д...	ОД	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2П30	ФИ_Кредиты	47441	В52	474418108	Прочие доходы по ...	Консоли	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2А20	ФИ_Кредиты	47427	623	474278	Проценты по креди...	Проценты	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65
<input type="checkbox"/>	00040	2	2П20	ФИ_РасчетныеСчета	40817	100	4081781К	Накоп	ОД	643	810	Да	999	0,01	1,00	89,65

Подсчет Загружены строк: 100

ФОРМА 410 – ОТНЕСЕНИЕ ДАННЫХ В ОТЧЕТ (ОСТАТКИ) (Ч.2)

Форма 410 - Отнесение данных в отчет (остатки) x Форма 410 x

Скрыть параметры поиска ?

Дата с* 31.12.2023 Версия расчета 1

Дата по* 31.12.2023 Статус записи А

Филиал [] Просмотр исходных данных

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

Сумма взятая в отчет в валюте	Сумма взятая в отчет в долларах	Дата открытия	Дата погашения текущая	Плановая дата	Интервал срока	Доля участия нерезидента в капитале банка	Тип клиента	Код сектора 410	Признак финансовой организации	Признак международной организации	Орган власти	Признак связанной стор
1 161,95	12,96	16.06.2014	01.01.1900	01.01.1900	До1Годавключ	0,00	ФизЛицо	840	Нет			
57 428,24	640,31	17.08.2020	01.01.1900	01.01.1900	До1Годавключ	0,00	ФизЛицо	840	Нет			
1 841 418,36	20 531,31	16.11.2020	16.01.2031	01.01.1900	Более1Года		ФизЛицо	840	Нет			
1 345,38	15,00	28.03.2023	16.03.2026	01.01.1900	Более1Года		ФизЛицо	840	Нет			
437 945,16	4 882,97	21.09.2020	22.09.2025	01.01.1900	Более1Года	0,00	ФизЛицо	840	Нет			
1 676,46	18,69	22.02.2022	22.02.2052	01.01.1900	Более1Года	0,00	ФизЛицо	840	Нет			
59,93	0,67	07.09.2021	01.01.1900	01.01.1900	До1Годавключ	0,00	ФизЛицо	840	Нет			
265,97	2,97	30.04.2021	30.04.2051	01.01.1900	Более1Года	0,00	ФизЛицо	840	Нет			

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

Признак связанной стороны отчитывающегося банка	Капитал в долларах	Капитал в рублях	SWIFT	Сумма накопленного купонного дохода в валюте	Общая сумма акций банка в рублях	Общая сумма субординированных кредитов в долларах	Общая сумма субординированных кредитов в рублях	Предприятие специального н
	0,00	0,00			0,00		0,00	
	0,00	0,00			0,00		0,00	

Предприятие специального назначения	Признак кредитной организ...	Цена справедливая	Сумма акций нерезидента в рублях	Выпуск ЦБ	Признак вхожден...	Остаточная стоимость субординиро...	Код вида требования (обязательства)	Остаточный срок до погашения	Код срочности по остаточному сроку	Признак национа
			0,00	0	Нет			0,00		<Не определено
			0,00	0	Нет			0,00		<Не определено
				0	Да		T5	7,04	LT	<Не определено
				0	Да		T5	2,21	LT	<Не определено
			0,00	0	Нет			1,73		<Не определено

Код срочности по остаточному сроку	Признак национальной валюты зарубежного филиала	Вид сделки РЕПО	Вид ценной бумаги	Количество ЦБ	Тип нерезидента	Уровень счета	Субординированный займ	Признак резидента эмитента	Дата окончания договора (первоначальная)	Дата окончания договора (продолгованная)
	<Не определено>	<Не определено>				Аналитический	<Не определено>		01.01.1900	01.01.1900
	<Не определено>	<Не определено>				Аналитический	<Не определено>		01.01.1900	01.01.1900
LT	<Не определено>	<Не определено>				Аналитический			16.01.2031	16.01.2031
LT	<Не определено>	<Не определено>				Аналитический			16.03.2026	16.03.2026
	<Не определено>	<Не определено>				Аналитический			22.09.2025	22.09.2025
	<Не определено>	<Не определено>				Аналитический			22.02.2052	22.02.2052

ПКК – КОНТРОЛЬ АТТРИБУТОВ

Контроль атрибутов

Правило отслеживает и выводит следующие ошибки:

Счета открытые на БС 40501, 40601, 40701, 45805, 45808, 45811, 45905, 45908, 45911, 414, 417, 420, 431, 434, 437, 445, 448, 451, 464, 467, 470 и «Признак финансовой организации» != «Да»

Счета открытые на БС 402, 411, 428, 442, 461, 50306, 50206, 50105 и Орган власти != «Субъект РФ»

Счета открытые на БС 401, 40301, 40302, 40312, 410, 427, 441, 460, 50205, 50104 и Орган власти != «МинФин РФ»

Счета открытые на 30102, 30202, 30228, 312, 31701, 31704, 31801, 31804, 319, 329 и Орган власти != «ЦБ»

Филиал	БС	Номер счета	Номер договора	Код валюты	Финансовый инструмент	Признак финансовой организации	Орган власти	Наименование клиента	Код сектора
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
00000	45811	4581181	4581181000	810	ФИ_Кредиты	Нет			830
00000	45811	4581181	4581181030	810	ФИ_Кредиты	Нет			830
00000	45811	4581181	H100004815	810	ФИ_ВнутрихозяйствОперации	Нет			830
00000	45811	4581181	4581181050	810	ФИ_Кредиты	Нет			830
00000	45811	4581181	001	810	ФИ_ПрочиеТребования	Нет	<Не определено>	ОБЩЕСТВО С ОГРАНИЧЕННОЙ	830
00000	45811	4581181	4581181060	810	ФИ_Кредиты	Нет			830
00000	45811	4581181	4581181070	810	ФИ_Кредиты	Нет			830
00000	45811	4581181	4581181090	810	ФИ_Кредиты	Нет			830
00000	46407	4640781	1000002495	810	ФИ_ВнутрихозяйствОперации	Нет			830
00000	47001	4700181	H100006935	810	ФИ_ВнутрихозяйствОперации	Нет			830
00000	47005	4700581	1000002305	810	ФИ_ВнутрихозяйствОперации	Нет			830
00000	47005	4700581	1000002305	810	ФИ_ВнутрихозяйствОперации	Нет			830
00000	47006	4700681	1000001591	810	ФИ_ВнутрихозяйствОперации	Нет			830
00000	47006	4700681	H100002473	810	ФИ_ВнутрихозяйствОперации	Нет			830
00000	47007	4700781	1000001353	810	ФИ_ВнутрихозяйствОперации	Нет			830
00000	47007	4700781	H100005033	810	ФИ_ВнутрихозяйствОперации	Нет			830
00000	47007	4700781	H100004912	810	ФИ_ВнутрихозяйствОперации	Нет			830

ФОРМА 0409129

Данные о средневзвешенных процентных ставках по привлеченным кредитной организацией вкладам, депозитам, о текущих счетах физических лиц и банковских счетах юридических лиц и индивидуальных предпринимателей

Ольга Игнатьева,
старший инженер-аналитик
департамента «Экономика данных»

ИЗМЕНЕНИЯ 2025

Данные о вкладах,
депозитах физических лиц

Данные о средствах в рублях на
текущих счетах физических лиц –
резидентов (рубли 40817)

ДО 01.01.2025



Раздел 1 Данные о средневзвешенных процентных ставках по привлеченным кредитной организацией вкладам, депозитам
Раздел 2 Данные о привлеченных средствах на текущие счета физических лиц – резидентов в рублях

Данные о средствах на банковских
счетах юридических лиц, ИП

Данные о вкладах,
депозитах физических лиц

Данные о средствах на
текущих счетах физических
лиц (все валюты 40817, 40820)

ПОСЛЕ 01.01.2025



Раздел 1 Данные о средневзвешенных процентных ставках по привлеченным кредитной организацией вкладам, депозитам
Раздел 2 Данные о привлеченных средствах на текущие счета физических лиц
Раздел 3. Данные о привлеченных средствах на счета юридических лиц и индивидуальных предпринимателей

ИЗМЕНЕНИЯ 2025

Указанием Банка России № 6800-У с
01.01.2025 вносятся изменения в форму
0409129



Форма ежемесячная

будет сдаваться в новом формате в
первый раз в феврале 2025

РАЗДЕЛ 2 ДОПОЛНЕН ДАННЫМИ

- о привлеченных средствах на текущие счета физических лиц в разрезе кодов валют (с включением в раздел 2 графы «Код валюты»)
- о привлеченных средствах на текущие счета физических лиц — нерезидентов (балансовый счет № 40820)

НОВЫЙ РАЗДЕЛ 3

Данные о привлеченных средствах на счета юридических лиц и индивидуальных предпринимателей в разрезе:

- балансовых счетов
- признаков начисления процентов
- валют счетов

ИЗМЕНЕНИЯ 2026

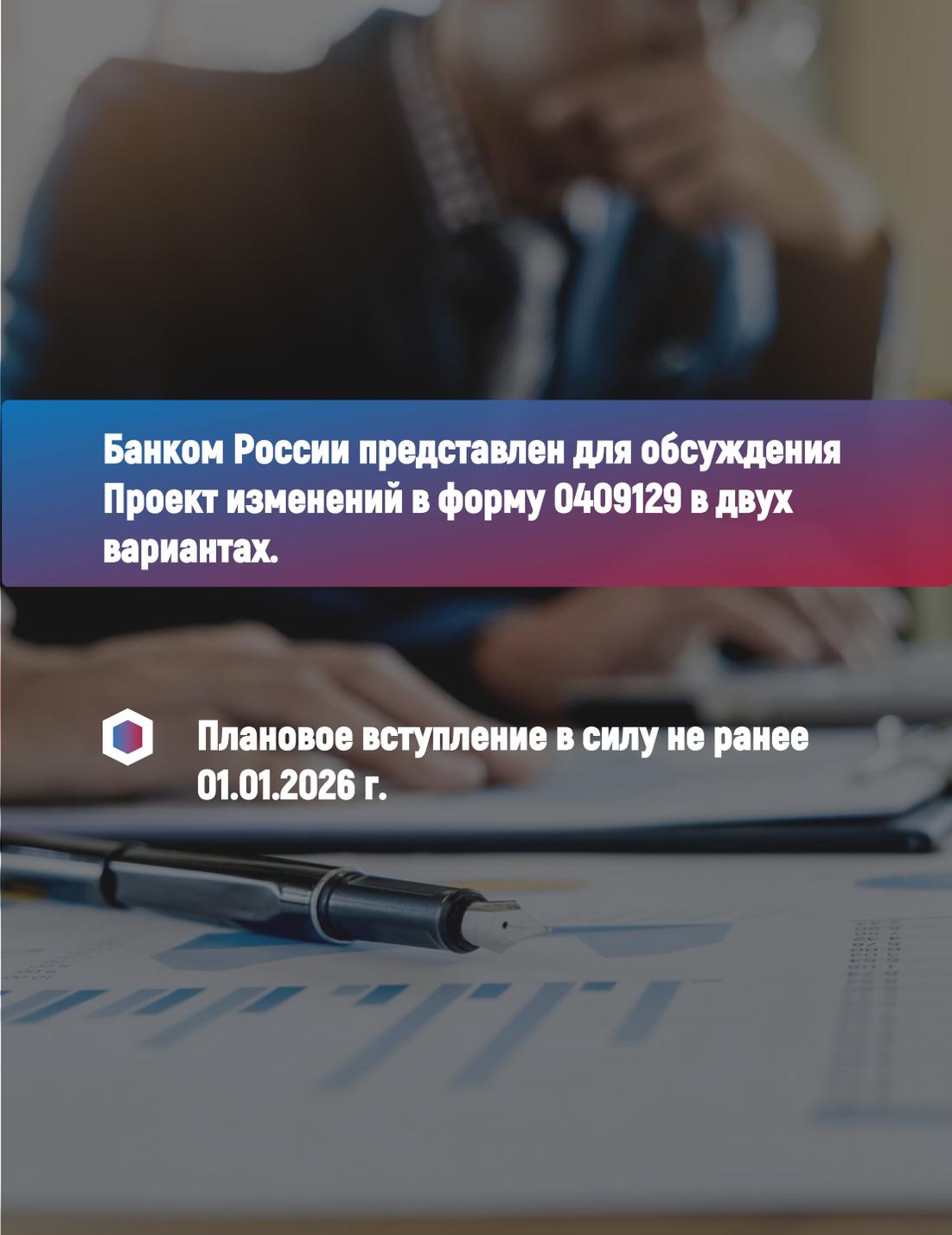
ФОРМА ДОПОЛНЕНА ИНФОРМАЦИЕЙ:

О банковских счетах юридических лиц и индивидуальных предпринимателей с выделением:

- Процентной ставки по привлечению на банковские счета
- Суммы на счетах, на которую начислялись проценты за отчетный месяц

ПРОЕКТ ПРЕДСТАВЛЕН В ДВУХ ВАРИАНТАХ:

- **Вариант 1:** в редакции Указания Банка России № 6800-У - внесены изменения в Раздел 3
- **Вариант 2:** в нормализованной структуре собираемых данных с группировкой в отдельные разделы однотипных показателей для юридических лиц, индивидуальных предпринимателей и физических лиц- перегруппированы разделы 2 и 3



**Банком России представлен для обсуждения
Проект изменений в форму 0409129 в двух
вариантах.**



**Плановое вступление в силу не ранее
01.01.2026 г.**

ОТЛИЧИЯ ВАРИАНТОВ ПЛАНИРУЕМЫХ ИЗМЕНЕНИЙ

ВАРИАНТ 1

Данные отчета разбиваются на Разделы 2 и 3 для отдельного отражения данных по физическим и юридическим лицам (индивидуальным предпринимателям) с разбивкой на подразделы по показателям:

- Подразделы 2.1 и 3.1 – отражаются данные о привлеченных средствах на банковские счета
- Подразделы 2.2 и 3.2 – отражаются данные о размере процентных ставок, сумме начисленных и выплаченных процентов по банковским счетам

ВАРИАНТ 2



Данные по физическим и юридическим лицам (индивидуальным предпринимателям) разбиваются на Разделы 2 и 3 с группировкой по однотипным показателям:

- **Раздел 2** - Данные о привлеченных средствах на банковские счета юридических лиц, индивидуальных предпринимателей и физических лиц
- **Раздел 3** - Данные о размере процентных ставок, сумме начисленных и выплаченных процентов по банковским счетам юридических лиц, индивидуальных предпринимателей и физических лиц

ИСТОЧНИКИ ДАННЫХ ДЛЯ РАСЧЕТА ФОРМЫ



Загруженные данные:

- Аналитический счет
- Депозит
- Депозит Дополнительное соглашение
- Депозит Ставка
- Депозит Неснижаемый остаток
- Договор расчетного счета Ставка
- Остатки и обороты по аналитическому счету
- Проводка балансовая
- Связь проводок
- Журнал начисления процентов по договору р/с



Рассчитанные данные на основе данных в базовых реестрах - активов и пассивов, а также прочих реестрах:

- Средневзвешенная процентная ставка
- Количество счетов
- Сумма средств на счетах, на которую начислялись проценты
- Средний остаток
- Минимальный остаток
- Сумма начисленных процентов в отчет
- Остаток пропорциональный базе
- **Признак начисления процентов**

АТРИБУТИВНЫЙ СОСТАВ ФОРМЫ

РЕЕСТР ДАННЫХ

■ Реестр данных Раздел 1	43
■ Реестр данных Раздел 2	27
■ Реестр данных Раздел 3	17

+ 17
атрибутов



РЕЕСТР ИТОГОВЫХ ДАННЫХ

■ Раздел 1	10
■ Раздел 2.1	6 (+1)
■ Раздел 2.2	9
■ Раздел 3	7

+ 8
атрибутов

ИТ БАНКОВСКИЕ УСЛУГИ И МАСКИ СЧЕТОВ

Форма 0409129 - Раздел 2. Банковские услуги

Скрыть параметры поиска ?



Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Идентификатор [ID]	Код продукта [...]	ИД банковского продукта ...	Наименование банковского продукта...	ИД банковского продукта на СВОД [...]	Наименование банковского продукта на СВОД ...
<input type="checkbox"/>	134	PL - RUB		141 004 PL - L E (K) - PL - RUB		135 004 PL - L E (K) - PL - RUB

Форма 0409129 - Маски счетов

Скрыть параметры поиска ?



Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Номер графы	Группа счетов	Профиль <input checked="" type="checkbox"/>	НомерРаздела
<input type="checkbox"/>	5	PL RUB 42201 - 42501	Form 0409129 - 20240101	1

ЖУРНАЛ НАЧИСЛЕНИЯ ПРОЦЕНТОВ ПО ДОГОВОРУ Р/С

Журнал начисления процентов по договору р/с

Скрыть параметры поиска Скрыть значения фильтров ?

Базовый остаток для начисления <> 0

<input type="checkbox"/>	Сделка	Дата начала действия записи	Дата окончания действия записи	Базовый остаток для начисл...	Процентная ставка	Сумма начисленных процентов
<input type="checkbox"/>	13892328	01.01.2024	01.02.2024	344 697 000,00	0,00	0,00
<input type="checkbox"/>	4049708	16.01.2024	01.02.2024	209 998 154,98	0,00	0,00
<input type="checkbox"/>	4077301	01.01.2024	01.02.2024	183 967 733,74	0,00	0,00
<input type="checkbox"/>	14041272	09.01.2024	01.02.2024	84 572 009,88	8,30	441 114,66
<input type="checkbox"/>	4428093	31.01.2024	01.02.2024	31 089 081,60	9,20	7 814,74
<input type="checkbox"/>	3251495	13.01.2024	01.02.2024	30 243 635,78	8,30	130 312,06
<input type="checkbox"/>	4329151	31.01.2024	01.02.2024	30 000 000,00	8,30	6 803,28
<input type="checkbox"/>	4435748	25.01.2024	01.02.2024	26 800 000,00	8,30	42 543,17
<input type="checkbox"/>	3999552	11.01.2024	01.02.2024	22 229 543,34	8,30	105 863,64
<input type="checkbox"/>	13805059	31.01.2024	01.02.2024	21 000 000,00	9,20	5 278,69
<input type="checkbox"/>	13977900	01.01.2024	01.02.2024	20 853 900,00	0,00	0,00
<input type="checkbox"/>	4438437	01.01.2024	01.02.2024	20 405 771,37	0,00	0,00
<input type="checkbox"/>	13940116	07.01.2024	01.02.2024	20 133 788,45	8,30	114 146,48
<input type="checkbox"/>	3306075	11.01.2024	01.02.2024	19 370 537,07	0,00	0,00
<input type="checkbox"/>	13937331	25.01.2024	01.02.2024	18 974 700,00	0,00	0,00
<input type="checkbox"/>	13817152	16.01.2024	01.02.2024	16 316 370,00	0,00	0,00
<input type="checkbox"/>	14011827	01.01.2024	01.02.2024	15 960 960,00	0,00	0,00
<input type="checkbox"/>	13784527	01.01.2024	01.02.2024	15 951 180,00	0,00	0,00
<input type="checkbox"/>	13972604	01.01.2024	01.02.2024	15 521 115,00	0,00	0,00
<input type="checkbox"/>	13642920	01.01.2024	01.02.2024	15 389 531,00	0,00	0,00
<input type="checkbox"/>	4485114	02.01.2024	01.02.2024	15 236 417,26	8,30	103 657,59
<input type="checkbox"/>	4577076	27.01.2024	01.02.2024	15 026 680,90	8,30	17 038,45
<input type="checkbox"/>	13817528	01.01.2024	01.02.2024	14 811 750,00	0,00	0,00
<input type="checkbox"/>	13540566	01.01.2024	01.02.2024	14 356 062,00	0,00	0,00

ОТНЕСЕНИЕ ДАННЫХ В ОТЧЕТ РАЗДЕЛ 2

Форма 129 - Реестр данных. Раздел 2

Скрыть параметры поиска

Дата с* 30.09.2024 .. Версия расчета 1
 Дата по* 30.09.2024 .. Статус записи А
 Филиал .. Просмотр исходных данных

<input type="checkbox"/>	Номер лицевого счета	Номер счета п...	Номер договора	Код валюты с ЛС	Остаток на да...	ИД банковского продукта	Код банковского продукта	Наименование банковского продукта	ИД банковского...	Наименование банковског...	Процентная ставка	Средневзвеш
<input type="checkbox"/>	408178107105		408178107105...	810	6 549.00	5 255	MULTP	Мультикарта (пенс)	5 255	Накопительный счет	7.00	
<input type="checkbox"/>	408178104300		408178104300...	810	6 442.34	5 255	MULTP	Мультикарта (пенс)	5 255	Накопительный счет	7.00	
<input type="checkbox"/>	4081781002										7.00	
<input type="checkbox"/>	4081781031										7.00	
<input type="checkbox"/>	4081781023										7.00	
<input type="checkbox"/>	4081781062										7.00	
<input checked="" type="checkbox"/>	4081781042										7.00	
<input type="checkbox"/>	4081781051										7.00	
<input type="checkbox"/>	4081781021										7.00	
<input type="checkbox"/>	4081781022										7.00	

Форма 129 - Раздел 2.1

Скрыть параметры поиска Скрыть значения фильтров

Дата с* .. Версия ..
 Дата по* .. Статус ..
 Филиал ..

(Номер раздела = 2.1)

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Номер раздела	Филиал	ИД банковского продукта	Код валюты счета	Наименование банковской услуги	Количество счетов, действующих на отчетную дату, ед.
<input checked="" type="checkbox"/>	2.1	F122_KO	5 255	643	Накопительный счет	4 840
<input type="checkbox"/>	2.1					
<input type="checkbox"/>	2.1					
<input type="checkbox"/>	2.1					
<input type="checkbox"/>	2.1					

Форма 129 - Раздел 2.1

Скрыть параметры поиска Скрыть значения фильтров

Дата с* 30.09.2024 .. Версия расчета 1
 Дата по* 30.09.2024 .. Статус записи А
 Филиал ..

(Номер раздела = 2.2)

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Номер раздела	Филиал	ИД банковског...	Процентная став...	Сумма средств на счетах, на ко...	Общая сумма процентов, начисленн...	Общая сумма процентов, выплаченных...	Сумма остатков средств на с...	Признак структурного продукта
<input type="checkbox"/>	2.2	00000	5 255	14.00	28 977 444.13	336 304.04	336 304.04	28 613 387.25	0
<input type="checkbox"/>	2.2	00000	5 255	16.00	31 146 242.12	397 826.77	397 826.77	30 806 372.95	0
<input type="checkbox"/>	2.2	00000	5 255	15.00	31 409 623.12	376 874.89	376 874.89	31 007 370.00	0

ОТНЕСЕНИЕ ДАННЫХ В ОТЧЕТ РАЗДЕЛ 3

Форма 129 - Раздел 3 | Форма 129 - Реестр данных, Раздел 3

Скрыть параметры поиска ?

Дата с* 31.01.2024 | Версия расчета 1
 Дата по* 31.01.2024 | Статус записи A
 Филиал | Просмотр исходных данных

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Филиал	Номер лицевого счета	Остаток на дату отчета в руб. коп.	Номер договора	Процентная ставка	Сумма начисленных процентов с проводки	Сумма выплаченных процентов	Признак вхождения	База для начисления процентов	Средневзвешенная ставка	База из журнала	Сумма начисленных процентов из журнала	Сумма начисленных процентов в отчет	Дата начала	Дата окончания
<input type="checkbox"/>		40501810322030877...	50 000,00	323456	5,00	3 525,00	3 525,00	Да	50 000,00	5,00	50 000,00	3 525,00		01.09.2024	30.09.2024
<input type="checkbox"/>		40701810428030864...	38 000,00	323456	8,00	4 783,00	4 783,00	Да	38 000,00	8,00	38 000,00	3 525,00		01.09.2024	30.09.2024
<input type="checkbox"/>		40702810746030883...	100 000,00	323456	10,00	10 000,00	10 000,00	Да	100 000,00	10,00	100 000,00	3 525,00		01.09.2024	30.09.2024
<input type="checkbox"/>		40802810345030364...	800 000,00	323456	10,00	80 000,00	80 000,00	Да	800 000,00	10,00	800 000,00	3 525,00		01.09.2024	30.09.2024

Форма 129 - Раздел 3 | Форма 129 - Реестр данных, Раздел 3

Скрыть параметры поиска ?

Дата с* 31.01.2024 | Версия расчета 1
 Дата по* 31.01.2024 | Статус записи A
 Филиал | Просмотр исходных данных

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Филиал	Балансовый счет	Признак начисления процентов по счету	Код валюты счета	Общая сумма процентов, начисленных за отчетный месяц (тысяч единиц валюты)	Общая сумма процентов, выплаченных за отчетный месяц (тысяч единиц валюты)	Сумма остатков средств на счетах на отчетную дату (тысяч единиц валюты)
<input type="checkbox"/>		40702		1,00	810,00	10 000,00	100 000,00
<input type="checkbox"/>		40701		1,00	810,00	4 783,00	38 000,00
<input type="checkbox"/>		40802		1,00	810,00	80 000,00	800 000,00
<input type="checkbox"/>		40501		1,00	810,00	3 525,00	50 000,00

ПКК СВЕРКА СО 101-Й ФОРМОЙ

Контроль Раздела 2.

№ п/п	БС	Наименование продукта	Раздел 2. Остаток на дату отчета в рублях	Раздел 2. Остаток на дату отчета в рублевом эквиваленте (для ин.валюты)	Исходящий остаток в рублях по БС формы 0409101	Исходящий остаток в ин. валюте по БС формы 0409101	Графа 5.1 строки - графа 6.1 строки "Итого по реестру" (Расхождения в рублях)	Графа 5.2 строки - графа 6.2 строки "Итого по реестру" (Расхождения в ин.валюте в рублевом эквиваленте)	Графа 5.1+5.2 строки / графа 6.1+графа 6.2 строк 1 и 2 * 100	Комментарий
1	2	4	5.1	5.2	6.1	6.2	7.1	7.2	8	9
1	40817	X	10 000	100	10 000	100	0	0	X	Если графа 7.1 \neq 0, либо графа 7.2 \neq 0 то "Расхождение с балансом", иначе "ОК";
2	40820	X	5 000	50	5 000	50	0	0	X	Если графа 7.1 \neq 0, либо графа 7.2 \neq 0 то "Расхождение с балансом", иначе "ОК";
3	40817 40820	Прочие счета	1	1	X	X	X	X	0,01	1. Сверка с ф.101 "Исходящий остаток в рублях": Если графа 8 > 1%, то "Предупреждение: Прочие счета" превышают 1% от суммы остатка по БС 40817, 40820", иначе "ОК";

Контроль Раздела 3.

№ п/п	БС	Раздел 3. Остаток на дату отчета в рублях	Раздел 3. Остаток на дату отчета в рублевом эквиваленте (для ин.валюты)	Исходящий остаток в рублях по БС формы 0409101	Исходящий остаток в ин. валюте по БС формы 0409101	Графа 4.1 строки - графа 5.1 строки "Итого по реестру" (Расхождения в рублях)	Графа 4.2 строки - графа 5.2 строки "Итого по реестру" (Расхождения в ин.валюте в рублевом эквиваленте)	Комментарий
1	2	4.1	4.2	5.1	5.2	6.1	6.2	7
1	40802	10 000	100	10 000	100	0	0	Если графа 6.1 \neq 0, либо графа 6.2 \neq 0 то "Расхождение с балансом", иначе "ОК";
2	40807	5 000	50	5 000	50	0	0	Если графа 6.1 \neq 0, либо графа 6.2 \neq 0 то "Расхождение с балансом", иначе "ОК";

ФОРМА 0409110

Расшифровки отдельных показателей деятельности
кредитной организации

Виктория Артемьева,
старший инженер-аналитик
департамента «Экономика данных»

ИЗМЕНЕНИЯ В ФОРМЕ

Добавлены новые коды

■ Раздел I	8	}	33 кода
■ Раздел II	1		
■ Раздел III	6		
■ Раздел III.1	9		
■ Раздел IV	9		

Добавлены 2 новые графы с суммами в разделе IV

- Графа 4 – золото (в рублевом эквиваленте)
- Графа 6 – драгоценные металлы, отличные от золота (в рублевом эквиваленте)



ИНФОРМАЦИОННЫЕ ГРУППЫ НОВЫХ КОДОВ

Выделение субординированных кредитов (депозитов, займов)

- Раздел I: A474/16.13.1; A474/16.14.1; A474/19.2.1; A474/19.3.1; A474/19.4.1; A474/19.5.1; A474/19.6.1; A/18.6.1;
- Раздел III: 6518, 6520;
- Раздел IV: IL/21; IL/22

Классифицированные в качестве долевых инструментов

Раздел I: A474/16.13.1, A474/16.14.1, A474/19.2.1, A474/19.3.1, A474/19.4.1, A474/19.5.1, A474/19.6.1, A/18.6.1

Выделение иностранных ЮЛ, зарегистрированных в соответствии с ФЗ №290-ФЗ

Раздел IV: D/2; D/2.1; D/2.2; D/2.3; D/18; D/18.1; D/24; D/24.1; IL/2; IL/2.1; IA/1; IA/1.1; DS/3; DS/3.1

Выделение влияния валютных курсов перечисленных (в коде) символов

Раздел III.1: 6346

Цифровые финансовые активы

Раздел III.1: 6340; 6341; 6342; 6343; 6344; 6345

Символ 411 отчетности по форме 0409102

- Раздел II: S411/4;
- Раздел III.1: 6348

Комбинация остатков символов и иные расшифровки

- Раздел III: 6516, 6517, 6519, 6521
- Раздел III.1: 6347

ФОРМА 0409110 АТРИБУТИВНЫЙ СОСТАВ

- Форма 0409110 – **12**

- Форма 0409110 - Реестр остатков – **55**

- Форма 0409110 - Реестр оборотов – **52**

- Форма 0409110 - Реестр остатков в разрезе строк – **57**

- Форма 0409110 - Реестр оборотов в разрезе строк – **55**

- Форма 0409110 - Детализация Итоговая форма – **10**

- Форма 0409110 - Детализация остатков по БС – **33**

- Форма 0409110 - Детализация оборотов по БС и атрибутам – **28**

- Форма 0409110 - Детализация оборотов по БС – **29**

- Форма 0409110 - Детализация оборотов по БС и атрибутам – **28**

- Форма 0409110 - Детализация Реестр оборотов БС 70606 – **36**

- Форма 0409110 - Детализация Реестр оборотов БС 770601 и проч. – **36**

ОБОГАЩЕННЫЕ/ РАССЧИТАННЫЕ ДАННЫЕ

Атрибуты в реестрах исходных и рассчитанных данных:

- Номер связанного счёта требования
- Номер счета обесценения
- Счет дохода/расхода
- Валютные доходы/расходы
- Цель кредита
- Международная организация по 290-ФЗ
- Субординированный займ
- Вид классификации ФИ
- Валюта
- Тип валюты
- Вид депозита
- Причина открытия
- Тип обеспечения

13
атрибутов

Атрибуты в реестре итоговых данных:

- Сумма золото (в рублевом эквиваленте)
- Сумма драгоценные металлы, отличные от золота (в рублевом эквиваленте)

+2
атрибута



НАСТРОЙКИ РАСЧЕТА КОДА 6516

Форма 0409110 - Настроечная таблица

Скрыть параметры поиска Скрыть значения фильтров ?



Код символа формы 110 = 6516

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

Профиль отчетной формы	Алгоритм	Номер раздела	Номер строки	Код символа формы 110	Знак	Описание расшифровки
▶ Форма 110 с 01.01.2025	Остатки	III	48	6516	Плюс	Балансовый счет № 60907 в части суммы убытков от обесценения деловой репутации

Код символа формы 110 = 6516

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

Описание расшифровки	Описание группы счетов	Маска связанного счета требования
▶ Балансовый счет № 60907 в части суммы убытков от обесценения деловой репутации	№№ 60907	60905

ИЗМЕНЕНИЯ В ФОРМЕ

«Группа счетов» в ИТ соответствует атрибуту в Реестре Активов	Аналитический счет	Остаток в рублях	Остаток в валюте	Номер связанного счета требования
Номер счета требования	Номер счета требования	Сумма требования (руб)	Сумма требования (вал)	-
Номер счета переоценки	Номер счета переоценки	Сумма переоценки	Сумма переоценки	Номер счета требования
Номер счета резерва	Номер счета резерва	Сумма фактического резерва	Сумма фактического резерва	Номер счета требования
Номер счета корректировки резерва	Номер счета корректировки резерва	Сумма корректировки резерва	Сумма корректировки резерва	Номер счета требования
Номер счета обесценения	Номер счета обесценения	Сумма обесценения	Сумма обесценения	Номер счета требования

НАСТРОЙКИ РАСЧЕТА КОДА 6346

Форма 0409110 - Настроечная таблица

Скрыть параметры поиска Скрыть значения фильтров ?



Код символа формы 110 = 6346

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

	Профиль отчетной формы	Алгоритм	Номер раздела	Номер строки	Код символа формы 110	Знак	Описание расшифровки
▶	Форма 110 с 01.01.2025	Обороты	III.1	36	6346	Плюс	Комбинация остатков символов 151 (кроме 15115, 15117, 15118, 15119) + 152 (кроме 15201-15214, 15218, 17101-17102, 17103-17104, 17105-17106, 17107-17108, 17109-17110, 17111-17112, 17113-17114, 17115-17116, 17117-17118, 17119-17120, 17121-17122, 17123-17124, 17125-17126, 17127-17128, 17129-17130, 17131-17132, 17133-17134, 17135-17136, 17137-17138, 17139-17140, 17141-17142, 17143-17144, 17145-17146, 17147-17148, 17149-17150, 17151-17152, 17153-17154, 17155-17156, 17157-17158, 17159-17160, 17161-17162, 17163-17164, 17165-17166, 17167-17168, 17169-17170, 17171-17172, 17173-17174, 17175-17176, 17177-17178, 17179-17180, 17181-17182, 17183-17184, 17185-17186, 17187-17188, 17189-17190, 17191-17192, 17193-17194, 17195-17196, 17197-17198, 17199-17200, 17201-17202, 17203-17204, 17205-17206, 17207-17208, 17209-17210, 17211-17212, 17213-17214, 17215-17216, 17217-17218, 17219-17220, 17221-17222, 17223-17224, 17225-17226, 17227-17228, 17229-17230, 17231-17232, 17233-17234, 17235-17236, 17237-17238, 17239-17240, 17241-17242, 17243-17244, 17245-17246, 17247-17248, 17249-17250, 17251-17252, 17253-17254, 17255-17256, 17257-17258, 17259-17260, 17261-17262, 17263-17264, 17265-17266, 17267-17268, 17269-17270, 17271-17272, 17273-17274, 17275-17276, 17277-17278, 17279-17280, 17281-17282, 17283-17284, 17285-17286, 17287-17288, 17289-17290, 17291-17292, 17293-17294, 17295-17296, 17297-17298, 17299-17300, 17301-17302, 17303-17304, 17305-17306, 17307-17308, 17309-17310, 17311-17312, 17313-17314, 17315-17316, 17317-17318, 17319-17320, 17321-17322, 17323-17324, 17325-17326, 17327-17328, 17329-17330, 17331-17332, 17333-17334, 17335-17336, 17337-17338, 17339-17340, 17341-17342, 17343-17344, 17345-17346, 17347-17348, 17349-17350, 17351-17352, 17353-17354, 17355-17356, 17357-17358, 17359-17360, 17361-17362, 17363-17364, 17365-17366, 17367-17368, 17369-17370, 17371-17372, 17373-17374, 17375-17376, 17377-17378, 17379-17380, 17381-17382, 17383-17384, 17385-17386, 17387-17388, 17389-17390, 17391-17392, 17393-17394, 17395-17396, 17397-17398, 17399-17400, 17401-17402, 17403-17404, 17405-17406, 17407-17408, 17409-17410, 17411-17412, 17413-17414, 17415-17416, 17417-17418, 17419-17420, 17421-17422, 17423-17424, 17425-17426, 17427-17428, 17429-17430, 17431-17432, 17433-17434, 17435-17436, 17437-17438, 17439-17440, 17441-17442, 17443-17444, 17445-17446, 17447-17448, 17449-17450, 17451-17452, 17453-17454, 17455-17456, 17457-17458, 17459-17460, 17461-17462, 17463-17464, 17465-17466, 17467-17468, 17469-17470, 17471-17472, 17473-17474, 17475-17476, 17477-17478, 17479-17480, 17481-17482, 17483-17484, 17485-17486, 17487-17488, 17489-17490, 17491-17492, 17493-17494, 17495-17496, 17497-17498, 17499-17500, 17501-17502, 17503-17504, 17505-17506, 17507-17508, 17509-17510, 17511-17512, 17513-17514, 17515-17516, 17517-17518, 17519-17520, 17521-17522, 17523-17524, 17525-17526, 17527-17528, 17529-17530, 17531-17532, 17533-17534, 17535-17536, 17537-17538, 17539-17540, 17541-17542, 17543-17544, 17545-17546, 17547-17548, 17549-17550, 17551-17552, 17553-17554, 17555-17556, 17557-17558, 17559-17560, 17561-17562, 17563-17564, 17565-17566, 17567-17568, 17569-17570, 17571-17572, 17573-17574, 17575-17576, 17577-17578, 17579-17580, 17581-17582, 17583-17584, 17585-17586, 17587-17588, 17589-17590, 17591-17592, 17593-17594, 17595-17596, 17597-17598, 17599-17600, 17601-17602, 17603-17604, 17605-17606, 17607-17608, 17609-17610, 17611-17612, 17613-17614, 17615-17616, 17617-17618, 17619-17620, 17621-17622, 17623-17624, 17625-17626, 17627-17628, 17629-17630, 17631-17632, 17633-17634, 17635-17636, 17637-17638, 17639-17640, 17641-17642, 17643-17644, 17645-17646, 17647-17648, 17649-17650, 17651-17652, 17653-17654, 17655-17656, 17657-17658, 17659-17660, 17661-17662, 17663-17664, 17665-17666, 17667-17668, 17669-17670, 17671-17672, 17673-17674, 17675-17676, 17677-17678, 17679-17680, 17681-17682, 17683-17684, 17685-17686, 17687-17688, 17689-17690, 17691-17692, 17693-17694, 17695-17696, 17697-17698, 17699-17700, 17701-17702, 17703-17704, 17705-17706, 17707-17708, 17709-17710, 17711-17712, 17713-17714, 17715-17716, 17717-17718, 17719-17720, 17721-17722, 17723-17724, 17725-17726, 17727-17728, 17729-17730, 17731-17732, 17733-17734, 17735-17736, 17737-17738, 17739-17740, 17741-17742, 17743-17744, 17745-17746, 17747-17748, 17749-17750, 17751-17752, 17753-17754, 17755-17756, 17757-17758, 17759-17760, 17761-17762, 17763-17764, 17765-17766, 17767-17768, 17769-17770, 17771-17772, 17773-17774, 17775-17776, 17777-17778, 17779-17780, 17781-17782, 17783-17784, 17785-17786, 17787-17788, 17789-17790, 17791-17792, 17793-17794, 17795-17796, 17797-17798, 17799-17800, 17801-17802, 17803-17804, 17805-17806, 17807-17808, 17809-17810, 17811-17812, 17813-17814, 17815-17816, 17817-17818, 17819-17820, 17821-17822, 17823-17824, 17825-17826, 17827-17828, 17829-17830, 17831-17832, 17833-17834, 17835-17836, 17837-17838, 17839-17840, 17841-17842, 17843-17844, 17845-17846, 17847-17848, 17849-17850, 17851-17852, 17853-17854, 17855-17856, 17857-17858, 17859-17860, 17861-17862, 17863-17864, 17865-17866, 17867-17868, 17869-17870, 17871-17872, 17873-17874, 17875-17876, 17877-17878, 17879-17880, 17881-17882, 17883-17884, 17885-17886, 17887-17888, 17889-17890, 17891-17892, 17893-17894, 17895-17896, 17897-17898, 17899-17900, 17901-17902, 17903-17904, 17905-17906, 17907-17908, 17909-17910, 17911-17912, 17913-17914, 17915-17916, 17917-17918, 17919-17920, 17921-17922, 17923-17924, 17925-17926, 17927-17928, 17929-17930, 17931-17932, 17933-17934, 17935-17936, 17937-17938, 17939-17940, 17941-17942, 17943-17944, 17945-17946, 17947-17948, 17949-17950, 17951-17952, 17953-17954, 17955-17956, 17957-17958, 17959-17960, 17961-17962, 17963-17964, 17965-17966, 17967-17968, 17969-17970, 17971-17972, 17973-17974, 17975-17976, 17977-17978, 17979-17980, 17981-17982, 17983-17984, 17985-17986, 17987-17988, 17989-17990, 17991-17992, 17993-17994, 17995-17996, 17997-17998, 17999-18000, 18001-18002, 18003-18004, 18005-18006, 18007-18008, 18009-18010, 18011-18012, 18013-18014, 18015-18016, 18017-18018, 18019-18020, 18021-18022, 18023-18024, 18025-18026, 18027-18028, 18029-18030, 18031-18032, 18033-18034, 18035-18036, 18037-18038, 18039-18040, 18041-18042, 18043-18044, 18045-18046, 18047-18048, 18049-18050, 18051-18052, 18053-18054, 18055-18056, 18057-18058, 18059-18060, 18061-18062, 18063-18064, 18065-18066, 18067-18068, 18069-18070, 18071-18072, 18073-18074, 18075-18076, 18077-18078, 18079-18080, 18081-18082, 18083-18084, 18085-18086, 18087-18088, 18089-18090, 18091-18092, 18093-18094, 18095-18096, 18097-18098, 18099-18100, 18101-18102, 18103-18104, 18105-18106, 18107-18108, 18109-18110, 18111-18112, 18113-18114, 18115-18116, 18117-18118, 18119-18120, 18121-18122, 18123-18124, 18125-18126, 18127-18128, 18129-18130, 18131-18132, 18133-18134, 18135-18136, 18137-18138, 18139-18140, 18141-18142, 18143-18144, 18145-18146, 18147-18148, 18149-18150, 18151-18152, 18153-18154, 18155-18156, 18157-18158, 18159-18160, 18161-18162, 18163-18164, 18165-18166, 18167-18168, 18169-18170, 18171-18172, 18173-18174, 18175-18176, 18177-18178, 18179-18180, 18181-18182, 18183-18184, 18185-18186, 18187-18188, 18189-18190, 18191-18192, 18193-18194, 18195-18196, 18197-18198, 18199-18200, 18201-18202, 18203-18204, 18205-18206, 18207-18208, 18209-18210, 18211-18212, 18213-18214, 18215-18216, 18217-18218, 18219-18220, 18221-18222, 18223-18224, 18225-18226, 18227-18228, 18229-18230, 18231-18232, 18233-18234, 18235-18236, 18237-18238, 18239-18240, 18241-18242, 18243-18244, 18245-18246, 18247-18248, 18249-18250, 18251-18252, 18253-18254, 18255-18256, 18257-18258, 18259-18260, 18261-18262, 18263-18264, 18265-18266, 18267-18268, 18269-18270, 18271-18272, 18273-18274, 18275-18276, 18277-18278, 18279-18280, 18281-18282, 18283-18284, 18285-18286, 18287-18288, 18289-18290, 18291-18292, 18293-18294, 18295-18296, 18297-18298, 18299-18300, 18301-18302, 18303-18304, 18305-18306, 18307-18308, 18309-18310, 18311-18312, 18313-18314, 18315-18316, 18317-18318, 18319-18320, 18321-18322, 18323-18324, 18325-18326, 18327-18328, 18329-18330, 18331-18332, 18333-18334, 18335-18336, 18337-18338, 18339-18340, 18341-18342, 18343-18344, 18345-18346, 18347-18348, 18349-18350, 18351-18352, 18353-18354, 18355-18356, 18357-18358, 18359-18360, 18361-18362, 18363-18364, 18365-18366, 18367-18368, 18369-18370, 18371-18372, 18373-18374, 18375-18376, 18377-18378, 18379-18380, 18381-18382, 18383-18384, 18385-18386, 18387-18388, 18389-18390, 18391-18392, 18393-18394, 18395-18396, 18397-18398, 18399-18400, 18401-18402, 18403-18404, 18405-18406, 18407-18408, 18409-18410, 18411-18412, 18413-18414, 18415-18416, 18417-18418, 18419-18420, 18421-18422, 18423-18424, 18425-18426, 18427-18428, 18429-18430, 18431-18432, 18433-18434, 18435-18436, 18437-18438, 18439-18440, 18441-18442, 18443-18444, 18445-18446, 18447-18448, 18449-18450, 18451-18452, 18453-18454, 18455-18456, 18457-18458, 18459-18460, 18461-18462, 18463-18464, 18465-18466, 18467-18468, 18469-18470, 18471-18472, 18473-18474, 18475-18476, 18477-18478, 18479-18480, 18481-18482, 18483-18484, 18485-18486, 18487-18488, 18489-18490, 18491-18492, 18493-18494, 18495-18496, 18497-18498, 18499-18500, 18501-18502, 18503-18504, 18505-18506, 18507-18508, 18509-18510, 18511-18512, 18513-18514, 18515-18516, 18517-18518, 18519-18520, 18521-18522, 18523-18524, 18525-18526, 18527-18528, 18529-18530, 18531-18532, 18533-18534, 18535-18536, 18537-18538, 18539-18540, 18541-18542, 18543-18544, 18545-18546, 18547-18548, 18549-18550, 18551-18552, 18553-18554, 18555-18556, 18557-18558, 18559-18560, 18561-18562, 18563-18564, 18565-18566, 18567-18568, 18569-18570, 18571-18572, 18573-18574, 18575-18576, 18577-18578, 18579-18580, 18581-18582, 18583-18584, 18585-18586, 18587-18588, 18589-18590, 18591-18592, 18593-18594, 18595-18596, 18597-18598, 18599-18600, 18601-18602, 18603-18604, 18605-18606, 18607-18608, 18609-18610, 18611-18612, 18613-18614, 18615-18616, 18617-18618, 18619-18620, 18621-18622, 18623-18624, 18625-18626, 18627-18628, 18629-18630, 18631-18632, 18633-18634, 18635-18636, 18637-18638, 18639-18640, 18641-18642, 18643-18644, 18645-18646, 18647-18648, 18649-18650, 18651-18652, 18653-18654, 18655-18656, 18657-18658, 18659-18660, 18661-18662, 18663-18664, 18665-18666, 18667-18668, 18669-18670, 18671-18672, 18673-18674, 18675-18676, 18677-18678, 18679-18680, 18681-18682, 18683-18684, 18685-18686, 18687-18688, 18689-18690, 18691-18692, 18693-18694, 18695-18696, 18697-18698, 18699-18700, 18701-18702, 18703-18704, 18705-18706, 18707-18708, 18709-18710, 18711-18712, 18713-18714, 18715-18716, 18717-18718, 18719-18720, 18721-18722, 18723-18724, 18725-18726, 18727-18728, 18729-18730, 18731-18732, 18733-18734, 18735-18736, 18737-18738, 18739-18740, 18741-18742, 18743-18744, 18745-18746, 18747-18748, 18749-18750, 18751-18752, 18753-18754, 18755-18756, 18757-18758, 18759-18760, 18761-18762, 18763-18764, 18765-18766, 18767-18768, 18769-18770, 18771-18772, 18773-18774, 18775-18776, 18777-18778, 18779-18780, 18781-18782, 18783-18784, 18785-18786, 18787-18788, 18789-18790, 18791-18792, 18793-18794, 18795-18796, 18797-18798, 18799-18800, 18801-18802, 18803-18804, 18805-18806, 18807-18808, 18809-18810, 18811-18812, 18813-18814, 18815-18816, 18817-18818, 18819-18820, 18821-18822, 18823-18824, 18825-18826, 18827-18828, 18829-18830, 18831-18832, 18833-18834, 18835-18836, 18837-18838, 18839-18840, 18841-18842, 18843-18844, 18845-18846, 18847-18848, 18849-18850, 18851-18852, 18853-18854, 18855-18856, 18857-18858, 18859-18860, 18861-18862, 18863-18864, 18865-18866, 18867-18868, 18869-18870, 18871-18872, 18873-18874, 18875-18876, 18877-18878, 18879-18880, 18881-18882, 18883-18884, 18885-18886, 18887-18888, 18889-18890, 18891-18892, 18893-18894, 18895-18896, 18897-18898, 18899-18900, 18901-18902, 18903-18904, 18905-18906, 18907-18908, 18909-18910, 18911-18912, 18913-18914, 18915-18916, 18917-18918, 18919-18920, 18921-18922

НАСТРОЙКИ РАСЧЕТА КОДА 6347

Форма 0409110 - Настроечная таблица

Скрыть параметры поиска Скрыть значения фильтров



Код символа формы 110 = 6347

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

	Профиль отчетной формы	Алгоритм	Номер раздела	Номер строки	Код символа формы 110	Знак	Описание расшифровки	Описание группы счетов
▶	Форма 110 с 01.01.2025	Обороты	III.1	37	6347	Плюс	Комбинация остатков символов 15115 + 15117 + 15219 + 15220 + 17115 + 1...	№№ 70601, 70602, 70701, 70702
	Форма 110 с 01.01.2025	Обороты	III.1	37	6347	Минус	Комбинация остатков символов 15115 + 15117 + 15219 + 15220 + 17115 + 1...	№№ 70606, 70607, 70706, 70707

Код символа формы 110 = 6347

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

	Маска счета дебета	Маска счета кредита	Цель кредита	Тип обеспечения
▶		15115, 15117, 15219, 15220, 17115, 17117, 17219, 17220, 2...	Ипотека, Долевое строительство, Военная ипотека	Недвижимость жилая, Право требования
	37115, 37117, 37219, 37220, 38115, 38117, 38219, 38220, 4111...		Ипотека, Долевое строительство, Военная ипотека	Недвижимость жилая, Право требования

ПРИМЕР ДЕТАЛИЗАЦИИ РАССЧИТАННЫХ ДАННЫХ

Форма 0409110 - Реестр оборотов в разрезе строк

Скрыть параметры поиска ?

Дата с* 30.09.2024 .. Версия расчета 1

Дата по* 30.09.2024 .. Статус записи А

Филиал [] X Просмотр исходных данных []

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

Номер раздела	Код символа формы 110	Сумма по коду	Сумма по коду в валюте	Дата проводки	Балансовый счет Дебет	Номер счета дебета	Наименование счета дебета
III.1	6346	65.10	65.10	16.09.2024	47425	47425810	
III.1	6347	29 616.24	29 616.24	19.09.2024	47425	47425810	
▶ III.1	6347	-143 578.07	-143 578.07	04.09.2024	70606	70606810	

Балансовый счет Кредит	Номер счета кредита	Наименование счета кредита	Счет дохода/расхода	Символ дохода / расхода	Сумма в валюте счета дебета
70601	70601810		70601810	15102	65.10
70601	70601810		70601810	15115	29 616.24
45515	45515810		70606810	37115	143 578.07

Сумма в валюте счета кредита	Сумма, приведенная к рублям	Номер связанного счёта требования	Финансовый инструмент	Цель кредита	Валютные доходы/расходы
65.10	65.10	47427840...	ФИ_Кредиты	Потребительский кредит	Да
29616.24	29616.24	47427810...	ФИ_Кредиты	Ипотека	Нет
143578.07	143578.07	45507810...	ФИ_Кредиты	Долевое строительство	Нет

ФОРМА 0409634

Отчет об открытых позициях по валютному риску

Марина Баранова,
ведущий инженер-аналитик
департамента «Экономика данных»

ОБЩИЕ СВЕДЕНИЯ

Порядок расчета ОВП изложен в инструкции 213-И, которая вступила в действие с 01.07.2024



Порядок расчета ОВП изложен в инструкции 213-И, которая вступила в действие с 01.07.2024



Разные сроки предоставления разделов отчета



ИЗМЕНЕНИЯ В ФОРМЕ

ДО 01.01.2025

Отчет об открытых валютных позициях – 17 атрибутов

Раздел «Справочно» – 7 атрибутов

ПОСЛЕ 01.01.2025

Раздел 1 – ОВП для ограничения валютного риска – 27 атрибутов

Раздел 2 – ОВП для оценки влияния на капитал – 14 атрибутов

Раздел 3 – Информация о превышениях размеров (лимитов) ОВП – 13 атрибутов

Раздел 4 - Информация об отдельных показателях по ОВП – 5 атрибутов

Раздел 5 - Информация о сделках, по которым имеется повышенный риск притворности или повышенный риск неисполнения – 21 атрибут

НОВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ, ВВЕДЕННЫЕ ИНСТРУКЦИЕЙ 213-И

- ✓ Скорректированный базовый капитал
- ✓ Сделки с повышенным риском притворности и повышенным риском неисполнения
- ✓ Встроенные ПФИ
- ✓ Критерии существенности для проверки сделок на повышенный риск
- ✓ ОВП для ограничения валютного риска (с учетом МСФО) и для ограничения влияния на капитал (без учета МСФО)
- ✓ ОВП для каждого норматива достаточности капитала
- ✓ Новые лимиты на балансовую и валовую балансовую позиции

АВТОМАТИЗАЦИЯ ФОРМЫ



НАСТРОЕЧНЫЕ ТАБЛИЦЫ

- Скорректированный базовый капитал
- Лимиты ОВП
- Пороги существенности для срочных сделок



ЗАГРУЗКА АТТРИБУТОВ

- Признак сделки с повышенным риском
- Признак встроенного ПФИ



РАСЧЁТ АТТРИБУТОВ

- Сделки, не подлежащие проверке на повышенный риск
- Уровень капитала, в состав показателей которого включен актив/обязательство

НАСТРОЙКИ РАСЧЕТА

Отдельные показатели ✕

  Скрыть параметры поиска ?










Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Филиал	Дата, на которую...	Показатель	Значение показателя
<input type="checkbox"/>		31.08.2024	Скорректированный базовый капитал	54 174 028 000,00
<input type="checkbox"/>		31.08.2024	Капитал, руб.коп.	54 634 248 000,00










Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Алгоритм поиска капитала	Критерий существенности от скорректированного б...	Критерий существенности от скорректированного баз...	Критерий существенности по сумме	Метод определения позиций по ПФИ
<input type="checkbox"/>	на отчетную дату	0.20	5 000 000 000,00	100 000 000,00	количественный










Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Филиал	Балансовая ОВП	Совокупная ОВП	Валовая балансовая ОВП	Валовая совокупная ОВП	Чистая совокупная ОВП
<input type="checkbox"/>		50.00	10.00	50.00	20.00	10.00

ПРИМЕР ДЕТАЛИЗАЦИИ РАССЧИТАННЫХ ДАННЫХ

Файл Детальный слой Реестр данных Общие справочники Отчетные формы Отчеты

Форма 0409634

Форма 0409634 - Реестр отнесения к строкам

Скрыть параметры поиска ?

Дата с* 30.09.2024 .. Версия расчета 1

Дата по* 30.09.2024 .. Статус записи А

Филиал [] X Просмотр исходных данных

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	ИД Договора	Тип счета	Ко...	Баланс...	Сумма в вал...	Сумма в р...	Номер сч...	Резерв ОВП	Номер сче...	Сумма коррек...	Счет пе...	Номер счета корре...	Счет рее...	Наимено...	Сумма ОВП	ИД номера счета резе
<input type="checkbox"/>	0	А	376	20202	1 553 600,00	44 255 476...		0,00		0,00				Новый и...	1 553 600,00	
<input type="checkbox"/>	939 646	А	398	30114	67 625 068,77	13 101 748...	30126810...	676 250,66	301298106...	35 374,73				Казахст...	66 766 230,37	
<input checked="" type="checkbox"/>	8 231 455	А	156	47502	727 128,12	9 609 943,37		0,00		0,00	4750115...			Китайск...	727 128,12	
<input type="checkbox"/>	1 711 130	П	840	40817	0,02	1,85		0,00						Доллар ...	-0,02	
<input type="checkbox"/>	1 710 907	П	978	40817	6,41	663,24		0,00						Евро	-6,41	
<input type="checkbox"/>	0	П	А99	30601	3 000,00	290 460,00		0,00						Серебро	-3 000,00	
<input type="checkbox"/>	7 714 439	А	156	93304	35 371 000,00	467 473 74...		0,00		0,00				Китайск...	35 116 465,27	
<input type="checkbox"/>	8 180 459	А	978	93304	12 000,00	1 241 632,80		0,00		0,00				Евро	11 906,08	
<input type="checkbox"/>			840	91315	6 229 867,96	577 587 25...	47425810...	62 298,68	474658105...	-2 887 936,28				Доллар ...	-31 149,34	2
<input type="checkbox"/>			840	91315	1 221 665,30	113 263 76...	47425810...	12 216,65	474658107...	-566 318,83				Доллар ...	-6 108,33	3
<input type="checkbox"/>			840	91315	1 358 175,60	125 919 99...	47425810...	13 581,76	474668104...	5 918 239,58				Доллар ...	-77 416,01	3
<input type="checkbox"/>	8 233 467		840	91314	147 191 919...	147 191 91...	32211810...	0,00	322138100...	91 952,07			32202810...	Доллар ...	0,00	
<input type="checkbox"/>	8 233 513		840	91314	1 229 194 28...	1 229 194 ...	32211810...	0,00	322138100...	767 888,34			32202810...	Доллар ...	0,00	

РЫНОЧНЫЙ РИСК

Коды 8812.1, 8812.2, 8812.0 Формы 0409135 «Информация об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации»

Крайнова Ирина,
ведущий инженер-аналитик
департамента «Экономика данных»

ОБЩИЕ СВЕДЕНИЯ

ОСНОВНЫЕ ПОНЯТИЯ

- Порядок расчета рыночного риска (РР) изложен в положении 511-П.
- Величина Рыночного риска предоставляется ежемесячно в рамках формы 135, как коды 8812.1, 8812.2, 8812.0.
- Изменения вступили в действие с **01.07.2024** и **01.10.2024**.

ОЦЕНКА РЫНОЧНОГО РИСКА

Рыночный риск оценивается по Инструментам:

- вложения в ценные бумаги (в т.ч. депозитарные расписки)
- срочные и наличные сделки
- ПФИ (форварды, фьючерсы, свопы, опционы)
- драгоценные металлы, камни (алмазы)

НОВЫЕ ПОНЯТИЯ И ОГРАНИЧЕНИЯ

- ✓ Уточнение периметра инструментов, по которым оценивается рыночный риск
- ✓ Отмена порога для включения валютного риска в расчет РР (форма 634), был 2% от Капитала
- ✓ Отсутствие применения страновых оценок к облигациям российских банков (продление решения СД БР)
- ✓ Введение понятия сделок с повышенным риском (ф634), ПФИ банковского портфеля, особенности их включения в расчет
- ✓ Увеличение коэффициента риска для инструментов в интервале до 1 месяца с 0% до 0,1% (взвес в РР – 1.25%)
- ✓ Включение в расчет драгоценных камней (обработанных природных алмазов)



АТТРИБУТИВНЫЙ СОСТАВ

До изменений: 164 атрибута,
из них 64 – расчетные:



- отнесение к определенному виду РР
- определение чистой позиции по инструменту
- определение временных интервалов и зон
- определение коэффициентов взвешивания
- определение промежуточных и итоговой суммы рыночного риска по позициям с учетом соответствующих коэффициентов

После изменений: - 172 атрибута, из
них 67 – расчетных:

- ПФИ Банковского портфеля на основе загружаемых атрибутов по целям договора:
 - управление ликвидностью
 - хеджирование рисков
 - сделка не для торговых операций
- Сделка с повышенным риском (на основе данных формы 0409634 или маркировки)

НАСТРОЙКИ РАСЧЕТА

Рыночный риск - Позиция PP x Рыночный риск - Вид PP x Рыночный риск - Отнесение ЦБ к ПК x Рыночный риск - Настройка отнесения к кодам ПК x Рыночный риск - Группы риска ЦБ x Рыночный риск - Сроки и риск x

Скрытие параметров



Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Ид...	Проф...	Вид позиции PP	Описание	Наименование фина...	Группа счетов	Признак ПФИ	Базисный актив	Тип сделки ПФИ	Тип операции	ФО сделки
<input type="checkbox"/>	2 170	135	Позиция валюты по ПФИ	ПФИ, базисным (базовым) активом которых являются ино...		NN 963П	Да	Валюта		SELL	SWAP
<input type="checkbox"/>	2 171	135	Позиция валюты по ПФИ	ПФИ, базисным (базовым) активом которых являются ино...		NN 47407	Да	Валюта		SELL	SWAP
<input type="checkbox"/>	2 175	135	Позиция валюты по ПФИ	ПФИ, базисным (базовым) активом которых являются ино...		NN 933A	Да	Валюта		BUY	Фьючерс
<input type="checkbox"/>	2 176	135	Позиция валюты по ПФИ	ПФИ, базисным (базовым) активом которых являются ино...		NN 963П	Да	Валюта		SELL	FORWAR
<input type="checkbox"/>	2 179	135	Позиция по вложениям в ЦБ	обыкновенных акций		NN 506A, 507A, 6...					
<input type="checkbox"/>	2 180	135	Позиция по вложениям в ДМ	балансовых активов и пассивов, номинированных в драг...		NN 204A, 47407,...		ДрагМетал			
<input type="checkbox"/>	2 186	135	Позиция ДМ по ПФИ	ПФИ, базисным (базовым) активом которых являются тов...		NN 934A	Да			BUY	Фьючерс
<input type="checkbox"/>	2 187	135	Позиция ДМ по ПФИ	ПФИ, базисным (базовым) активом которых являются тов...		NN 964П	Да			SELL	FORWAR
<input type="checkbox"/>	2 190	135	Позиция ДС по продаже цен...	на обязательства по обратной поставке ценных бумаг, п...	ФИ_СделкиРЕПО	NN 315П, 316П, 4...					
<input type="checkbox"/>	2 192	135	Позиция валюты по ПФИ	ПФИ, базисным (базовым) активом которых являются ино...		NN 963П	Да	Валюта		SELL	Фьючерс
<input type="checkbox"/>	2 193	135	Позиция ДМ золото по ПФИ	ПФИ, базисным (базовым) активом которых являются ино...		NN 964П	Да	ДрагМетал		SELL	FORWAR
<input type="checkbox"/>	2 197	135	Позиция ДМ по ПФИ	ПФИ, базисным (базовым) активом которых являются тов...		NN 934A	Да			BUY	FORWAR
<input type="checkbox"/>	2 198	135	Позиция ЦБ по ПФИ	сделки купли-продажи с активом ЦБ (не ПФИ)		NN 941A, 971П, 9...		Ценныебумаги			

[Профиль настроек] = '135'

Конструктор фильтра...

Всего найдено: 44

Всего страниц: 1 < 1 >

ПРИМЕР ИТОГОВОГО ОТЧЕТА

Рыночный Риск

Реестр данных - ОПР | Реестр данных - СПР | Реестр данных - ВР | Реестр данных - ФР | Реестр данных - ТР | Реестр данных - итоговый реестр

Скрыть параметры поиска ?

Дата с* 30.06.2023 .. Версия расчета 1

Дата по* 30.06.2023 .. Статус записи А

Филиал [] [X] Просмотр исходных данных

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Уровень	Вид риска	Код валюты позиции	Признак высокого риска	Сумма по виду риска (вал)	Сумма по виду риска (руб)	Коэффициент РР	Взвешенная сумма по виду риска (руб)
<input type="checkbox"/>	1	Общий фондовый риск	840			3 914 354 859,860	8,000	313 148 389,000
<input type="checkbox"/>	1	Общий фондовый риск	978			56 650 125,000	8,000	4 532 010,000
<input type="checkbox"/>	2	Специальный процентный риск				69 404 354,979		5 552 348,400
<input type="checkbox"/>	2	Общий процентный риск			0,000	218 666 124,962		218 666 124,962
<input type="checkbox"/>	2	Общий фондовый риск				5 695 101 193,860	8,000	455 608 074,000
<input type="checkbox"/>	2	Валютный риск (ф.634)						
<input type="checkbox"/>	2	Специальный фондовый риск				10 128 541 375,860	8,000	435 178 855,000
<input type="checkbox"/>	2	Общий товарный риск				2 379 478 220,520	15,000	356 921 733,080
<input type="checkbox"/>	2	Дополнительный товарный риск				2 379 478 220,520	3,000	71 384 346,620
<input type="checkbox"/>	3	Процентный риск				288 070 479,941		224 218 473,362
<input type="checkbox"/>	3	Товарный риск				4 758 956 441,040		428 306 079,700
<input type="checkbox"/>	3	Валютный риск				3 811 998 830,600		0,000
<input type="checkbox"/>	3	Фондовый риск				15 823 642 569,720		890 786 929,000
<input type="checkbox"/>	4	Рыночный риск				24 682 668 321,301	12,500	19 291 393 525,780

ПРИМЕР ДЕТАЛИЗАЦИИ РАССЧИТАННЫХ ДАННЫХ

Реестр данных - ОПР x Реестр данных - СПР x Реестр данных - ВР x Реестр данных - ФР x Реестр данных - ТР x Реестр данных - итоговый реестр x

Скрыть параметры поиска ?

Дата с* 30.06.2023 .. Версия расчета 1

Дата по* 30.06.2023 .. Статус записи А

Филиал X Просмотр исходных данных

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	С...	П...	Филиал	Номер...	...	Р...	Наиме...	Наименование портфеля ЦБ	Роль аналитического счета	Сумма средний риск (руб)	Сумма СПР (...)	ФО сделки	Дата плановая	Сумма без риска (руб)	Сумма низкий р
<input type="checkbox"/>	A		0000	50605...		2...	Сберб...	Оцениваемые по справедливой стоимости	Основной	13 622 818,900	1 089 825,510		21.04.2024		
<input type="checkbox"/>	A		0000	50104...		2...	ОФЗ 2...	Оцениваемые по справедливой стоимости	Дисконт	49,468	3,960		16.03.2039	2 423,942	
<input type="checkbox"/>	A		0000	50104...		2...	ОФЗ 2...	Оцениваемые по справедливой стоимости	Основной	16 550 734,190	1 324 058,740		16.03.2039	810 985 975,290	
<input type="checkbox"/>	A		0000	50104...		2...	ОФЗ 2...	Оцениваемые по справедливой стоимости	Премия	1 345 778,118	107 662,250		16.03.2039	65 943 127,792	
<input type="checkbox"/>	A		0000	50104...		2...	ОФЗ 2...	Оцениваемые по справедливой стоимости	НКД	418 786,933	33 502,950		16.03.2039	20 520 559,727	
<input type="checkbox"/>	A		0000	50104...		2...	ОФЗ 2...	Оцениваемые по справедливой стоимости	Дисконт	195 524,256	15 641,940		15.05.2041	9 580 688,554	
<input type="checkbox"/>	A		0000	50104...		2...	ОФЗ 2...	Оцениваемые по справедливой стоимости	Основной	19 320 981,855	1 545 678,550		15.05.2041	946 728 110,915	
<input type="checkbox"/>	A		0000	50104...		2...	ОФЗ 2...	Оцениваемые по справедливой стоимости	НКД	122 467,898	9 797,430		15.05.2041	6 000 926,992	
<input type="checkbox"/>	A		0000	50110...			СВОМ ...	Оцениваемые по справедливой стоимости	Основной	1 924 888,320	153 991,070		21.09.2026		
<input type="checkbox"/>	A		0000	50110...			СВОМ ...	Оцениваемые по справедливой стоимости	Дисконт	159 312,700	12 745,020		21.09.2026		
<input type="checkbox"/>	A		0000	50110...			СВОМ ...	Оцениваемые по справедливой стоимости	НКД	41 271,650	3 301,730		21.09.2026		
<input type="checkbox"/>	A		0000	50104...		2...	ОФЗ 2...	Оцениваемые по справедливой стоимости	Основной	15 512 148,053	1 240 971,840		07.07.2023	760 095 254,607	
<input type="checkbox"/>	A		0000	50104...		2...	ОФЗ 2...	Оцениваемые по справедливой стоимости	НКД	93 709,904	7 496,790		07.07.2023	4 591 785,296	

[Сумма СПР (руб)] в ('3,960', '316,010', '3 301,730', '7 354,610', '7 496,790', '9 797,430', '12 745,020', '15 641,940', '33 502,950', '107 662,250', '153 991,070', '1 089 825,510', '1 240 971,840', '1 324 058,740', '1 545 678,550')

Конструктор фильтра...

ПРИМЕР ДЕТАЛИЗАЦИИ ВЗАИМОЗАЧЕТА (ПКК)

Реестр взаимозачета											
Наименование бумаги	ISIN код	Актив (длинная позиция)			Пассив (короткая позиция)			Позиция после взаимозачета			Вид риска
		Номер счета	остаток на счете (с учетом переоценки)	дата (Дата окончания обратного РЕПО/срочной сделки/ПФИ)	номер счета	остаток на счете (с учетом переоценки)	сумма по 91314 в пределах 91419	дата (Дата окончания обратного РЕПО/срочной сделки/ПФИ)	длинная позиция	короткая позиция	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
Облигация ФР	RU0000000000	50605	1 148 665 971,87						1 757 828 621,97		ФР
Облигация ФР	RU0000000000	50618	616 873 400,10	02.05.2024							ФР
Облигация ФР	RU0000000000	93304	4 594 424 979,00	20.06.2024					4 594 424 979,00		ПР
Облигация ФР	RU0000000000				96504	4 484 788 101,00		20.06.2024		4 484 788 101,00	ФР
Облигация ФР	RU0000000000				97101	7 710 750,00		02.05.2024			ФР

ФОРМА 0409122

Расчет показателя краткосрочной ликвидности («БАЗЕЛЬ III»)

Екатерина Максимова,
Руководитель команды
департамента «Экономика данных»

ОБЩИЕ СВЕДЕНИЯ

- № 6800-У
изменения в 6406-У с 01.01.2025 г.
- № 6667-У
изменения в 421-П с 01.10.2024 г.
- №510-П: без изменений

КЛЮЧЕВЫЕ ИЗМЕНЕНИЯ

- Уточнен список исключаемых средств (в т.ч., счета типа «С»)
- Активы с цифровыми рублями включаются отчет – строка 1.1.1(1)
- Список ВЛА-2А дополнен номинированными в российских рублях облигациями, выпущенные ВЭБ.РФ и ЕИРЖС (строки 1.2.6. и 1.2.7)
- Определен порядок отнесения КСУ к необременённым высоколиквидным активам
- Анализ рейтингов международных рейтинговых агентств дополнен рейтингами национальных рейтинговых агентств – строка 1.3.2.3
- Средства, подлежащие депонированию, необходимо пересчитывать по формуле – строка 2.2.6

$$КС_{Н} = \frac{УОР \times К_{пу} - КС_{ср} \times К_{факт}}{К_{пу} - К_{факт}} - КС$$

СОСТАВ ОТЧЕТА

ДОПОЛНИТЕЛЬНО РЕАЛИЗОВАНЫ НОВЫЕ ИТ

- «Периоды усреднения обязательных резервов»
- «Алгоритмы позиций ФОР»

РЕЕСТРЫ ОТЧЕТА

- Форма 0409122 – Агрегат – **29**
- Форма 0409122 - Итоговая форма – **17**
- Форма 0409122 - Итоговый реестр – **209 + 2 НОВЫХ**
- Форма 0409122 - Реестр Данных Формы – **204 + 2 НОВЫХ**
- Форма 0409122 - Суммы неттинга в разрезе клиента – **21**
- Форма 0409122 - Детализация признака снижения средств – **18**
- Форма 0409122 - Детализация расчета СрАрф треб/обяз – **12**

ДЛЯ РАСЧЕТА СТРОКИ 2.2.6. ДОБАВЛЕНА НТ С ОТРАЖЕНИЕМ ПЕРИОДОВ УСРЕДНЕНИЯ

122 x

Файл СПО DWH CBR Подготовка отчетов Мониторинг контроля качества данных Мониторинг бизнес-процессов Тестовые данные Справочники ФОРМА 0409800

Базовые данные
Исходные данные
Рассчитанные данные
Детализации
Настроочные таблицы

- Форма 0409122 - Параметры расчета
- Форма 0409122 - Параметры позиций формы
- Форма 0409122 - Алгоритмы позиций ФОР
- Форма 0409122 - Периоды усреднения обязательных резервов
- Форма 0409122 - Параметры исключения из ОПДС
- Форма 0409122 - Параметры исключения из ООДС
- Форма 0409122 - Значимые валюты счета
- Форма 0409122 - Корректировка позиций**
- Форма 0409122 - Ручной ввод
- Форма 0409122 - Страна филиала
- Форма 0409122 - Пользовательский показатель обесценивания
- Форма 0409122 - Параметры превышения ВЛА над ЧООДС
- Форма 0409122 - Минимальный операционный остаток по счету
- Форма 0409122 - ЦБ принимаемые в обеспечение по кредитам Банка России
- Реестр сумм по срокам - Настройка интеграции
- Форма 0409122 - Особенности заполнения

Форма 0409122 - Периоды усреднения обязательных резервов x Форма 0409122 - Алгоритмы позиций ФОР

Скрыть параметры поиска ?

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Начало периода усреднения	Окончание периода усреднения	Отчетный период
<input checked="" type="checkbox"/>	17.01.2024	13.02.2024	01.12.2023
<input type="checkbox"/>	14.02.2024	12.03.2024	01.01.2024
<input type="checkbox"/>	13.03.2024	09.04.2024	01.02.2024
<input type="checkbox"/>	10.04.2024	07.05.2024	01.03.2024
<input type="checkbox"/>	08.05.2024	04.06.2024	01.04.2024
<input type="checkbox"/>	05.06.2024	09.07.2024	01.05.2024
<input type="checkbox"/>	10.07.2024	13.08.2024	01.06.2024
<input type="checkbox"/>	14.08.2024	10.09.2024	01.07.2024
<input type="checkbox"/>	11.09.2024	08.10.2024	01.08.2024
<input type="checkbox"/>	09.10.2024	12.11.2024	01.09.2024
<input type="checkbox"/>	13.11.2024	10.12.2024	01.10.2024
<input type="checkbox"/>	11.12.2024	14.01.2025	01.11.2024

ПРЕДУСМОТРЕНО ЗАПОЛНЕНИЕ НА ОСНОВАНИИ РЕАЛИЗОВАННОГО/ЗАГРУЖЕННОГО ОТЧЕТА «ИНФОРМАЦИЯ ДЛЯ РАСЧЕТА РАЗМЕРА ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ РЕЗЕРВОВ»

Форма 0409122 - Периоды усреднения обязательных резервов X Форма 0409122 - Алгоритмы позиций ФОР X

Скрыть параметры поиска ?

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

<input type="checkbox"/>	Номер позиции	Алгоритм расчета
<input type="checkbox"/>	P1_2.2.6	ФОР

РЕЕСТР ДАННЫХ ОТЧЕТА

Форма 0409122 - Реестр данных Формы X

Скрыть параметры поиска Скрыть значения фильтров ?

Дата с* 31.07.2024 .. Версия расчета
 Дата по* 31.07.2024 .. Статус записи А
 Филиал .. Просмотр исходных данны

(Признак ВЛА > 0 ИЛИ Рейтинг ценной бумаги (нац., балл) > 0 ИЛИ Рейтинг эмитента (нац., балл) > 0)

Поместите сюда заголовок колонки для группировки по этой колонке

Код ISIN ...	Признак ВЛА	Рейтинг ценной бумаги (нац., балл)	Рейтинг эмитента (нац., балл)	Рейтинг ценной бумаги (балл)	Вхождение в ломбардный список	Признак котируемости выпуска	Цена рыночная	Вид ценной бумаги
RU000A0J...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	1 000,52	Облигация федерального займа
RU000A0J...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	1,00	Облигация федерального займа
RU000A1...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	944,16	Облигация федерального займа
RU000A0J...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	0,00	Облигация федерального займа
RU000A0J...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	1 000,52	Облигация федерального займа
RU000A0J...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	1 000,52	Облигация федерального займа
RU000A1...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	1,00	Облигация федерального займа
RU000A0J...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	1,00	Облигация федерального займа
RU000A1...	3	0,00	0,00	1 400,00	Нет	Да	807,29	Корпоративная облигация
RU000A1...	3	0,00	0,00	1 400,00	Нет	Да	807,29	Корпоративная облигация
RU000A0J...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	1,00	Облигация федерального займа
RU000A1...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	944,16	Облигация федерального займа
RU000A0J...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	1,00	Облигация федерального займа
RU000A0J...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	0,00	Облигация федерального займа
RU000A1...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	944,16	Облигация федерального займа
RU000A0J...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	0,00	Облигация федерального займа
RU000A1...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	944,16	Облигация федерального займа
RU000A0J...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	0,00	Облигация федерального займа
RU000A1...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	944,16	Облигация федерального займа
RU000A1...	1	0,00	0,00	1 350,00	Да	Да	0,00	Облигация федерального займа

НОВЫЙ ПРОЕКТ ИЗМЕНЕНИЙ С 01.01.2026 Г.



Подготовлен проект нового положения взамен 510-П с сохранением подходов по 421-П. Утверждение данного нормативного акта планируется в декабре 2024 года.



Отменяется/меняется форма 0409122 (сдается СЗКО, Банковскими группами и крупными банками). Вместо норматива краткосрочной ликвидности по Базелю (НКЛ) вводится новый **национальный** норматив краткосрочной ликвидности (ННКЛ), при этом норматив остается прежним Н26 (Н27).



**ЕСЛИ ВАМ НУЖНА ПОМОЩЬ В
ПОСТРОЕНИИ ОБЯЗАТЕЛЬНОЙ
ОТЧЕТНОСТИ, ОБРАЩАЙТЕСЬ!**



cbrf@diasoft.ru

