

Банковская отчетность

Код территории по ОКATO	Код кредитной организации (филиала) по ОКПО	Регистрационный номер (/порядковый номер)
145	142943661	3292

СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, ПОКАЗАТЕЛЕ ФИНАНСОВОГО РЫЧГА И НОРМАТИВЕ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ (публикуемая форма) на 01.10.2018 года

Кредитной организации  
Акционерное общество Райффайзенбанк  
/ АО Райффайзенбанк

Адрес (место нахождения) кредитной организации  
(головной кредитной организации банковской группы)  
129090, Москва, ул. Троицкая, д. 17/1

Код формы по ОКУД 0409813  
Каргальная (Головая)

Раздел 1. Сведения об обязательных нормативах

Номер строки	Наименование показателя	Номер пометки	Нормативное значение, процент	Фактическое значение, процент	
				на отчетную дату	на начало отчетного года
1	2	3	4	5	6
1	Норматив достаточности базового капитала (Н1.1), Банковской группы (Н20.1)		4.5	9.7	10.0
2	Норматив достаточности основного капитала Банка (Н1.2), Банковской группы (Н20.2)		6.0	10.4	10.7
3	Норматив достаточности собственных средств (капитала) банка (норматива Н1.0), Банковской группы (Н20.0)		8.0	12.9	13.6
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)		3.0	10.1	10.7
6	Норматив избыточной ликвидности банка (Н2)				
7	Норматив текучей ликвидности банка (Н3)				
8	Норматив долгосрочной ликвидности банка (Н4)				
9	Норматив максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н5)				
			максимальное значение	количество нарушений	длительность
			максимальное значение	количество нарушений	длительность

10	Норматива максимального размера крупных кредитных рисков (Н7), банковской группы (Н22)	800.01	138.5					135.5						
11	Норматива максимального размера кредитов, банковских гарантий и поручительства, предоставленных Банком своим участникам (акционерам) (Н9.1)													
12	Норматива совокупной величины риска по инсайдеру банка (Н10.1)													
13	Норматива использования собственных средств (капитала) банка для приобретения акций (долей) других юридических лиц (Н12), норматива использования собственных средств (капитала) банковской группы для приобретения головной кредитной организацией, банковской группы и участниками банковской группы акций (долей) других юридических лиц (Н23)													
14	Норматива соотношения суммы ликвидных активов сроком исполнения в ближайшие 30 календарных дней к сумме обязательств РНКО (Н19)													
15	Норматива 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	Норматива максимальной совокупной величины кредитов клиентам – участникам расчетов на завершение расчетов (Н16)													
17	Норматива предоставления РНКО от своего имени и за свой счет кредитов заемщикам, кроме клиентов – участников расчетов (Н16.1)													
18	Норматива минимального соотношения размера ипотечного покрытия и объема эмиссии облигаций с ипотечным покрытием (Н18)													
19	Норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков банковской группы (Н21)	25.01	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность
			17.61	01	01	15.41	01	01	01	01	01	01	01	
20	Норматива 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
			17.61	01	01	15.41	01	01	01	01	01	01	01	

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

Номер п/п	Наименование показателя	Номер пояснения	Сумма, тыс. руб.
1	2	3	4
1	Размер активов в соответствии с бухгалтерской балансом (публикуемая форма), всего		1008688311
2	Поправка в части вложений в капитал кредитных, финансовых, страховых или иных организаций, отчетные данные которых включаются в консолидированные финансовые отчетности, но не включаются в расчет величины собственных средств (капитала), обязательных нормативов и резервов (лимитов) открытых валютных позиций банковской группы		0
3	Поправка в части филиальных активов, отраженных в отчетности с правилами бухгалтерского учета, но не включаемых в расчет показателя финансового рычага		0
4	Поправка в части провозимых финансовых инструментов (ПФИ)		-48344151
5	Поправка в части операций кредитования ценными бумагами		0
6	Поправка в части приведения к кредитному эквиваленту условности обязательства кредитного характера		1789826501
7	Прочие поправки		176657371
8	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправок для расчета показателя финансового рычага, итого		11633513291

Раздел 2.2 Таблица расчета показателя финансового рычага

Номер п/п	Наименование показателя	Номер пояснения	Сумма, тыс. руб.
1	2	3	4
1	Величина балансовых активов, всего		905590429.001
2	Уменьшаемая поправка на сумму показателю, принимаемых в уменьшение величины источников основного капитала		1325343.001
Риск по балансовым активам			

3	Величина балансовых активов под риском с учетом поправок (разность строк 1 и 2), итого	0	904265086.001
Риск по операциям с ПФИ			
4	Текущий кредитный риск по операциям с ПФИ (за вычетом полученной вариационной маржи), всего	11	9089952.001
5	Потенциальный кредитный риск на контрагента по операциям с ПФИ, всего	11	5564692.001
6	Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПФИ, подлежащей списанию с баланса в соответствии с правилами бухгалтерского учета	0	в соответствии с российскими правилами бухгалтерского учета
7	Уменьшающая поправка на сумму перечисленной вариационной маржи в установленных случаях	0	напрямиком
8	Поправка в части требований банка - участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клиентов	0	0.001
9	Поправка для учета кредитного риска в отношении базисного актива по выданным кредитным ПФИ	0	0.001
10	Уменьшающая поправка в части выданных кредитных ПФИ	0	0.001
11	Величина риска по ПФИ с учетом поправок (сумма строк 4, 5, 9 за вычетом строк 7, 8, 10), итого	0	14654644.001
Риск по операциям кредитования ценными бумагами			
12	Требования по операциям кредитования ценными бумагами (без учета неликвидов), всего	11	68213783.001
13	Поправка на величину неликвидов денежной части (требований и обязательств) по операциям кредитования ценными бумагами	0	0.001
14	Величина кредитного риска на контрагента по операциям кредитования ценными бумагами	0	0.001
15	Величина риска по гарантийным операциям кредитования ценными бумагами	0	0.001
16	Требования по операциям кредитования ценными бумагами с учетом поправок (сумма строк 12, 14, 15 за вычетом строки 13), итого	0	68213783.001
Риск по условным обязательствам кредитного характера (КРВ)			
17	Номинальная величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ), всего	0	538366997.001
18	Поправка в части применения коэффициентов кредитного эквивалента	0	359384347.001

19 Величина риска по условиям обязательств  
кредитного характера (КРВ) с учетом поправок  
(разность строк 17 и 18), всего

Капитал риска

20 Основная капитал 11  
11760221.00

21 Величина балансовых активов и внебалансовых  
требований под риском для расчета показателя  
финансового рычага (сумма строк 3, 11, 16, 19),  
всего 11  
1166116163.00

Показатель финансового рычага

22 Показатель финансового рычага по "Базелю III"  
(строка 20/ строка 21), процент 11  
10.09

Раздел 3. Информация о расчете норматива краткосрочной ликвидности

Номер строки	Наименование показателя	Номер пометки	Данные на 01.04.2018		Данные на 01.07.2018		Данные на 01.10.2018		
			величина требований (обязательства) / тыс. руб.	взвешенная величина требований (обязательства) / тыс. руб.	величина требований (обязательства) / тыс. руб.	взвешенная величина требований (обязательства) / тыс. руб.	величина требований (обязательства) / тыс. руб.	взвешенная величина требований (обязательства) / тыс. руб.	
1	1	2	3	4	5	6	7	8	9

ВЫСОКОКАЧЕСТВЕННЫЕ ЛИКВИДНЫЕ АКТИВЫ

1 Высоколиквидные активы (ВЛА) с учетом доплат-  
рельных требований (активов), включенных в  
числитель Н26 (Н27) X  
163327923.00

ОЖИДАЕМЕ ОТЛОКИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ

2 Денежные средства физических лиц, всего,  
в том числе: 385370143.00 36248491.00 411137449.00 38618864.00 426186133.00 40111762.00

3 Стабильные средства 45770459.00 228853.00 49903622.00 2495181.00 50137029.00 2506851.00

4 Нестабильные средства 339599684.00 33959968.00 361233827.00 36123383.00 376049104.00 37604910.00

5 Денежные средства клиентов, привлеченные без  
обеспечения, всего, в том числе: 293538870.00 136820684.00 322505136.00 161104341.00 333072885.00 151364219.00

6 Операционные депозиты 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00 0.00

7 Депозиты, не относящиеся к операционным  
(прочие депозиты) 283679241.00 129960623.00 301414200.00 146330947.00 317551786.00 14186235.00

8 Необеспеченные долговые обязательства 0.00 0.00 2108108.00 2108108.00 7.00 7.00

9 Денежные средства клиентов, привлеченные под  
обеспечение X 34014.00 X 106290.00 X 199077.00

10 Дополнительно ожидаемые отлоки денежных средств,  
всего, в том числе: 136779102.00 19162337.00 141046155.00 17278425.00 13159830.00 14345145.00

11 по производным финансовым инструментам и в связи  
с потенциальной потребностью во внесении  
дополнительного обеспечения 4467813.00 4467813.00 3147240.00 3147240.00 1516239.00 1516239.00

12	связанные с потерей фондирования по обеспеченным долговым инструментам		0.001		0.001		0.001		0.001		0.001		0.001
13	по обязательствам Банка по неиспользованным безотзывным и условно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности		132311288.001	14694524.001	137898916.001	14131186.001	130079591.001	12828906.001					
14	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств по прочим договорным обязательствам		464715594.001	226340145.001	560112679.001	280161702.001	658042131.001	282691559.001					
15	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств по прочим условным обязательствам		0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001					
16	Суммарный отток денежных средств, итогов (строка 2 + строка 5 + строка 9 + строка 10 + строка 14 + строка 15)	X		418605671.001	X		497269322.001	X			488711762.001		
ОЖИДАЕМЫЕ ПРИТОКИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ													
17	По операциям предоставления денежных средств под обеспечение ценными бумагами, включая операции обратного РЕПО		78278572.001	42141130.001	64762808.001	29898871.001	55632356.001	24397008.001					
18	По договорам без нарушения контрактных сроков исполнения обязательств		43671842.001	32395142.001	44641628.001	30323840.001	53630387.001	35211654.001					
19	Прочие притоки		216733152.001	216733152.001	268807268.001	268807268.001	265363865.001	265363865.001					
20	Суммарный приток денежных средств, итогов (строка 17 + строка 18 + строка 19)		338683566.001	291269424.001	378211704.001	329029979.001	374626608.001	324972527.001					
СУММАРНАЯ СКОРЕКТИРОВАННАЯ СТОИМОСТЬ													
21	Вид - за вычетом корректировок, рассчитанных с учетом ограничений на максимальную величину Вид-2Б и Вид-2	X		163327923.001	X		200435890.001	X			231513470.001		
22	Итоговый ожидаемый отток денежных средств	X		128037808.001	X		168460672.001	X			164592819.001		
23	Норматив краткосрочной ликвидности банковской группы (Н26), кредитной организации (Н27), проценты	X		129.141	X		118.841	X			142.411		

Руководитель финансовой дирекции

Хобенилград Г.Ф.В.

Главный бухгалтер

Широкова Н.Ю.

