

14.07.2015 № 23-14/267

Банки (по списку)

О представлении информации о расчете показателей капитала, левереджа и ликвидности, предусмотренных международными стандартами Базель III

В соответствии с пунктом 3 постановления Правления Национального банка Республики Беларусь от 24 сентября 2012 г. № 493 "Об утверждении Методики расчета банками показателей капитала, левереджа и ликвидности, предусмотренных международными стандартами Базель III" (в ред. постановления Правления Национального банка Республики Беларусь от 30 сентября 2014 г. № 604) (далее – Методика) письмом Национального банка от 15.12.2014 № 23-14/69 "О представлении информации о расчете показателей капитала, левереджа и ликвидности, предусмотренных международными стандартами Базель III" (далее – письмо Национального банка от 15.12.2014 № 23-14/69) было направлено описание информационной технологии, определяющей порядок составления и представления банками информации о расчете данных показателей.

Принятие постановления Правления Национального банка Республики Беларусь от 10 июля 2015 г. № 419 "О внесении дополнений и изменений в Методику расчета банками показателей капитала, левереджа и ликвидности, предусмотренных международными стандартами Базель III" вызвало необходимость приведения указанного описания в соответствие с данным постановлением.

Настоящим письмом направляем описание информационной технологии, определяющей порядок составления и представления банками информации о расчете показателей согласно приложениям 1 – 4 к Методике:

"Расчет показателей капитала" – в виде текстовых файлов (далее – файлы) с именем F2860.NNN (где NNN – код банка, представляющего информацию);

”Расчет показателя леввереджа“ – в виде файлов с именем F2861.NNN;

”Расчет показателя покрытия ликвидности“ – в виде файлов с именем F2862.NNN;

”Расчет показателя чистого стабильного фондирования“ – в виде файлов с именем F2863.NNN.

При составлении и представлении информации о расчете показателей следует использовать форматы файлов F2860.NNN (приложение 1), F2861.NNN (приложение 2), F2862.NNN (приложение 3), F2863.NNN (приложение 4).

Информация представляется в виде комплекта файлов F2860.NNN, F2861.NNN, F2862.NNN, F2863.NNN через документальный информационный портал Национального банка или другим способом, согласованным с Национальным банком.

В информационной строке файлов каждое поле является обязательным для заполнения.

Если при заполнении информационной строки в файлах значение каждого включаемого в нее показателя равно нулю, то такую строку допускается не включать в файлы.

При обнаружении ошибок в информации банки вправе вносить исправления в информацию в порядке, согласованном с Главным управлением банковского надзора Национального банка.

В связи с выходом настоящего письма не применяются в работе письмо Национального банка от 15.12.2014 № 23-14/69, а также письмо Национального банка от 03.02.2015 № 23-14/12 ”О представлении информации о расчете показателя покрытия ликвидности, предусмотренного международными стандартами Базель III“. Файлы, подготовленные банками в соответствии с указанными письмами, просим представить в последний раз по состоянию на 1 июля 2015 г. не позднее 20 июля 2015 г.

В соответствии с приведенным в настоящем письме описанием информационной технологии просим представить:

файлы F2860.NNN, F2861.NNN, F2863.NNN по состоянию на 1 октября 2015 г. не позднее 20 октября 2015 г. и на 1 января 2016 г. не позднее 20 января 2016 г.;

файл F2862.NNN в первый раз – по состоянию на 1 августа 2015 г. не позднее 20 августа 2015 г., в последующем – ежемесячно не позднее 20-го числа месяца, по состоянию на 1-е число которого составлен расчет.

Кроме того, просим представить 21 августа 2015 г. расчет показателя покрытия ликвидности по состоянию на 1 июля 2015 г. в соответствии с приведенным в настоящем письме описанием информационной технологии в виде файлов с именем F2862a.NNN.

При необходимости следует обращаться в Национальный банк:
в управление методологии пруденциального надзора Главного управления банковского надзора (телефон 219 23 34) – по вопросам применения Методики для составления расчета показателей;
в управление сопровождения информационных систем Главного управления информационных технологий (телефон 259 16 59) – по вопросам представления информации в виде файлов.

Приложение: на 4 л. в 1 экз.

Заместитель
Председателя Правления

П.А.Маманович

Приложение 1

Формат файла,
содержащего расчет показателей капитала

Имя: F2860.NNN

Текст:

```
#maket "F2860"
#branch NNN
#day 01
#month MM
#year YYYY
#version VR
#clerk "name"
#phone "number"
#postclerk "pcname"
#postphone "pcnumber"
KKKK,X
.....
```

где:

- NNN - код головного учреждения банка;
- MM - номер месяца, по состоянию на 1-е число которого составлен расчет;
- YYYY - год (4 знака);
- VR - порядковый номер версии файла (начиная с 1);
- name - фамилия ответственного исполнителя;
- number - номер телефона ответственного исполнителя;
- pcname - фамилия исполнителя, ответственного за представление файла;
- pcnumber - номер телефона исполнителя, ответственного за представление файла;
- KKKK - код отчетного данного (графа 3 приложения 1 к Методике);
- X - значение отчетного данного с точностью до 0.1.

Формат файла,
содержащего расчет показателя левереджа

Имя: F2861.NNN

Текст:

```
#maket "F2861"
#branch NNN
#day 01
#month MM
#year YYYY
#version VR
#clerk "name"
#phone "number"
#postclerk "pcname"
#postphone "pcnumber"
KKKK,X
.....
```

где:

- NNN - код головного учреждения банка;
- MM - номер месяца, по состоянию на 1-е число которого составлен расчет;
- YYYY - год (4 знака);
- VR - порядковый номер версии файла (начиная с 1);
- name - фамилия ответственного исполнителя;
- number - номер телефона ответственного исполнителя;
- pcname - фамилия исполнителя, ответственного за представление файла;
- pcnumber - номер телефона исполнителя, ответственного за представление файла;
- KKKK - код отчетного данного (графа 3 приложения 2 к Методике);
- X - значение отчетного данного с точностью до 0.1.

Формат файла,
содержащего расчет показателя покрытия ликвидности

Имя: F2862.NNN

Текст:

```
#maket "F2862"
#branch NNN
#day 01
#month MM
#year YYYY
#version VR
#clerk "name"
#phone "number"
#postclerk "pcname"
#postphone "pcnumber"
KKKK,S,X
.....
```

где:

- NNN - код головного учреждения банка;
- MM - номер месяца, по состоянию на 1-е число которого составлен расчет;
- YYYY - год (4 знака);
- VR - порядковый номер версии файла (начиная с 1);
- name - фамилия ответственного исполнителя;
- number - номер телефона ответственного исполнителя;
- pcname - фамилия исполнителя, ответственного за представление файла;
- pcnumber - номер телефона исполнителя, ответственного за представление файла;
- KKKK - код отчетного данного (графа 3 приложения 3 к Методике);
- S - символ отчетного данного (примечание 1);
- X - значение отчетного данного с точностью до 0.1.

Примечание.

1. Необходимо использовать следующие значения поля S в информационной строке:

- 1 - "Сумма по балансу";
- 2 - "Сумма расчета".

Формат файла, содержащего расчет
показателя чистого стабильного фондирования

Имя: F2863.NNN

Текст:

```
#maket "F2863"
#branch NNN
#day 01
#month MM
#year YYYY
#version VR
#clerk "name"
#phone "number"
#postclerk "pcname"
#postphone "pcnumber"
KKKK,S,X
.....
```

где:

- NNN - код головного учреждения банка;
- MM - номер месяца, по состоянию на 1-е число которого составлен расчет;
- YYYY - год (4 знака);
- VR - порядковый номер версии файла (начиная с 1);
- name - фамилия ответственного исполнителя;
- number - номер телефона ответственного исполнителя;
- pcname - фамилия исполнителя, ответственного за представление файла;
- pcnumber - номер телефона исполнителя, ответственного за представление файла;
- KKKK - код отчетного данного (графа 3 приложения 4 к Методике);
- S - символ отчетного данного (примечание 1);
- X - значение отчетного данного с точностью до 0.1.

Примечание.

1. Необходимо использовать следующие значения поля S в информационной строке:

- 1 - "Сумма по балансу";
- 2 - "Сумма расчета".