

Банковская отчетность		
Код территории 03	Код кредитной организации	
	по ОКПО 12815693	регистрационный номер 3173

**СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, НОРМАТИВЕ ФИНАНСОВОГО РЫЧАГА
И НОРМАТИВЕ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ
(публикуемая форма)
на 1 января 2020 года**

Полное или сокращенное фирменное наименование кредитной организации (головной кредитной организации банковской группы)

Общество с ограниченной ответственностью "Коммерческий банк внешнеторгового финансирования", ООО КБ "ВНЕСФИНБАНК"

Адрес (место нахождения) кредитной организации (головной кредитной организации)

350000, КРАСНОДАРСКИЙ КРАЙ, Г. КРАСНОДАР, УЛ.КОММУНАРОВ/УЛ. ГИМНАЗИЧЕСКАЯ, Д.61/42

Код формы по ОКД/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		534383	550501	449056	474396	631949	
1a	Базовый капитал при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков без учета влияния переходных мер		579346	562436	476990	503620		
2	Основной капитал		534383	550501	449056	474396	631949	
2a	Основной капитал при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		579346	562436	476990	503620		
3	Собственные средства (капитал)		946694	1010924	946413	1018993	1262409	
3a	Собственные средства (капитал) при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		991657	1022859	974347	1048217		
АКТИВЫ, ВЗВЕШЕННЫЕ ПО УРОВНЮ РИСКА, тыс.руб.								
4	Активы, взвешенные по уровню риска		6043399	5826268	5269014	3872264	7372079	
НОРМАТИВЫ ДОСТАТОЧНОСТИ КАПИТАЛА, процент								
5	Норматив достаточности базового капитала Н1.1 (Н20.1)	6.4	8.842	9.449	8.523	12.251	8.572	
5a	Норматив достаточности базового капитала при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		9.398	9.573	8.942	12.917		
6	Норматив достаточности основного капитала Н1.2 (Н20.2)	6.4	8.842	9.449	8.523	12.251	8.572	
6a	Норматив достаточности основного капитала при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		9.398	9.573	8.942	12.917		
7	Норматив достаточности собственных средств (капитала) Н1.0 (Н1ц, Н1.3, Н20.0)	6.4	15.665	17.351	17.962	26.315	17.124	
7a	Норматив достаточности собственных средств (капитала) при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		16.087	17.410	18.266	26.885		
НАДБАВКИ К БАЗОВОМУ КАПИТАЛУ (в процентах от суммы активов, взвешенных по уровню риска), процент								
8	Надбавка поддержания достаточности капитала/календарных дней к сумме обязательств РНКО (Н15)		2.250	2.125	2.000	1.875	1.875	
9	Антициклическая надбавка		0.036	0.065	0.000	0.005	0.000	
10	Надбавка за системную значимость							
11	Надбавки к нормативам достаточности собственных средств (капитала), всего (стр. 8 + стр. 9 + стр. 10)		2.286	2.190	2.000	1.880	1.875	
12	Базовый капитал, доступный для направления на поддержание надбавок к нормативам достаточности собственных средств (капитала)		7.665	9.351	9.962	18.315	9.124	
НОРМАТИВ ФИНАНСОВОГО РЫЧАГА								
13	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета норматива финансового рычага, тыс. руб.		6348704	5584845	5002973	4668049	7954963	
14	Норматив финансового рычага банка (Н1.4), банковской группы (Н20.4), процент		8.42	9.86	8.98	10.16	7.94	
14a	Норматив финансового рычага при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков, процент		8.96	9.98	9.41	10.82		
НОРМАТИВ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ								
15	Высоколиквидные активы, тыс.руб.							
16	Чистый ожидаемый отток денежных средств, тыс.руб.							
17	Норматив краткосрочной ликвидности Н26 (Н27), процент							
НОРМАТИВ СТРУКТУРНОЙ ЛИКВИДНОСТИ (НОРМАТИВ ЧИСТОГО СТАБИЛЬНОГО ФОНДИРОВАНИЯ)								
18	Норматив стабильного фондирования (НСФ), тыс.руб.							
19	Требуемое стабильное фондирование (ТСФ), тыс.руб.							
20	Норматив структурной ликвидности (норматив чистого стабильного фондирования) Н28 (Н29), процент							
НОРМАТИВЫ, ОГРАНИЧИВАЮЩИЕ ОТДЕЛЬНЫЕ ВИДЫ РИСКОВ, процент								
21	Норматив мгновенной ликвидности Н2		254.498	166.821	238.542	260.555	213.118	
22	Норматив текущей ликвидности Н3		194.190	131.450	160.831	238.532	178.533	
23	Норматив долгосрочной ликвидности Н4		0.639	0.677	1.161	0.719	0.666	
24	Норматив максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков Н6 (Н21)							
			максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность
			19.249	0	0	19.657	0	0
25	Норматив максимального размера крупных кредитных рисков Н7 (Н22)							
			170.289		155.298	140.687	65.320	138.649
26	Норматив совокупной величины риска по инакциям Н10.1							
			0.023		0.001	0.003	0.072	0.216
27	Норматив использования собственных средств (капитала) для приобретения акций (долей) других юридических лиц Н12 (Н23)							
			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
			0.139	0	0	0.001	0	0
						максимальное значение	количество нарушений	длительность
						0.003	0	0
						максимальное значение	количество нарушений	длительность
						0.072	0	0
						максимальное значение	количество нарушений	длительность
						0.216	0	0
29	Норматив достаточности совокупных ресурсов центрального контрагента Н2цк							
30	Норматив достаточности индивидуального клирингового обеспечения центрального контрагента Н3цк							

31	Норматив ликвидности центрального контрагента НЦК						
32	Норматив максимального размера риска концентрации НБК						
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 – участникам расчетов на завершение расчетов Н16						
35	Норматив предоставления РНКО от своего имени и за свой счет кредитов заемщикам, кроме клиентов – участников расчетов Н16.1						
36	Норматив максимального размера вексельных обязательств расчетных небанковских кредитных организаций Н16.2						
37	Норматив минимального соотношения размера ипотечного покрытия и объема эмиссии облигаций с ипотечным покрытием 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 пояснения	Сумма, тыс. руб.
1	2	3	4
1	Размер активов в соответствии с бухгалтерским балансом (публикуемая форма), всего:		2565228
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		не применимо 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 показателя финансового рычага		0
4	Поправка в части произвольных финансовых инструментов (ПФИ)		6282
5	Поправка в части операций кредитования ценными бумагами		0
6	Поправка в части приведения к кредитному эквиваленту условных обязательств кредитного характера		3806551
7	Прочие поправки		44480
8	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправок для расчета показателя финансового рычага, итого:		6333581

Подраздел 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:		2571872
2	Уменьшающая поправка на сумму показателей, принимаемых в уменьшение величины источников основного капитала		36001
3	Величина балансовых активов под риском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), всего		2535871
	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		0
5	Потенциальный кредитный риск на контрагента по операциям с ПФИ, всего		6282
6	Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПФИ, подлежащей списанию с баланса в соответствии с правилами бухгалтерского учета		неприменимо
7	Уменьшающая поправка на сумму перечисленной вариационной маржи в установленных случаях		0
8	Поправка в части требований банка - участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клиентов		0
9	Поправка для учета кредитного риска в отношении базисного актива по выпущенным кредитным ПФИ		0
10	Уменьшающая поправка в части выпущенных кредитных ПФИ		0
11	Величина риска по ПФИ с учетом поправок, итого (сумма строк 4, 5, 9 за вычетом строк 7, 8, 10),		6282
	Риск по операциям кредитования ценными бумагами		
12	Требования по операциям кредитования ценными бумагами (без учета неттинга), всего:		0
13	Поправка на величину неттинга денежной части (требований и обязательств) по операциям кредитования ценными бумагами		0
14	Величина кредитного риска на контрагента по операциям кредитования ценными бумагами		0
15	Величина риска по гарантийным операциям кредитования ценными бумагами		0
16	Требования по операциям кредитования ценными бумагами с учетом поправок		0
	Риск по условным обязательствам кредитного характера (КРВ)		
17	Номинальная величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ), всего:		3933115
18	Поправка в части применения коэффициентов кредитного эквивалента		126564
19	Величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ) с учетом поправок (разность строк 17 и 18)		3806551
20	Капитал и риски Основной капитал		534383

21	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета норматива финансового рычага, всего (сумма строк 3, 11, 16, 19)		6348704
Норматив финансового рычага			
22	Норматив финансового рычага банка (Н1.4), банковской группы (Н20.4), процент (строка 20 : строка 21)	8,2	8,42

Раздел 3. Информация о расчете норматива краткосрочной ликвидности

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения
1	2	3
ВЫСОКОКАЧЕСТВЕННЫЕ ЛИКВИДНЫЕ АКТИВЫ		
1	Высоколиквидные активы (ВЛА) с учетом дополнительных требований (активов), включенных в числитель Н26 (Н27)	
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	
10	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств, всего, в том числе:	
11	по производным финансовым инструментами 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 итогов: (строка 2 + строка 5 + строка 9 + строка 10 + строка 14 + строка 15)	
ОЖИДАЕМЫЕ ПРИТОКИ 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, итогов: (строка 17 + строка 18 + строка 19)	
СУММАРНАЯ СКОРРЕКТИРОВАННАЯ СТОИМОСТЬ		
21	ВЛА- за вычетом корректировок, рассчитанных с учетом ограничений на максимальную величину ВЛА-2Б и ВЛА-2	
22	Чистый ожидаемый отток денежных средств	
23	Норматив краткосрочной ликвидности банковской группы (Н26), кредитной организации (Н27), процент	

Председатель Правления

Главный бухгалтер

Начальник отдела отчетности

Телефон 8612195510



Чиков М.О.

Павлоградская Д.С.

Лутфулина К.Н.

31.03.2020