

Банковская отчетность		
Код территории по ОКATO	Код кредитной организации (филиала) по ОКПО	регистрационный номер (/порядковый номер)
45296559	70140300	3436

СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, НОРМАТИВЕ ФИНАНСОВОГО РИСКА И НОРМАТИВЕ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ
(публикуемая форма)
на 01 апреля 2021 г.

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

Первый Клиентский Банк (Общество с ограниченной ответственностью) / ООО Первый Клиентский Банк

Адрес (место нахождения) кредитной организации (головной кредитной организации банковской группы) 115280, г.Москва, ул. Ленинская Слобода, д.19, стр.1.

Код формы по ОКУД 0409813

Квартальная (Годовая)

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

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Фактическое 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	Базовый капитал	19	1315243	1321214	1228303	1228204	1202141
1а	Базовый капитал при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков без учета влияния переходных мер		1321214	1321214	1228303	1228204	1202141
2	Основной капитал	19	1315243	1321214	1228303	1228204	1202141
2а	Основной капитал при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		1321214	1321214	1228303	1228204	1202141
3	Собственные средства (капитал)	13.1, 9	1678854	1619764	1583751	1595598	1579017
3а	Собственные средства (капитал) при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		1639771	1593826	1570629	1541739	1593678
АКТИВЫ, взвешенные по уровню риска, тыс.руб.							
4	Активы, взвешенные по уровню риска	19	5638090	7162344	7768055	8071621	8677825
НОРМАТИВЫ ДОСТАТОЧНОСТИ КАПИТАЛА, процент							
5	Норматив достаточности базового капитала Н1.1 (Н20.1)		23.327	18.446	15.812	15.217	13.853
5а	Норматив достаточности базового капитала при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		23.659	18.169	15.601	15.141	13.596
6	Норматив достаточности основного капитала Н1.2 (Н20.2)		23.327	18.446	15.812	15.217	13.853
6а	Норматив достаточности основного капитала при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков		23.659	18.169	15.601	15.141	13.596

7	Норматив достаточности собственных средств (капитала) Н1.0 (Н1ц, Н1.3, Н20.0)	29.777	22.615	20.388	19.768	18.196
7a	Норматив достаточности собственных средств (капитала) при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков	29.010	21.918	19.949	19.006	18.024
НАДБАВКИ К БАЗОВОМУ КАПИТАЛУ (в процентах от сумм активов, взвешенных по уровню риска), процент						
8	Надбавка поддержания достаточности капитала	2.500	2.500	2.500	2.500	2.250
9	Длительная надбавка	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000
10	Надбавка за системную значимость					
11	Надбавки к нормативам достаточности собственных средств (капитала), всего (стр.8+стр.9+стр.10)	2.500	2.500	2.500	2.500	2.500
12	Базовый капитал, доступный для направления на поддержание надбавок к нормативам достаточности собственных средств (капитала)	17.327	12.446	9.812	9.217	7.853
НОРМАТИВ ФИНАНСОВОГО РЫЧАГА						
13	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета норматива финансового рычага, тыс. руб.	4838604	6820056	6951106	7111336	8057678
14	Норматив финансового рычага (Н1.4), банковской группы (Н20.4), процент	27.182	19.643	17.671	17.271	14.919
14a	Норматив финансового рычага при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков, процент	27.532	19.372	17.402	17.266	14.894
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	Имеющееся 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	73.847	72.061	80.414	86.191	113.798
22	Норматив текущей ликвидности Н3	86.550	118.077	93.073	101.001	118.283

23	Норматив долгосрочной ликвидности Н4	69.596			59.581			157.189			60.694			58.947			
24	Норматив максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков Н6 (Н21)	18.820	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность
						17.693			18.210			17.65			16.77		
25	Норматив максимального размера крупных кредитных рисков Н7 (Р22)	172.111			241.926			292.155			294.786			320.059			
26	Норматив совокупной величины риска по инсайдерам Н10.1	0.000			0.000			0.000			0.000			0.000			
27	Норматив использования собственных средств (капитала) для приобретения акций (долей) других юридических лиц Н12 (Н23)	0.000			0.000			0.000			0.000			0.000			
28	Норматив максимального размера риска на связанное с банком лицо (группу связанных с банком лиц) Н25	0.68	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность	максимальное значение	количество нарушений	длительность
						0.51			0.50			0.53			0.56		
29	Норматив достаточности совокупных ресурсов центрального контрагента Н2цк																
30	Норматив достаточности индивидуального клирингового обеспечения центрального контрагента Н3цк																
31	Норматив ликвидности центрального контрагента Н4цк																
32	Норматив максимального размера риска концентрации Н5цк																
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																
35	Норматив предоставления РНКО от своего имени и за свой счет кредитов заемщикам, кроме клиентов - участников расчетов Н16.1																
36	Норматив максимального размера внебалансовых обязательств расчетных небанковских кредитных организаций Н16.2																
37	Норматив минимального соотношения размера исплочного покрытия и объема эмиссии облигаций с исплочным покрытием Н18																

Раздел 2. Информация о расчете норматива финансового рычага (Н1.4)

Подраздел 2.1 Расчет размера балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета норматива финансового рычага (Н1.4)

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Сумма, тыс. руб.
1	2	3	4
1	Размер активов в соответствии с бухгалтерским балансом (публикуемая форма), всего		3232204
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		Внеприменимо для отчетности кредитной организации как юридического лица

3	Поправка в части фидуциарных активов, отраженных в соответствии с правилами бухгалтерского учета, но не включаемых в расчет норматива финансового рычага		0
4	Поправка в части производных финансовых инструментов (ПФИ)		3937
5	Поправка в части операций кредитования ценными бумагами		0
6	Поправка в части приведения к кредитному эквиваленту условных обязательств кредитного характера		1600694
7	Прочие поправки		17929
8	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправок для расчета норматива финансового рычага, итого		4818906

Раздел 2.2 Расчет норматива финансового рычага (Н1.4)

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Сумма, тыс. руб.
1	2	3	4
Риск по балансовым активам			
1	Величина балансовых активов, всего		3234921.00
2	Уменьшающая поправка на сумму показателей, принимаемых в уменьшение величины источников основного капитала		948.00
3	Величина балансовых активов под риском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), всего		3233973.00
Риск по операциям с ПФИ			
4	Текущий кредитный риск по операциям с ПФИ (за вычетом полученной вариационной маржи и (или) с учетом неттинга позиций, если применимо), всего		0.00
5	Потенциальный кредитный риск на контрагента по операциям с ПФИ, всего		3937.00
6	Поправка на размер номинальной суммы представленного обеспечения по операциям с ПФИ, подлежащей списанию с баланса		неприменно
7	Уменьшающая поправка на сумму начисленной вариационной маржи в установленных случаях		0.00
8	Поправка в части требований банка - участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клингов		0.00
9	Поправка для учета кредитного риска в отношении балансового актива по выпущенным кредитным ПФИ		0.00
10	Уменьшающая поправка в части выпущенных кредитных ПФИ		0.00
11	Величина риска по ПФИ с учетом поправок, итого (сумма строк 4, 5, 9 за вычетом строк 7, 8, 10)		3937.00
Риск по операциям кредитования ценными бумагами			
12	Требования по операциям кредитования ценными бумагами (без учета неттинга), всего		0.00
13	Поправка на величину неттинга денежной части (требований и обязательств) по операциям кредитования ценными бумагами		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, итого (сумма строк 12, 14, 15 за вычетом строки 13)		0.00
Риск по условным обязательствам кредитного характера (КРВ)			
17	Номинальная величина риска по условным обязательствам кредитного характера, всего		1744703.00
18	Поправка в части применения коэффициентов кредитного эквивалента		144009.00

19	Величина риска по условным обязательствам кредитного характера с учетом поправок, итого (равность строк 17 и 18)		1600694.00
Капитал и риски			
20	Основной капитал	19	1315243.00
21	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета норматива финансового рычага, всего (сумма строк 3, 11, 16, 19)		4838604.00
Норматив финансового рычага			
22	Норматив финансового рычага банка (П1.4), банковской группы (Н20.4), процент (строка 20 : строка 21)		27.18

Раздел 3. Информация о расчете норматива краткосрочной ликвидности

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Данные на 01.04.2021	
			величина требований (обязательств), тыс. руб.	взвешенная величина требований (обязательств), тыс. руб.
1	2	3	4	5
ВЫСОКОКАЧЕСТВЕННЫЕ ЛИКВИДНЫЕ АКТИВЫ				
1	Высоколиквидные активы (ВЛА) с учетом дополнительных требований (активов), включенных в числовые Н26 (Н27)		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 ожидаемые оттоки денежных средств, всего, в том числе:			
11	по производным финансовым инструментам и в связи с потенциальной потребностью во внесении дополнительного обеспечения			
12	связанные с потерей фондирования по обеспеченным долгам 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 условиям обязательств			
16	Суммарный отток денежных средств, итого (строка 2 + строка 5 + строка 9 + строка 10 + строка 14 + строка 15)		X	
ОЖИДАЕМЫЕ ПРИТОКИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ				
17	По операциям предоставления денежных средств под обеспечение ценными бумагами, включая операции обратного репо			
18	По договорам без нарушения контрактных сроков исполнения обязательств			
19	Прочие притоки			
20	Суммарный приток денежных средств, итого (строка 17 + строка 18 + строка 19)			
СУММАРНАЯ СКОРРЕКТИРОВАННАЯ СТОИМОСТЬ				
21	ВЛА за вычетом корректировок, рассчитанных с		X	

учетом ограничений на максимальную величину БЛА-2Б и БЛА-2			
22 Чистый ожидаемый отток денежных средств		X	
23 Норматив краткосрочной ликвидности банковской группы (Н26), кредитной организации (Н27), процент		X	

Председатель Правления Ланьшина Н.А.

Главный бухгалтер Юрская Н.Г.

Начальник отдела отчетности
Телефон: +7 495-276 06 16
Морозов О.И.

13 мая 2021 г.

