

Код территории по ОКATO	Код кредитной организации (филиала)	
	по ОКПО	регистрационный номер(порядковый номер)
45286590000	09807247	1027739082106

**СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, ПОКАЗАТЕЛЕ
ФИНАНСОВОГО РЫЧАГА И НОРМАТИВЕ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ
(публикуемая форма)
на 1 октября 2016 года**

Кредитной организации Акционерное общество "ЮниКредит Банк" (АО ЮниКредит Банк)
Почтовый адрес 119034, г. Москва, Пречистенская набережная, 9

Код формы по ОКУД 0409813
Квартальная (Полугодовая) (Годовая)
тыс. руб.

Раздел 1. Сведения об обязательных нормативах

Номер строки	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 банка (Н1.1), банковской группы (Н20.1)	4.3	4.5	11.7	9.6
2	Норматив достаточности основного капитала банка (Н1.2), банковской группы (Н20.2)	4.3	6.0	11.7	9.6
3	Норматив достаточности собственных средств (капитала) банка (Н1.0), банковской группы (Н20.0)	4.3	8.0	15.4	13.0
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	Норматив текущей ликвидности банка (Н3)	-	-	-	-
7	Норматив долгосрочной ликвидности банка (Н4)	-	-	-	-
8	Норматив максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков банка (Н6)	-	-	Максимальное	Максимальное
8.1				Минимальное	Минимальное
9	Норматив максимального размера крупных кредитных рисков банка (Н7), банковской группы (Н22)		800	183.8	253.8
10	Норматив максимального размера кредитов, банковских гарантий и поручительств, предоставленных банком своим участникам (акционерам) (Н9.1)	-	-	-	-
11	Норматив совокупной величины риска по инсайдерам банка (Н10.1)	-	-	-	-
12	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	-	-
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 размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков банковской группы (Н21)	5.1.1	25	15.9	22.4

Раздел 2. Информация о расчете показателя финансового рычага

Подраздел 2.1. Расчет размера балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета показателя финансового рычага

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Сумма
1	2	3	4
1	Размер активов в соответствии с бухгалтерским балансом (публикуемая форма), всего		1 222 408 764.00
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		-
3	Поправка в части фидуциарных активов, отражаемых в соответствии справками бухгалтерского учета, но не включаемых в расчет показателя финансового рычага		-
4	Поправка в части производных финансовых инструментов (ПФИ)		151 623 094.00
5	Поправка в части операций кредитования ценными бумагами		7 462 014.00
6	Поправка в части приведения к кредитному эквиваленту условных обязательств кредитного характера		125 212 117.00
7	Прочие поправки		18 082 493.00
8	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправок для расчета показателя финансового рычага, итого		1 488 623 496.00

Подраздел 2.2. Таблица расчета показателя финансового рычага

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Сумма
1	2	3	4
Риск по балансовым активам			
1	Величина балансовых активов, всего		1 071 124 791.00
2	Уменьшающая поправка на сумму показателей, принимаемых в уменьшение величины источников основного капитала		4 526 423.00
3	Величина балансовых активов под риском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), итого		1 066 598 368.00
Риск по операциям с ПФИ			
4	Текущий кредитный риск по операциям с ПФИ (за вычетом полученной вариационной маржи), всего		43 935 856.00
5	Потенциальный кредитный риск на контрагента по операциям с ПФИ, всего		169 959 025.00
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		355 307.00
8	Поправка в части требований банка - участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клиентов		-
9	Поправка для учета кредитного риска в отношении базисного (базового) актива по выпущенным кредитным ПФИ		-
10	Уменьшающая поправка в части выпущенных кредитных ПФИ		-
11	Величина риска по ПФИ с учетом поправок (сумма строк 4, 5, 9 за вычетом строк 7, 8, 10), итого		213 539 574.00
Риск по операциям кредитования ценными бумагами			
12	Требования по операциям кредитования ценными бумагами (без учета неттинга), всего		90 254 440.00
13	Поправка на величину неттинга денежной части (требований и обязательств) по операциям кредитования ценными бумагами		3 560 456.00
14	Величина кредитного риска на контрагента по операциям кредитования ценными бумагами		11 022 470.00
15	Величина риска по гарантийным операциям кредитования ценными бумагами		-
16	Требования по операциям кредитования ценными бумагами с учетом поправок (сумма строк 12, 14, 15 за вычетом строки 13), итого		97 716 454.00
Риск по условным обязательствам кредитного характера (КРВ)			
17	Номинальная величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ), всего		463 383 392.00
18	Поправка в части применения коэффициентов кредитного эквивалента		338 171 275.00
19	Величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ) с учетом поправок (разность строк 17 и 18), итого		125 212 117.00
Капитал и риски			
20	Основной капитал	4.4	136 313 735.00
21	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета показателя финансового рычага (сумма строк 3, 11, 16, 19), всего	4.4	1 503 066 513.00
Показатель финансового рычага			
22	Показатель финансового рычага по Базелю III (строка 20: строка 21), процент	4.4	9.07

Раздел 3. Информация о расчете норматива краткосрочной ликвидности

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Данные на 01.04		Данные на 01.07		Данные на 01.10		
			величина требований (обязательств)	взвешенная величина требований (обязательств)	величина требований (обязательств)	взвешенная величина требований (обязательств)	величина требований (обязательств)	взвешенная величина требований (обязательств)	
1		2	3	4	5	4	5	4	5
ВЫСОКОКАЧЕСТВЕННЫЕ ЛИКВИДНЫЕ АКТИВЫ									
1	Высоколиквидные активы (ВЛА) с учетом дополнительных требований(активов), включенных в числитель Н26 (Н27)	5.3.1	x	99 446 824.00	x	98 124 244.00	x	141 934 440.00	
ОЖИДАЕМЫЕ ОТТОКИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ									
2	Денежные средства физических лиц, всего, в том числе:		176 717 599.00	17 671 760.00	174 792 525.00	17 479 253.00	174 848 123.00	17 484 812.00	
3	стабильные средства		-	-	-	-	-	-	
4	нестабильные средства		176 717 599.00	17 671 760.00	174 792 525.00	17 479 253.00	174 848 123.00	17 484 812.00	
5	Денежные средства клиентов, привлеченные без обеспечения, всего, в том числе:		307 019 940.00	148 938 528.00	309 466 984.00	151 352 220.00	311 001 923.00	153 227 756.00	
6	операционные депозиты		-	-	-	-	-	-	
7	депозиты, не относящиеся к операционным (прочие депозиты)		-	-	307 446 512.00	149 331 748.00	308 994 713.00	151 220 546.00	
8	необеспеченные долговые обязательства		3 401 739.00	3 401 739.00	1 732 506.00	1 732 506.00	1 717 051.00	1 717 051.00	
9	Денежные средства клиентов, привлеченные под обеспечение		x	-	x	-	x	-	
10	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств, всего, в том числе:		170 665 292.00	71 358 434.00	173 951 257.00	76 549 070.00	192 459 387.00	85 806 059.00	
11	по производным финансовым инструментами и в связи спотенциальной потребностью во внесении дополнительного обеспечения		61 095 380.00	61 095 380.00	66 451 877.00	66 451 877.00	74 328 060.00	74 328 060.00	
12	связанные с потерей фондирования по обеспеченным долговым инструментам		-	-	-	-	-	-	
13	по обязательствам банка по неиспользованным безотзывным и условно отзывным кредитным линиями линиями ликвидности		109 569 912.00	10 263 054.00	107 499 380.00	10 097 193.00	118 131 327.00	11 477 999.00	
14	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств по прочим договорным обязательствам		183 797 145.00	10 964 132.00	182 729 908.00	10 966 474.00	177 893 114.00	10 774 392.00	
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)	5.3.1	x	248 932 854.00	x	256 347 017.00	x	267 293 019.00	
ОЖИДАЕМЫЕ ПРИТОКИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ									
17	По операциям предоставления денежных средств под обеспечение ценными бумагами, включая операции обратного РЕПО		33 219 737.00	17 871 100.00	42 239 401.00	15 499 214.00	49 642 531.00	13 750 943.00	
18	По договорам без нарушения контрактных сроков исполнения обязательств		149 666 260.00	143 318 414.00	120 978 397.00	112 174 851.00	104 502 620.00	94 552 192.00	
19	Прочие притоки		38 727 339.00	38 727 339.00	43 936 133.00	43 936 133.00	51 440 300.00	51 440 300.00	
20	Суммарный приток денежных средств, итого (строка 17 + строка 18 + строка 19)	5.3.1	221 613 336.00	199 916 853.00	207 153 931.00	171 610 198.00	205 585 451.00	159 743 435.00	
СУММАРНАЯ СКОРРЕКТИРОВАННАЯ СТОИМОСТЬ									
21	ВЛА, за вычетом корректировок, рассчитанных с учетом ограничений на максимальную величину ВЛА-2Б и ВЛА-2	5.3.1	x	94 945 728.00	x	95 873 696.00	x	98 310 068.00	
22	Чистый ожидаемый отток денежных средств		x	62 233 213.00	x	84 736 819.00	x	107 549 584.00	
23	Норматив краткосрочной ликвидности банковской группы (Н26), кредитной организации (Н27), процент	5.3.1	x	152.56	x	113.14	x	97.96	

Руководитель головной кредитной организации
 Главный бухгалтер головной кредитной организации



29.11.2016

(Handwritten signatures in blue ink)

М.Ю. Алексеев
 Г.Е. Чернышева