

| Банковская отчетность | | |
|-------------------------|---|------|
| Код территории по ОКATO | Код кредитной организации (филиала) по ОКПО | |
| | регистрационный номер (/порядковый номер) | |
| 45286596 | 59833333 | 3431 |

**СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, ПОКАЗАТЕЛЕ ФИНАНСОВОГО РЫЧАГА
И НОРМАТИВЕ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ
(публикуемая форма)
на 01.01.2017 года**

Кредитной организации Акционерное общество "ТРОЙКА-Д БАНК" / АО "ТРОЙКА-Д БАНК"

Почтовый адрес 119180, г.Москва, ул.Б.Полянка, д.19, стр.1

Код формы по
ОКУД 0409813
Квартальная (Годовая)

Раздел 1. Сведения об обязательных нормативах

| в процентах | | | | | |
|--------------|---|--------------------|-------------------------|---|---|
| Номер п/п | Наименование показателя | Номер пояснения | Нормативное значение | Фактическое значение | |
| | | | | на отчетную дату | на начало отчетного года |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| 1 | Норматив достаточности базового капитала (Н1.1), банковской группы (Н20.1) | 6, 7 | 4.5 | 17.9 | 10.5 |
| 2 | Норматив достаточности основного капитала банка (Н1.2), банковской группы (Н20.2) | 6, 7 | 6.0 | 17.9 | 10.5 |
| 3 | Норматив достаточности собственных средств (капитала) банка (норматив Н1.0), банковской группы (Н20.0) | 6, 7 | 8.0 | 21.5 | 10.5 |
| 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 мгновенной ликвидности банка (Н2) | 7, 9.5 | 15.0 | 136.5 | 67.2 |
| 6 | Норматив текущей ликвидности банка (Н3) | 7, 9.5 | 50.0 | 174.5 | 82.3 |
| 7 | Норматив долгосрочной ликвидности банка (Н4) | 7, 9.5 | 120.0 | 57.5 | 115.0 |
| 8 | Норматив максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) | 7, 9.1 | 25.0 | Максимальное 19.1 Минимальное 1.0 | Максимальное 33.4 Минимальное 0.1 |
| 9 | Норматив максимального размера крупных кредитных рисков (Н7), банковской группы (Н22) | 7, 9.1 | 800.0 | 197.2 | 469.2 |
| 10 | Норматив максимального размера кредитов, банковских гарантий и поручительств, предоставленных банком своим участникам (акционерам) (Н9.1) | | 50.0 | 0.0 | 0.0 |
| 11 | Норматив совокупной величины риска по инсайдерам банка (Н10.1) | 7, 9.1 | 3.0 | 0.8 | 0.2 |
| 12 | Норматив использования собственных средств (капитала) банка для приобретения акций (долей) других юридических лиц (Н12), норматив использо- вания собственных средств (капитала) банковской группы для приобретения головной кредитной организацией банковской группы и участниками банковской группы акций (долей) других юридических лиц (Н23) | | 25.0 | 0.0 | 0.0 |
| 13 | Норматив соотношения суммы ликвидных активов сроком исполнения в ближайшие 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 ипотечного покрытия и объема эмиссии облигаций с ипотечным покрытием (H18) | | | | |
| 18 | Норматив максимального соотношения размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков банковской группы (H21) | | | | |

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

| тыс.руб. | | | | |
|--------------|--|--------------------|---|--|
| Номер п/п | Наименование показателя | Номер пояснения | Сумма | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | |
| 1 | Размер активов в соответствии с бухгалтерским балансом (публикуемая форма), всего | 7 | 11885789 | |
| 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 производных финансовых инструментов (ПФИ) | | 0 | |
| 5 | Поправка в части операций кредитования ценными бумагами | | 0 | |
| 6 | Поправка в части приведения к кредитному эквиваленту условных обязательств кредитного характера | | 928253 | |
| 7 | Прочие поправки | | 90954 | |
| 8 | Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправок для расчета показателя финансового рычага, итого | | 12723088 | |

Раздел 2.2 Таблица расчета показателя финансового рычага

| тыс.руб. | | | | |
|----------------------------|---|--------------------|---|--|
| Номер п/п | Наименование показателя | Номер пояснения | Сумма | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | |
| Риск по балансовым активам | | | | |
| 1 | Величина балансовых активов, всего: | 7 | 11814533.0 | |
| 2 | Уменьшающая поправка на сумму показателей, принимаемых в уменьшение величин источников основного капитала | | 19698.0 | |
| 3 | Величина балансовых активов под риском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), итого: | | 11794835.0 | |
| Риск по операциям с ПФИ | | | | |
| 4 | Текущий кредитный риск по операциям с ПФИ (за вычетом полученной вариационной маржи), всего: | | 0.0 | |
| 5 | Потенциальный кредитный риск на контрагента по операциям с ПФИ, всего: | | 0.0 | |
| 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 неприменимо | |
| 7 | Уменьшающая поправка на сумму перечисленной вариационной маржи в установленных случаях | | 0.0 | |

| | | |
|--|---|------------|
| 8 | Поправка в части требований банка - участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клиентов | 0.0 |
| 9 | Поправка для учета кредитного риска в отношении базисного (базового) актива по выпущенным кредитным ПФИ | 0.0 |
| 10 | Уменьшающая поправка в части выпущенных кредитных ПФИ | 0.0 |
| 11 | Величина риска по ПФИ с учетом поправок (сумма строк 4, 5, 9 за вычетом строк 7, 8, 10), итого: | 0.0 |
| Риск по операциям кредитования ценными бумагами | | |
| 12 | Требования по операциям кредитования ценными бумагами (без учета неттинга), всего: | 0.0 |
| 13 | Поправка на величину неттинга денежной части (требований и обязательств) по операциям кредитования ценными бумагами | 0.0 |
| 14 | Величина кредитного риска на контрагента по операциям кредитования ценными бумагами | 0.0 |
| 15 | Величина риска по гарантийным операциям кредитования ценными бумагами | 0.0 |
| 16 | Требования по операциям кредитования ценными бумагами с учетом поправок (сумма строк 12, 14, 15 за вычетом строки 13), итого: | 0.0 |
| Риск по условным обязательствам кредитного характера (КРВ) | | |
| 17 | Номинальная величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ'), всего: | 1220547.0 |
| 18 | Поправка в части применения коэффициентов кредитного эквивалента | 292294.0 |
| 19 | Величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ') с учетом поправок (разность строк 17 и 18), итого: | 928253.0 |
| Капитал риска | | |
| 20 | Основной капитал | 1931938.0 |
| 21 | Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета показателя финансового рычага (сумма строк 3, 11, 16, 19), всего: | 12723088.0 |
| Показатель финансового рычага | | |
| 22 | Показатель финансового рычага по Базелю III (строка 20/ строка 21), процент | 15.2 |

Раздел 3. Информация о расчете норматива краткосрочной ликвидности

тыс. руб.

| Номер строки | Наименование показателя | Номер пояснения | Данные на 01.04.2016 | | Данные на 01.07.2016 | | Данные на 01.10.2016 | | Данные на 01.01.2017 | |
|-----------------------------------|--|-----------------|------------------------------------|---|------------------------------------|---|------------------------------------|---|------------------------------------|---|
| | | | величина требований (обязательств) | взвешенная величина требований (обязательств) | величина требований (обязательств) | взвешенная величина требований (обязательств) | величина требований (обязательств) | взвешенная величина требований (обязательств) | величина требований (обязательств) | взвешенная величина требований (обязательств) |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 |
| ИСПОЛНИТЕЛЬНЫЕ ЛИКВИДНЫЕ АКТИВЫ | | | | | | | | | | |
| 1 | Высоколиквидные активы (ВЛА) с учетом дополнительных требований (активов), включенных в числитель Н26 (Н27) | | X | | X | | 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 долговые обязательства | | | | | | | | | |
| 9 | Денежные средства клиентов, привлеченные под обеспечение | | X | | X | | X | | X | |
| 10 | Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств, всего, 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 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) | X | | X | | X | | X | |
| 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, итого (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 | X | | X | | X | | X | |
| 22 | Чистый ожидаемый отток денежных средств | X | | X | | X | | X | |
| 23 | Норматив краткосрочной ликвидности банковской группы (Н26), кредитной организации (Н27), процент | X | | X | | X | | X | |

И.о. Президента

Е.Г. Русанова

Е.Г. Русанова

Главный бухгалтер

О.П. Мироненко

О.П. Мироненко

27.04.2017

