

Банковская отчетность			
Код территории по ОКТО	Код кредитной организации (филиала) по ОКТО	Регистрационный номер (/порядковый номер)	145
			142943661
			3292

СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, ПОКАЗАТЕЛЕ ФИНАНСОВОГО РИСКА И НОРМАТИВЕ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ (публичная форма) на 01.10.2016 года

Товарной кредитной организации банковской группы
Акционерное общество Райффайзенбанк
/ АО Райффайзенбанк

Почтовый адрес
129090, Москва, ул. Троицкая, д. 17/1

Код формы по ОКД 0409813
Квартальная (Голован)

Раздел 1. Сведения об обязательных нормативах

Номер п/п	Наименование показателя	Номер пометки	Нормативное значение	Фактическое значение		в процентах
				на отчетную дату	на начало отчетного года	
1	1 Норматив достаточности базового капитала (Н1.1), Банковской группы (Н20.1)		4.51	9.61	8.71	
2	2 Норматив достаточности основного капитала Банка (Н1.2), Банковской группы (Н20.2)		6.01	10.51	9.71	
3	3 Норматив достаточности собственных средств (капитала) Банка (Н1.0), Банковской группы (Н20.0)		8.01	15.21	13.61	
4	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	5 Норматив мгновенной ликвидности банка (Н2)					
6	6 Норматив текущей ликвидности банка (Н3)					
7	7 Норматив долгосрочной ликвидности банка (Н4)					
8	8 Норматив максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков Банка (Н6)		Минимальное	Максимальное	Максимальное	Минимальное

9	Норматив максимального размера крупных кредитных рисков банка (Н7), банковской группы (Н22)			800.01	97.11	120.91
10	Норматив максимального размера кредитов, банковских гарантий и поручительств, предоставленных Банком своим участникам (акционерам) (Н9.1)					
11	Норматив совокупной величины риска по инсайдерам банка (Н10.1)					
12	Норматив использования собственных средств (капитала) банка для приобретения акций (долей) других юридических лиц (Н12), норматив использования собственных средств (капитала) банковской группы для приобретения головной кредитной организацией банковской группы акции (долей) других юридических лиц (Н23)			25.01	2.31	2.61
13	Норматив соотношения суммы ликвидных активов сроком исполнения в ближайше 30 календарных дней к сумме обязательств РНКО (Н15)					
14	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)					
15	Норматив максимальной совокупной величины кредитов клиентам – участникам расчетов на завершение расчетов (Н16)					
16	Норматив предоставления РНКО от своего имени и за свой счет кредитов заемщикам, кроме клиентов – участников расчетов (Н16.1)					
17	Норматив минимального соотношения размера непокрытого покрытия и объема эмиссии облигаций с ипотечным покрытием (Н18)					
18	Норматив максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков банковской группы (Н21)					

Раздел 2. Информация о расчете показателя финансового рычага

Раздел 2.1 Расчет размера балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета показателя финансового рычага

№	Наименование показателя	№	Сумма	тыс. руб.
п/п		пояснения		
1	Размер активов в соответствии с бухгалтерским балансом (публикуемая форма), всего		789906030	
2	Поправка в части вложений в капитал кредитных,			01

	финансовых, страховых или иных организаций, отчетные данные которых включаются в консолидированный финансовую отчетность, но не включаются в расчет величины собственных средств (капитала), обязательств нормативов и размеров (лимитов) открытых валютных позиций банковской группы			
3	Поправка в части филиальных активов, отражаемых в соответствии с правилами бухгалтерского учета, но не включаемых в расчет показателя финансового рычага	0		0
4	Поправка в части производных финансовых инструментов (ПФИ)	0		-18699097
5	Поправка в части операций кредитования ценными бумагами	0		0
6	Поправка в части приведения к кредитному эквиваленту условных обязательств кредитного характера	0		94441923
7	Прочие поправки	0		13438541
8	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправки для расчета показателя финансового рычага, итого	0		852210315

Раздел 2.2 Таблица расчета показателя финансового рычага

тыс. руб.

Номер п/п	Наименование показателя	Номер пометки	Сумма
1	Величина балансовых активов, всего	3	4
Риск по балансовым активам			
1	Величина балансовых активов, всего		696228044.00
2	Уменьшаемая поправка на сумму показателя, принимаемая в уменьшение величины источников основного капитала		4255708.00
3	Величина балансовых активов под риском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), итого		691972336.00
Риск по операциям с ПФИ			
4	Текущий кредитный риск по операциям с ПФИ (за вычетом полученной вариационной маржи), всего		14445071.00
5	Потенциальный кредитный риск на контрагента		2995503.00

	по операциям с ПФИ, всего							
6	Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПФИ, подлежащей списанию с баланса в соответствии с правилами бухгалтерского учета	0						
7	Уменьшаемая поправка на сумму перечисленной вариационной маржи в установленных случаях	0						0.00
8	Поправка в части требований банка – участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клиентов	0						0.00
9	Поправка для учета кредитного риска в отношении базисного (базового) актива по выпущенным кредитным ПФИ	0						0.00
10	Уменьшаемая поправка в части выпущенных кредитных ПФИ	0						0.00
11	Величина риска по ПФИ с учетом поправок (сумма строк 4, 5, 9 за вычетом строк 7, 8, 10), итого	0						17440574.00
Риск по операциям кредитования ценными бумагами								
12	Требования по операциям кредитования ценными бумагами (без учета неттинга), всего	0						46487608.00
13	Поправка на величину неттинга денежной части (требований и обязательств) по операциям кредитования ценными бумагами	0						0.00
14	Величина кредитного риска на контрагенту по операциям кредитования ценными бумагами	0						0.00
15	Величина риска по гарантийным операциям кредитования ценными бумагами	0						0.00
16	Требования по операциям кредитования ценными бумагами с учетом поправок (сумма строк 12, 14, 15 за вычетом строки 13), итого	0						46487608.00
Риск по условным обязательствам кредитного характера (КРВ)								
17	Номинальная величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ), всего	0						172900689.00
18	Поправка в части применения коэффициентов кредитного эквивалента	0						78458766.00
19	Величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ), с учетом поправок (разность строк 17 и 18), итого	0						94441923.00

Капитал риска

13	по обязательствам Банка по неиспользованным обязательствам и условно отзванным кредитным линиям и линиям ликвидности	89519873.00	8397536.00	92233605.00	8572189.00	84692949.00	7885114.00
14	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств по прочим договорным обязательствам	265945946.00	194082107.00	231130249.00	173882162.00	237901087.00	149219856.00
15	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств по прочим условным обязательствам	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
16	Суммарный отток денежных средств, итого (строка 2 + строка 5 + строка 9 + строка 10 + строка 14 + строка 15)	X	372605461.00	X	333888007.00	X	32270462.00
ОЖИДАЕМЫЕ ПРИТОКИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ							
17	По операциям предостачания денежных средств под обеспечение ценными бумагами, включая операции обратного РЕПО	35387528.00	29630001.00	37940384.00	28772729.00	51525486.00	35117532.00
18	По договорам без нарушения контрактных сроков исполнения обязательств	62288298.00	48995373.00	48160228.00	39867131.00	31019805.00	24475062.00
19	Прочие припоки	19641133.00	19641133.00	17701819.00	17701819.00	146607540.00	146607540.00
20	Суммарный приток денежных средств, итого (строка 17 + строка 18 + строка 19)	294086959.00	275036507.00	263118731.00	245657979.00	229152831.00	206200134.00
СУММАРНАЯ СКОРЕКТИРОВАННАЯ СТОИМОСТЬ							
21	ВНД, за вычетом корректировок, рассчитанных с учетом ограничений на максимальную величину ВНД-2в и ВНД-2	X	92446769.00	X	101284211.00	X	98590414.00
22	Чистый ожидаемый отток денежных средств	X	114227699.00	X	96816163.00	X	113104288.00
23	Норматив краткосрочной ликвидности банковской группы (Н26), кредитной организации (Н27), процены	X	80.93	X	104.61	X	87.17

Руководитель финансовой дирекции

Хебенштрайт Г.Ф.В.

Главный бухгалтер

Широкова Н.Ю.

Исполнитель
Телефон: (495) 721-99-0

И.В.Тренина

18.11.2016

Контрольная сумма:

Ф. 813 Подраздел 2.1 :49499
Ф. 813 Подраздел 2.2 :6154
Ф. 813 Раздел 3 :22184
:43105

Версия файла описателей (.РАК): 16.08.2016

