

Банковская отчетность

Код территории по ОКATO	Код кредитной организации (филиала) по ОКПО	регистрационный номер (/порядковый номер)
45286560	40449715	3290

**СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, НОРМАТИВЕ ФИНАНСОВОГО РЫЧАГА
И НОРМАТИВЕ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ
(публикуемая форма)
на 01.10.2020 года**

Полное или сокращенное фирменное наименование кредитной организации (головной кредитной организации банковской группы) Общество с ограниченной ответственностью Эйч-Эс-Би-Си Банк (РР) / ООО Эйч-Эс-Би-Си Банк (РР)
Адрес (место нахождения) кредитной организации (головной кредитной организации банковской группы) 115054, Москва Павелецкая пл., д.2 стр.2

Код формы по ОКУД 0409813
Квартальная (Годовая)

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	Базовый капитал	11602026	111595836	10209123	10206284	10392961	
1a	Базовый капитал при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков без учета влияния переходных мер	12864095	12857905	11344699	11156549	11190900	
2	Основной капитал	11602026	111595836	10209123	10206284	10392961	
2a	Основной капитал при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков	12864095	12857905	11344699	11156549	11190900	
3	Собственные средства (капитал)	12074013	11870283	11701607	11322678	10636079	
3a	Собственные средства (капитал) при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков	13257418	13233321	13226790	12601805	12085410	
АКТИВЫ, взвешенные по уровню риска, тыс.руб.							
4	Активы, взвешенные по уровню риска	42983545	41915813	60663245	51225044	43347744	
НОРМАТИВЫ ДОСТАТОЧНОСТИ КАПИТАЛА, процент							
5	Норматив достаточности базового капитала Н1.1 (Н20.1)	4.3.4	26.992	27.665	16.829	19.924	23.976
5a	Норматив достаточности базового капитала при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		29.928	30.676	18.701	21.779	25.817
6	Норматив достаточности основного капитала Н1.2 (Н20.2)	4.3.4	26.992	27.665	16.829	19.924	23.976
6a	Норматив достаточности основного капитала при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		29.928	30.676	18.701	21.779	25.817
7	Норматив достаточности собственных средств (капитала) Н1.0 (Н1ц, Н1.3, Н20.0)	4.3.4	28.09	28.319	19.289	22.104	24.537

7a	Норматив достаточности собственных средств (капитала) при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		30.843		31.571		21.804		24.601		27.989								
НАДБАВКИ К БАЗОВОМУ КАПИТАЛУ (в процентах от суммы активов, взвешенных по уровню риска), процент																			
8	Надбавка поддержания достаточности капитала		2.500		2.500		2.500		2.250		2.125								
9	Антициклическая надбавка		0.000		0		0.000		0.139		0.061								
10	Надбавка за системную значимость	не применимо																	
11	Надбавки к нормативам достаточности собственных средств (капитала), всего (стр.8+стр.9+стр.10)		2.500		2.500		2.500		2.389		2.186								
12	Базовый капитал, доступный для направления на поддержание надбавок к нормативам достаточности собственных средств (капитала)		120.090		120.319		19.310		13.924		16.537								
НОРМАТИВ ФИНАНСОВОГО РЫЧАГА																			
13	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета норматива финансового рычага, тыс. руб.		96167890		86607376		116664263		100524169		85641002								
14	Норматив финансового рычага (Н1.4), Банковской группы (Н20.4), процент	14.4	12.07		13.390		18.760		10.153		12.135								
14a	Норматив финансового рычага при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков, процент		13.2		14.846		19.724		11.098		13.067								
НОРМАТИВ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ																			
15	Высоколиквидные активы, тыс. руб.	не применимо																	
16	Чистый ожидаемый отток денежных средств, тыс. руб.	не применимо																	
17	Норматив краткосрочной ликвидности (Н26 (Н27), процент	не применимо																	
НОРМАТИВ СТРУКТУРНОЙ ЛИКВИДНОСТИ (НОРМАТИВ ЧИСТОГО СТАБИЛЬНОГО ФОНДИРОВАНИЯ)																			
18	Имеющееся стабильное фондирование (ИСФ), тыс. руб.	не применимо																	
19	Требуемое стабильное фондирование (ТСФ), тыс. руб.	не применимо																	
20	Норматив структурной ликвидности (норматив чистого стабильного фондирования) Н28, (Н29), процент	не применимо																	
НОРМАТИВЫ, ОГРАНИЧИВАЮЩИЕ ОТДЕЛЬНЫЕ ВИДЫ РИСКОВ, процент																			
21	Норматив мгновенной ликвидности Н2		85.133		164.437		110.044		367.704		175.349								
22	Норматив текущей ликвидности Н3		165.773		207.193		154.300		180.571		214.119								
23	Норматив долгосрочной ликвидности Н4		12.279		12.764		13.412		13.590		10.444								
24	Норматив максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков Н6 (Н21)		максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений
			19.48	0	0	16.07	0	0	14.4	0	0	14.6	0	0	15.2	0	0	0	
25	Норматив максимального размера крупных кредитных рисков Н7 (P22)		120.825		135.965		175.544		156.857		148.586								
26	Норматив совокупной величины риска по инсайдерам Н10.1		0		0		0		0		0								

27	Норматив использования собственных средств (капитала) для приобретения акций (долей) других юридических лиц (Н12 (Н23))		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
28	Норматив максимального размера риска на связанное с банком лицо (группу связанных с банком лиц) Н25		максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность
			0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
29	Норматив достаточности совокупных ресурсов центрального контрагента Н2цк	не применимо															
30	Норматив достаточности индивидуального клирингового обеспечения центрального контрагента Н3цк	не применимо															
31	Норматив ликвидности центрального контрагента Н4цк	не применимо															
32	Норматив максимального размера риска концентрации Н5цк	не применимо															
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	не применимо															
34	Норматив максимальной совокупной величины кредитов клиентам - участникам расчетов на завершение расчетов Н16	не применимо															
35	Норматив предоставления РНКО от своего имени и за свой счет кредитов заемщикам, кроме клиентов - участников расчетов Н16.1	не применимо															
36	Норматив максимального размера вексельных обязательств расчетов небанковских кредитных организаций Н16.2	не применимо															
37	Норматив минимального соотношения размера ипотечного покрытия и объема эмиссии облигаций с ипотечным покрытием Н18	не применимо															

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 пояснения	Сумма, тыс. руб.
1	2	3	4
1	Размер активов в соответствии с бухгалтерским балансом (публикуемая форма), всего		80113186
2	Поправка в части вложений в капитал кредитных, финансовых, страховых или иных организаций, отчетные данные которых включаются в консолидированную финансовую отчетность, но не включаются в расчет величины собственных средств (капитала), обязательных нормативов и размеров (лимитов) открытых валютных позиций банковской группы		Неприменимо для отчетности кредитной организации как юридического лица
3	Поправка в части фидуциарных 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)		902380
5	Поправка в части операций кредитования ценными бумагами		0
6	Поправка в части приведения к кредитному эквиваленту условных обязательств кредитного характера		16515491

7	Прочие поправки		1363167
8	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправок для расчета норматива финансового рычага, итого	4.4	96167890

Раздел 2.2 Расчет норматива финансового рычага (Н1.4)

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Сумма, тыс. руб.
1	2	3	4
Риск по балансовым активам			
1	Величина балансовых активов, всего		68385795.00
2	Уменьшающая поправка на сумму показателей, принимаемых в уменьшение величины источников основного капитала		44332.00
3	Величина балансовых активов под риском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), всего		68341463.00
Риск по операциям с ПФИ			
4	Текущий кредитный риск по операциям с ПФИ (за вычетом полученной вариационной маржи и (или) с учетом неттинга позиций, если применимо), всего		2332421.00
5	Потенциальный кредитный риск на контрагента по операциям с ПФИ, всего		902380.00
6	Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПФИ, подлежащей списанию с баланса		неприменимо
7	Уменьшающая 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 выпущенным кредитным ПФИ		0.00
10	Уменьшающая поправка в части выпущенных кредитных ПФИ		0.00
11	Величина риска по ПФИ с учетом поправок, итого (сумма строк 4, 5, 9 за вычетом строк 7, 8, 10)		3234801.00
Риск по операциям кредитования ценными бумагами			
12	Требования по операциям кредитования ценными бумагами (без учета неттинга), всего		8076135.00
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		0.00
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)		8076135.00
Риск по условным обязательствам кредитного характера (КРВ')			

17	Номинальная величина риска по условным обязательствам кредитного характера, всего		16515491.00
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)		16515491.00
Капитал и риски			
20	Основной капитал		11602026.00
21	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета норматива финансового рычага, всего (сумма строк 3, 11, 16, 19)		96167890.00
Норматив финансового рычага			
22	Норматив финансового рычага банка (Н1.4), банковской группы (Н20.4), процент (строка 20 : строка 21)	4.4	12.07

Раздел 3. Информация о расчете норматива краткосрочной ликвидности

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Данные на 01.04.2020		Данные на 01.07.2020		Данные на 01.10.2020	
			величина требований (обязательств), тыс. руб.	взвешенная величина требований (обязательств), тыс. руб.	величина требований (обязательств), тыс. руб.	взвешенная величина требований (обязательств), тыс. руб.	величина требований (обязательств), тыс. руб.	взвешенная величина требований (обязательств), тыс. руб.
1	2	3	4	5	6	7	8	9
ВЫСОКОКАЧЕСТВЕННЫЕ ЛИКВИДНЫЕ АКТИВЫ								
1	Высоколиквидные активы (ВЛА) с учетом дополнительных требований (активов), включенных в числитель Н26 (Н27)	не применимо	X		X		X	
ОЖИДАЕМЫЕ ОТТОКИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ								
2	Денежные средства физических лиц, всего, в том числе:	не применимо						
3	стабильные средства	не применимо						
4	нестабильные средства	не применимо						
5	Денежные средства клиентов, привлеченные без обеспечения, всего, в том числе:	не применимо						
6	операционные депозиты							
7	депозиты, не относящиеся к операционным (прочие депозиты)							
8	необеспеченные долговые обязательства							
9	Денежные средства клиентов, привлеченные под обеспечение		X		X		X	
10	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств, всего, в том числе:	не применимо						
11	по производным финансовым инструментам и в связи с потенциальной потребностью во внесении дополнительного обеспечения							
12	связанные с потерей фондирования по обеспеченным							

	долговым инструментам							
13	по обязательствам банка по неиспользованным безотзывным и условно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности							
14	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств по прочим договорным обязательствам							
15	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств по прочим условным обязательствам							
16	Суммарный отток денежных средств, итого (строка 2 + строка 5 + строка 9 + строка 10 + строка 14 + строка 15)	не применимо	X		X		X	
ОЖИДАЕМЫЕ ПРИТОКИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ								
17	По операциям предоставления денежных средств под обеспечение ценными бумагами, включая операции обратного репо	не применимо						
18	По договорам без нарушения контрактных сроков исполнения обязательств	не применимо						
19	Прочие притоки							
20	Суммарный приток денежных средств, итого (строка 17 + строка 18 + строка 19)	не применимо						
СУММАРНАЯ СКОРРЕКТИРОВАННАЯ СТОИМОСТЬ								
21	ВЛА за вычетом корректировок, рассчитанных с учетом ограничений на максимальную величину ВЛА-2Б и ВЛА-2	не применимо	X		X		X	
22	Чистый ожидаемый отток денежных средств	не применимо	X		X		X	
23	Норматив краткосрочной ликвидности банковской группы (H26), кредитной организации (H27), процент	не применимо	X		X		X	

Председатель Правления

Макаллистер Малаки

Главный бухгалтер

Конева Е.А.

10 ноября 2020 года