

**Общество с ограниченной ответственностью
«Голдман Сакс Банк»**

**Годовая бухгалтерская (финансовая) отчетность и
Аудиторское заключение
независимого аудитора**

31 декабря 2016 г.

СОДЕРЖАНИЕ

АУДИТОРСКОЕ ЗАКЛЮЧЕНИЕ НЕЗАВИСИМОГО АУДИТОРА

БУХГАЛТЕРСКАЯ ОТЧЕТНОСТЬ

Бухгалтерский баланс	1
Отчет о финансовых результатах.....	3
Отчет об уровне достаточности капитала для покрытия рисков, величине резервов на возможные потери по ссудам и иным активам.....	5
Сведения об обязательных нормативах, показателе финансового рычага и нормативе краткосрочной ликвидности.....	13
Отчет о движении денежных средств	17
1. Существенная информация о Банке.....	19
2. Основные риски и неопределенности.....	21
3. Краткая характеристика деятельности Банка.....	26
4. Краткий обзор основ подготовки отчетности и основных положений учетной политики Банка.....	26
4.1 Информация об изменениях в учетной политике Банка на текущий отчетный год.....	32
4.2 Информация об изменениях в учетной политике Банка на следующий отчетный год.....	33
4.3 Характер допущений и основные источники неопределенности на конец периода.....	33
4.4 Применение правил бухгалтерского учета.....	34
4.5 События после отчетной даты	34
5. Сопроводительная информация к финансовой отчетности.....	35
5.1 Сопроводительная информация к бухгалтерскому балансу по форме отчетности 0409806.....	35
5.2 Сопроводительная информация к отчету о финансовых результатах по форме отчетности 0409807.....	42
5.3 Сопроводительная информация к отчету об уровне достаточности капитала для покрытия рисков, величине резервов на возможные потери по ссудам и иным активам по форме отчетности 0409808.....	46
5.4 Сопроводительная информация к статьям сведений об обязательных нормативах, о показателе финансового рычага по форме отчетности 0409813	49
5.5 Сопроводительная информация к отчету о движении денежных средств по форме отчетности 0409814.....	50
6. Информация о принимаемых рисках, процедурах их оценки, управления рисками и капиталом.	51
6.1 Обзор управления рисками.	51
6.2 Структура управления рисками.....	52
6.3 Краткий обзор рисков, характерных для Банка	52
6.4 Стратегия управления рисками и капиталом	53
6.5 Кредитный риск.....	54
6.6 Операционный риск.....	61
6.7 Рыночный риск.....	62
6.8 Риск ликвидности.....	68

6.9	Риск потери доходов от бизнеса	71
6.10	Риск концентрации.....	72
6.11	Риск моделирования	76
7.	Информация по сегментам деятельности Банка.	77
8.	Информация об операциях со связанными с Банком сторонами.....	77
9.	Сведения о системе оплаты труда, выплатах управленческому персоналу Банка и персоналу, принимающему риски.....	80

Аудиторское заключение независимого аудитора

Участнику общества с ограниченной ответственностью «Голдман Сакс Банк»:

Заключение по результатам аудита годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности

Мнение

По нашему мнению, прилагаемая годовая бухгалтерская (финансовая) отчетность отражает достоверно во всех существенных отношениях финансовое положение Общества с ограниченной ответственностью «Голдман Сакс Банк» (далее – «Банк») по состоянию на 1 января 2017 года, а также его финансовые результаты и движение денежных средств за 2016 год, в соответствии с правилами составления годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности для кредитных организаций, установленными в Российской Федерации.

Предмет аудита

Мы провели аудит годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности Банка, которая включает:

- бухгалтерский баланс (публикуемая форма) по состоянию на 1 января 2017 года;
- отчет о финансовых результатах (публикуемая форма) за 2016 год;
- приложения к бухгалтерскому балансу и отчету о финансовых результатах:
 - Отчет об уровне достаточности капитала для покрытия рисков, величине резервов на возможные потери по ссудам и иным активам (публикуемая форма) по состоянию на 1 января 2017 года;
 - Сведения об обязательных нормативах, показателе финансового рычага и нормативе краткосрочной ликвидности (публикуемая форма) по состоянию на 1 января 2017 года;
 - Отчет о движении денежных средств (публикуемая форма) по состоянию на 1 января 2017 года;
- пояснительную информацию.

Годовая бухгалтерская (финансовая) отчетность подготовлена в соответствии с Указанием Банка России от 4 сентября 2013 года №3054-У «О порядке составления кредитными организациями годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности». Годовая бухгалтерская (финансовая) отчетность подготовлена руководством Банка на основе бухгалтерской отчетности, составленной в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации и нормативными актами Банка России. Прилагаемая годовая бухгалтерская (финансовая) отчетность не имеет своей целью представление финансового положения и результатов деятельности в соответствии с принципами или методами бухгалтерского учета, общепринятыми в странах и иных административно-территориальных образованиях, помимо Российской Федерации. Соответственно, прилагаемая годовая бухгалтерская (финансовая) отчетность не предназначена для лиц, не знакомых с принципами, процедурами и методами бухгалтерского учета, принятыми в Российской Федерации.

Основание для выражения мнения

Мы провели аудит в соответствии с Международными стандартами аудита (МСА). Наша ответственность в соответствии с этими стандартами описана далее в разделе «Ответственность аудитора за аудит годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности» нашего заключения.

Мы полагаем, что полученные нами аудиторские доказательства являются достаточными и надлежащими, чтобы служить основанием для выражения нашего мнения.

Независимость

Мы независимы по отношению к Банку в соответствии с Кодексом этики профессиональных бухгалтеров Совета по международным стандартам этики для бухгалтеров (Кодекс СМСЭБ) и этическими требованиями Кодекса профессиональной этики аудиторов и Правил независимости аудиторов и аудиторских организаций, применимыми к нашему аудиту годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности в Российской Федерации, и нами выполнены прочие этические обязанности в соответствии с этими требованиями и Кодексом СМСЭБ.

Ответственность руководства и лиц, отвечающих за корпоративное управление, за годовую бухгалтерскую (финансовую) отчетность

Руководство несет ответственность за подготовку и достоверное представление данной годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности в соответствии с правилами составления годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности для кредитных организаций, установленными в Российской Федерации, и за систему внутреннего контроля, которую руководство считает необходимой для подготовки годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности, не содержащей существенных искажений вследствие недобросовестных действий или ошибок.

При подготовке годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности руководство несет ответственность за оценку способности Банка продолжать непрерывно свою деятельность, за раскрытие в соответствующих случаях сведений, относящихся к непрерывности деятельности, и за составление отчетности на основе допущения о непрерывности деятельности, за исключением случаев, когда руководство намеревается ликвидировать Банк, прекратить его деятельность или когда у него отсутствует какая-либо иная реальная альтернатива, кроме ликвидации или прекращения деятельности.

Лица, отвечающие за корпоративное управление, несут ответственность за надзор над процессом подготовки годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности Банка.

Ответственность аудитора за аудит годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности

Наша цель состоит в получении разумной уверенности в том, что годовая бухгалтерская (финансовая) отчетность не содержит существенных искажений вследствие недобросовестных действий или ошибок, и в выпуске аудиторского заключения, содержащего наше мнение. Разумная уверенность представляет собой высокую степень уверенности, но не является гарантией того, что аудит, проведенный в соответствии с МСА, всегда выявляет существенные искажения при их наличии. Искажения могут быть результатом недобросовестных действий или ошибок и считаются существенными, если можно обоснованно предположить, что в отдельности или в совокупности они могут повлиять на экономические решения пользователей, принимаемые на основе этой годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности.

В рамках аудита, проводимого в соответствии с МСА, мы применяем профессиональное суждение и сохраняем профессиональный скептицизм на протяжении всего аудита. Кроме того, мы выполняем следующее:

- выявляем и оцениваем риски существенного искажения годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности вследствие недобросовестных действий или ошибок; разрабатываем и проводим аудиторские процедуры в ответ на эти риски; получаем аудиторские доказательства, являющиеся достаточными и надлежащими, чтобы служить основанием для выражения нашего мнения. Риск необнаружения существенного искажения в результате недобросовестных действий выше, чем риск необнаружения существенного искажения в результате ошибки, так как недобросовестные действия могут включать сговор, подлог, умышленный пропуск, искаженное представление информации или действия в обход системы внутреннего контроля;
- получаем понимание системы внутреннего контроля, имеющей значение для аудита, с целью разработки аудиторских процедур, соответствующих обстоятельствам, но не с целью выражения мнения об эффективности системы внутреннего контроля Банка;
- оцениваем надлежащий характер применяемой учетной политики и обоснованность бухгалтерских оценок и соответствующего раскрытия информации, подготовленного руководством;
- делаем вывод о правомерности применения руководством допущения о непрерывности деятельности, а на основании полученных аудиторских доказательств – вывод о том, имеется ли существенная неопределенность в связи с событиями или условиями, в результате которых могут возникнуть значительные сомнения в способности Банка продолжать непрерывно свою деятельность. Если мы приходим к выводу о наличии существенной неопределенности, мы должны привлечь внимание в нашем аудиторском заключении к соответствующему раскрытию информации в годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности или, если такое раскрытие информации является ненадлежащим, модифицировать наше мнение. Наши выводы основаны на аудиторских доказательствах, полученных до даты нашего аудиторского заключения. Однако будущие события или условия могут привести к тому, что Банк утратит способность продолжать непрерывно свою деятельность;
- проводим оценку представления годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности в целом, ее структуры и содержания, включая раскрытие информации, а также того, представляет ли годовая бухгалтерская (финансовая) отчетность лежащие в ее основе операции и события так, чтобы было обеспечено их достоверное представление.

Мы осуществляем информационное взаимодействие с лицами, отвечающими за корпоративное управление, доводя до их сведения помимо прочего, информацию о запланированном объеме и сроках аудита, а также о существенных замечаниях по результатам аудита, в том числе о значительных недостатках системы внутреннего контроля, которые мы выявляем в процессе аудита.

Отчет в соответствии с другими законодательными и нормативными требованиями

Отчет о результатах проверки в соответствии с требованиями статьи 42 Федерального закона от 2 декабря 1990 года № 395-1 «О банках и банковской деятельности»

Руководство Банка несет ответственность за выполнение Банком обязательных нормативов, установленных Банком России, а также за соответствие внутреннего контроля и организации систем управления рисками Банка требованиям, предъявляемым Банком России к таким системам.

В соответствии со статьей 42 Федерального закона от 2 декабря 1990 года № 395-1 «О банках и банковской деятельности» в ходе аудита годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности Банка за 2016 год мы провели проверку:

- выполнения Банком по состоянию на 1 января 2017 года обязательных нормативов, установленных Банком России;
- соответствия внутреннего контроля и организации систем управления рисками Банка требованиям, предъявляемым Банком России к таким системам.

Указанная проверка ограничивалась такими выбранными на основе нашего суждения процедурами, как запросы, анализ, изучение документов, сравнение утвержденных Банком требований, порядка и методик с требованиями, предъявляемыми Банком России, а также пересчет, сравнение и сверку числовых значений и иной информации.

В результате проведенной нами проверки установлено следующее:

- 1) в части выполнения Банком обязательных нормативов, установленных Банком России:
значения установленных Банком России обязательных нормативов Банка по состоянию на 1 января 2017 года находились в пределах установленных Банком России предельных значений.
При этом обращаем внимание, что мы не проводили каких-либо процедур в отношении данных бухгалтерского учета Банка, кроме процедур, которые мы сочли необходимыми для целей выражения мнения о том, отражает ли годовая бухгалтерская (финансовая) отчетность Банка достоверно во всех существенных отношениях его финансовое положение по состоянию на 1 января 2017 года, а также его финансовые результаты и движение денежных средств за 2016 год в соответствии с правилами составления годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности для кредитных организаций, установленными в Российской Федерации.
- 2) в части соответствия внутреннего контроля и организации систем управления рисками Банка требованиям, предъявляемым Банком России к таким системам:
 - а) в соответствии с требованиями и рекомендациями Банка России по состоянию на 1 января 2017 года подразделения Банка по управлению значимыми для Банка рисками не были подчинены и не были подотчетны подразделениям, принимающим соответствующие риски;
 - б) действующие по состоянию на 1 января 2017 года внутренние документы Банка, устанавливающие методики выявления и управления значимыми для Банка кредитными, операционными, рыночными, процентными, правовыми рисками, рисками потери ликвидности и рисками потери деловой репутации, методики осуществления стресс-тестирования утверждены уполномоченными органами управления Банка в соответствии с требованиями и рекомендациями Банка России;
 - в) наличие в Банке по состоянию на 1 января 2017 года системы отчетности по значимым для Банка кредитным, операционным, рыночным, процентным, правовым рискам, рискам потери ликвидности и рискам потери деловой репутации, а также собственным средствам (капиталу) Банка;

- г) периодичность и последовательность отчетов, подготовленных подразделениями управления рисками Банка и службой внутреннего аудита Банка в течение 2016 года по вопросам управления кредитными, операционными, рыночными, процентными, правовыми рисками, рисками потери ликвидности и рисками потери деловой репутации Банка, соответствовали внутренним документам Банка; указанные отчеты включали результаты наблюдения подразделениями управления рисками Банка и службой внутреннего аудита Банка в отношении оценки эффективности соответствующих методик Банка, а также рекомендации по их совершенствованию;
- д) по состоянию на 1 января 2017 года к полномочиям Совета директоров Банка и исполнительных органов управления Банка относится контроль соблюдения Банком установленных внутренними документами Банка предельных значений рисков и достаточности собственных средств (капитала). С целью осуществления контроля эффективности применяемых в Банке процедур управления рисками и последовательности их применения в течение 2016 года Совет директоров Банка и исполнительные органы управления Банка на периодической основе обсуждали отчеты, подготовленные подразделениями управления рисками Банка и службой внутреннего аудита, рассматривали предлагаемые меры по устранению недостатков.

Данные процедуры в отношении внутреннего контроля и организации систем управления рисками Банка проведены нами исключительно для целей проверки соответствия внутреннего контроля и организации систем управления рисками Банка требованиям, предъявляемым Банком России к таким системам.

31 марта 2017 года
Москва, Российская Федерация



А. А. Ерюхина, руководитель задания (квалификационный аттестат №01-000387),
Акционерное общество «Прайсвотерхаус Куперс Аудит»

Аудируемое лицо: ООО «Голдман Сакс Банк»

Свидетельство о государственной регистрации № 3490
выдано Банком России от 15 января 2009 г.

Свидетельство о внесении записи в ЕГРЮЛ выдано 30.10.2008 г. за №
1087711000112

Место нахождения аудируемого лица: Российская Федерация, 125047,
Москва, улица Гашека, дом 6

Независимый аудитор:
Акционерное общество «Прайсвотерхаус Куперс Аудит».

Свидетельство о государственной регистрации № 008.890 выдано
Московской регистрационной палатой 28 февраля 1992 года.

Свидетельство о внесении записи в ЕГРЮЛ выдано 22 августа 2002
года за № 1027700148431.

Член саморегулируемой организации аудиторов «Российский Союз
аудиторов» (Ассоциация).

ОПНЗ в реестре аудиторов и аудиторских организаций, – 11603050547.

Банковская отчетность

Код территории по ОКATO	Код кредитной организации (филиала) по ОКПО		регистрационный номер (/порядковый номер)
45286575000	89484775		3490

БУХГАЛТЕРСКИЙ БАЛАНС
(публикуемая форма)
на 01.01.2017 года

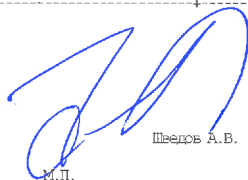
Кредитной организации
Общество с ограниченной ответственностью Голдман Сакс Банк / ООО Голдман Сакс Банк
Почтовый адрес: 125047 г.Москва, ул.Гашека, д.6

Код формы по ОКУД 0409806
Квартальная (Годовая)
тыс. руб.

Номер строки	Наименование статьи	Номер пояснений	Данные на отчетную дату	Данные на начало отчетного года
1	2	3	4	5
I. АКТИВЫ				
1	Денежные средства	5.1.	0	0
2	Средства кредитных организаций в Центральном банке Российской Федерации	5.1.	151894	116905
2.1	Обязательные резервы	5.1.	27116	17576
3	Средства в кредитных организациях	5.1.	284410	308897
4	Финансовые активы, оцениваемые по справедливой стоимости через прибыль или убыток	5.1.	1054206	2712687
5	Чистая осудная задолженность	5.1.	3838191	2747744
6	Чистые вложения в ценные бумаги и другие финансовые активы, имеющиеся в наличии для продажи	5.1.	0	0
6.1	Инвестиции в дочерние и зависимые организации	5.1.	0	0
7	Чистые вложения в ценные бумаги, удерживаемые до погашения	5.1.	0	0
8	Требования по текущему налогу на прибыль	5.1.	10005	41216
9	Отложенный налоговый актив	5.1.	60997	57975
10	Основные средства, нематериальные активы и материальные запасы	5.1.	134672	126151
11	Долгосрочные активы, предназначенные для продажи		0	0
12	Прочие активы	5.1.	2374838	2938226
13	Всего активов	5.1.	7909213	9049801
II. ПАССИВЫ				
14	Кредиты, депозиты и прочие средства Центрального банка Российской Федерации	5.1.	0	0
15	Средства кредитных организаций	5.1.	0	0
16	Средства клиентов, не являющихся кредитными организациями	5.1.	2712219	1894950
16.1	Вклады (средства) физических лиц в том числе индивидуальных предпринимателей		0	0
17	Финансовые обязательства, оцениваемые по справедливой стоимости через прибыль или убыток	5.1.	1078197	2712687
18	Выпущенные долговые обязательства		0	0
19	Обязательство по текущему налогу на прибыль		1	0
20	Отложенное налоговое обязательство		0	0
21	Прочие обязательства	5.1.	941185	1403045
22	Резервы на возможные потери по условным обязательствам		0	0

	кредитного характера, прочих возможным потерям и операциям с результатами операций зон			
23	Всего обязательств	5.1.	4731602	6010682
III. ИСТОЧНИКИ СОБСТВЕННЫХ СРЕДСТВ				
24	Средства акционеров (участников)	5.1.	1450000	1450000
25	Собственные акции (доли), выкупленные у акционеров (участников)		0	0
26	Эмиссионный доход	5.1.	250000	250000
27	Резервный фонд		0	0
28	Переоценка по справедливой стоимости ценных бумаг, имевшихся в наличии для продажи, уменьшенная на отложенное налоговое обязательство (увеличенная на отложенный налоговый актив)		0	0
29	Переоценка основных средств и нематериальных активов, уменьшенная на отложенное налоговое обязательство		0	0
30	Переоценка обязательств (требований) по выплате долгосрочных вознаграждений		0	0
31	Переоценка инструментов хеджирования		0	0
32	Денежные средства безвозмездного финансирования (вклады в имущество)		0	0
33	Нераспределенная прибыль (непокрытые убытки) прошлых лет	5.1.	1339118	737630
34	Неиспользованная прибыль (убыток) за отчетный период	5.1.	138493	601489
35	Всего источников собственных средств	5.1.	3177611	3039119
IV. ВНЕБАЛАНСОВЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА				
36	Возмездные обязательства кредитной организации	5.1.	55962380	45050097
37	Выданные кредитной организацией гарантии и поручительства		0	0
38	Условные обязательства некредитного характера		0	0

Председатель Правления


М.П.
Шведов А.В.

Главный бухгалтер



Адамия Е.К.

Исполнитель
Телефон: 645 40 00



Код территории по ОКATO	Код кредитной организации (филиала)	
	по ОКПО	регистрационный номер (/порядковый номер)
45286575000	89484775	3490

Отчет о финансовых результатах
(публикуемая форма)
за 2016 год

Кредитной организации
Общество с ограниченной ответственностью Голдман Сакс Банк / ООО Голдман Сакс Банк

Почтовый адрес: 125047 г.Москва, ул.Гашека, д.6

Код формы по ОКД 0409807
Квартальная (Годовая)

Раздел 1. О прибылях и убытках

тыс. руб.

Номер строки	Наименование статьи	Номер пояснений	Данные за отчетный период	Данные за соответствующий период прошлого года
1	2	3	4	5
1	Процентные доходы, всего, в том числе:	5.2.	212010	297848
1.1	от размещения средств в кредитных организациях	5.2.	44200	18876
1.2	от ссуд, предоставленных клиентам, не являющимся кредитными организациями	5.2.	167796	278591
1.3	от оказания услуг по финансовой аренде (лизингу)	5.2.	0	0
1.4	от вложений в ценные бумаги	5.2.	14	381
2	Процентные расходы, всего, в том числе:	5.2.	7987	5165
2.1	по привлеченным средствам кредитных организаций	5.2.	3	81
2.2	по привлеченным средствам клиентов, не являющимся кредитными организациями	5.2.	7984	5084
2.3	по выпущенным долговым обязательствам	5.2.	0	0
3	Чистые процентные доходы (отрицательная процентная маржа)	5.2.	204023	292683
4	Изменение резерва на возможные потери по ссудам, ссудной и приравненной к ней задолженности, средствам, размещенным на корреспондентских счетах, а также начисленным процентным доходам, всего, в том числе:	5.2.	2130	-2130
4.1	изменение резерва на возможные потери по начисленным процентным доходам	5.2.	0	0
5	Чистые процентные доходы (отрицательная процентная маржа) после создания резерва на возможные потери	5.2.	206153	290553
6	Чистые доходы от операций с финансовыми активами, оцениваемыми по справедливой стоимости через прибыль или убыток	5.2.	141886	1072903
7	Чистые доходы от операций с финансовыми обязательствами, оцениваемыми по справедливой стоимости через прибыль или убыток	5.2.	0	0
8	Чистые доходы от операций с ценными бумагами, имеющимися в наличии для продажи	5.2.	0	0
9	Чистые доходы от операций с ценными бумагами, удерживаемыми до погашения	5.2.	0	0
10	Чистые доходы от операций с иностранной валютой	5.2.	226317	-1256006
11	Чистые доходы от переоценки иностранной валюты	5.2.	-164976	395025
12	Чистые доходы от операций с драгоценными металлами	5.2.	0	0
13	Доходы от участия в капитале других юридических лиц	5.2.	0	0
14	Коммиссионные доходы	5.2.	0	1

15	Комиссионные расходы	5.2.	62543	31959
16	Изменение резерва на возможные потери по ценным бумагам, имеющимся в наличии для продажи	5.2.	0	0
17	Изменение резерва на возможные потери по ценным бумагам, удерживаемым до погашения	5.2.	0	0
18	Изменение резерва по прочим потерям	5.2.	-24196	20152
19	Прочие операционные доходы	5.2.	1914743	2345891
20	Чистые доходы (расходы)	5.2.	2237384	2836560
21	Операционные расходы	5.2.	1970334	1987552
22	Прибыль (убыток) до налогообложения	5.2.	267050	849008
23	Возмещение (расход) по налогам	5.2.	128557	247519
24	Прибыль (убыток) от продолжающейся деятельности	5.2.	138493	601489
25	Прибыль (убыток) от прекращенной деятельности	5.2.	0	0
26	Прибыль (убыток) за отчетный период	5.2.	138493	601489

Раздел 2. О прочем совокупном доходе

тыс. руб.

Номер строки	Наименование статьи	Номер пояснений	Данные за отчетный период	Данные за соответствующий период прошлого года
1	2	3	4	5
1	Прибыль (убыток) за отчетный период	5.2	138493	601489
2	Прочий совокупный доход (убыток)		X	X
3	Статьи, которые не переклассифицируются в прибыль или убыток, всего, в том числе:		0	0
3.1	изменение фонда переоценки основных средств		0	0
3.2	изменение фонда переоценки обязательств (требований) по пенсионному обеспечению работников по программам с установленными выплатами		0	0
4	Налог на прибыль, относящийся к статьям, которые не могут быть переклассифицированы в прибыль или убыток		0	0
5	Прочий совокупный доход (убыток), который не может быть переклассифицирован в прибыль или убыток, за вычетом налога на прибыль		0	0
6	Статьи, которые не могут быть переклассифицированы в прибыль или убыток, всего, в том числе:		0	0
6.1	изменение фонда переоценки финансовых активов, имеющихся в наличии для продажи		0	0
6.2	изменение фонда хеджирования денежных потоков		0	0
7	Налог на прибыль, относящийся к статьям, которые могут быть переклассифицированы в прибыль или убыток		0	0
8	Прочий совокупный доход (убыток), который может быть переклассифицирован в прибыль или убыток, за вычетом налога на прибыль		0	0
9	Прочий совокупный доход (убыток) за вычетом налога на прибыль		0	0
10	Финансовый результат за отчетный период	5.2	138493	601489

Председатель Правления

Цедков А.В.

Главный бухгалтер

Анапия Е.К.

Исполнитель

Колесникова С.А.

Телефон: 645 40 00

Банковская отчетность		
Код территории по ОКATO	Код кредитной организации (филиала)	
	по ОКТО	регистрационный номер (/порядковый номер)
45286575000	89484775	3490

ОТЧЕТ ОБ УРОВНЕ ДОСТАТОЧНОСТИ КАПИТАЛА ДЛЯ ПОКРЫТИЯ РИСКОВ,
ВЕЛИЧИНЕ РЕЗЕРВОВ НА ВОЗМОЖНЫЕ ПОТЕРИ ПО КРЕДИТНЫМ И ИНЫМ АКТИВАМ
(ПУБЛИКУЕМАЯ ФОРМА)

по состоянию на 01.01.2017 года

Кредитной организации
Общество с ограниченной ответственностью Голдман Сакс Банк / ООО Голдман Сакс Банк

Почтовый адрес: 125047 г.Москва, ул.Гашева, д.6

Код формы по ОКУД 0409808
Квартальная (Годовая)

Раздел 1. Информация об уровне достаточности капитала

тыс.руб.

Номер строки	Наименование инструмента (показателя)	Номер пояснения	Стоимость инструмента (величина показателя) на отчетную дату		Стоимость инструмента (величина показателя) на начало отчетного года	
			включаемая в расчет капитала	не включаемая в расчет капитала в период до	включаемая в расчет капитала	не включаемая в расчет капитала в период до
				1 января 2018 года		1 января 2018 года
1	2	3	4	5	6	7
Источники базового капитала						
1	Уставный капитал и эмиссионный доход, всего, в том числе сформированный:	5.3	1700000.0000	X	1700000.0000	X
1.1	обыкновенными акциями (долями)	5.3	1450000.0000	X	1450000.0000	X
1.2	привилегированными акциями			X		X
2	Нераспределенная прибыль (убыток):	5.3	1339118.0000	X	737630.0000	X
2.1	прошлых лет	5.3	1339118.0000	X	737630.0000	X
2.2	отчетного года			X		X
3	Резервный фонд			X		X
4	Доли уставного капитала, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала)		не применимо	X	не применимо	X
5	Инструменты базового капитала дочерних организаций, принадлежащие третьим сторонам		не применимо	не применимо	не применимо	не применимо
6	Источники базового капитала, итого (строка 1 +/- строка 2 + строка 3 - строка 4 + строка 5)	5.3	3039118.0000	X	2437630.0000	X
Показатели, уменьшающие источники базового капитала						
7	Корректировка торгового портфеля		не применимо	не применимо	не применимо	не применимо
8	Деловая репутация (Гудвилл) за вычетом отложенных налоговых обязательств					
9	Нематериальные активы (кроме деловой репутации и сумм прав по обслуживанию полученных кредитов) за вычетом отложенных налоговых обязательств					
10	Отложенные налоговые активы, зависящие от будущей прибыли					
11	Резервы хеджирования денежных потоков		не применимо	не применимо	не применимо	не применимо
12	Недооцененные резервы на возможные потери					
13	Доход от сделок свейквализации		не применимо	не применимо	не применимо	не применимо
14	Доходы и расходы, связанные с изменением кредитного риска по обязательствам, оцениваемым по справедливой стоимости		не применимо	не применимо	не применимо	не применимо
15	Активы пенсионного плана с установленными выплатами		не применимо	не применимо	не применимо	не применимо

16	Вложения в собственные акции (долями)					
17	Взаимное перекрестное владение акциями (долями)		не применимо	не применимо	не применимо	не применимо
18	Несущественные вложения в инструменты базового капитала финансовых организаций					
19	Существенные вложения в инструменты базового капитала финансовых организаций					
20	Права по обслуживанию ипотечных кредитов		не применимо	не применимо	не применимо	не применимо
21	Отложенные налоговые активы, не зависящие от будущей прибыли					
22	Совокупная сумма существенных вложений и отложенных налоговых активов в части, превышающей 15 процентов от величины базового капитала, всего, в том числе:					
23	Существенные вложения в инструменты базового капитала финансовых организаций					
24	Права по обслуживанию ипотечных кредитов		не применимо	не применимо	не применимо	не применимо
25	Отложенные налоговые активы, не зависящие от будущей прибыли					
26	Иные показатели, уменьшающие источники базового капитала, установленные Банком России, всего, в том числе:					
26.1	показатели, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала)			X		X
27	Отрицательная величина добавочного капитала			X		X
28	Показатели, уменьшающие источники базового капитала, итого (сумма строк с 7 по 22 и строка 26 и 27)			X		X
29	Базовый капитал, итого (строка 6- строка 28)	5.3	3039118.0000	X	2437630.0000	X
Источники добавочного капитала						
30	Инструменты добавочного капитала и эмиссионный доход, всего, в том числе:			X		X
31	классифицируемые как капитал			X		X
32	классифицируемые как обязательства			X		X
33	Инструменты добавочного капитала, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала)			X		X
34	Инструменты добавочного капитала дочерних организаций, принадлежащие третьим сторонам, всего, в том числе:		не применимо	X	не применимо	X
35	Инструменты добавочного капитала дочерних организаций, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала)			X		X
36	Источники добавочного капитала, итого (строка 30 + строка 33 + строка 34)			X		X
Показатели, уменьшающие источники добавочного капитала						
37	Вложения в собственные инструменты добавочного капитала					
38	Взаимное перекрестное владение инструментами добавочного капитала		не применимо	не применимо	не применимо	не применимо
39	Несущественные вложения в инструменты добавочного капитала финансовых организаций					
40	Существенные вложения в инструменты добавочного капитала финансовых организаций					
41	Иные показатели, уменьшающие источники добавочного капитала, установленные Банком России, всего, в том числе:			X		X
41.1	показатели, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала), всего, из них:			X		X
41.1.1	нематериальные активы			X		X
41.1.2	собственные акции (доли), приобретенные (выкупленные) у акционеров (участников)			X		X
41.1.3	акции (доли) дочерних и зависимых финансовых организаций и кредитных организаций – резидентов			X		X
41.1.4	источники собственных средств, для формирования которых использованы ненадлежащие активы			X		X
41.1.5	отрицательная величина дополнительного капитала, сложившаяся в связи с корректировкой величины собственных средств (капитала) на сумму источников дополнительного капитала, сформированных с использованием инвесторами			X		X

	ненадежных активов					
42	Отрицательная величина дополнительного капитала			X		X
43	Показатели, уменьшающие источники добавочного капитала, (сумма строк с 37 по 42)			X		X
44	Добавочный капитал, итого (строка 36 – строка 43)			X		X
45	Основной капитал, итого (строка 29 + строка 44)	5.3	3039118.0000	X	2437630.0000	X
Источники дополнительного капитала						
46	Инструменты дополнительного капитала и эмиссионный доход	5.3	97451.0000	X	553224.0000	X
47	Инструменты дополнительного капитала, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала)			X		X
48	Инструменты дополнительного капитала дочерних организаций, принадлежащие третьим сторонам, всего, в том числе:		не применимо	X	не применимо	X
49	Инструменты дополнительного капитала дочерних организаций, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала)			X		X
50	Резервы на возможные потери		не применимо	X	не применимо	X
51	Источники дополнительного капитала, итого (строка 46 + строка 47 + строка 48 + строка 50)	5.3	97451.0000	X	553224.0000	X
Показатели, уменьшающие источники дополнительного капитала						
52	Вложения в собственные инструменты дополнительного капитала					
53	Взаимное перекрестное владение инструментами дополнительного капитала		не применимо	не применимо	не применимо	не применимо
54	Неущественные вложения в инструменты дополнительного капитала финансовых организаций					
55	Существенные вложения в инструменты дополнительного капитала финансовых организаций					
56	Иные показатели, уменьшающие источники дополнительного капитала, установленные Банком России, всего, в том числе:			X		X
56.1	показатели, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала), всего, из них:			X		X
56.1.1	источники капитала, для формирования которых инвесторами использованы ненадежные активы			X		X
56.1.2	пропорциональная дебиторская задолженность длительностью свыше 30 календарных дней			X		X
56.1.3	субординированные кредиты, предоставленные кредитным организациям – резидентам			X		X
56.1.4	превышение совокупной суммы кредитов, банковских гарантий и оприутельств, предоставленных своим акционерам (участникам) и инсайдерам, над ее максимальным размером			X		X
56.1.5	вложения в сооружение и приобретение основных средств и материальных запасов			X		X
56.1.6	разница между действительной стоимостью доли, принадлежащей вышедшим из общества участникам, и стоимостью, по которой доля была реализована другому участнику			X		X
57	Показатели, уменьшающие источники дополнительного капитала, итого (сумма строк с 52 по 56)			X		X
58	Дополнительный капитал, итого (строка 51 – строка 57)	5.3	97451.0000	X	553224.0000	X
59	Собственные средства (капитал), итого (строка 45 + строка 58)	5.3	3136569.0000	X	2990854.0000	X
60	Активы, взвешенные по уровню риска:		X	X	X	X
60.1	подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала)			X		X
60.2	необходимые для определения достаточности базового капитала	6	7473986.0000	X	9715861.0000	X
60.3	необходимые для определения достаточности основного капитала	6	7473986.0000	X	9715861.0000	X
60.4	необходимые для определения достаточности собственных средств (капитала)	6	7473986.0000	X	9715861.0000	X
Показатели достаточности собственных средств (капитала) и надбавки к нормативам достаточности собственных средств (капитала), процент						
61	Достаточность базового капитала (строка 29 / строка 60.2)	6	40.6626	X	25.0892	X

62	Достаточность основного капитала (строка 45 / строка 60.3)	6	40.6626	X	25.0892	X
63	Достаточность собственных средств (капитала) (строка 59 / строка 60.4)	6	41.9665	X	30.7832	X
64	Набавки к нормативам достаточности собственных средств (капитала), всего, в том числе:	5.3, 6	46712.4100	X	не применимо	X
65	набавка поддержания достаточности капитала	5.3, 6	46712.4100	X	не применимо	X
66	антициклическая набавка		0.0000	X	не применимо	X
67	набавка за системную значимость банков		не применимо	X	не применимо	X
68	Базовый капитал, доступный для направления на поддержание набавок к нормативам достаточности собственных средств (капитала)	5.3	33.9664	X	не применимо	X
Нормативы достаточности собственных средств (капитала), процент						
69	Норматив достаточности базового капитала	6	4.5000	X	5.0000	X
70	Норматив достаточности основного капитала	6	6.0000	X	6.0000	X
71	Норматив достаточности собственных средств (капитала)	6	8.0000	X	10.0000	X
Показатели, принимаемые в уменьшение источников капитала, не превышающие установленные пороги существенности						
72	Несущественные вложения в инструменты капитала финансовых организаций			X		X
73	Существенные вложения в инструменты капитала внутренних моделей			X		X
74	Права по обслуживанию ипотечных кредитов		не применимо	X	не применимо	X
75	Отложенные налоговые активы, не зависящие от будущей прибыли		60997.0000	X	57975.0000	X
Ограничения на включение в расчет дополнительного капитала резервов на возможные потери						
76	Резервы на возможные потери, включаемые в расчет дополни- тельного капитала, в отношении позиций, для расчета кредитного риска по которым применяется стандартизирован- ный подход		не применимо	X	не применимо	X
77	Ограничения на включение в расчет дополнительного капи- тала сумм резервов на возможные потери при использовании стандартизированного подхода		не применимо	X	не применимо	X
78	Резервы на возможные потери, включаемые в расчет дополни- тельного капитала, в отношении позиций, для расчета кредитного риска по которым применяется подход на основе внутренних моделей		не применимо	X	не применимо	X
79	Ограничения на включение в расчет дополнительного капи- тала сумм резервов на возможные потери при использовании подхода на основе внутренних моделей		не применимо	X	не применимо	X
Инструменты, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) (применяется с 1 января 2018 года по 1 января 2022 года)						
80	Текущее ограничение на включение в состав источников базового капитала инструментов, подлежащих поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала)			X		X
81	Часть инструментов, не включенная в состав источников базового капитала вследствие ограничения			X		X
82	Текущее ограничение на включение в состав источников дбавочного капитала инструментов, подлежащих поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала)			X		X
83	Часть инструментов, не включенная в состав источников дбавочного капитала вследствие ограничения			X		X
84	Текущее ограничение на включение в состав источников дополнительного капитала инструментов, подлежащих поэтап- ному исключению из расчета собственных средств (капитала)			X		X
85	Часть инструментов, не включенная в состав источников дополнительного капитала вследствие ограничения			X		X

Примечание.

Сведения о данных бухгалтерского баланса, являющихся источниками для составления раздела 1 Отчета, приведены в пояснениях к сопроводительной информации к форме 0409808.

Подраздел 2.1. Кредитный риск при применении стандартизированного подхода

тыс.руб.

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Данные на отчетную дату			Данные на начало отчетного года		
			Стоимость активов (инструментов), оцениваемых по стандартизированному подходу	Активы (инструменты) за вычетом сформированных резервов на возможные потери	Стоимость активов (инструментов), взвешенных по уровню риска	Стоимость активов (инструментов), оцениваемых по стандартизированному подходу	Активы (инструменты) за вычетом сформированных резервов на возможные потери	Стоимость активов (инструментов), взвешенных по уровню риска
1	2	3	4	5	6	7	8	9
1	Кредитный риск по активам, отраженным на балансовых счетах	6	3547360	3528684	627033	3595043	3591170	3124909
1.1	Активы с коэффициентом риска <1> 0 процентов, всего, из них:	6	1572243	1572243	0	116905	116905	0
1.1.1	денежные средства и обязательные резервы, депонированные в Банке России	6	1572243	1572243	0	116905	116905	0
1.1.2	кредитные требования и другие требования, обеспеченные гарантиями Российской Федерации, Минфина России и Банка России и залогом государственных долговых ценных бумаг Российской Федерации, Минфина России и Банка России	6	0	0	0	0	0	0
1.1.3	кредитные требования и другие требования к центральным банкам или правительствам стран, имеющих страновую оценку "0", "1" <2>, в том числе обеспеченные гарантиями этих стран и так далее	6	0	0	0	0	0	0
1.2	Активы с коэффициентом риска 20 процентов, всего, из них:	6	1661760	1661760	332352	436695	436695	87339
1.2.1	кредитные требования и другие требования к субъектам Российской Федерации, муниципальным образованиям, к иным организациям, обеспеченные гарантиями и залогом ценных бумаг субъектов Российской Федерации и муниципальных образований	6	0	0	0	0	0	0
1.2.2	кредитные требования и другие требования к центральным банкам или правительствам стран, имеющих страновую оценку "2", в том числе обеспеченные их гарантиями (залогом ценных бумаг)	6	0	0	0	0	0	0
1.2.3	кредитные требования и другие требования к кредитным организациям – резидентам стран со страновой оценкой "0", "1", имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности <3>, в том числе обеспеченные их гарантиями	6	1338800	1338800	267760	149332	149332	29866
1.3	Активы с коэффициентом риска 50 процентов, всего, из них:	6	0	0	0	0	0	0
1.3.1	кредитные требования и другие требования в иностранной валюте, обеспеченные гарантиями Российской Федерации, Минфина России и Банка России и залогом государственных долговых ценных бумаг Российской Федерации, Минфина России и Банка России, номинированных в иностранной валюте	6	0	0	0	0	0	0
1.3.2	кредитные требования и другие требования к центральным банкам или правительствам стран, имеющих страновую оценку "3", в том числе обеспеченные их гарантиями (залогом ценных бумаг)	6	0	0	0	0	0	0
1.3.3	кредитные требования и другие требования к кредитным организациям – резидентам стран со страновой оценкой "0", "1", не имеющих рейтингов долгосрочной кредитоспособности, и к кредитным организациям – резидентам стран со страновой оценкой "2", в том числе обеспеченные их гарантиями	6	0	0	0	0	0	0
1.4	Активы с коэффициентом риска 100%, всего, из них:	6	313357	294681	294681	3041443	3037570	3037570
1.4.1	Размещение средств в финансовых организациях стран СЭСР (включая проценты)	6	2301	2301	2301	2602969	2602969	2602969
1.4.2	Чистая задолженность контрагентов по неисковленным договорам	6	106124	99874	99871	142014	142014	142014
1.4.3	Основные средства	6	134413	134413	134413	125549	125549	125549
1.4.4	Требование по отложенному налогу на прибыль	6	24399	24399	24399	34785	34785	34785
1.4.5	Средства в кредитных организациях РФ (включая проценты)	6	12	12	12	35531	35531	35531
1.4.6	Хозяйственные операции	6	25204	12781	12781	53450	51707	51707
1.5	Активы с коэффициентом риска 150 процентов – кредитные требования и другие требования к центральным банкам или правительствам стран, имеющих страновую оценку "7"		0	0	0	0	0	0
2	Активы с иными коэффициентами риска:	X	X	X	X	X	X	X
2.1	с пониженными коэффициентами риска, всего, в том числе:	6	2160779	2160779	153350	2613647	2613647	174193

2.1.1	Ипотечные суды с коэффициентом риска 50 процентов		0	0	0	0	0	0
2.1.2	Ипотечные суды с коэффициентом риска 70 процентов		0	0	0	0	0	0
2.1.3	Требования участников клиринга	6	2160779	2160779	153350	2613647	2613647	174193
2.2	с повышенными коэффициентами риска, всего, в том числе:	6	1131765	1124502	1297867	84032	84032	137070
2.2.1	с коэффициентом риска 110 процентов	6	1039515	1039515	1143466	0	0	0
2.2.2	с коэффициентом риска 130 процентов	6	55652	48389	62905	60842	60842	79095
2.2.3	с коэффициентом риска 150 процентов		0	0	0	0	0	0
2.2.4	с коэффициентом риска 250 процентов	6	36598	36598	91496	23190	23190	57975
2.2.5	с коэффициентом риска 1250 процентов		0	0	0	0	0	0
2.2.5.1	по сделкам по услуге ипотечным агентам или специализированным организациям денежным требованиям, в том числе удостоверенным закладными		0	0	0	0	0	0
3	Кредиты на потребительские цели всего, в том числе:		0	0	0	0	0	0
3.1	с коэффициентом риска 140 процентов		0	0	0	0	0	0
3.2	с коэффициентом риска 170 процентов		0	0	0	0	0	0
3.3	с коэффициентом риска 200 процентов		0	0	0	0	0	0
3.4	с коэффициентом риска 300 процентов		0	0	0	0	0	0
3.5	с коэффициентом риска 600 процентов		0	0	0	0	0	0
4	Кредитный риск по условным обязательствам кредитного характера, всего, в том числе:		0	0	0	0	0	0
4.1	по финансовым инструментам с высоким риском		0	0	0	0	0	0
4.2	по финансовым инструментам со средним риском		0	0	0	0	0	0
4.3	по финансовым инструментам с низким риском		0	0	0	0	0	0
4.4	по финансовым инструментам без риска		0	0	0	0	0	0
5	Кредитный риск по производным финансовым инструментам	6	218530		218530	1504281		1504281

<> Классификация активов по группам риска произведена в соответствии с пунктом 2.3 Инструкции Банка России № 139-И.

<> Отраслевые оценки указаны в соответствии с классификацией экспортных кредитных агентств, участвующих в Соглашении стран - членов Организации экономического сотрудничества и развития (ОЭСР) "Об основных принципах предоставления и использования экспортных кредитов, имеющих официальную поддержку" (информация о отраслевых оценках публикуется на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет" в разделе "Банковский надзор").

<> Рейтинги долгосрочной кредитоспособности кредитной организации определяются на основе присвоенных международными рейтинговыми агентствами рейтингов: Standard & Poor's или Fitch Rating's либо Moody's Investors Service.

Подраздел 2.1.1. Кредитный риск при применении подхода на основе внутренних рейтингов

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	тыс.руб.					
			Данные на отчетную дату			Данные на начало отчетного года		
			Стоимость активов (инструментов), оцениваемых по подходу на основе внутренних рейтингов	Активы (инструменты) за вычетом сформированных резервов на возможные потери	Совокупная величина кредитного риска	Стоимость активов (инструментов), оцениваемых по подходу на основе внутренних рейтингов	Активы (инструменты) за вычетом сформированных резервов на возможные потери	Совокупная величина кредитного риска
1	2	3	4	5	6	7	8	9
1	Кредитный риск, рассчитанный с использованием базового подхода на основе внутренних рейтингов		0	0	0	0	0	0
2	Кредитный риск, рассчитанный с использованием продвинутого подхода на основе внутренних рейтингов		0	0	0	0	0	0

Подраздел 2.2 Операционный риск

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	тыс. руб. (кол-во)	
			Данные на отчетную дату	Данные на начало отчетного года
			4	5
6	Операционный риск, всего, в том числе:	6	410120.0	315149.0
6.1	Доходы для целей расчета капитала на покрытие операционного риска, всего, в том числе:	6	2734130.0	2100995.0
6.1.1	Чистые процентные доходы	6	230069.0	202614.0
6.1.2	Чистые непроцентные доходы	6	2504061.0	1898381.0
6.2	Количество лет, предшествующих дате расчета величины операционного риска	6	3.0	3.0

Подраздел 2.3 Рыночный риск

тыс. руб.

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Данные на отчетную дату	Данные на начало отчетного года
1	2	3	4	5
7	Обовязательный рыночный риск, всего, в том числе:	6	0.0	95243.9
7.1	процентный риск, всего, в том числе:		0.0	0.0
7.1.1	общий		0.0	0.0
7.1.2	специальный		0.0	0.0
7.1.3	гамма-риск и вега-риск по опционам, включаемым в расчет процентного риска		0.0	0.0
7.2	фондовый риск, всего, в том числе:		0.0	0.0
7.2.1	общий		0.0	0.0
7.2.2	специальный		0.0	0.0
7.2.3	гамма-риск и вега-риск по опционам, включаемым в расчет фондового риска		0.0	0.0
7.3	валютный риск, всего, в том числе:	6	0.0	7619.5
7.3.1	гамма-риск и вега-риск по опционам, включаемым в расчет валютного риска		0.0	0.0
7.4	товарный риск, всего, в том числе:		0.0	0.0
7.4.1	основной товарный риск		0.0	0.0
7.4.2	дополнительный товарный риск		0.0	0.0
7.4.3	гамма-риск и вега-риск по опционам, включаемым в расчет товарного риска		0.0	0.0

Раздел 3. Информация о величине резервов на возможные потери по ссудам и иным активам

тыс. руб.

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Данные на отчетную дату	Прирост (+)/ снижение (-) за отчетный период	Данные на начало отчетного года
1	2	3	4	5	6
1	Фактически сформированные резервы на возможные потери, всего, в том числе:	5.3.	25939	22066	3873
1.1	по ссудам, ссудной и приравненной к ней задолженности	5.3.	0	-2130	2130
1.2	по иным балансовым активам, по которым существует риск понесения потерь, и прочим потерям	5.3.	25939	24196	1743
1.3	по условным обязательствам кредитного характера и ценным бумагам, права на которые удостоверяются депозитариями, не удовлетворяющими критериям Банка России, отраженным на внебалансовых счетах	5.3.	0	0	0
1.4	под операции с резидентами офшорных зон		0	0	0

Раздел 4. Информация о показателе финансового рынка

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Значение на отчетную дату	Значение на дату, отстоящую на один квартал от отчетной	Значение на дату, отстоящую на два квартала от отчетной	Значение на дату, отстоящую на три квартала от отчетной
1	2	3	4	5	6	7
1	Основной капитал, тыс.руб.	5.4	3039118.0	3039118.0	3035735.0	3039118.0
2	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета показателя финансового рынка, тыс.руб.	5.4	8321920.0	7818787.0	8051477.0	9693049.0
3	Показатель финансового рынка по "Базелю III", процент	5.4	36.5	38.9	37.7	31.4

Раздел 5. Основные характеристики инструментов капитала

№ п.п. / Наименование характеристики инструмента	Сокращенное фирменное наименование займца инструмента капитала	Идентификационный номер инструмента	Принимает право	Реализуемые условия					
				Может ли капитал, в который инструмент включается в состав предыдущего периода "Вексель III"	Условно капитал, в который инструмент включается после осуществления предыдущего периода "Вексель III"	Условно капитал, в который инструмент включается в капитал	Тип инструмента	Способность инструмента, входящего в расчет капитала	Наименование статуса инструмента
	1	2	3	4	5	6	7	8	9
1	ООО "Солнечный Сити Банк"	1	ОБ (ООО) не применимо (не применимо)	не применимо	не применимо	не применимо	длин в уставном капитале	1450000	1450000

Раздел 5. Продолжение

№ п.п. / Наименование характеристики инструмента	Реализуемые условия							Прочие/дополнительные условия				
	Классификация инструмента для целей бухгалтерского учета	Дата выпуска (привнесения, реализации) инструмента	Наличие срока по инструменту	Дата погашения инструмента	Наличие права дополнительного выпуска (включая) инструменты, составляющие составляющие с Вексель III	Первоначальная дата (даты) выпуска (включая) инструменты, составляющие составляющие с Вексель III	Последняя дата (даты) выпуска (включая) инструменты, составляющие составляющие с Вексель III	Тип сделки по инструменту	Смешан	Наличие условий инструмента, предусматривающих выпуск дополнительных инструментов по определенным анализам	Способность выпуск дополнительных инструментов	Наличие условий, предусматривающих уменьшение пла- новой по инстру- менту или иных ссылки к дополнительно выпуску (дополнению) инструмента
	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21
1	акционерный капитал	30.10.2008	безсрочный	не применимо	нет	не применимо	не применимо	не применимо	не применимо	не применимо	полностью по ус- тавному голу- данию по и. ф.о.а.) учредителя ба- лансовой груп- пы	не применимо

Раздел 5. Продолжение

№ п.п. / Наименование характеристики инструмента	Прочие/дополнительные условия											
Характер выпуска	Назначение инструмента	Условия, при на- ступлении которых осуществляется конвертация инструмента	Плановый или частичный конвертация	Смешанная конвертация	Смешанная конвертация	Уровень капитала, в который включается инструмент	Сокращенное фирменное наименование инструмента, в который конвертируется инструмент	Способность инструмента, входящего в расчет капитала	Условия, при на- ступлении которых осуществляется отзыв инструмента	Плановый или частичный отзыв	Плановый или частичный отзыв	
22	23	24	25	26	27	28	29	30	31	32	33	
1 не применимо	не применимо	не применимо	не применимо	не применимо	не применимо	не применимо	не применимо	не применимо	не применимо	не применимо	не применимо	

Раздел 5. Продолжение

№ п.п. / Наименование характеристики инструмента	Механизм восстановления	Субординированность инструмента	Соответствие требованиям Положения Банка России N 395-П и Положения Банка России N 509-П	Описание несоответствий
	34	35	36	37
1	не применимо	не применимо	да	

Раздел "Отражено". Информация о движении резерва на возможные потери по ссудам, ссудной и приравненной к ней задолженности.

1. Формирование (доначисление) резерва в отчетном периоде (тыс. руб.),
всего 0 (номер пояснений: 5), в том числе взыскание:

1.1. взыскание ссуд 0;

1.2. изменения качества ссуд 0;

1.3. изменения официального курса иностранной валюты по отношению к рублю,
установленного Банком России 0;

1.4. иных причин 0.

2. Восстановление (уменьшение) резерва в отчетном периоде (тыс. руб.),
всего 2130, в том числе взыскание:

2.1. списания безнадежных ссуд 0;

2.2. погашения ссуд 2130;

2.3. изменения качества ссуд 0;

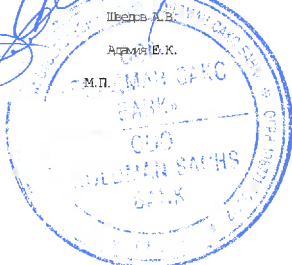
2.4. изменения официального курса иностранной валюты по отношению к
рублю, установленного Банком России 0;

2.5. иных причин 0.

Председатель Правления

Главный бухгалтер

Исполнитель: Колосникова С.А.
Телефон: 645 40 00



Код территории по ОКATO	Код кредитной организации (филиала) по ОКПО		регистрационный номер (/порядковый номер)
45286575000	89484775	3490	

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

Кредитной организации

Общество с ограниченной ответственностью Голдман Сакс Банк / ООО Голдман Сакс Банк

Почтовый адрес: 125047 г.Москва, ул.Гашека, д.6

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	4.5	40.7	25.1
2	Норматив достаточности основного капитала банка (Н1.2), банковской группы (Н20.2)	6	6.0	40.7	25.1
3	Норматив достаточности собственных средств (капитала) банка (норматив Н1.0), банковской группы (Н20.0)	6	8.0	42.0	30.8
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)	6	15.0	99999.9	99999.9
6	Норматив текущей ликвидности банка (Н3)	6	50.0	1015.3	34069.8
7	Норматив долгосрочной ликвидности банка (Н4)	6	120.0	0.0	0.0
8	Норматив максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6)	6	25.0	Максимальное 3.5 Минимальное 0.0	Максимальное 4.5 Минимальное 0.0
9	Норматив максимального размера крупных кредитных рисков (Н7), банковской группы (Н22)	6	800.0	5.4	6.1
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)		2.0	0.0	0.0
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 (Н18)				
18	Норматив максимального соотношения размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков банковской группы (Н21)				

Раздел 2. Информация о расчете показателя финансового рынка

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

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	6	7909213
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 рынка		0
4	Поправка в части производных финансовых инструментов (ПФИ)	6	480865
5	Поправка в части операций кредитования ценными бумагами		0
6	Поправка в части приведения к кредитному эквиваленту условных обязательств кредитного характера		0
7	Прочие поправки	6	68158
8	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправок для расчета показателя финансового рынка, итого	6	8321920

Раздел 2.2 Таблица расчета показателя финансового рынка

тыс.руб.			
Номер п/п	Наименование показателя	Номер пояснения	Сумма
1	2	3	4
	Риск по балансовым активам		
1	Величина балансовых активов, всего:	5.4	6786849.0
2	Уменьшающая поправка на сумму показателей,		0.0

	принимаясь в уменьшение величины источников основного капитала		
3	Величина балансовых активов под риском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), итого:	5.4	6786849.0
Риск по операциям с ПФИ			
4	Текущий кредитный риск по операциям с ПФИ (за вычетом полученной вариационной маржи), всего:	5.4	1054206.0
5	Потенциальный кредитный риск на контрагента по операциям с ПФИ, всего:	5.4	480865.0
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:	5.4	1535071.0
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:		0.0
18	Поправка в части применения коэффициентов кредитного эквивалента		0.0
19	Величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ') с учетом поправок (разность строк 17 и 18), итого:		0.0
Капитал риска			
20	Основной капитал	5.4	3039118.0
21	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета показателя финансового рычага (сумма строк 3, 11, 16, 19), всего:	5.4	8321920.0

Показатель финансового рынка			
22	Показатель финансового рынка по Базелю III (строка 20/ строка 21) , процент	5.4	36.5

Раздел 3. Информация о расчете норматива краткосрочной ликвидности:

тыс. руб.

№ строки	Наименование показателя	№ строки	Данные на 01.04.2016		Данные на 01.07.2016		Данные на 01.10.2016		Данные на 01.01.2017	
			высшая потребность (обязательств)	высшая потребность (обязательств)	высшая потребность (обязательств)	высшая потребность (обязательств)	высшая потребность (обязательств)	высшая потребность (обязательств)	высшая потребность (обязательств)	высшая потребность (обязательств)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
ВЫСШЕЕ ПОТРЕБНОСТЬ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ										
1	Высшие денежные средства (ВН) с учетом долгосрочных обязательств (активов), включенных в категорию ВБ (47)		X		X		X		X	
ОБЯЗАТЕЛЬСТВА ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ										
2	Денежные средства физических лиц, всего, в том числе:									
3	сберегательные средства									
4	несберегательные средства									
5	Денежные средства клиентов, привлеченные без обеспечения, всего, в том числе:									
6	операционные депозиты									
7	депозиты, не относящиеся к операционным (прочие депозиты)									
8	несберегательные депозиты обеспечения									
9	Денежные средства клиентов, привлеченные под обеспечение		X		X		X		X	
10	Долгосрочные обязательства отклики денежных средств, всего, в том числе:									
11	по предоставленным финансовым инструментам и в связи с потенциальной потребностью во внесении долгосрочного обеспечения									
12	заемные с целью финансирования по обеспеченным долговым инструментам									
13	по обязательствам базиса по неисполненным безотзывным и условно отзывным кредитным линиям и линиям ликвидности									
14	Долгосрочные обязательства отклики денежных средств по прочим долгосрочным обязательствам									
15	Долгосрочные обязательства отклики денежных средств по прочим условным обязательствам									
16	Суммарный отклик денежных средств, всего (строка 2 + строка 5 + строка 9 + строка 10 + строка 14 + строка 15)		X		X		X		X	
ОБЪЕМЫ ПЕЧАТИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ										
17	По сформированным денежным средствам по обязательствам ценным бумагам, включая операции с ценными бумагами									
18	По документам без нарушения изъятия сроков исполнения обязательств									
19	Прочие операции									
20	Суммарный отклик денежных средств, всего (строка 17 + строка 18 + строка 19)									
ОБЪЕМЫ ОБЕСПЕЧЕНИЯ СРЕДСТВ										
21	ВН, за вычетом корректировок, рассчитанных с учетом ограничений на максимальную величину ВБ-2B и ВБ-2		X		X		X		X	
22	Чистый отклик отклики денежных средств		X		X		X		X	
23	Норматив краткосрочной ликвидности (высшая потребность (48) / чистый отклик (22) , краткосрочной ликвидности (48) , процент									

Председатель Правления

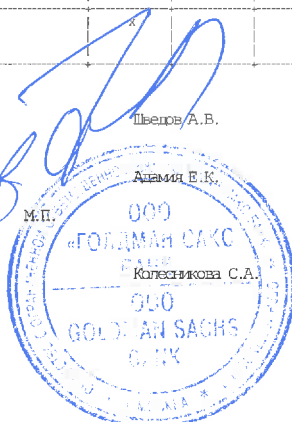
Тыщев А.В.

Главный бухгалтер

Адамян Е.К.

Исполнитель

Телефон: 645 40 00



Код территории по ОКATO	Код кредитной организации (филиала)	
	по ОКПО	регистрационный номер (/порядковый номер)
45286575000	89484775	3490

ОТЧЕТ О ДВИЖЕНИИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ
(публикуемая форма)
на 01.01.2017 года

Кредитной организации
Общество с ограниченной ответственностью Голдман Сакс Банк / ООО Голдман Сакс Банк

Почтовый адрес: 125047 г.Москва, ул.Гашека, д.6

Код формы по ОКД 0409814
Квартальная/Годовая
тыс.руб.

Номер п/п	Наименование статей	Номер пояснения	Денежные потоки за отчетный период	Денежные потоки за соответствующий период прошлого года
1	2	3	4	5
1	Чистые денежные средства, полученные от (использованные в) операционной деятельности			
1.1	Денежные средства, полученные от (использованные в) операционной деятельности до изменений в операционных активах и обязательствах, всего, в том числе:	5.5.	-5940	646903
1.1.1	проценты полученные	5.5.	228834	302917
1.1.2	проценты уплаченные	5.5.	-7679	-5067
1.1.3	комиссии полученные	5.5.	0	1
1.1.4	комиссии уплаченные	5.5.	-63099	-31664
1.1.5	доходы за вычетом расходов по операциям с финансовыми активами, оцениваемыми по справедливой стоимости через прибыль или убыток, имеющимися в наличии для продажи	5.5.	165877	970968
1.1.6	доходы за вычетом расходов по операциям с ценными бумагами, удерживаемыми до погашения	5.5.	0	0
1.1.7	доходы за вычетом расходов по операциям с иностранной валютой	5.5.	226317	-1256006
1.1.8	прочие операционные доходы	5.5.	1546640	2892975
1.1.9	операционные расходы	5.5.	-2002290	-1937535
1.1.10	расход (возмещение) по налогам	5.5.	-100540	-289686
1.2	Прирост (снижение) чистых денежных средств от операционных активов и обязательств, всего, в том числе:	5.5.	65263	-619212
1.2.1	чистый прирост (снижение) по обязательным резервам на счетах в Банке России	5.5.	-9540	4111
1.2.2	чистый прирост (снижение) по вложениям в ценные бумаги, оцениваемым по справедливой стоимости через прибыль или убыток	5.5.	0	0
1.2.3	чистый прирост (снижение) по осудной задолженности	5.5.	-1515887	1459177
1.2.4	чистый прирост (снижение) по прочим активам	5.5.	489089	-563719
1.2.5	чистый прирост (снижение) по кредитам, депозитам и прочим средствам Банка России	5.5.	0	0
1.2.6	чистый прирост (снижение) по средствам других кредитных организаций	5.5.	561	0
1.2.7	чистый прирост (снижение) по средствам клиентов, не являющихся кредитными организациями	5.5.	1098930	-1130154
1.2.8	чистый прирост (снижение) по финансовым обязательствам, оцениваемым по справедливой стоимости через прибыль или убыток	5.5.	0	0

1.2.9	Чистый прирост (снижение) по выпущенным долговым обязательствам	5.5.	0	0
1.2.10	Чистый прирост (снижение) по прочим обязательствам	5.5.	2110	-388627
1.3	Итого по разделу 1 (стр. 1.1 + стр. 1.2)	5.5.	59323	27691
2	Чистые денежные средства, полученные от (использованные в) инвестиционной деятельности			
2.1	Приобретение ценных бумаг и других финансовых активов, относящихся к категории "имеющиеся в наличии для продажи"	5.5.	0	0
2.2	Выручка от реализации и погашения ценных бумаг и других финансовых активов, относящихся к категории "имеющиеся в наличии для продажи"	5.5.	0	0
2.3	Приобретение ценных бумаг, относящихся к категории "удерживаемые до погашения"	5.5.	0	0
2.4	Выручка от погашения ценных бумаг, относящихся к категории "удерживаемые до погашения"	5.5.	0	0
2.5	Приобретение основных средств, нематериальных активов и материальных запасов	5.5.	-28940	-25439
2.6	Выручка от реализации основных средств, нематериальных активов и материальных запасов	5.5.	0	0
2.7	Дивиденды полученные	5.5.	0	0
2.8	Итого по разделу 2 (сумма строк с 2.1 по 2.7)	5.5.	-28940	-25439
3	Чистые денежные средства, полученные от (использованные в) финансовой деятельности			
3.1	Взносы акционеров (участников) в уставный капитал	5.5.	0	0
3.2	Приобретение собственных акций (долей), выкупленных у акционеров (участников)	5.5.	0	0
3.3	Продажа собственных акций (долей), выкупленных у акционеров (участников)	5.5.	0	0
3.4	Выплаченные дивиденды	5.5.	0	0
3.5	Итого по разделу 3 (сумма строк с 3.1 по 3.4)	5.5.	0	0
4	Влияние изменений официальных курсов иностранных валют по отношению к рублю, установленным Банком России, на денежные средства и их эквиваленты	5.5.	-28687	45538
5	Прирост (использование) денежных средств и их эквивалентов	5.5.	1696	47790
5.1	Денежные средства и их эквиваленты на начало отчетного года	5.5.	403853	356063
5.2	Денежные средства и их эквиваленты на конец отчетного периода	5.5.	405549	403853

Председатель Правления

Шведов А.В.

Главный бухгалтер

Адамия Е.К.

Исполнитель
Телефон: 645 40 00

М.П. Колесникова С.А.

