

| Банковская отчетность | | |
|-------------------------|---|--|
| Код территории по ОКATO | Код кредитной организации (филиала) по ОКПО | регистрационный номер (порядковый номер) |
| 445902000 | 466957372 | 3500 |

СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, ПОКАЗАТЕЛЕ ФИНАНСОВОГО РИСКА И НОРМАТИВЕ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ (публикуемая форма) на 01.07.2018 года

Кредитной организации
Общество с ограниченной ответственностью "Фольксваген Банк РУС"
/ ООО "Фольксваген Банк РУС"

Адрес (место нахождения) кредитной организации
(головной кредитной организации банковской группы)
Российская Федерация, 117485, г.Москва, ул. Обручева 30/1, строение 1

Код формы по ОКОД 0409813
Квартальная (Годовая)

Раздел 1. Сведения об обязательных нормативах

| № п/п | Наименование показателя | № п/п пояснения | Нормативное значение, процент | Фактическое значение, процент | | |
|-------|--|-----------------|-------------------------------|-------------------------------|--------------------------|--------------|
| | | | | на отчетную дату | на начало отчетного года | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | |
| 1 | Норматив достаточности базового капитала (Н1.1), (банковской группы) (Н20.1) | | 4.5 | 42.0 | 42.6 | |
| 2 | Норматив достаточности основного капитала (банка (Н1.2), банковской группы) (Н20.2) | | 6.0 | 42.0 | 42.6 | |
| 3 | Норматив достаточности собственных средств (капитала) банка (норматив Н1.0), (банковской группы) (Н20.3) | | 8.0 | 42.0 | 42.6 | |
| 4 | Норматив достаточности собственных средств (капитала) небанковской кредитной организации, имеющей право на осуществление переводов денежных средств без открытия банковских счетов и связанных с ними иных банковских операций (Н1.3) | | | | | |
| 5 | Норматив финансового рычага банка (Н1.4), (банковской группы) (Н20.4) | | 3.0 | 39.3 | 39.2 | |
| 6 | Норматив мгновенной ликвидности банка (Н2) | 6.3 | 15.0 | 108.9 | 108.9 | |
| 7 | Норматив текущей ликвидности банка (Н3) | 6.3 | 50.0 | 148.5 | 182.8 | |
| 8 | Норматив долгосрочной ликвидности банка (Н4) | 6.3 | 120.0 | 100.0 | 71.0 | |
| 9 | Норматив максимального размера кредита (на одного заемщика или группу связанных заемщиков) (Н5) | | 25.0 | максимальное значение | количество нарушений | длительность |
| | | | | 5.0 | | 6.5 |
| 10 | Норматив максимального размера крупных кредитных рисков (Н7), (банковской группы) (Н22) | | 800.0 | 13.0 | 15.2 | |
| 11 | Норматив максимального размера кредитов, (банковских гарантий и поручительства, предоставленных банком своим участникам (акционерам) (Н9.1) | | 50.0 | 0.0 | 0.0 | |
| 12 | Норматив совокупной величины риска (по инсайдерам банка (Н10.1) | | 3.0 | 0.0 | 0.0 | |
| 13 | Норматив использования собственных средств (капитала) банка для приобретения акций (долей) (других юридических лиц (Н12), норматив использования 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 | |
| 14 | Норматив соотношения суммы ликвидных активов (сроком исполнения в ближайшем 30 календарных дней к сумме обязательств ЕНКО (Н15) | | | | | |
| 15 | Норматив ликвидности небанковской кредитной организации, имеющей право на осуществление переводов денежных средств без открытия (банковских счетов и связанных с ними иных банковских операций) (Н16.1) | | | | | |
| 16 | Норматив максимальной совокупной величины кредитов клиентам - участникам расчетов на заведение расчетов (Н16) | | | | | |
| 17 | Норматив предоставления ЕНКО от своего имени (и за свой счет) кредитов заемщикам, кроме клиентов - участников расчетов (Н16.1) | | | | | |
| 18 | Норматив минимального соотношения размера выданных поручений и объема эмиссии облигаций с ипотечным покрытием (Н18) | | | | | |
| 19 | Норматив максимального размера риска (на одного заемщика или группу связанных заемщиков банковской группы) (Н21) | | | максимальное значение | количество нарушений | длительность |
| | | | | | | |
| 20 | Норматив максимального размера риска (на связанные с банком лица (группу связанных с банком лиц) (Н25) | | 20.0 | максимальное значение | количество нарушений | длительность |
| | | | | 5.0 | | 6.5 |

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

| № п/п | Наименование показателя | № п/п пояснения | Сумма, тыс. руб. |
|-------|--|-----------------|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| 1 | Размер активов в соответствии с бухгалтерским балансом (публикуемая форма), всего | | 34032902 |
| 2 | Поправка в части включенной 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 |
| 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/ожидаемому условным обязательствам кредитного характера | | 429266 |

| | | |
|---|--|----------|
| 7 | Прочие поправки | 1067256 |
| 8 | Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправок для расчета показателя финансового рычага, итого | 33454912 |

Раздел 2.2 Таблица расчета показателя финансового рычага

| Номер п/п | Наименование показателя | Номер пояснения | Сумма, тыс. руб. |
|---|---|-----------------|--|
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| Риск по балансовым активам | | | |
| 1 | Величина балансовых активов, всего: | | 33795796,00 |
| 2 | Уменьшающая поправка на сумму показателей, принимаемых в уменьшение величины источников основного капитала | | 770150,00 |
| 3 | Величина балансовых активов под риском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), итого: | | 33025646,00 |
| Риск по операциям с ПИИ | | | |
| 4 | Текущий кредитный риск по операциям с ПИИ (за вычетом полученной вариационной маржи), всего: | | 0,00 |
| 5 | Потенциальный кредитный риск на контрагента по операциям с ПИИ, всего: | | 0,00 |
| 6 | Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПИИ, подлежащей списанию с баланса в соответствии с правилами бухгалтерского учета | | в соответствии с российскими правилами бухгалтерского учета (неприменяемо) |
| 7 | Уменьшающая поправка на сумму перечисленной вариационной маржи в установленных случаях | | 0,00 |
| 8 | Поправка в части требований банка - участника (клирринга и центральному контрагенту по исполнению сделок клиентов) | | 0,00 |
| 9 | Поправка для учета кредитного риска в отношении балансового актива по выпущенным кредитным ПИИ | | 0,00 |
| 10 | Уменьшающая поправка в части выпущенных кредитных ПИИ | | 0,00 |
| 11 | Величина риска по ПИИ с учетом поправок (сумма строк 4, 5, 9 за вычетом строк 7, 8, 10), итого: | | 0,00 |
| Риск по операциям кредитования ценных бумаг | | | |
| 12 | Требования по операциям кредитования ценных бумаг (без учета неттинга), всего: | | 0,00 |
| 13 | Поправка на величину неттинга двусторонней части (требований и обязательств) по операциям кредитования ценных бумаг | | 0,00 |
| 14 | Величина кредитного риска на контрагента по операциям кредитования ценными бумагами | | 0,00 |
| 15 | Величина риска по гарантийным операциям кредитования ценными бумагами | | 0,00 |
| 16 | Требования по операциям кредитования ценными бумагами с учетом поправок (сумма строк 12, 14, 15 за вычетом строки 13), итого: | | 0,00 |
| Риск по условным обязательствам кредитного характера (КЕВ) | | | |
| 17 | Номинальная величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КЕВ), всего: | | 4292656,00 |
| 18 | Поправка в части применения коэффициентов кредитного эквивалента | | 3863390,00 |
| 19 | Величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КЕВ) с учетом поправок (разность строк 17 и 18), итого: | | 429266,00 |
| Капитал риска | | | |
| 20 | Основной капитал | | 13143618,00 |
| 21 | Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета показателя финансового рычага (сумма строк 3, 11, 16, 19), всего: | | 35454912,00 |
| Показатель финансового рычага | | | |
| 22 | Показатель финансового рычага по Базелю III (строка 20/ строка 21), процент | | 39,29 |

Раздел 3. Информация о расчете норматива краткосрочной ликвидности

| Номер строки | Наименование показателя | Номер пояснения | Данные на 01.04.2018 | | Данные на 01.07.2018 | |
|--|--|-----------------|---|--|---|--|
| | | | величина требований (обязательств), тыс. руб. | взвешенная величина требований (обязательств), тыс. руб. | величина требований (обязательств), тыс. руб. | взвешенная величина требований (обязательств), тыс. руб. |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| ВЫСОКОКАЧЕСТВЕННЫЕ ЛИКВИДНЫЕ АКТИВЫ | | | | | | |
| 1 | Высококачественные активы (ВКА) с учетом дополнительных требований (активов), включенных в Числитель H26 (H27) | | 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 | |
| 10 | Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств | | | | | |

| | | | | | |
|--|--|--|---|--|---|
| Итого, в том числе: | | | | | |
| 11 | По производимым финансовым инструментам и в связи с потенциальной потребностью во внесении дополнительного обеспечения | | | | |
| 12 | Связанные с потерей финансирования по обеспеченным долговым инструментам | | | | |
| 13 | По обязательствам банка по неиспользованным резервам и условно отменным кредитным линиям и линиям ликвидности | | | | |
| 14 | Дополнительно ожидаемые отток денежных средств по прочим договорным обязательствам | | | | |
| 15 | Дополнительно ожидаемые отток 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 |
| 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) | | | | |
| СВЯЗАННАЯ СКОНКРЕТИЗИРОВАННАЯ СТОИМОСТЬ | | | | | |
| 21 | ВЛА за вычетом обременений, рассчитанных с учетом ограничений на максимальную величину ВЛА-2Б и ВЛА-2 | | X | | X |
| 22 | Чистый ожидаемый отток денежных средств | | X | | X |
| 23 | Норматив краткосрочной ликвидности банковской группы (Н25), кредитной организации (Н27), процент | | X | | X |

Председатель Правления

Корчагин Николай Павлович

Главный бухгалтер

Лебедева Ольга Евгеньевна

Руководитель направления

Семакова Надежда Александровна

07.08.2018

