

Банковская отчетность			
Код территории по ОКATO	Код кредитной организации (филиала) по ОКПО	регистрационный номер	(/порядковый номер)
4527553	29313754	3185	

СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, НОРМАТИВЕ ФИНАНСОВОГО РИСКА И НОРМАТИВЕ КРЕДИТНОГО РИСКА (публикуемая форма) на 01.07.2021 года

Полное или сокращенное фирменное наименование кредитной организации (головной кредитной организации банковской группы) Эс-Би-Ай Банк Общество с ограниченной ответственностью / Эс-Би-Ай Банк ООО
 Адрес (место нахождения) кредитной организации (головной кредитной организации банковской группы) Российская Федерация, 125315, Москва, Ленинградский проспект, дом 72, корп. 4

Код формы по ОКУД 0409813
 Квартальная

Раздел 1. Сведения об основных показателях деятельности кредитной организации (банковской группы)

Номер (строки)	Наименование показателя	Номер пояснения	Фактическое значение				
			на отчетную дату	на дату, отстоящую на один квартал от отчетной	на дату, отстоящую на два квартала от отчетной	на дату, отстоящую на три квартала от отчетной	на дату, отстоящую на четыре квартала от отчетной
1	2	3	4	5	6	7	8
КАПИТАЛ, тыс. руб.							
1	Вазовый капитал	4.3	6930606	6086323	6254531	3858398	3321041
1а	Вазовый капитал при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков	7957782	6608013	6605411	3866451	3301735	
2	Основной капитал	4.3	6930606	6086323	6254531	3858398	3321041
2а	Основной капитал при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков	7957782	6608013	6605411	3866451	3301735	
3	Собственные средства (капитал)	4.3	6930606	6086323	6254531	6807137	3301735
3а	Собственные средства (капитал) при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков	8078391	6691630	6605411	7200734	3613219	
АКТИВЫ, ВЗВЕШЕННЫЕ ПО УРОВНЮ РИСКА, тыс. руб.							
4	Активы, взвешенные по уровню риска		28800220	24244029.5	23378999.5	18542921.5	20521048.1
НОРМАТИВЫ ДОСТАТОЧНОСТИ КАПИТАЛА, процент							
5	Норматив достаточности базового капитала Н1.1 (Н20.1)	4.3	24.0644	25.1044	26.7528	20.8080	16.1840
5а	Норматив достаточности базового капитала при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		27.6310	27.2560	29.0910	20.4440	16.0900
6	Норматив достаточности основного капитала Н1.2 (Н20.2)	4.3	24.0644	25.1044	26.7528	20.8080	16.1840
6а	Норматив достаточности основного капитала при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		27.6310	27.2560	29.0910	20.4440	16.0900
7	Норматив достаточности собственных средств (капитала) Н1.0 (Н1к, Н1.3, Н20.0)	4.3	24.0644	25.1044	26.7528	36.7100	16.1840
7а	Норматив достаточности собственных средств (капитала) при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		28.0500	27.6010	29.0910	38.0740	16.0900
НАДБАВКА К ВАЗОВОМУ КАПИТАЛУ (в процентах от суммы активов, взвешенных по уровню риска), процент							
8	Надбавка поддержания достаточности капитала		2.5000	2.5000	2.5000	2.5000	2.5000

	ного клирингового обеспечения центрального контрагента НЦК								
30	Норматив ликвидности центрального контрагента НЦК								
31	Норматив максимального размера риска концентрации НЦК								
32	Норматив текущей ликвидности РИКО (Н15)								
33	Норматив ликвидности небанковской кредитной организации, имеющей право на осуществление переводов денежных средств без открытия банковских счетов и связанных с ними иных банковских операций Н15.1								
34	Норматив максимальной совокупной величины кредитов клиентам - участни- кам расчетов на завершение расчетов Н16								
35	Норматив предоставления РИКО от своего имени и за свой счет кредитов завещанкам, кроме клиентов - участни- ков расчетов Н16.1								
36	Норматив максимального размера внебалансных обязательств расчетных небанковских кредитных организаций Н16.2								
37	Норматив минимального соотношения размера ипотечного покрытия и объема эмиссии облигаций с ипотечным покры- тием Н18								

Раздел 2. Информация о расчете норматива финансового рычага (Н1.4)

Подраздел 2.1 Расчет размера балансовых активов и внебалансовых требований
под риском для расчета норматива финансового рычага (Н1.4)

Номер (строки)	Наименование показателя	Номер пооянения	Сумма, тыс. руб.
1	2	3	4
1	Размер активов в соответствии с бухгалтерским балансом (публикуемая форма), всего		19735587
2	Поправка в части вложений в капитал кредитных, финансовых, страховых или иных организаций, отчетные данные которых включаются в консоли- дированную финансовую отчетность, но не включаются в расчет величины собственных средств (капитала), обязательных нормативов и размеров (лимитов) открытых валютных позиций банковской группы		Неприменно для отчетности кредитной организации как юридического лица
3	Поправка в части финансовых активов, отражаемых в соответствии с правилами бухгалтерского учета, но не включаемых в расчет норматива финансового рычага		0
4	Поправка в части производных финансовых инструментов (ПФИ)		0
5	Поправка в части операций кредитования ценными бумагами		33
6	Поправка в части применения к кредитному эквиваленту условных обязательств кредитного характера		10252189
7	Прочие поправки		-973159
8	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправок для расчета норматива финансового рычага, итого		29014650

Раздел 2.2 Расчет норматива финансового рычага (Н1.4)

Номер (строки)	Наименование показателя	Номер пооянения	Сумма, тыс. руб.
1	2	3	4
Риск по балансовым активам			
1	Величина балансовых активов, всего		18420868.00
2	Уменьшающая поправка на сумму показателей, принимаемых в уменьшение величины источников основного капитала		391891.00
3	Величина балансовых активов под риском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), всего		18028977.00
Риск по операциям с ПФИ			
4	Текущий кредитный риск по операциям с ПФИ (за		0.00

	вычетом полученной вариационной маржи и (или) с учетом неттинга позиции, если применимо), всего	
5	Потенциальный кредитный риск на контрагента по операциям с ПФИ, всего	0.00
6	Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПФИ, подлежащей списанию с баланса	неприменимо
7	Уменьшаемая поправка на сумму перечисленной вариационной маржи в установленных случаях	0.00
8	Поправка в части требований банка - участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клиентов	0.00
9	Поправка для учета кредитного риска в отношении базисного актива по выданным кредитам ПФИ	0.00
10	Уменьшаемая поправка в части выданных кредитных ПФИ	0.00
11	Величина риска по ПФИ с учетом поправок, итого (сумма строк 4, 5, 9 за вычетом строк 7, 8, 10)	0.00
Риск по операциям кредитования ценными бумагами		
12	Требования по операциям кредитования ценными бумагами (без учета неттинга), всего	733451.00
13	Поправка на величину неттинга денежной части (требований и обязательств) по операциям кредитования ценными бумагами	0.00
14	Величина кредитного риска на контрагента по операциям кредитования ценными бумагами	33.00
15	Величина риска по гарантийным операциям кредитования ценными бумагами	0.00
16	Требования по операциям кредитования ценными бумагами с учетом поправок, итого (сумма строк 12, 14, 15 за вычетом строки 13)	733484.00
Риск по условным обязательствам кредитного характера (КРВ')		
17	Номинальная величина риска по условным обязательствам кредитного характера, всего	10252189.00
18	Поправка в части применения коэффициентов кредитного эквивалента	0.00
19	Величина риска по условным обязательствам кредитного характера с учетом поправок, итого (разность строк 17 и 18)	10252189.00
Капитал и риски		
20	Основной капитал	6930606.00
21	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета норматива финансового рычага, всего (сумма строк 3, 4, 16, 19)	29014650.00
Норматив финансового рычага		
22	Норматив финансового рычага банка (Н1.4), банковской группы (Н20.4), процент (строка 20 : строка 21)	23.89

Раздел 3. Информация о расчете норматива краткосрочной ликвидности

Номер строки	Наименование показателя	Номер показателя	Данные на 01.04.2021		Данные на 01.07.2021	
			величина требований (обязательства), тыс. руб.	завешенная величина (обязательства), тыс. руб.	величина требований (обязательства), тыс. руб.	завешенная величина (обязательства), тыс. руб.
1	2	3	4	5	6	7
ВЫСОКОКАЧЕСТВЕННЫЕ ЛИКВИДНЫЕ АКТИВЫ						
1	Высокликвидные активы (ВЛА) с учетом дополнительных требований (активов), включенных в числитель Н26 (Н27)		X		X	
ОЖИДАЕМЫЕ ОТТОКИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ						
2	Денежные средства физических лиц, всего, в том числе:					
3	стабильные средства					
4	нестабильные средства					
5	Денежные средства клиентов, привлеченные без обеспечения, всего, в том числе:					
6	операционные депозиты					
7	Депозиты, не относящиеся к операционным (прочие депозиты)					
8	необеспеченные долговые обязательства					
9	Денежные средства клиентов, привлеченные под обеспечение		X		X	
10	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств, всего, в том числе:					

11	По производим финансовым инструментам и в связи с потенциальной потребностью во внесении дополнительного обеспечения			
12	Связанные с потерей финансирования по обеспеченным договорам инвестирования			
13	По обязательствам Банка по неиспользованным кредитам и условно отозванным кредитам лицам и лицам дивиденды			
14	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств по прочим договорам обязательствам			
15	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств по прочим условиям обязательствам			
16	Суммарный отток денежных средств, итого (строка 2 + строка 3 + строка 9 + строка 10 + строка 14 + строка 15)	X		X
ОЖИДАЕМЫЕ ПИТОМЫ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ				
17	По операциям предоставления денежных средств под обеспечение ценными бумагами, включая операции обратного репо			
18	По договорам без нарушения контрактных сроков исполнения обязательств			
19	Прочие притоки			
20	Суммарный приток денежных средств, итого (строка 17 + строка 18 + строка 19)			
СУММАРНАЯ СПОНТИВНАЯ СТОИМОСТЬ				
21	ИВА за вычетом корректировок, рассчитанных с учетом ограничений на максимальную позицию ИВА-2В и ИВА-2	X		X
22	Чистый ожидаемый отток денежных средств	X		X
23	Наработки рыночной ликвидности базисской Группы (ИЗВ), кредитной организации (ИЗТ), процент	X		X

Председатель Правления
 Зам. главного бухгалтера
 Зам. гл. бухгалтера
 Телефон: 7 (495) 651-65-12

Иванов И.А.
Иванов И.А.
Иванов И.А.

