

Формирование подраздела 4.4 раздела 4 отчетности по форме 0420455 «Расчет показателя достаточности капитала» в формате XBRL

При формировании подраздела 4.4 раздела 4 «Расчет величины рыночного риска. Показатели для расчета величины рыночного риска по ПФИ, за исключением величины рыночного риска, рассчитываемой как совокупная величина индивидуального клирингового обеспечения» отчетности по форме 0420455 «Расчет показателя достаточности капитала», установленной в приложении 1 к Указанию № 5117-У¹, для показателей с кодом purcb-dic:Velich_val_riska_ds и purcb-dic:Stavka_riska_ds необходимо формировать отчетность, руководствуясь наименованиями показателей, установленными Указанием № 5117-У.

Коды показателей представлены в файле «ЭП_прил_ПУРЦБ» на листе «0420455», размещенном в составе сопроводительных документов к таксономии XBRL Банка России для модуля НСО ПУРЦБ на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» в разделе «Финансовые рынки /Открытый стандарт отчетности XBRL /Таксономия XBRL».

¹ Указание Банка России от 04.04.2019 № 5117-У «О формах, сроках и порядке составления и представления отчетности профессиональных участников рынка ценных бумаг, организаторов торговли, клиринговых организаций и лиц, осуществляющих функции центрального контрагента, а также другой информации в Центральный банк Российской Федерации»

Денежные средства				
Источник ставки риска валюты по поставляе мым/получ аемым денежным средствам	Ставка риска по процентно й части рыночного риска по поставляе мым/получ аемым денежным средствам	Ставка риска валюты по поставляе мым/получ аемым денежным средствам	Величина процентно й части рыночного риска по поставляе мым/получ аемым денежным средствам	Вели риск поста ваем денеж средс
Некорректные наименования в таксономии				
purch-dic:A13Abstract				
purch- dic:Istochnik _stavki_ds	purch- dic:Velich_val _risika_ds	purch- dic:Stavka_ _risika_ds	purch- dic:Velich_p roc_risika_d s	purch- dic:Ve _stavka_ _risika_ds

Номер строки	Наименование показателя	Наименование группы аналитических признаков	Код показателя, группы аналитических признаков
1	2	3	4
121	Уникальный номер группы однородных объектов по базовому активу		purch- dic:Yunik_nomer_gruppi_baz_akt
121.1		Идентификатор ПФИИ	dim-int:Rek_PFITaxis
121.2		Идентификатор строки	dim-int:ID_strokiTaxis
122	Код валюты поставляемых/получаемых денежных средств		purch- dic:Kod_val_denaredEnumerator
122.1		Идентификатор ПФИИ	dim-int:Rek_PFITaxis
122.2		Идентификатор строки	dim-int:ID_strokiTaxis
123	Количество поставляемых/получаемых денежных средств		purch-dic:Kolvo_post_pol_ds
123.1		Идентификатор ПФИИ	dim-int:Rek_PFITaxis
123.2		Идентификатор строки	dim-int:ID_strokiTaxis
124	Ставка риска валюты по поставляемым/получаемым денежным средствам		purch-dic:Stavka_risika_val_ds
124.1		Идентификатор ПФИИ	dim-int:Rek_PFITaxis
124.2		Идентификатор строки	dim-int:ID_strokiTaxis
125	Источник ставки риска валюты по поставляемым/получаемым денежным средствам		purch-dic:Istochnik_stavki_ds
125.1		Идентификатор ПФИИ	dim-int:Rek_PFITaxis
125.2		Идентификатор строки	dim-int:ID_strokiTaxis
126	Величина валютной части рыночного риска по поставляемым/получаемым денежным средствам		purch-dic:Velich_val_risika_ds
126.1		Идентификатор ПФИИ	dim-int:Rek_PFITaxis
126.2		Идентификатор строки	dim-int:ID_strokiTaxis
127	Ставка риска по процентной части рыночного риска по поставляемым/получаемым денежным средствам		purch-dic:Stavka_risika_ds

Код показателя в нормативном акте и таксономии	Название показателя в таксономии (некорректное)	В Указании 5117-У		Тип отчетного элемента
		Номер строки	Наименование показателя	
purch- dic:Velich_val_risika_ _ds	Ставка риска по процентной части рыночного риска по поставляемым/получаемым денежным средствам	126	Величина валютной части рыночного риска по поставляемым/получаемым денежным средствам	monetaryItem Type
purch- dic:Stavka_risika_ds	Ставка риска валюты по поставляемым/получаемым денежным средствам	127	Ставка риска по процентной части рыночного риска по поставляемым/получаемым денежным средствам	decimalItemTy pe

Обращаем внимание на расположение указанных показателей в интерфейсе ПО «Анкета-Редактор XBRL».

The screenshot displays the 'Anketa-Redaktor XBRL' interface. The main window shows a table with the following columns:

Код валюты поставляемых/получаемых денежных средств	Количество поставляемых/получаемых денежных средств	Ставка риска валюты по поставляемым/получаемым денежным средствам	Источник ставки риска валюты по поставляемым/получаемым денежным средствам	Ставка риска по процентной части рыночного риска по поставляемым/получаемым денежным	Ставка риска валюты по поставляемым/получаемым денежным средствам	Величина процентной части рыночного риска поставляемым/получаемым	Величина риска по поставляемым/получаемым денежным средствам	Длинная/короткая позиция по поставляемым/получаемым денежным средствам
				100	2			

Two callout boxes provide the names of the indicators:

- Left callout:** Название показателя согласно Указания №5117-У: «Величина валютной части рыночного риска по поставляемым/получаемым денежным средствам»
- Right callout:** Название показателя согласно Указания №5117-У: «Ставка риска по процентной части рыночного риска по поставляемым/получаемым денежным средствам»

Below the table, there are two boxes indicating the units and precision for the highlighted indicators:

- Разрядность: 2, Единица измерения: RUB
- Разрядность: 2, Единица измерения: Pure