

Банковская отчетность

Код формы по ОКТО	Код кредитной организации (ИНН)	по ОКВ	регистрационный номер
48	1752519		2245

СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, ПОКАЗАТЕЛЕ ФИНАНСОВОГО РЫЧАГА И НОРМАТИВЕ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ (публикуемая форма) на 01.10.2018 года

Кредитной организации Акционерное общество Коммерческий банк "КОСМОС" / АО КБ "КОСМОС"

Адрес (место нахождения) кредитной организации (головной кредитной организации банковской группы) 123317 Москва, Красногвардейский б-р, д. 7, стр. 1

Код формы по ОКУД 0409813

Квартальная (Годовая)

Раздел 1. Сведения об обязательных нормативах

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Нормативное значение, проценты	Фактическое значение, проценты		
				на отчетную дату	на начало отчетного года	
1	2	3	4	5	6	
1	Норматив достаточности базового капитала (Н1.1) банковской группы (Н22.1)		4,9	21,3	25,9	
2	Норматив достаточности основного капитала банка (Н1.2), банковской группы (Н22.2)		6,0	21,3	25,9	
3	Норматив достаточности собственных средств (капитала) банка (норматив К1.0) банковской группы (Н22.0)	7.5	8,0	47,1	39,7	
4	Норматив достаточности собственных средств (капитала) небанковской кредитной организации, имеющей право на осуществление переводов денежных средств без открытия банковского счета и связанных с ними иных банковских операций (Н1.3)					
5	Норматив финансового рычага банка (Н1.4), банковской группы (Н22.4)		3,0	22,2	0,0	
6	Норматив мгновенной ликвидности банка (Н2)	17.15	15,0	76,6	66,1	
7	Норматив текущей ликвидности банка (Н3)	17.15	60,0	127,0	121,2	
8	Норматив долгосрочной ликвидности банка (Н4)	17.15	120,0	37,7	41,6	
9	Норматив максимального размера риска (на одного заемщика или группу связанных заемщиков) (Н6)		25,0	максимальное значение 17,4	количество нарушений 16,9	длительность 18,5
10	Норматив максимального размера группы кредитных рисков (Н7), банковской группы (Н22)		800,0	323,3	88,5	
11	Норматив максимального размера кредитов, банковских гарантий и поручительств, предоставляемых банком своим участникам (акционерам) (Н9.1)		50,0	0,2	0,7	
12	Норматив совокупной величины риска по ипотечным банкам (Н10.1)		3,0	0,3	1,0	
13	Норматив использования собственных средств (капитала) банка для приобретения акций (долей) других юридических лиц (Н12), норматив использования собственных средств (капитала) банковской группы для приобретения доли(ями) кредитной организацией банковской группы и участниками (банковской группы акций (долей) других юридических лиц (Н23)		25,0	0,0	0,0	
14	Норматив совокупного суммированного размера сроков исполнения в ближайшие 30 календарных дней к сумме обязательств РИКО (Н15)					
15	Норматив ликвидности небанковской кредитной организации, имеющей право на осуществление переводов денежных средств без открытия банковского счета и связанных с ними иных банковских операций (Н15.1)					
16	Норматив максимальной совокупной величины кредитных и депозитных - участником расчетов на депозитных счетах (Н16)					
17	Норматив предоставления РИКО от своего имени и за свой счет кредитов заемщикам, кроме клиентов - участников расчетов (Н16.1)					
18	Норматив максимального соотношения размера ипотечного покрытия 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 связанное с банком лицо (группу связанных с банком лиц) (Н25)			максимальное значение	количество нарушений	длительность

Раздел 2. Информация о расчете показателя финансового рычага

Раздел 2.1 Расчет размера балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчете показателя финансового рычага

Номер п/п	Наименование показателя	Номер пояснения	Сумма, тыс. руб.
1	2	3	4
1	Размер активов в соответствии с бухгалтерским балансом (публикуемая форма), всего		1028853
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		не применимо для отчетности кредитной организации как юридического лица

	(доли) открытых валютных позиций банковской группы		
3	Поправка в части фидуциарных активов, отраженных 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 эквиваленту условных обязательства кредитного характера		2380
7	Прочие поправки		15537
8	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправок для расчета показателя финансового рычага, итого		1015696

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:		1013316.00
2	Уменьшающая поправка на сумму показателей, принимаемых в уменьшение величин источников основного капитала		0.00
3	Величина балансовых активов под риском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), итого:		1013316.00
Риск по операциям с ПФИ			
4	Текущий кредитный риск по операциям с ПФИ (за вычетом полученной вариационной маржи), всего:		0.00
5	Потенциальный кредитный риск на контрагента по операциям с ПФИ, всего:		0.00
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 неприменяемо
7	Уменьшающая поправка на сумму перечисленной вариационной маржи в установленных случаях		0.00
8	Поправка в части требований банка - участника клиринга к центральному контрагенту по исполнению сделок клиентов		0.00
9	Поправка для учета кредитного риска в отношении базисного 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 (сумма строк 4, 5, 9 за вычетом строк 7, 8, 10), итого:		0.00
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 (сумма строк 12, 14, 15 за вычетом строки 13), итого:		0.00
Риск по условным обязательствам кредитного характера (КРВ)			
17	Номинальная величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ'), всего:		23799.00
18	Поправка в части применения коэффициентов кредитного эквивалента		21419.00
19	Величина риска по условным обязательствам кредитного характера (КРВ') с учетом поправок (разность строк 17 и 18), итого:		2380.00

Капитал риска		
20	Основной капитал	225096.00
21	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета показателя финансового рычага (сумма строк 3, 11, 16, 19), всего:	1015696.00
Показатель финансового рычага		
22	Показатель финансового рычага по Базелю III (строка 20/ строка 21), процент	22.16

Раздел 3. Информация о расчете норматива краткосрочной ликвидности

Строка	Наименование показателя	Комментарии	Данные на 01.06.2018		Данные на 01.07.2018		Данные на 01.10.2018	
			включая требования (обязательства) тыс. руб.	включая требования (обязательства) тыс. руб.	включая требования (обязательства) тыс. руб.	включая требования (обязательства) тыс. руб.	включая требования (обязательства) тыс. руб.	включая требования (обязательства) тыс. руб.
1	2	3	4	5	6	7	8	9
<b>ВЫСОКОКАЧЕСТВЕННЫЕ ЛИКВИДНЫЕ АКТИВЫ</b>								
1	Включая акции (БЛА) с учетом доплат: (включая требования (акции), включенных в классификацию И26 (И27))		X		X		X	
<b>ОЖИДАЕМЫЕ ОТТОКИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ</b>								
2	Денежные средства физически лиц, всего, в том числе:							
3	исключая средства:							
4	исключая средства:							
5	Денежные средства клиентов, привлеченные без обеспечения, всего, в том числе:							
6	операционные депозиты							
7	депозиты, не относящиеся к операционным (прочие депозиты)							
8	исключая требования к клиентам							
9	Денежные средства клиентов, привлеченные под обеспечение		X		X		X	
10	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств, всего, в том числе:							
11	по пролонгации финансовых инструментов и в связи с потенциальной потребностью во внесении дополнительного обеспечения							
12	связанные с потерей фондирования по обеспеченным договорам страхования							
13	по обязательствам банка по неиспользованным обеспеченным и условно отозванным кредитным линиям и другим обязательствам							
14	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств по прочим договорным обязательствам							
15	Дополнительно ожидаемые оттоки денежных средств по прочим условным обязательствам							
16	Суммарный отток денежных средств, всего (строка 2 + строка 5 + строка 9 + строка 10 + строка 14 + строка 15)		X		X		X	
<b>ОЖИДАЕМЫЕ ПИТОКИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ</b>								
17	по операциям предоставления денежных средств под обеспечение ценными бумагами, акциями операции обратного РЕПО							
18	по договорам без встречных контрактных сроков исполнения обязательств							
19	Прочие оттоки							
20	Суммарный приток денежных средств, всего (строка 17 + строка 18 + строка 19)							
<b>СУММАРНАЯ КОЭФФИЦИЕНТНАЯ СТОИМОСТЬ</b>								
21	ВЛА за вычетом корректировок, рассчитываемая с учетом отраженных на максимальную величину И26-26 и И26-2		X		X		X	
22	Чисел ожидаемый отток денежных средств		X		X		X	
23	Норматив краткосрочной ликвидности базисной группы (И26), кредитной организации (И27), процент		X		X		X	

Председатель Правления

Поповский С.В.

Главный бухгалтер

Соловьева Л.С.

Зам. главного бухгалтера  
Телефон: 495-792-88-92

01.11.2018

Контрольная сумма: ф.813 Раздел 1 :47410  
ф.813 Раздел 2.1 :4553  
ф.813 Раздел 2.2 :17575  
ф.813 Раздел 3 :34973

Версия файла описателей (.PAK) :21.06.2018