**Правила формування показників,**

**що подаються у звітному файлі 7SX “****Дані про мінімальний розмір ринкового ризику”**

1. Файл статистичної звітності 7SX “Дані про мінімальний розмір ринкового ризику” розроблено відповідно до вимог Положення про порядок визначення банками України мінімального розміру ринкового ризику, затвердженого постановою Правління Національного банку України від 30.12.2021 № 162 (із змінами) (далі – Положення № 162).
2. У файлі статистичної звітності зазначається інформація за станом на звітну дату щодо:

1) визначеного банками мінімального розміру процентного ризику торгової книги, фондового ризику, валютного ризику, товарного ризику та ризику опціонів, які є складовими ринкового ризику;

2) ризик-позицій, які включаються до розрахунку мінімального розміру ринкового ризику;

3) узгоджених ризик-позицій, які банк має право не включати до розрахунку процентного ризику торгової книги або фондового ризику (у разі включення банком узгоджених ризик-позицій до розрахунку відповідних ризиків, тоді такі ризик-позиції вважаються неузгодженими).

1. Дані передаються в розрізі:

1) для процентного ризику торгової книги – іноземна валюта, гривня згідно з вимогами підпункту 1 пункту 20 розділу ІІ Положення № 162;

2) для фондового ризику – національний ринок згідно з вимогами підпункту 15 пункту 3 розділу I та підпункту 1 пункту 27 розділу ІІІ Положення № 162;

3) для валютного ризику ­– іноземна валюта, золото згідно з вимогами підпункту 1 пункту 31 розділу ІV Положення № 162;

4) для товарного ризику – товар згідно з вимогами підпункту 22 пункту 3 розділу I та підпункту 1 пункту 35 розділу V Положення № 162.

**Особливості формування показників**

**Опис параметрів**

**Параметр S243 –** код діапазону зі строком до погашення (загальноринковий ризик у складі процентного ризику торгової книги) (довідник S243).

**Параметр F145 –** код розподілу ризик-позицій залежно від емітента фінансового інструмента та застосованого вагового коефіцієнта ризику згідно з Додатком 4 Положення № 162 (специфічний ризик у складі процентного ризику торгової книги) (довідник F145).

**Параметр R030 –** код валюти або банківського металу [відповідно до Класифікатора іноземних валют та банківських металів, затвердженого постановою Правління Національного банку України від 04 лютого 1998 року № 34 (у редакції постанови Правління Національного банку України від 19 квітня 2016 року № 269) (зі змінами)] (довідник R030). Для показників A7S001-A7S012 та A7S201-A7S208 передача даних за кошиком в сукупності інших іноземних валют, за якими валова ризик-позиція за інструментами, номінованими в кожній із таких валют, не перевищує 3% балансової вартості активів, зазначається код “#”, що означає розріз відсутній відповідно до довідника R030 (у разі здійснення банком такого розподілу відповідно до підпункту 1 пункту 31 розділу IV Положення № 162).

**Параметр K040 –** код країни (відповідно до національного стандарту України ДСТУ ISO 3166-1:2009 “Коди назв країн світу”, затвердженого наказом Державного комітету України з питань технічного регулювання та споживчої політики від 23 грудня 2009 року № 471) (довідник K040). Для показників A7S101-A7S108 та A7S110-A7S113 передача даних за кошиком ринок країн єврозони (Австрія, Бельгія, Греція, Естонія, Ірландія, Іспанія, Італія, Кіпр, Латвія, Литва, Люксембург, Мальта, Нідерланди, Німеччина, Португалія, Словаччина, Словенія, Фінляндія, Франція, Хорватія) зазначається код “#”, що означає розріз відсутній відповідно до довідника K040 (у разі здійснення банком такого розподілу відповідно до підпункту 15 пункту 3 розділу I Положення № 162).

**Правило формування показника A7S001 “Довгі ризик-позиції за похідними фінансовими інструментами зі ставкою купона, що є більшою або дорівнює 3%, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 3040А, 3041А, 3042А, 3043А**,** 3044А, 3049А, 3140А, 3141А, 3142А, 3143А, 3144А, 9201А, 9202А, 9206А, 9207А, 9208А, 9221А, 9227А, 9228А, 9321А, 9324А, 9327А, 9328А, 9351А, 9352А, 9353А, 9354А, 9356А, 9357А, 9358А, 9359А з дотриманням умов включення похідних фінансових інструментів до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги, визначених у Додатку 2 до Положення № 162.

**Правило формування показника A7S002 “Довгі ризик-позиції за похідними фінансовими інструментами зі ставкою купона, що є меншою 3%, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 3040А, 3041А, 3042А, 3043А**,** 3044А, 3049А, 3140А, 3141А, 3142А, 3143А, 3144А, 9201А, 9202А, 9206А, 9207А, 9208А, 9221А, 9227А, 9228А, 9321А, 9324А, 9327А, 9328А, 9351А, 9352А, 9353А, 9354А, 9356А, 9357А, 9358А, 9359А з дотриманням умов включення похідних фінансових інструментів до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги, визначених у Додатку 2 до Положення № 162.

**Правило формування показника A7S003 “Короткі ризик-позиції за похідними фінансовими інструментами зі ставкою купона, що є більшою або дорівнює 3%, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 3350П, 3351П, 3352П, 3353П, 3354П, 3359П, 3360П, 3361П, 3362П,3363П**,** 3364П, 9211П, 9212П, 9216П, 9217П, 9218П, 9231П, 9237П, 9238П, 9331П, 9334П, 9337П, 9338П, 9361П, 9362П, 9363П, 9364П, 9366П, 9367П, 9368П, 9369П, з дотриманням умов включення похідних фінансових інструментів до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги, визначених у Додатку 2 до Положення № 162.

**Правило формування показника A7S004 “Короткі ризик-позиції за похідними фінансовими інструментами зі ставкою купона, що є меншою 3%, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 3350П, 3351П, 3352П, 3353П, 3354П, 3359П, 3360П, 3361П, 3362П,3363П**,** 3364П, 9211П, 9212П, 9216П, 9217П, 9218П, 9231П, 9237П, 9238П, 9331П, 9334П, 9337П, 9338П, 9361П, 9362П, 9363П, 9364П, 9366П, 9367П, 9368П, 9369П, з дотриманням умов включення похідних фінансових інструментів до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги, визначених у Додатку 2 до Положення № 162.

**Правило формування показника A7S005 “Довгі ризик-позиції за іншими інструментами зі ставкою купона, що є більшою або дорівнює 3%, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 1400А, 1401А, 1402А, 1403А, 1404А, 1405АП, 1406АП, 1408А, 1450А, 1455АП, 1456АП, 1458А, 1532А, 1535АП, 1536АП, 1538А, 2391А, 2396АП, 2397АП, 2398А, 2454А, 2456АП, 2457АП, 2458А, 3002А, 3003А, 3005А, 3007АП, 3008А, 3010А, 3011А, 3012А, 3013А, 3014А, 3015АП, 3016АП, 3018А, 9300А, 9350А.

**Правило формування показника A7S006 “Довгі ризик-позиції за іншими інструментами зі ставкою купона, що є меншою 3%, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 1400А, 1401А, 1402А, 1403А, 1404А, 1405АП, 1406АП, 1408А, 1450А, 1455АП, 1456АП, 1458А, 1532А, 1535АП, 1536АП, 1538А, 2391А, 2396АП, 2397АП, 2398А, 2454А, 2456АП, 2457АП, 2458А, 3002А, 3003А, 3005А, 3007АП, 3008А, 3010А, 3011А, 3012А, 3013А, 3014А, 3015АП, 3016АП, 3018А, 9300А, 9350А.

**Правило формування показника A7S007 “Короткі ризик-позиції за іншими інструментами зі ставкою купона, що є більшою або дорівнює 3%, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 1912П, 3310П, 3312П, 3313П, 3314П, 3315АП, 3316АП, 3318П, 3330П, 3335АП, 3336АП, 3338П, 3380П, 3385АП, 3386АП, 3388П, 9310П, 9360П.

**Правило формування показника A7S008 “Короткі ризик-позиції за іншими інструментами зі ставкою купона, що є меншою 3%, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 1912П, 3310П, 3312П, 3313П, 3314П, 3315АП, 3316АП, 3318П, 3330П, 3335АП, 3336АП, 3338П, 3380П, 3385АП, 3386АП, 3388П, 9310П, 9360П.

**Правило формування показника A7S009 “Відкриті довгі ризик-позиції за інструментами зі ставкою купона, що є більшою або дорівнює 3%, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються довгі (неузгоджені, виходячи з вимог Додатку 3 до Положення № 162) ризик-позиції, визначені за інструментами, включеними до показників A7S001, A7S003, A7S005 та A7S007 з урахуванням вимог розділу ІІ Положення № 162 щодо розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S010 “Відкриті довгі ризик-позиції за інструментами зі ставкою купона, що є меншою 3%, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються довгі (неузгоджені, виходячи з вимог Додатку 3 до Положення № 162) ризик-позиції, визначені за інструментами, включеними до показників A7S002, A7S004, A7S006 та A7S008 з урахуванням вимог розділу ІІ Положення № 162 щодо розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S011 “Відкриті короткі ризик-позиції за інструментами зі ставкою купона, що є більшою або дорівнює 3%, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються короткі (неузгоджені, виходячи з вимог Додатку 3 до Положення № 162) ризик-позиції, визначені за інструментами, включеними до показників A7S001, A7S003, A7S005 та A7S007 з урахуванням вимог розділу ІІ Положення № 162 щодо розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S012 “Відкриті короткі ризик-позиції за інструментами зі ставкою купона, що є меншою 3%, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються короткі (неузгоджені, виходячи з вимог Додатку 3 до Положення № 162) ризик-позиції, визначені за інструментами, включеними до показників A7S002, A7S004, A7S006 та A7S008 з урахуванням вимог розділу ІІ Положення № 162 щодо розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S013 “Розмір загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначається розмір загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги, визначений згідно з вимогами розділу ІІ Положення № 162.

**Правило формування показника A7S014 “Довгі ризик-позиції за інструментами, включеними до розрахунку специфічного ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 1400А, 1401А, 1402А, 1403А, 1404А, 1405АП, 1406АП, 1408А, 1450А, 1455АП, 1456АП, 1458А, 1532А, 1535АП, 1536АП, 1538А, 2391А, 2396АП, 2397АП, 2398А, 2454А, 2456АП, 2457АП, 2458А, 3002А, 3003А, 3005А, 3007АП, 3008А, 3010А, 3011А, 3012А, 3013А, 3014А, 3015АП, 3016АП, 3018А, 3040А, 3041А, 3042А, 3044А, 3049А, 3140А, 3141А, 3142А, 3144А, 9300А, 9321А, 9324А, 9327А, 9328А, 9350А, 9351А, 9352А, 9353А, 9354А, 9356 А, 9357А, 9358А, 9359А, з дотриманням умов включення похідних фінансових інструментів до розрахунку специфічного ризику в складі процентного ризику торгової книги, визначених у Додатку 2 до Положення № 162.

**Правило формування показника A7S015 “Короткі ризик-позиції за інструментами, включеними до розрахунку специфічного ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 1912П, 3310П, 3312П, 3313П, 3314П, 3315АП, 3316АП, 3318П, 3330П, 3335АП, 3336АП, 3338П, 3350П, 3351П, 3352П, 3354П, 3359П, 3360П, 3361П, 3362П, 3364П, 3380П, 3385АП, 3386АП, 3388П, 9310П, 9331П, 9334П, 9337П, 9338П, 9360П, 9361П, 9362П, 9363П, 9364П, 9366П, 9367П, 9368П, 9369П, з дотриманням умов включення похідних фінансових інструментів до розрахунку специфічного ризику в складі процентного ризику торгової книги, визначених у Додатку 2 до Положення № 162.

**Правило формування показника A7S016 “Відкриті довгі ризик-позиції за інструментами, включеними до розрахунку специфічного ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються довгі (неузгоджені, виходячи з вимог Додатку 3 до Положення № 162) ризик-позиції, визначені за інструментами, включеними до показників A7S014 та A7S015 з урахуванням вимог розділу ІІ Положення № 162 щодо розрахунку специфічного ризику в складі процентного ризику торгової книги.

**Правило формування показника A7S017 “Відкриті короткі ризик-позиції за інструментами, включеними до розрахунку специфічного ризику в складі процентного ризику торгової книги”**

Зазначаються короткі (неузгоджені, виходячи з вимог Додатку 3 до Положення № 162) ризик-позиції, визначені за інструментами, включеними до показників A7S014 та A7S015 з урахуванням вимог розділу ІІ Положення № 162 щодо розрахунку специфічного ризику в складі процентного ризику торгової книги.

**Правило формування показника A7S018 “Розмір ризику опціонів, чутливих до процентного ризику торгової книги, за спрощеним методом”**

Зазначається розмір ризику опціонів, чутливих до процентного ризику торгової книги, визначений за спрощеним методом згідно з вимогами пунктів 38-41 розділу VІ Положення № 162.

**Правило формування показника A7S019 “Розмір ризику опціонів, чутливих до процентного ризику торгової книги, за методом “дельта плюс” - гамма-ризик”**

Зазначається розмір гама-ризику опціонів, чутливих до процентного ризику торгової книги, визначений за методом “дельта плюс” згідно з вимогами пункту 46 розділу VІ Положення № 162.

**Правило формування показника A7S020 “Розмір ризику опціонів, чутливих до процентного ризику торгової книги, за методом “дельта плюс” - вега-ризик”**

Зазначається розмір вега-ризику опціонів, чутливих до процентного ризику торгової книги, визначений за методом “дельта плюс” згідно з вимогами пунктів 47-48 розділу VІ Положення № 162.

**Правило формування показника A7S101 “Довгі ризик-позиції за похідними фінансовими інструментами, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 3040А, 3041А, 3042А, 3049А, 3140А, 3141А, 3142А, 9321А, 9324А, 9327А, 9351А, 9352А, 9353А, 9354А, 9356А, 9357А, 9359А, з дотриманням умов включення похідних фінансових інструментів до розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику, визначених у Додатку 7 до Положення № 162.

**Правило формування показника A7S102 “Короткі ризик-позиції за похідними фінансовими інструментами, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 3350П, 3351П, 3352П, 3359П, 3360П, 3361П, 3362П, 9331П, 9334П, 9337П, 9361П, 9362П, 9363П, 9364П, 9366П, 9367П, 9369П, з дотриманням умов включення похідних фінансових інструментів до розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику, визначених у Додатку 7 до Положення № 162.

**Правило формування показника A7S103 “Довгі ризик-позиції за іншими інструментами, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 1532А, 1535АП, 1536АП, 1538А, 2391А, 2396АП, 2397АП, 2398А, 2454А, 2456АП, 2457АП, 2458А, 3002А, 3003А, 3005А, 3007АП, 3008А, 9300А, 9350А.

**Правило формування показника A7S104 “Короткі ризик-позиції за іншими інструментами, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 1912П, 3314П, 3315АП, 3316АП, 3318П, 3380П, 3385АП, 3386АП, 3388П, 9310П, 9360П.

**Правило формування показника A7S105 “Відкриті довгі ризик-позиції за похідними фінансовими інструментами, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику”**

Зазначаються довгі (неузгоджені, виходячи з вимог Додатку 8 до Положення № 162) ризик-позиції, визначені за інструментами, включеними до показників A7S101 та A7S102 з урахуванням вимог розділу ІІІ Положення № 162 щодо розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S106 “Відкриті короткі ризик-позиції за похідними фінансовими інструментами, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику”**

Зазначаються короткі (неузгоджені, виходячи з вимог Додатку 8 до Положення № 162) ризик-позиції, визначені за інструментами, включеними до показників A7S101 та A7S102 з урахуванням вимог розділу ІІІ Положення № 162 щодо розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S107 “Відкриті довгі ризик-позиції за іншими інструментами, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику”**

Зазначаються довгі (неузгоджені, виходячи з вимог Додатку 8 до Положення № 162) ризик-позиції, визначені за інструментами, включеними до показників A7S103 та A7S104 з урахуванням вимог розділу ІІІ Положення № 162 щодо розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику.

**Правило формування показника A7S108 “Відкриті короткі ризик-позиції за іншими інструментами, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику”**

Зазначаються короткі (неузгоджені, виходячи з вимог Додатку 8 до Положення № 162) ризик-позиції, визначені за інструментами, включеними до показників A7S103 та A7S104 з урахуванням вимог розділу ІІІ Положення № 162 щодо розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику.

**Правило формування показника A7S109 “Відкрита (довга або коротка) ризик-позиція за інструментами, включеними до розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику”**

Зазначається відкрита (довга або коротка) ризик-позиція за всіма інструментами, включеними до показників A7S105-A7S108 з урахуванням вимог розділу ІІІ Положення № 162 щодо розрахунку загальноринкового ризику в складі фондового ризику.

**Правило формування показника A7S110 “Довгі ризик-позиції за інструментами, включеними до розрахунку специфічного ризику в складі фондового ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 1532А, 1535АП, 1536АП, 1538А, 2391А, 2396АП, 2397АП, 2398А, 2454А, 2456АП, 2457АП, 2458А, 3002А, 3003А, 3005А, 3007АП, 3008А, 3040А, 3041А, 3042А, 3049А, 3140А, 3141А, 3142А, 9300А, 9321А, 9324А, 9327А, 9350А, 9351А, 9352А, 9353А, 9354А, 9356А, 9357А, 9359А, з дотриманням умов включення похідних фінансових інструментів до розрахунку специфічного ризику в складі фондового ризику, визначених у Додатку 7 до Положення № 162.

**Правило формування показника A7S111 “Короткі ризик-позиції за інструментами, включеними до розрахунку специфічного ризику в складі фондового ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції (включаючи узгоджені ризик-позиції незалежно від того, чи включає їх банк до розрахунку), що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 1912П, 3314П, 3315АП, 3316АП, 3318П, 3350П, 3351П, 3352П, 3359П, 3360П, 3361П, 3362П, 3380П, 3385АП, 3386АП, 3388П, 9310П, 9331П, 9334П, 9337П, 9360П, 9361П, 9362П, 9363П, 9364П, 9366П, 9367П, 9369П, з дотриманням умов включення похідних фінансових інструментів до розрахунку специфічного ризику в складі фондового ризику, визначених у Додатку 7 до Положення № 162.

**Правило формування показника A7S112 “Відкриті довгі ризик-позиції за інструментами, включеними до розрахунку специфічного ризику в складі фондового ризику”**

Зазначаються довгі (неузгоджені, виходячи з вимог Додатку 8 до Положення № 162) ризик-позиції, визначені за інструментами, включеними до показників A7S110 та A7S111 з урахуванням вимог розділу ІІІ Положення № 162 щодо розрахунку специфічного ризику в складі фондового ризику.

**Правило формування показника A7S113 “Відкриті короткі ризик-позиції за інструментами, включеними до розрахунку специфічного ризику в складі фондового ризику”**

Зазначаються короткі (неузгоджені, виходячи з вимог Додатку 8 до Положення № 162) ризик-позиції, визначені за інструментами, включеними до показників A7S110 та A7S111 з урахуванням вимог розділу ІІІ Положення № 162 щодо розрахунку специфічного ризику в складі фондового ризику.

**Правило формування показника A7S114 “Розмір ризику опціонів, чутливих до фондового ризику, за спрощеним методом”**

Зазначається розмір ризику опціонів, чутливих до фондового ризику, визначений за спрощеним методом згідно з вимогами пунктів 38-41 розділу VІ Положення № 162.

**Правило формування показника A7S115 “Розмір ризику опціонів, чутливих до фондового ризику, за методом “дельта плюс” - гамма-ризик”**

Зазначається розмір гама-ризику опціонів, чутливих до фондового ризику, визначений за методом “дельта плюс” згідно з вимогами пункту 46 розділу VІ Положення № 162.

**Правило формування показника A7S116 “Розмір ризику опціонів, чутливих до фондового ризику, за методом “дельта плюс” - вега-ризик”**

Зазначається розмір вега-ризику опціонів, чутливих до фондового ризику, визначений за методом “дельта плюс” згідно з вимогами пунктів 47-48 розділу VІ Положення № 162.

**Правило формування показника A7S201 “Довгі ризик-позиції за похідними фінансовими інструментами, включеними до розрахунку валютного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції, що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 3040А, 3041А, 3042А, 3043А, 3049А, 3140А, 3141А, 3142А, 3143А, 9201А, 9202А, 9203А, 9204А, 9206А, 9207А, 9208А, 9221А, 9224А, 9227А, 9228А, 9321А, 9324А, 9327А, 9351А, 9352А, 9353А, 9354А, 9356А, 9357А, 9359А, з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку валютного ризику, визначених у пункті 30 розділу IV Положення № 162, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S202 “Короткі ризик-позиції за похідними фінансовими інструментами, включеними до розрахунку валютного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції, що обліковуються за балансовими/ позабалансовими рахунками: 3350П, 3351П, 3352П, 3353П, 3359П, 3360П, 3361П, 3362П, 3364П, 9211П, 9212П, 9213П, 9214П, 9216П, 9217П, 9218П, 9231П, 9234П, 9237П, 9238П, 9331П, 9334П, 9337П, 9361П, 9362П, 9363П, 9364П, 9366П, 9367П, 9369П, з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку валютного ризику, визначених у пункті 30 розділу IV Положення № 162, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S203 “Довгі ризик-позиції за позабалансовими інструментами (крім похідних фінансових інструментів), включеними до розрахунку валютного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції, що обліковуються за позабалансовими рахунками 9000А, 9001А, 9002А, 9003А, 9100А, 9122А, 9129А, 9200А, 9300А, 9350А, з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку валютного ризику, визначених у пункті 30 та підпункті 2 пункту 31 розділу IV Положення № 162.

**Правило формування показника A7S204 “Короткі ризик-позиції за позабалансовими інструментами (крім похідних фінансових інструментів), включеними до розрахунку валютного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції, що обліковуються за балансовими**/**позабалансовими рахунками**:**

3690П, 3692П, в частині резервів за інструментами, включеними до показника A7S203;

9210П, 9310П, 9360П, з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку валютного ризику, визначених у пункті 30 розділу IV Положення № 162.

**Правило формування показника A7S205 “Довгі ризик-позиції за іншими інструментами, включеними до розрахунку валютного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції, що обліковуються за балансовими рахунками:

груп 100, 101, 109, 110, 119, 120, 121, 140, 141, 142, 143, 144, 145, 150, 151, 152, 153, 154, 181, 183, 189, 201, 202, 203, 204, 206, 207, 208, 210, 211, 212, 213, 214, 220, 221, 222, 223, 224, 226, 230, 231, 232, 233, 234, 235, 236, 237, 238, 239, 240, 241, 242, 243, 244, 245, 280, 289, 300, 301, 310, 311, 321, 340, 341, 342, 350, 351, 352, 354, 355, 356, 357, 359, 371, 410, 420, 432, які зменшуються на суму залишків за контрактивними рахунками та пасивних залишків за рахунками зазначених груп (крім пасивних залишків за рахунками 1500П, 1507П, які не включаються до розрахунку);

1600А, 1607А, 2600А, 2607А, 2620А, 2621А, 2627А, 2650А, 2657А, які зменшуються на суму залишків за контрактивними рахунками 1609КА, 2609КА, 2629КА, 2659КА;

2920А, 2924А, 3705А, 3706А, 3739А, 3900А, 3901А, 3902А, 3904А, 3906А, 3928А,

з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку валютного ризику, визначених у пункті 30 розділу IV Положення № 162.

**Правило формування показника A7S206 “Короткі ризик-позиції за іншими інструментами, включеними до розрахунку валютного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції, що обліковуються за балансовими рахунками:

груп 130, 131, 132, 133, 160, 161, 162, 191, 192, 193, 251, 252, 253, 254, 255, 256, 257, 260, 261, 262, 263, 264, 265, 270, 290, 293, 294, 295, 330, 331, 332, 333, 337, 338, 360, 361, 362, 363, 364, 365, 366, 367, 368, 372; які зменшуються на суму активних залишків за рахунками зазначених груп (крім активних залишків за рахунками 1600А, 1607А, 2600А, 2607А, 2620А, 2621А, 2627А, 2650А, 2657А, залишків за контрактивними рахунками 1609КА, 2609КА, 2629КА, 2659КА, які не включаються до розрахунку);

3690П, 3692П, крім пасивних залишків за цими рахунками, які включені до показника A7S204**;**

1500П, 1507П, 2920П, 2924П, 3699П**,** 3705П, 3706П, 3739П, 3900П, 3901П, 3903П, 3905П, 3907П, 3929П,

з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку валютного ризику, визначених у пункті 30 розділу IV Положення № 162.

**Правило формування показника A7S207 “Відкриті довгі ризик-позиції за інструментами, включеними до розрахунку валютного ризику”**

Зазначаються відкриті довгі ризик-позиції, визначені за ризик-позиціями, включеними до показників A7S201-A7S206 з урахуванням вимог розділу ІV Положення № 162 щодо розрахунку валютного ризику.

**Правило формування показника A7S208 “Відкриті короткі ризик-позиції за інструментами, включеними до розрахунку валютного ризику”**

Зазначаються відкриті короткі ризик-позиції, визначені за ризик-позиціями, включеними до показників A7S201-A7S206 з урахуванням вимог розділу ІV Положення № 162 щодо розрахунку валютного ризику.

**Правило формування показника A7S209 “Розмір валютного ризику”**

Зазначається розмір валютного ризику, визначений згідно з вимогами розділу ІV Положення № 162.

**Правило формування показника A7S210 “Розмір ризику опціонів, чутливих до валютного ризику, за спрощеним методом”**

Зазначається розмір ризику опціонів, чутливих до валютного ризику, визначений за спрощеним методом згідно з вимогами пунктів 38-41 розділу VІ Положення № 162.

**Правило формування показника A7S211 “Розмір ризику опціонів, чутливих до валютного ризику, за методом “дельта плюс” - гамма-ризик”**

Зазначається розмір гама-ризику опціонів, чутливих до валютного ризику, визначений за методом “дельта плюс” згідно з вимогами пункту 46 розділу VІ Положення № 162.

Розмір гама-ризику передається по модулю (додатнім числом).

**Правило формування показника A7S212 “Розмір ризику опціонів, чутливих до валютного ризику, за методом “дельта плюс” - вега-ризик”**

Зазначається розмір вега-ризику опціонів, чутливих до валютного ризику, визначений за методом “дельта плюс” згідно з вимогами пунктів 47-48 розділу VІ Положення № 162.

**Правило формування показника A7S301 “Довгі ризик-позиції за товарами групи “Дорогоцінні метали”, крім золота, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції в товарах, що належать до групи “Дорогоцінні метали” таблиці Додатку 11 до Положення № 162, крім золота, та обліковуються за балансовими/позабалансовими рахунками:

груп 110, 119, 120, 121, 150, 151, 152, 153, 154, 181, 183, 189, 201, 202, 203, 204, 206, 207, 208, 210, 211, 212, 213, 214, 220, 221, 222, 223, 224, 226, 230, 231, 232, 233, 234, 235, 236, 237, 238, 239, 240, 241, 242, 243, 244, 245, 289, 356, 357, 359, 371, 410, 420, 432, які зменшуються на суму залишків за контрактивними рахунками та пасивних залишків за рахунками зазначених груп (крім пасивних залишків за рахунками 1500П, 1507П, які не включаються до розрахунку);

1600А, 1607А, 2600А, 2607А, 2620А, 2621А, 2627А, 2650А, 2657А, які зменшуються на суму залишків за контрактивними рахунками 1609КА, 2609КА, 2629КА, 2659КА;

2800А, 2809А, 3040А, 3041А, 3042А, 3049А, 3140А, 3141А, 3142А, 3540А, 3548А;

2920А, 2924А, 3705А, 3706А, 3739А, 3900А, 3901А, 3902А, 3904А, 3906А, 3928А;

3403А, 3407А, 3409А;

9000А, 9001А, 9002А, 9003А, 9100А, 9122А, 9129А, 9200А, 9201А, 9202А, 9203А, 9204А, 9206А, 9207А, 9221А, 9224А, 9227А, 9321А, 9324А, 9327А, 9350А, 9351А, 9352А, 9353А, 9354А, 9356А, 9357А, 9359А,

з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку товарного ризику, визначених у пункті 34 розділу V Положення № 162, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S302 “Короткі ризик-позиції за товарами групи “Дорогоцінні метали”, крім золота, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції в товарах, що належать до групи “Дорогоцінні метали” таблиці Додатку 11 до Положення № 162, крім золота, та обліковуються за балансовими/позабалансовими рахунками:

груп 130, 131, 132, 133, 160, 161, 162, 191, 192, 193, 251, 252, 253, 254, 255, 256, 257, 260, 261, 262, 263, 264, 265, 270, 293, 294, 295, 338, 366, 367, 368, 369, 372; які зменшуються на суму активних залишків за рахунками зазначених груп (крім активних залишків за рахунками 1600А, 1607А, 2600А, 2607А, 2620А, 2621А, 2627А, 2650А, 2657А, залишків за контрактивними рахунками 1609КА, 2609КА, 2629КА, 2659КА, які не включаються до розрахунку);

1500П, 1507П, 2920П, 2924П, 3705П, 3706П, 3739П, 3900П, 3901П, 3903П, 3905П, 3907П, 3929П;

2900П, 2909П, 3350П, 3351П, 3352П, 3359П, 3360П, 3361П, 3362П, 3640П, 3648П;

9210П, 9211П, 9212П, 9213П, 9214П, 9216П, 9217П, 9231П, 9234П, 9237П, 9331П, 9334П, 9337П, 9360П, 9361П, 9362П, 9363П, 9364П, 9366П, 9367П, 9369П,

з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку товарного ризику, визначених у пункті 34 розділу V Положення № 162, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S303 “Довгі ризик-позиції за товарами групи “Недорогоцінні метали”, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції в товарах, що належать до групи “Недорогоцінні метали” таблиці Додатку 11 до Положення № 162, та обліковуються за балансовими/позабалансовими рахунками: 3040А, 3041А, 3042А, 3049А, 3140А, 3141А, 3142А, 3409А, 3540А, 3548А, 9321А, 9324А, 9327А, 9350А, 9351А, 9352А, 9353А, 9354А, 9356А, 9357А, 9359А, з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку товарного ризику, визначених у пункті 34 розділу V Положення № 162, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S304 “Короткі ризик-позиції за товарами групи “Недорогоцінні метали”, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції в товарах, що належать до групи “Недорогоцінні метали” таблиці Додатку 11 до Положення № 162, та обліковуються за балансовими/позабалансовими рахунками: 3350П, 3351П, 3352П, 3359П, 3360П, 3361П, 3362П, 3640П, 3648П, 3380П, 3385АП, 3386АП, 3388П, 9331П, 9334П, 9337П, 9360П, 9361П, 9362П, 9363П, 9364П, 9366П, 9367П, 9369П, з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку товарного ризику, визначених у пункті 34 розділу V Положення № 162, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S305 “Довгі ризик-позиції за товарами групи “М’які та інші агрокультури”, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції в товарах, що належать до групи “М’які та інші агрокультури” таблиці Додатку 11 до Положення № 162, та обліковуються за балансовими/позабалансовими рахунками: 3040А, 3041А, 3042А, 3049А, 3140А, 3141А, 3142А, 3409А, 3540А, 3548А, 9321А, 9324А, 9327А, 9350А, 9351А, 9352А, 9353А, 9354А, 9356А, 9357А, 9359А, з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку товарного ризику, визначених у пункті 34 розділу V Положення № 162, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S306 “Короткі ризик-позиції за товарами групи “М’які та інші агрокультури”, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції в товарах, що належать до групи “М’які та інші агрокультури” таблиці Додатку 11 до Положення № 162, та обліковуються за балансовими/позабалансовими рахунками: 3350П, 3351П, 3352П, 3359П, 3360П, 3361П, 3362П, 3640П, 3648П, 3380П, 3385АП, 3386АП, 3388П, 9331П, 9334П, 9337П, 9360П, 9361П, 9362П, 9363П, 9364П, 9366П, 9367П, 9369П, з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку товарного ризику, визначених у пункті 34 розділу V Положення № 162, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S307 “Довгі ризик-позиції за товарами груп енергопродукції, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції в товарах, що належать до груп “Енергія – тверде паливо”, “Енергія – рідкі горючі речовини”, “Енергія –електроенергія та вуглець” та “Газоподібні горючі речовини” таблиці Додатку 11 до Положення № 162, та обліковуються за балансовими/позабалансовими рахунками: 3040А, 3041А, 3042А, 3049А, 3140А, 3141А, 3142А, 3409А, 3540А, 3548А, 9321А, 9324А, 9327А, 9350А, 9351А, 9352А, 9353А, 9354А, 9356А, 9357А, 9359А, з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку товарного ризику, визначених у пункті 34 розділу V Положення № 162, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S308 “Короткі ризик-позиції за товарами груп енергопродукції, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції в товарах, що належать до груп “Енергія – тверде паливо”, “Енергія – рідкі горючі речовини”, “Енергія –електроенергія та вуглець” та “Газоподібні горючі речовини” таблиці Додатку 11 до Положення № 162, та обліковуються за балансовими/позабалансовими рахунками: 3350П, 3351П, 3352П, 3359П, 3360П, 3361П, 3362П, 3640П, 3648П, 3380П, 3385АП, 3386АП, 3388П, 9331П, 9334П, 9337П, 9360П, 9361П, 9362П, 9363П, 9364П, 9366П, 9367П, 9369П, з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку товарного ризику, визначених у пункті 34 розділу V Положення № 162, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S309 “Довгі ризик-позиції за товарами всіх інших груп, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції в товарах, що належать до всіх інших груп таблиці Додатку 11 до Положення № 162, крім включених до розрахунку товарного ризику за показниками A7S301, A7S303, A7S305, A7S307, та обліковуються за балансовими/позабалансовими рахунками: 3040А, 3041А, 3042А, 3049А, 3140А, 3141А, 3142А, 3409А, 3540А, 3548А, 9321А, 9324А, 9327А, 9350А, 9351А, 9352А, 9353А, 9354А, 9356А, 9357А, 9359А, з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку товарного ризику, визначених у пункті 34 розділу V Положення № 162, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S310 “Короткі ризик-позиції за товарами всіх інших груп, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відповідні ризик-позиції в товарах, що належать до всіх інших груп таблиці Додатку 11 до Положення № 162, крім включених до розрахунку товарного ризику за показниками A7S302, A7S304, A7S306, A7S308, та обліковуються за балансовими/позабалансовими рахунками: 3350П, 3351П, 3352П, 3359П, 3360П, 3361П, 3362П, 3640П, 3648П, 3380П, 3385АП, 3386АП, 3388П, 9331П, 9334П, 9337П, 9360П, 9361П, 9362П, 9363П, 9364П, 9366П, 9367П, 9369П, з дотриманням умов включення інструментів до розрахунку товарного ризику, визначених у пункті 34 розділу V Положення № 162, та, в разі розрахунку банком ризику опціонів за методом дельта-плюс, дельта-еквіваленти за ризик-позиціями в опціонах, розраховані згідно з вимогами підпункту 1 пункту 43, пунктів 44 та 45 розділу VI Положення № 162.

**Правило формування показника A7S311 “Відкриті довгі ризик-позиції за товарами групи “Дорогоцінні метали”, крім золота, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відкриті довгі ризик-позиції, визначені за ризик-позиціями, включеними до показників A7S301 та A7S302 з урахуванням вимог розділу V Положення № 162 щодо розрахунку товарного ризику.

**Правило формування показника A7S312 “Відкриті короткі ризик-позиції за товарами групи “Дорогоцінні метали”, крім золота, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відкриті короткі ризик-позиції, визначені за ризик-позиціями, включеними до показників A7S301 та A7S302 з урахуванням вимог розділу V Положення № 162 щодо розрахунку товарного ризику.

**Правило формування показника A7S313 “Відкриті довгі ризик-позиції за товарами групи “Недорогоцінні метали”, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відкриті довгі ризик-позиції, визначені за ризик-позиціями, включеними до показників A7S303 та A7S304 з урахуванням вимог розділу V Положення № 162 щодо розрахунку товарного ризику.

**Правило формування показника A7S314 “Відкриті короткі ризик-позиції за товарами групи “Недорогоцінні метали”, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відкриті короткі ризик-позиції, визначені за ризик-позиціями, включеними до показників A7S303 та A7S304 з урахуванням вимог розділу V Положення № 162 щодо розрахунку товарного ризику.

**Правило формування показника A7S315 “Відкриті довгі ризик-позиції за товарами групи “М’які та інші агрокультури”, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відкриті довгі ризик-позиції, визначені за ризик-позиціями, включеними до показників A7S305 та A7S306 з урахуванням вимог розділу V Положення № 162 щодо розрахунку товарного ризику.

**Правило формування показника A7S316 “Відкриті короткі ризик-позиції за товарами групи “М’які та інші агрокультури”, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відкриті короткі ризик-позиції, визначені за ризик-позиціями, включеними до показників A7S305 та A7S306 з урахуванням вимог розділу V Положення № 162 щодо розрахунку товарного ризику.

**Правило формування показника A7S317 “Відкриті довгі ризик-позиції за товарами груп енергопродукції, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відкриті довгі ризик-позиції, визначені за ризик-позиціями, включеними до показників A7S307 та A7S308 з урахуванням вимог розділу V Положення № 162 щодо розрахунку товарного ризику.

**Правило формування показника A7S318 “Відкриті короткі ризик-позиції за товарами груп енергопродукції, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відкриті короткі ризик-позиції, визначені за ризик-позиціями, включеними до показників A7S307 та A7S308 з урахуванням вимог розділу V Положення № 162 щодо розрахунку товарного ризику.

**Правило формування показника A7S319 “Відкриті довгі ризик-позиції за товарами всіх інших груп, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відкриті довгі ризик-позиції, визначені за ризик-позиціями, включеними до показників A7S309 та A7S310 з урахуванням вимог розділу V Положення № 162 щодо розрахунку товарного ризику.

**Правило формування показника A7S320 “Відкриті короткі ризик-позиції за товарами всіх інших груп, включеними до розрахунку товарного ризику”**

Зазначаються відкриті короткі ризик-позиції, визначені за ризик-позиціями, включеними до показників A7S309 та A7S310 з урахуванням вимог розділу V Положення № 162 щодо розрахунку товарного ризику.

**Правило формування показника A7S321 “Розмір товарного ризику за товарами групи “Дорогоцінні метали”, крім золота”**

Зазначається розмір товарного ризику за товарами групи “Дорогоцінні метали” таблиці Додатку 11 до Положення № 162, крім золота, визначений згідно з вимогами розділу V Положення № 162.

**Правило формування показника A7S322 “Розмір товарного ризику за товарами групи “Недорогоцінні метали”**

Зазначається розмір товарного ризику за товарами групи “Недорогоцінні метали” таблиці Додатку 11 до Положення № 162, визначений згідно з вимогами розділу V Положення № 162.

**Правило формування показника A7S323 “Розмір товарного ризику за товарами групи “М’які та інші агрокультури”**

Зазначається розмір товарного ризику за товарами групи “М’які та інші агрокультури” таблиці Додатку 11 до Положення № 162, визначений згідно з вимогами розділу V Положення № 162.

**Правило формування показника A7S324 “Розмір товарного ризику за товарами груп енергопродукції”**

Зазначається розмір товарного ризику за товарами груп “Енергія – тверде паливо”, “Енергія – рідкі горючі речовини”, “Енергія –електроенергія та вуглець” та “Газоподібні горючі речовини” таблиці Додатку 11 до Положення № 162, визначений згідно з вимогами розділу V Положення № 162.

**Правило формування показника A7S325 “Розмір товарного ризику за товарами всіх інших груп”**

Зазначається розмір товарного ризику за товарами всіх інших груп таблиці Додатку 11 до Положення № 162, крім включених до розрахунку товарного ризику за показниками A7S321, A7S322, A7S323, A7S24, визначений згідно з вимогами розділу ІV Положення № 162.

**Правило формування показника A7S326 “Розмір ризику опціонів, чутливих до товарного ризику, за спрощеним методом”**

Зазначається розмір ризику опціонів, чутливих до товарного ризику, визначений за спрощеним методом згідно з вимогами пунктів 38-41 розділу VІ Положення № 162.

**Правило формування показника A7S327 “Розмір ризику опціонів, чутливих до товарного ризику, за методом “дельта плюс” - гамма-ризик”**

Зазначається розмір гама-ризику опціонів, чутливих до товарного ризику, визначений за методом “дельта плюс” згідно з вимогами пункту 46 розділу VІ Положення № 162.

**Правило формування показника A7S328 “Розмір ризику опціонів, чутливих до товарного ризику, за методом “дельта плюс” - вега-ризик”**

Зазначається розмір вега-ризику опціонів, чутливих до товарного ризику, визначений за методом “дельта плюс” згідно з вимогами пунктів 47-48 розділу VІ Положення № 162.

**Правило формування показника A7S401 “Мінімальний розмір ринкового ризику”**

Зазначається розмір ринкового ризику, визначений за формулою (1) згідно з вимогами Положення № 162.