

Код территории	Бюджетная отчетность	
	код бюджетной организации	регистрационный номер
60	0914700	481

СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, НОРМАТИВЕ ФИНАНСОВОГО РЫСКА И НОРМАТИВЕ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ
(публикуемая форма)
на 1 июля 2020 года

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

Общество с ограниченной ответственностью «Коммерческий Банк "Трастабанк"»

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

344017, г. Ростов-на-Дону, ул. Чернышова, 6

Код формы по ОКУД 0409813
Кредитный (Госкомстат)

Раздел 1. Сведения об основных показателях деятельности кредитной организации (банковской группы)

Номер строки	Наименование показателя	Номер показателя	Балансовое 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	Капитал		1129415	1141279	1159274	1201161	1261203
1а	Капитал при условии применения модели ожидаемых кредитных убытков без учета влияния периодов месс		1262533	1294204	1396259	1460779	1504244
2	Обязательный капитал		1129415	1141279	1159274	1201161	1261203
2а	Обязательный капитал при условии применения модели ожидаемых кредитных убытков		1262533	1294204	1396259	1460779	1504244
3	Собственный капитал (капитал)		1022286	1031920	1052150	1072100	1097959
3а	Собственный капитал (капитал) при условии применения модели ожидаемых кредитных убытков		143378	166292	167943	174738	182563
АКТИВЫ, ВНЕБАЛАНСОВЫЕ ПО УРОВню РИСКА, тыс. руб.							
4	Активы, взвешенные по уровню риска		236158	811824	790584	852924	1079289
НОРМАТИВЫ ДОСТАТОЧНОСТИ КАПИТАЛА, процент							
5	Норматив достаточности капитала (критерий Н1, Н10.1)		15,69	14,20	15,17	15,19	9,81
5а	Норматив достаточности базового капитала при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		13,63	16,66	17,19	18,34	9,72
6	Норматив достаточности капитала (критерий Н2, Н10.2)		13,69	14,20	15,17	15,69	9,81
6а	Норматив достаточности капитала при условии применения модели ожидаемых кредитных убытков		13,09	16,96	17,19	18,34	9,72
7	Норматив достаточности собственных средств (капитала) Н1.0 (критерий Н10.3)		12,89	15,12	16,13	16,45	10,56
7а	Норматив достаточности собственных средств (капитала) при условии применения модели ожидаемых кредитных убытков		13,79	16,98	18,11	17,72	9,87
НАДБАВКИ К БАЛАНСУ КАПИТАЛА (в процентах от суммы активов, взвешенных по уровню риска), процент							
8	Надбавка к базовому капиталу за обеспечение вытекающая		2,100	2,500	2,250	2,120	2,200
9	Аддитивная надбавка						
10	Надбавка к нормативу достаточности						
11	Надбавка к нормативу достаточности собственных средств (капитала), всего (стр. 8 + стр. 9 + стр. 10)		2,100	2,500	2,250	2,120	2,200
12	Баланс капитала, доступный для выплаты на покрытие выборок к нормативу достаточности собственных средств (капитала)						
НОРМАТИВ ФИНАНСОВОГО РЫСКА							
13	Величина базисных активов в англоамериканской системе под раском для расчета норматива финансового риска, тыс. руб.		10639120	764397	768300	756458	1087393
14	Норматив финансового риска (критерий Н14.1, банковской группы (Н20.4), процент		10,56	15,86	15,86	15,21	9,79
14а	Норматив финансового риска при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков, процент		11,60	16,86	16,50	17,67	9,81
НОРМАТИВ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ							
15	Величина ликвидных активов, тыс. руб.						
16	Величина кредитных активов, тыс. руб.						
17	Норматив ликвидности (критерий Н15.1)						
НОРМАТИВЫ СТРУКТУРЫ ЛИКВИДНОСТИ (НОРМАТИВ ЧИСТОСТ/СТАБИЛЬНОСТИ ФИНАНСИРОВАНИЯ)							
18	Норматив краткосрочного финансирования (критерий Н18), процент						
19	Норматив долгосрочного финансирования (критерий Н19), процент						
20	Норматив долгосрочного финансирования (критерий Н20), процент						
НОРМАТИВ ОТРАЖЕНИЯ В ОТЧЕТАХ ОБЪЕМА РИСКОВ, процент							
21	Норматив включения ликвидности		36,34	43,24	23,20	80,81	246,43
22	Норматив включения ликвидности		9,40	10,98	19,44	103,49	16,03
23	Норматив включения ликвидности		91,60	46,67	50,76	50,76	56,06
24	Норматив включения ликвидности (Н1)						
25	Норматив включения ликвидности (Н2)						
26	Норматив включения ликвидности (Н3)						
27	Норматив включения ликвидности (Н4)						
28	Норматив включения ликвидности (Н5)						
29	Норматив включения ликвидности (Н6)						
30	Норматив включения ликвидности (Н7)						
31	Норматив включения ликвидности (Н8)						
32	Норматив включения ликвидности (Н9)						
33	Норматив включения ликвидности (Н10)						
34	Норматив включения ликвидности (Н11)						
35	Норматив включения ликвидности (Н12)						
36	Норматив включения ликвидности (Н13)						
37	Норматив включения ликвидности (Н14)						
Раздел 2. Информационное обеспечение расчета норматива финансового риска (Н14)							
Подраздел 2.1. Расчет риска базисных активов в англоамериканской системе под раском для расчета норматива финансового риска (Н14.1)							
1	Риск базисных активов, всего		10639120				
2	Уменьшающая поправка на смену ликвидности, ликвидности и ликвидности, всего		266247				
3	Величина базисных активов под раском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), всего		10372873				
4	Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПФМ, подпадающим сведения о балансе						
5	Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПФМ, подпадающим сведения о балансе						
6	Уменьшающая поправка на сумму перенесенной вариационной маржи в установленных случаях						
7	Поправка на часть требований банка - участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клиринга						
8	Поправка для учета кредитного риска в отношении базисного актива по выданным кредитным ПФМ						
9	Уменьшающая поправка в части выданных кредитных ПФМ						
10	Величина риска по ПФМ с учетом поправки, итого (сумма строк 4, 5, 6, 7, 8, 9)						
Подраздел 2.2. Расчет норматива финансового риска (Н14.2)							
1	Норматив финансового риска, всего		10639120				
2	Уменьшающая поправка на смену ликвидности, ликвидности и ликвидности, всего		266247				
3	Величина базисных активов под раском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), всего		10372873				
4	Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПФМ, подпадающим сведения о балансе						
5	Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПФМ, подпадающим сведения о балансе						
6	Уменьшающая поправка на сумму перенесенной вариационной маржи в установленных случаях						
7	Поправка на часть требований банка - участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клиринга						
8	Поправка для учета кредитного риска в отношении базисного актива по выданным кредитным ПФМ						
9	Уменьшающая поправка в части выданных кредитных ПФМ						
10	Величина риска по ПФМ с учетом поправки, итого (сумма строк 4, 5, 6, 7, 8, 9)						
Риск по операциям с ПФМ							
11	Теневой кредитный риск по операциям с ПФМ (за вычетом полученной вариационной маржи и (или) с учетом нетто-поправки, всего (применяется, всего)						
12	Потенциальный кредитный риск на пороченность по операциям с ПФМ, всего						
13	Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПФМ, подпадающим сведения о балансе						
14	Уменьшающая поправка на сумму перенесенной вариационной маржи в установленных случаях						
15	Поправка на часть требований банка - участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клиринга						
16	Поправка для учета кредитного риска в отношении базисного актива по выданным кредитным ПФМ						
17	Уменьшающая поправка в части выданных кредитных ПФМ						
18	Величина риска по ПФМ с учетом поправки, итого (сумма строк 11, 12, 13, 14, 15, 16, 17)						
Риск по операциям с кредитными инструментами							
19	Теневая поправка на смену ликвидности, ликвидности и ликвидности, всего						
20	Поправка на часть требований банка - участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клиринга						
21	Поправка для учета кредитного риска в отношении базисного актива по выданным кредитным ПФМ						
22	Уменьшающая поправка в части выданных кредитных ПФМ						
23	Величина риска по ПФМ с учетом поправки, итого (сумма строк 19, 20, 21, 22)						
Капитал и риск							
24	Обязательный капитал		1129415				
25	Величина базисных активов в англоамериканской системе под раском для расчета норматива финансового риска, всего (сумма строк 3, 11, 16, 19)		10639120				
26	Норматив финансового риска						
27	Норматив финансового риска (критерий Н14.1, банковской группы (Н20.4), процент (строк 25 / строка 24) x 100)						10,56

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	
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 УФО

(863)287-00-58(3047)

07.08.2020



Handwritten signature in blue ink

Прохватиллов А.Б.

Зинченко Е.А.

Кустова Т.В.