**ТЕХНИЧЕСКОЕ ЗАДАНИЕ**

**по формированию перечня активов/обязательств**

**для целей стресс-тестирования НПФ**

|  |  |
| --- | --- |
| **Наименование показателя** | **Описание заполнения** |
| Дата | Отчётная/расчётная дата |
| ТИП | Вид портфеля:СС – собственные средства (ОУД) (учитываются только активы, принимаемые к расчёт собственных средств по методике ЦБ)ПР1 – пенсионные резервыПН – пенсионные накопления, выплатной резерв и средства застрахованных лиц, которым назначены срочная пенсионная выплатаРОПС – резерв покрытия пенсионных обязательств |
| НПФ | НПФ «Профессиональный» (АО) – неизменный показатель |
| ИНН НПФ | 7701109908 – неизменный показатель |
| Класс | 1. Денежные средства на расчетных счетах
2. Акции
3. ГЦБ РФ
4. Облигации корпоративные
5. Денежные средства на брокерских счетах
6. Кредиторская задолженность
7. Недвижимость коммерческая
8. Прочая дебиторская задолженность

ВАЖНО: сохранить орфографию. |
| Код | Для ценных бумаг (облигации/акции) – ISIN.Для недвижимости – кадастровый номер.Для расчётного/брокерского счёта – номер договора.Для кредиторской/дебиторской задолженности – номер договора. |
| Наименование Актива | Для ценных бумаг (облигации/акции) – эмитент.Для недвижимости – адрес.Для расчётного/брокерского счёта – наименование банка/брокера.Для кредиторской/дебиторской задолженности – контрагент по договору. |
| ИНН | ИНН эмитента, банка, брокера, контрагента |
| Максимальный рейтинг | Используется международная шкала S&P/Fitch согласно таблице сопоставления (стр. 6 сценариев ЦБ) Если эмитенту присвоено несколько рейтингов разными агентствами, принимается наибольший согласно таблице.Если выпуску ценных бумаг присвоен рейтинг выше, чем эмитенту, значит используется рейтинг выпуска. |
| Наименование гаранта | *не заполняем* |
| ИНН гаранта | *не заполняем* |
| Максимальный рейтинг гаранта | *не заполняем* |
| Доля поручительства в купоне, % | *не заполняем* |
| Доля поручительства в номинале, % | *не заполняем* |
| Количество | Для ценных бумаг (облигации/акции) – количество в штуках.Для недвижимости, расчётного/брокерского счёта, кредиторской/дебиторской задолженности показатель = 1. |
| Стоимость | Для облигаций – сумма справедливой стоимости 1 облигации и суммы накопленного купонного дохода (НКД) 1 облигации, умноженная на количество штук.Для акций – справедливая стоимость 1 акции, умноженная на количество штук.Для недвижимости – стоимость по данным 1С.Для расчётного/брокерского счёта – сумма остатка на счёте.Для кредиторской/дебиторской задолженности – стоимость по данным 1С. |
| Цена | Для облигаций – сумма справедливой стоимости 1 облигации и суммы накопленного купонного дохода (НКД) 1 облигации.Для акций – справедливая стоимость 1 акции.Для недвижимости – стоимость по данным 1С.Для расчётного/брокерского счёта – сумма остатка на счёте.Для кредиторской/дебиторской задолженности – стоимость по данным 1С. |
| Тип цены (1 - справедливая, 0 - амортизированная) | Для кредиторской задолженность показатель = 0.Для всех остальных классов активов показатель = 1. |
| Номер группы | *не заполняем* |
| Ключевая/неключевая организация | *не заполняем* |
| (если неключевая) наименование ключевой организации | *не заполняем* |
| (если неключевая) ИНН ключевой организации | *не заполняем* |
| (если неключевая) рейтинг ключевой организации | *не заполняем* |
| Дата погашения | Заполняется только для:1. облигаций (согласно данным справочника ценных бумаг);
2. дебиторской/кредиторской задолженности (если отчётная дата является окончанием квартала, тогда датой погашения является дата окончания следующего квартала, в противном случае датой погашения является дата окончания текущего квартала.
 |
| Дата ближайшей оферты | Заполняется только для облигаций согласно данным справочника ценных бумаг. |
| Валюта | RUB – неизменный показатель. |
| Recovery Rate | Показатель равен 0 для:1. акций;
2. активов, не имеющих кредитного рейтинга;
3. кредиторской задолженности.

Показатель равен 0,35 для активов, имеющих кредитный рейтинг, кроме акций. |