

Банковская отчетность

Код территории по ОКТО	Код кредитной организации (филанала)
45	регистральный номер (номерной номер)
17410392	3518

СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, НОРМАТИВЕ ФИНАНСОВОГО РЫЧАГА И НОРМАТИВЕ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ

(публикуемая форма)
01 " _____ июля 2019 г.

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

Адрес (место нахождения) кредитной организации
(головной кредитной организации банковской группы) 119002, Москва, ул. Арбат, д.10

Код формы по ОКУД 0409813
Квартальная (Годовая)

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

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Финансовое значение			
			на дату, отстоящую от отчетной даты	на дату, отстоящую от отчетной даты	на дату, отстоящую от отчетной даты	на дату, отстоящую на четыре квартала от отчетной
1	2	3	4	5	6	8
КАПИТАЛ, тыс. руб.						
I	Базовый капитал					
Ia	Базовый капитал при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков без учета влияния пороговых мер					
2	Основной капитал					
2a	Основной капитал при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков					
3	Собственные средства (капитал)					
3a	Собственные средства (капитал) при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		100436	72743	65853	31878

1	2	3	4	5	6	7	8
АКТИВЫ, ВЗВЕШЕННЫЕ ПО УРОВНЮ РИСКА, тыс. руб.							
4	Активы, взвешенные по уровню риска						
НОРМАТИВЫ ДОСТАТОЧНОСТИ КАПИТАЛА, процент							
5	Норматив достаточности базового капитала Н1.1 (Н20.1)						
5а	Норматив достаточности базового капитала при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков						
6	Норматив достаточности основного капитала Н1.2 (Н20.2)						
6а	Норматив достаточности основного капитала при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков						
7	Норматив достаточности собственных средств (капитала) Н1.0 (Н1ш, Н1.3, Н20.0)	40.217	34.000	30.640	24.362	16.230	
7а	Норматив достаточности собственных средств (капитала) при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков						
НАДБАВКИ К БАЗОВОМУ КАПИТАЛУ (в процентах от суммы активов, взвешенных по уровню риска), процент							
8	Надбавка подержания достаточности капитала						
9	Антициклическая надбавка						
10	Надбавка за системную значимость						
11	Надбавки к нормативам достаточности собственных средств (капитала), всего (стр. 8 + стр. 9 + стр. 10)						
12	Базовый капитал, доступный для направления на подержание надбавок к нормативам достаточности собственных средств (капитала)						
НОРМАТИВ ФИНАНСОВОГО РЫЧАГА							
13	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета норматива финансового рычага, тыс. руб.						

1	2	3	4	5	6	7	8
14	Норматив финансового рычага банка (Н1.4), банковской группы (Н20.4), процент						
14а	Порог для финансового рычага при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков, процент						
НОРМАТИВ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ							
15	Высоколиквидные активы, тыс. руб.						
16	Чистый ожидаемый отток денежных средств, тыс. руб.						
17	Норматив краткосрочной ликвидности Н26 (Н27), процент						
НОРМАТИВ СТРУКТУРНОЙ ЛИКВИДНОСТИ (НОРМАТИВ ЧИСТОГО СТАБИЛЬНОГО ФОНДИРОВАНИЯ)							
18	Имеющиеся стабильное фондирование (ИСФ), тыс. руб.						
19	Требуемое стабильное фондирование (ТСФ), тыс. руб.						
20	Норматив структурной ликвидности (норматив чистого стабильного фондирования) Н28 (Н29), процент						
НОРМАТИВЫ, ОГРАНИЧИВАЮЩИЕ ОТДЕЛЬНЫЕ ВИДЫ РИСКОВ, процент							
21	Норматив мгновенной ликвидности Н2						
22	Норматив текущей ликвидности Н3						
23	Норматив долговой ликвидности Н4						
24	Норматив максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков Н6 (Н21)						
		максимальное значение	количество нарушений	максимальное значение	количество нарушений	максимальное значение	количество нарушений
25	Норматив максимального размера крупных кредитных рисков Н7 (Н22)						
26	Норматив совокупной величины риска по ипсайдерам Н10.1						

1	2	3	4	5	6	7	8
27	Норматив использования собственных средств (капитала) для приобретения акций (долей) других юридических лиц Н12 (Н23)						
28	Норматив максимального размера риска на связанное с банком лицо (группу связанных с банком лиц) Н25						
29	Норматив достаточности совокупных ресурсов центрального контрагента Н2лк						
30	Норматив достаточности индивидуального клирингового обеспечения центрального контрагента Н3лк						
31	Норматив ликвидности центрального контрагента Н4лк						
32	Норматив максимального размера риска концентрации Н5лк						
33	Норматив ликвидности небанковской кредитной организации, имеющей право на осуществление переводов денежных средств без открытия банковских счетов и связанных с ними иных банковских операций Н15.1						
34	Норматив максимальной совокупной величины кредитов клиентам - участникам расчетов на завершение расчетов Н16						

1	2	3	4	5	6	7	8
35	Норматив предоставления РНКО от своего имени и за свой счет кредитов заемщикам, кроме клиентов - участников расчетов Н16.1						
36	Норматив максимального размера вексельных обязательств расчетных небанковских кредитных организаций Н16.2						
37	Норматив минимального в соотношения размера ипотечного покрытия и объема эмиссии облигаций с ипотечным покрытием Н18						

Раздел 2. Информация о расчете норматива финансового рычага (П1.4)

Подраздел 2.1. Расчет размера балансовых активов и внебалансовых требований под раском для расчета норматива финансового рычага (П1.4)

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Сумма, тыс. руб.
1	2	3	4
1	Размер активов в соответствии с бухгалтерским балансом (публикуемая форма), всего		
2	Поправка в части вложений в капитал кредитных, финансовых, страховых или иных организаций, отнесенные данные которых		Неприменимо для отчетности кредитной организации
3	Поправка в части финансовых активов, отражаемых в соответствии с правилами бухгалтерского учета, но не включаемых в расчет норматива финансового рычага		
4	Поправка в части произведенных финансовых инструментов (ПФН)		
5	Поправка в части оперативной кредиторской пассивности бухгалтерии		
6	Поправка в части приведения к кредитному эквиваленту условных обязательств кредитного характера		
7	Прочие поправки		

8	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправок для расчета норматива финансового рыска, итого	
---	--	--

Приложение 2.2. Расчет норматива финансового рыска (Н14)

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Сумма, тыс. руб.
1	2	3	4
Риск по балансовым активам			
1	Величина балансовых активов, всего		
2	Уменьшающая поправка на сумму показателей, принятых в уменьшение остаточной стоимости основного капитала		
3	Величина балансовых активов под риском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), всего		
Риск по операциям с ПФИ			
4	Текущий кредитный риск по операциям с ПФИ (за вычетом полученной порционной маржи и (или) с учетом нетоварной позиции, если применимо),		
5	Потенциальный кредитный риск на комиссион по операциям с ПФИ, всего		
6	Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПФИ, подлежащей списанию с баланса		неприменимо
7	Уменьшающая поправка на сумму пересчитанной вариационной маржи в установленных случаях		

1	2	3	4
8	Поправка в части требований банка - участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клиентов		
9	Поправка для учета кредитного риска в отношении близкого звена по вынужденным кредитным ПФН		
10	Уменьшающая поправка в части вынужденных кредитных ПФН		
11	Величина риска по ПФН с учетом поправок, итого (сумма строк 4, 5, 9 за вычетом строк 7, 8, 10), итого		
Риск по операциям кредитования ценными бумагами			
12	Требования по операциям кредитования ценными бумагами (без учета истинной), всего		
13	Поправка на величину нетоварного дисконда части (требований и обязательств) по операциям кредитования ценными бумагами		
14	Величина кредитного риска на контрагента по операциям кредитования ценными бумагами		
15	Величина риска по гарантийным операциям кредитования ценными бумагами		
16	Требования по операциям кредитования ценными бумагами с учетом поправок, итого (сумма строк 12, 14, 15 за вычетом строки 13),		
Риск по условным обязательствам кредитного характера (КРВ)			
17	Полная величина риска по условным обязательствам кредитного характера, всего		
18	Поправка в части применения коэффициентов кредитного эквивалента		
19	Величина риска по условным обязательствам кредитного характера с учетом поправок, итого (разность строк 17 и 18)		

1	2	3	4
	Капитал и риски		
20	Основной капитал		
21	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под раском для расчета норматива финансового рычага, всего (сумма строк 3, 11, 16, 19)		
	Норматив финансового рычага		
22	Норматив финансового рычага банка (Н1.4), банковской группы (Н20.4), процент (строка 20 : строка 21)		

Раздел 3. Информация о расчете норматива краткосрочной ликвидности

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Данные	
			величина требования (обязательства), тыс. руб.	взвешенная величина требования (обязательства), тыс. руб.
1	2	3	4	5
ВЫСОКОКАЧЕСТВЕННЫЕ ЛИКВИДНЫЕ АКТИВЫ				
1	Высоколиквидные активы (ВЛА) с учетом дополнительных требований (активов), включенных в числитель Н26 (П27)		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	
10	Дополнительно охватываемые оттоком депонированных средств, всего, в том числе:			
11	по производным финансовым инструментам и в связи с инвестиционной потребностью по аннулированию аннулированных облигаций			
12	связанные с потерей фондирования по обеспеченным долговым инструментам			

1	2	3	4	5
13	по обязательствам банка по неиспользованным безотзывным и отзывным кредитным линиям			
14	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств по прочим лизинговым 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	
ОЖИДАЕМЫЕ ПРИТОКИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ				
17	Из поступлений 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 СКОРРЕКТРОВАННАЯ СТОИМОСТЬ				
21	И.А. за вычетом корректировок, рассчитанных с учетом ограничений на максимальную величину И.А.-2Б		X	
22	Частный ожидаемый отток денежных средств		X	
23	Норматив краткосрочной ликвидности банковской группы (Н26), кредитной организации (Н27)		X	



Председатель Правления Журавлева Анна Борисовна

Главный бухгалтер Лапина Ирина Владимировна

№ 21 " августа 2019 г.