

**Раздел II. Информация о системе управления рисками  
на 01.07.2018**

**Глава 1. Организация системы управления рисками и определение требований к капиталу**

**Таблица 2.1**

Информация о требованиях (обязательствах),  
взвешенных по уровню риска, и о минимальном размере  
капитала, необходимом для покрытия рисков  
на 01.07.2018

тыс. руб.

| Номер | Наименование показателя  | Требования (обязательства),<br>взвешенные по уровню риска |  | Минимальный<br>размер<br>капитала,<br>необходимый<br>для покрытия<br>рисков |
|-------|--|---|--|---|
|       |  | данные на<br>отчетную дату                                | данные на<br>предыдущую<br>отчетную дату | данные на<br>отчетную дату  |
| 1     | 2  | 3   | 4  | 5   |
| 1     | Кредитный риск (за исключением кредитного риска контрагента), всего,<br>в том числе:   | -   | -  | -   |
| 2     | при применении стандартизированного подхода  | -   | -  | -   |
| 3     | при применении ПБР   | -   | -  | -   |
| 4     | Кредитный риск контрагента, всего,<br>в том числе:   | -   | -  | -   |
| 5     | при применении стандартизированного подхода  | -   | -  | -   |
| 6     | при применении метода, основанного на<br>внутренних моделях  | -   | -  | -   |
| 7     | Инвестиции в долевые ценные бумаги (акции, паи в паевых инвестиционных фондах) и доли участия в уставном капитале юридических лиц, не входящие в торговый портфель, при применении рыночного подхода | -   | -  | -   |
| 8     | Вложения в акции, паи инвестиционных и иных фондов - сквозной подход   | -   | -  | -   |
| 9     | Вложения в акции, паи инвестиционных и иных фондов - мандатный подход  | -   | -  | -   |
| 10    | Вложения в акции, паи инвестиционных и иных фондов - резервный подход  | -   | -  | -   |
| 11    | Риск расчетов  | -   | -  | -   |
| 12    | Риск секьюритизации (за исключением риска секьюритизации торгового портфеля), всего,<br>в том числе:   | -   | -  | -   |
| 13    | при применении ПБР, основанного на рейтингах   | -   | -  | -   |
| 14    | при применении ПБР с использованием формулы надзора  | -   | -  | -   |

|    |   |       |       |    |
|----|---|-------|-------|----|
| 15 | при применении стандартизированного подхода   | -     | -     | -  |
| 16 | Рыночный риск, всего,<br>в том числе:   | -     | -     | -  |
| 17 | при применении стандартизированного подхода   | -     | -     | -  |
| 18 | при применении метода, основанного на<br>внутренних моделях   | -     | -     | -  |
| 19 | Операционный риск, всего,<br>в том числе:   | 353,5 | 216,5 | 93 |
| 20 | при применении базового индикативного подхода   | 353,5 | 216,5 | 93 |
| 21 | при применении стандартизированного подхода   | -     | -     | -  |
| 22 | при применении продвинутого<br>(усовершенствованного) подхода   | -     | -     | -  |
| 23 | Активы (требования) ниже порога существенности для<br>вычета из собственных средств (капитала),<br>взвешенные с коэффициентом 250%  | -     | -     | -  |
| 24 | Минимальный размер корректировки на предельный<br>размер снижения кредитного и операционного риска<br>при применении ПВР и продвинутого<br>(усовершенствованного) подхода | -     | -     | -  |
| 25 | Итого<br>(сумма строк 1 + 4 + 7 + 8 + 9 + 10 + 11 + 12 + 16 + 19 +<br>23 + 24)  | 353,5 | 216,5 | 93 |

#### Текстовая информация к таблице 2.1.

1. Значение достаточности капитала для операционного риска рассчитывается по формуле:

$$K = \frac{H1.3 \times (O + 12,5 \times OP)}{100}$$

где:

H1.3 - минимально допустимое значение норматива достаточности собственных средств (капитала) (H1.3), определенное в соответствии с Инструкцией № 137-И,

O - общая сумма обязательств (пассивов), рассчитанная как сумма остатков на счетах (в части банковских счетов юридических лиц), сгруппированных в код 8845 согласно приложения к Инструкции №137-И.

OP – размер операционного риска.