

Кредитной организации
Общество с ограниченной ответственностью Банк "ФЭЙСКО ФИНАНС"
/ ООО "ФЭЙН Банк"

Адрес (место нахождения) кредитной организации
(полной кредитной организации банковской группы)
г. Москва, улица Каретный Ряд, дом 5/10, строение 2

РЕШЕНИЕ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, ПОКАЗАТЕЛЕ ФИНАНСОВОГО РИСКА
И НОРМАТИВЕ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ
(публикуемая форма)
на 01.07.2018 года

Банковская отчетность	
Код территории	Код кредитной организации (филиала)
по ОКАТО	по ОКПО
	регистрационный номер
	(/порядковый номер)
145286585	09319252
	1143

Раздел 1. Сведения об обязательных нормативах

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Нормативное значение, процент	фактическое значение, процент					
				на отчетную дату	на начало отчетного года				
1	1	2	4	5	6				
1	Норматив достаточности базового капитала (Н1.1), банковской группы (Н20.1)	9.3	4.51	12.3	17.4				
2	Норматив достаточности основного капитала банка (Н1.2), банковской группы (Н20.2)	9.3	6.01	23.2	31.6				
3	Норматив достаточности собственных средств (Капитала) банка (норматив Н1.0), банковской группы (Н20.0)	9.3	8.01	23.2	31.6				
4	Норматив достаточности собственных средств (Капитала) небанковской кредитной организации, имеющей право на осуществление переводов денежных средств без открытия банковских счетов и связанных с ними иных банковских операций (Н1.3)								
5	Норматив финансового рычага банка (Н1.4), банковской группы (Н20.4)		3.01	22.1					
6	Норматив мгновенной ликвидности банка (Н2)		15.01	109.6	76.4				
7	Норматив текущей ликвидности банка (Н3)		50.01	170.7	309.7				
8	Норматив долгосрочной ликвидности банка (Н4)		120.01	6.7	1.9				
9	Норматив максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6)		25.01	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность
				20.71			19.11		
10	Норматив максимального размера крупных кредитных рисков (Н7), банковской группы (Н22)		800.01	235.7	179.9				
11	Норматив максимального размера кредитов, банковских гарантий и поручительства, предоставленных банком своим участникам (акционерам) (Н9.1)		50.01	4.6	4.2				

Код формы по ОКУД 0409813
Квартальная(Годовая)

12	Норматив совокупной величины риска по инсайдерям банка (Н10.1)			3.01		1.6			0.1	
13	Норматив использования собственных средств (капитала) банка для приобретения акций (долей) других юридических лиц (Н12), норматив использования собственных средств (капитала) банковской группы для приобретения доли в уставном капитале банковской группы акций (долей) другими юридическими лиц (Н23)									
14	Норматив соотношения суммы ликвидных активов сроком исполнения в ближайше 30 календарных дней к сумме обязательств РНКО (Н15)									
15	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)									
16	Норматив максимальной совокупной величины кредита клиентам – участникам расчетов на завершение расчетов (Н16)									
17	Норматив предостережения РНКО от своего имени и за свой счет кредитов заемщикам, кроме клиентов – участников расчетов (Н16.1)									
18	Норматив минимального соотношения размера ипотечного покрытия и объема эмиссии облигаций с ипотечным покрытием (Н18)									
19	Норматив максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков банковской группы (Н21)									
20	Норматив максимального размера риска на связанное с банком лицо (группу связанных с банком лиц) (Н25)									
				20.01	Максимальное значение	количество нарушений	длительность	Максимальное значение	количество нарушений	длительность
					13.51			8.81		

Раздел 2. Информации о расчете показателя финансового рычага

Раздел 2.1. Расчет размера балансовых активов и внебалансовых преобладаий

Номер	Наименование показателя	Номер пояснения	Сумма, тыс. руб.
п/п			
1	Размер активов в соответствии с бухгалтерским балансом (публикуемая форма), всего	3	4
1			20412951
2	Поправка в части вычетов в капитал кредитных, финансовых, страховых или иных организаций, отчетные данные которых включаются в консолидированный финансовый отчетность, но не включаются в расчет величины собственных средств (капитала), обязательных нормативов и размеров (ликвидов) открытых валютных позиций банковской группы		
3	Поправка в части финансовых активов, отраженных в соответствии с правилами бухгалтерского учета, но не включаемых в расчет показателя финансового рычага		0
4	Поправка в части производных финансовых инструментов (ИФП)		86431
5	Поправка в части операций кредитования ценными бумагами		197981

6	Поправка в части привилегия к кредитному аккредитиву условных обязательств кредитного клиента			5401
7	Прочие поправки			51601
8	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправок для расчета показателя финансового рычага, итог			2018616

Раздел 2.2 Таблица расчета показателя финансового рычага

Номер	Наименование показателя	Номер повышения	Сумма, тыс. руб.
1		2	3
			4
Риск по балансовым активам			
1	Величина балансовых активов, всего:		2049961.001
2	Уменьшающая поправка на сумму показателей, признаваемых в уменьшение величины источника основного капитала		10773.001
3	Величина балансовых активов под риском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), итог:		2039228.001
Риск по операциям с ПФИ			
4	Текущий кредитный риск по операциям с ПФИ (за вычетом полученной вариационной маржи), всего:		6593.001
5	Повышающий кредитный риск на контрагента по операциям с ПФИ, всего:		8643.001
6	Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПФИ, подлежащей списанию с баланса в соответствии с правилами бухгалтерского учета	в соответствии с российскими правилами бухгалтерского учета неприменяемо	
7	Уменьшающая поправка на сумму перечисленной вариационной маржи в установленных случаях		0.001
8	Поправка в части требований банка - участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клиентов		0.001
9	Поправка для учета кредитного риска в отношении базисного актива по выпущенным кредитным ПФИ		0.001
10	Уменьшающая поправка в части выпущенных кредитных ПФИ		0.001
11	Величина риска по ПФИ с учетом поправок (сумма строк 4, 5, 9 за вычетом строк 7, 8, 10), итог:		15236.001
Риск по операциям кредитования ценными бумагами			
12	Требования по операциям кредитования ценными бумагами (без учета неттинга), всего:		454181.001
13	Поправка на величину неттинга денежной части (требований и обязательств) по операциям		0.001

Кредитования ценными бумагами							
14	Величина кредитного риска на контрахента по операциям кредитования ценными бумагами			19798.001			
15	Величина риска по таргетным операциям кредитования ценными бумагами			0.001			
16	Преодоления по операциям кредитования ценными бумагами с учетом поправок (сумма строк 12, 14, 15 за вычетом строки 13), итогов:			473979.001			
Риск по условным обязательствам кредитного характера (КРВ)							
17	Номинальная величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ), всего:			5400.001			
18	Поправка в части применения коэффициентов кредитного эквивалента			540.001			
19	Величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ), с учетом поправок (гранность строк 17 и 18), итогов:			4860.001			
Капитал риска							
20	Основной капитал			442744.001			
21	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета показателя финансового рычага (сумма строк 3, 11, 16, 19), всего:			253303.001			
Показатель финансового рычага							
22	Показатель финансового рычага по Базелю III (строка 20 / строка 21), процент			17.48			

Раздел 3. Информация о расчете норматива краткосрочной ликвидности

Номер строки	Наименование показателя	Номер пометки	Данные на 01.04.2018		Данные на 01.07.2018	
			величина требований (обязательства), тыс. руб.	взвешенная величина требований (обязательства), тыс. руб.	величина требований (обязательства), тыс. руб.	взвешенная величина требований (обязательства), тыс. руб.
1	ВЫСОКОКАЧЕСТВЕННЫЕ ЛИКВИДНЫЕ АКТИВЫ					
1	Высоколиквидные активы (ВЛА) с учетом допони-тельных требований (активов), включенных в числитель И26 (И27)		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 обязательства				
9	Денежные средства клиентов, привлеченные под обеспечение	X			
10	Дополнительно ожидаемые отсрочки денежных средств, в том числе:				
11	по произвольным финансовым инструментам и в связи с потенциальной потребностью во внесении дополнительного обеспечения				
12	связанные с потерей фондирования по обеспеченным депозитным инструментам				
13	по обязательствам банка по неиспользованным безотзывным и условно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности				
14	Дополнительно ожидаемые отсрочки денежных средств по прочим договорным обязательствам				
15	Дополнительно ожидаемые отсрочки денежных средств по прочим условным обязательствам				
16	Суммарный отток денежных средств, итого (строка 2 + строка 5 + строка 9 + строка 10 + строка 14 + строка 15)	X		X	
ОЖИДАЕМЕ ПЕРИОДИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ					
17	по операциям предоставления денежных средств под обеспечение ценными бумагами, включая операции обратного РЕПО				
18	по договорам без нарушения контрактных сроков исполнения обязательства				
19	Прочие приголки				
20	Суммарный приток денежных средств, итого (строка 17 + строка 18 + строка 19)				
СУММАРНАЯ СКОРЕКТИРОВАННАЯ СТОИМОСТЬ					
21	ВДА за вычетом корректировок, рассчитанных с учетом оптимизаций на максимизацию величины ВДА-2Е и ВДА-2	X		X	
22	Чистый ожидаемый отток денежных средств	X		X	
23	Норматива краткосрочной ликвидности банковской группы (НЗБ), кредитной организации (НЗТ), прочими	X		X	

Председатель Правления

Салыч Г.Г.

Главный бухгалтер

Дерюгина Т. В.

Начальник отдела отчетности
Телефон: 8 (495) 249-1162

Пирожкин Е. В.

30.07.2018

