

Банковская отчетность

| | | |
|-------------------------|---|---|
| Код территории по ОКATO | Код кредитной организации (филиала) по ОКПО | регистрационный номер (/порядковый номер) |
| 45286585 | 09319252 | 1143 |

ОТЧЕТ ОБ УРОВНЕ ДОСТАТОЧНОСТИ КАПИТАЛА ДЛЯ ПОКРЫТИЯ РИСКОВ,
ВЕЛИЧИНЕ РЕЗЕРВОВ НА ВОЗМОЖНЫЕ ПОТЕРИ ПО ОСУДАМ И ИНЫМ АКТИВАМ
(ПУБЛИКУЕМАЯ ФОРМА)

по состоянию на 01.04.2017 года

Кредитной организации
Общество с ограниченной ответственностью Банк "ФРИДОМ ФИНАНС"
/ ООО "ФИН Банк"

Адрес (место нахождения) кредитной организации
(головной кредитной организации банковской группы)
г.Москва, улица Каретный ряд, дом 5/10, строение 2

Код формы по ОКУД 0409808
Квартальная (Годовая)

Раздел 1. Информация об уровне достаточности капитала

| Номер строки | Наименование инструмента (показателя) | Номер пояснения | Стоимость инструмента (величина показателя) на отчетную дату, тыс. руб. | | Стоимость инструмента (величина показателя) на начало отчетного года, тыс. руб. | |
|---|---|-----------------|---|--|---|--|
| | | | включаемая в расчет капитала | не включаемая в расчет капитала в период до 1 января 2018 года | включаемая в расчет капитала | не включаемая в расчет капитала в период до 1 января 2018 года |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| Источники базового капитала | | | | | | |
| 1 | Уставный капитал и эмиссионный доход, всего, в том числе сформированный: | | 178627.0000 | X | 58627.0000 | X |
| 1.1 | обыкновенными акциями (долями) | | 178627.0000 | X | 58627.0000 | X |
| 1.2 | привилегированными акциями | | | X | | X |
| 2 | Нераспределенная прибыль (убыток): | | 65180.0000 | X | 65180.0000 | X |
| 2.1 | прошлых лет | | 65180.0000 | X | 65180.0000 | X |
| 2.2 | отчетного года | | | X | | X |
| 3 | Резервный фонд | | 5864.0000 | X | 5864.0000 | X |
| 4 | Доли уставного капитала, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | | X | | X |
| 5 | Инструменты базового капитала дочерних организаций, принадлежащие третьим сторонам | | | | | |
| 6 | Источники базового капитала, итого (строка 1 +/- строка 2 + строка 3 - строка 4 + строка 5) | | 249671.0000 | X | 129671.0000 | X |
| Показатели, уменьшающие источники базового капитала | | | | | | |

| | | | | | | |
|--------------------------------|--|-------------|--|---|-------------|---|
| 7 | Корректировка торгового портфеля | | | | | |
| 8 | Деловая репутация (Гудвил) за вычетом отложенных налоговых обязательств | | | | | |
| 9 | Нематериальные активы (кроме деловой репутации и сумм прав по обслуживанию ипотечных кредитов) за вычетом отложенных налоговых обязательств | 1214.0000 | | | 671.0000 | |
| 10 | Отложенные налоговые активы, зависящие от будущей прибыли | | | | | |
| 11 | Резервы хеджирования денежных потоков | | | | | |
| 12 | Недосозданные резервы на возможные потери | | | | | |
| 13 | Доход от сделок сепаративации | | | | | |
| 14 | Доходы и расходы, связанные с изменением кредитного риска по обязательствам, оцениваемым по справедливой стоимости | | | | | |
| 15 | Активы пенсионного плана с установленными выплатами | | | | | |
| 16 | Вложения в собственные акции (долями) | | | | | |
| 17 | Взаимное перекрестное владение акциями (долями) | | | | | |
| 18 | Несущественные вложения в инструменты базового капитала финансовых организаций | | | | | |
| 19 | Существенные вложения в инструменты базового капитала финансовых организаций | | | | | |
| 20 | Права по обслуживанию ипотечных кредитов | | | | | |
| 21 | Отложенные налоговые активы, не зависящие от будущей прибыли | | | | | |
| 22 | Солокутная сумма существенных вложений и отложенных налоговых активов в части, превышающей 15 процентов от величины базового капитала, всего, в том числе: | | | | | |
| 23 | существенные вложения в инструменты базового капитала финансовых организаций | | | | | |
| 24 | права по обслуживанию ипотечных кредитов | | | | | |
| 25 | отложенные налоговые активы, не зависящие от будущей прибыли | | | | | |
| 26 | Иные показатели, уменьшающие источники базового капитала, установленные Банком России, всего, в том числе: | | | | | |
| 26.1 | показатели, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | | X | | X |
| 27 | Отрицательная величина добавочного капитала | | | X | | X |
| 28 | Показатели, уменьшающие источники базового капитала, итого (сумма строк с 7 по 22 и строк 26, 27) | 1214.0000 | | X | 671.0000 | X |
| 29 | Базовый капитал, итого (строка 6- строка 28) | 248457.0000 | | X | 129000.0000 | X |
| Источники добавочного капитала | | | | | | |
| 30 | Инструменты добавочного капитала и эмиссионный доход, всего, в том числе: | 207500.0000 | | X | 207500.0000 | X |
| 31 | классифицируемое как капитал | | | | | |

| | | | | | | |
|--|--|-------------|--|---|-------------|---|
| | | | | X | | X |
| 32 | классифицируемые как обязательства | 207500.0000 | | X | 207500.0000 | X |
| 33 | Инструменты добавочного капитала, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | | X | | X |
| 34 | Инструменты добавочного капитала дочерних организаций, принадлежащие третьим сторонам, всего, в том числе: | | | X | | X |
| 35 | Инструменты добавочного капитала дочерних организаций, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | | X | | X |
| 36 | Источники добавочного капитала, итого (строка 30 + строка 33 + строка 34) | 207500.0000 | | X | 207500.0000 | X |
| Показатели, уменьшающие источники добавочного капитала | | | | | | |
| 37 | Вложения в собственные инструменты добавочного капитала | | | | | |
| 38 | Взаимное перекрестное владение инструментами добавочного капитала | | | | | |
| 39 | Вещные вложения в инструменты добавочного капитала финансовых организаций | | | | | |
| 40 | Существенные вложения в инструменты добавочного капитала финансовых организаций | | | | | |
| 41 | Иные показатели, уменьшающие источники добавочного капитала, установленные Банком России, всего, в том числе: | 304.0000 | | X | 447.0000 | X |
| 41.1 | показатели, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала), всего, из них: | | | X | | X |
| 41.1.1 | нематериальные активы | 304.0000 | | X | 447.0000 | X |
| 41.1.2 | собственные акции (доли), приобретенные (выкупленные) у акционеров (участников) | | | X | | X |
| 41.1.3 | акции (доли) дочерних и зависимых финансовых организаций и кредитных организаций - резидентов | | | X | | X |
| 41.1.4 | источники собственных средств, для формирования которых использованы ненадлежащие активы | | | X | | X |
| 41.1.5 | отрицательная величина дополнительного капитала, сложившаяся в связи с корректировкой величины собственных средств (капитала) на сумму источников дополнительного капитала, сформированных с использованием инвесторами ненадлежащих активов | | | X | | X |
| 42 | Отрицательная величина дополнительного капитала | | | X | | X |
| 43 | Показатели, уменьшающие источники добавочного капитала, (сумма строк с 37 по 42) | 304.0000 | | X | 447.0000 | X |
| 44 | Добавочный капитал, итого (строка 36 - строка 43) | 207196.0000 | | X | 207053.0000 | X |
| 45 | Основной капитал, итого (строк 29 + строка 44) | 455653.0000 | | X | 336053.0000 | X |
| Источники дополнительного капитала | | | | | | |
| 46 | Инструменты дополнительного капитала и эмиссионный доход | 18286.0000 | | X | 10188.0000 | X |
| 47 | Инструменты дополнительного капитала, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | | X | | X |
| 48 | Инструменты дополнительного капитала дочерних организаций, принадлежащие третьим сторонам, всего, в том числе: | | | X | | X |

| | | | | | | | |
|---|--|-----|-------------|---|--|-------------|---|
| 49 | Инструменты дополнительного капитала дочерних организаций, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | | X | | | X |
| 50 | Резервы на возможные потери | | | X | | | X |
| 51 | Источники дополнительного капитала, итого (строка 46 + строка 47 + строка 48 + строка 50) | | 18286.0000 | X | | 10188.0000 | X |
| Показатели, уменьшающие источники дополнительного капитала | | | | | | | |
| 52 | Вложения в собственные инструменты дополнительного капитала | | | | | | |
| 53 | Взаимное перекрестное владение инструментами дополнительного капитала | | | | | | |
| 54 | Весуственные вложения в инструменты дополнительного капитала финансовых организаций | | | | | | |
| 55 | Существенные вложения в инструменты дополнительного капитала финансовых организаций | | | | | | |
| 56 | Иные показатели, уменьшающие источники дополнительного капитала, установленные Банком России, всего, в том числе: | | | X | | | X |
| 56.1 | показатели, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала), всего, из них: | | | X | | | X |
| 56.1.1 | источники капитала, для формирования которых инвесторами использованы ненадлежащие активы | | | X | | | X |
| 56.1.2 | просроченная дебиторская задолженность длительностью свыше 30 календарных дней | | | X | | | X |
| 56.1.3 | субординированные кредиты, предоставленные кредитным организациями - резидентам | | | X | | | X |
| 56.1.4 | превышение совокупной суммы кредитов, банковских гарантий и опручительств, предоставленных своими акционерам (участникам) и инсайдерам, над ее максимальным размером | | | X | | | X |
| 56.1.5 | вложения в сооружение и приобретение основных средств и материальных запасов | | | X | | | X |
| 56.1.6 | равница между действительной стоимостью доли, причитающейся вышедшим из общества участникам, и стоимостью, по которой доля была реализована другому участнику | | | X | | | X |
| 57 | Показатели, уменьшающие источники дополнительного капитала, итого (сумма строк с 52 по 56) | | | X | | | X |
| 58 | Дополнительный капитал, итого (строка 51 - строка 57) | | 18286.0000 | X | | 10188.0000 | X |
| 59 | Собственные средства (капитал), итого (строка 45 + строка 58) | | 473939.0000 | X | | 346241.0000 | X |
| 60 | Активы, аввешенные по уровню риска: | | X | X | | X | X |
| 60.1 | подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | | X | | | X |
| 60.2 | необходимые для определения достаточности базового капитала | | 762487.0000 | X | | 746895.0000 | X |
| 60.3 | необходимые для определения достаточности основного капитала | | 762487.0000 | X | | 746895.0000 | X |
| 60.4 | необходимые для определения достаточности собственных средств (капитала) | | 762487.0000 | X | | 746895.0000 | X |
| Показатели достаточности собственных средств (капитала) и надбавки к нормативам достаточности собственных средств (капитала), процент | | | | | | | |
| 61 | Достаточность базового капитала (строка 29 / строка 60.2) | 5.1 | 32.5851 | X | | 17.2715 | X |

| | | | | | | |
|--|--|-----|---------|---|---------|---|
| 62 | Достаточность основного капитала (строка 45 / строка 60.3) | 5.1 | 59.7588 | X | 44.9933 | X |
| 63 | Достаточность собственных средств (капитала) (строка 59 / строка 60.4) | 5.1 | 62.1570 | X | 46.3574 | X |
| 64 | Надбавки к нормативам достаточности собственных средств (капитала), всего, в том числе: | | | X | | X |
| 65 | надбавка поддержания достаточности капитала | | | X | | X |
| 66 | антициклическая надбавка | | | X | | X |
| 67 | надбавка за системную значимость банков | | | X | | X |
| 68 | Базовый капитал, доступный для направления на поддержание надбавок к нормативам достаточности собственных средств (капитала) | | | X | | X |
| Нормативы достаточности собственных средств (капитала), процент | | | | | | |
| 69 | Норматив достаточности базового капитала | | 4.5000 | X | 4.5000 | X |
| 70 | Норматив достаточности основного капитала | | 6.0000 | X | 6.0000 | X |
| 71 | Норматив достаточности собственных средств (капитала) | | 8.0000 | X | 8.0000 | X |
| Показатели, не превышающие установленные пороги существенности, для уменьшения источников капитала | | | | | | |
| 72 | Несущественные вложения в инструменты капитала финансовых организаций | | | X | | X |
| 73 | Существенные вложения в инструменты капитала внутренних моделей | | | X | | X |
| 74 | Права по обслуживанию ипотечных кредитов | | | X | | X |
| 75 | Отложенные налоговые активы, не зависящие от будущей прибыли | | | X | | X |
| Ограничения на включение резервов на возможные потери в расчет дополнительного капитала | | | | | | |
| 76 | Резервы на возможные потери, включаемые в расчет дополни- тельного капитала, в отношении позиций, для расчета кредитного риска по которым применяется стандартизован- ный подход | | | X | | X |
| 77 | Ограничения на включение в расчет дополнительного капи- тала сумм резервов на возможные потери при использовании стандартизованного подхода | | | X | | X |
| 78 | Резервы на возможные потери, включаемые в расчет дополни- тельного капитала, в отношении позиций, для расчета кредитного риска по которым применяется подход на основе внутренних моделей | | | X | | X |
| 79 | Ограничения на включение в расчет дополнительного капи- тала сумм резервов на возможные потери при использовании подхода на основе внутренних моделей | | | X | | X |
| Инструменты, подлежащие поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) (применяется с 1 января 2018 года по 1 января 2022 года) | | | | | | |
| 80 | Текущее ограничение на включение в состав источников базового капитала инструментов, подлежащих поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | | X | | X |
| 81 | Часть инструментов, не включенная в состав источников базового капитала вследствие ограничения | | | X | | X |
| 82 | Текущее ограничение на включение в состав источников дополнительного капитала инструментов, подлежащих поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | | X | | X |

| | | | | | | | | |
|----|--|--|--|---|--|--|--|---|
| 83 | Часть инструментов, не включенная в состав источников добавочного капитала вследствие ограничения | | | X | | | | X |
| 84 | Текущее ограничение на включение в состав источников дополнительного капитала инструментов, подлежащих поэтапному исключению из расчета собственных средств (капитала) | | | X | | | | X |
| 85 | Часть инструментов, не включенная в состав источников дополнительного капитала вследствие ограничения | | | X | | | | X |

Примечания.

Сведения о данных бухгалтерского баланса, являющихся источниками для составления раздела 1 Отчета, приведены в пояснениях N сопроводительной информации к отчетности по форме 0409808.

Раздел 2. Сведения о величине кредитного, операционного и рыночного рисков, покрываемых капиталом

Подраздел 2.1. Кредитный риск при применении стандартизированного подхода

| Номер строки | Наименование показателя | Номер пояснения | Данные на отчетную дату | | | Данные на начало отчетного года | | |
|--------------|--|-----------------|--|--|--|--|--|--|
| | | | Стоимость активов (инструментов), оцениваемых по стандартизированному подходу, тыс. руб. | Активы (инструменты) за вычетом сформированных резервов на возможные потери, тыс. руб. | Стоимость активов (инструментов), введенных по уровню риска, тыс. руб. | Стоимость активов (инструментов), оцениваемых по стандартизированному подходу, тыс. руб. | Активы (инструменты) за вычетом сформированных резервов на возможные потери, тыс. руб. | Стоимость активов (инструментов), введенных по уровню риска, тыс. руб. |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| 1 | Кредитный риск по активам, отраженным на балансовых счетах | | 801349 | 800656 | 94316 | 778271 | 777700 | 54534 |
| 1.1 | Активы с коэффициентом риска <1> 0 процентов, всего, из них: | | 385423 | 385423 | 0 | 385543 | 385543 | 0 |
| 1.1.1 | денежные средства и обязательные резервы, депонированные в Банке России | | 385423 | 385423 | 0 | 385543 | 385543 | 0 |
| 1.1.2 | кредитные требования и другие требования, обеспеченные гарантиями Российской Федерации, Минфина России и Банка России и залогом государственных долговых ценных бумаг Российской Федерации, Минфина России и Банка России | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1.1.3 | кредитные требования и другие требования к центральным банкам или правительствам стран, имеющих страновую оценки "0", "1" <2>, в том числе обеспеченные гарантиями этих стран и так далее | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1.2 | Активы с коэффициентом риска 20 процентов, всего, из них: | | 50804 | 50772 | 10154 | 98184 | 98182 | 19636 |
| 1.2.1 | кредитные требования и другие требования к субъектам Российской Федерации, муниципальным образованиям, организациям, обеспеченные гарантиями и залогом ценных бумаг субъектов Российской Федерации и муниципальных образований | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1.2.2 | кредитные требования и другие требования к центральным банкам или правительствам стран, имеющих страновую оценку "2", в том числе обеспеченные их гарантиями (залогом ценных бумаг) | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1.2.3 | кредитные требования и другие требования к кредитным организациям - резидентам стран со страновой оценкой "0", "1", имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности <3>, в том числе обеспеченные их гарантиями | | 50804 | 50772 | 10154 | 98184 | 98182 | 19636 |
| 1.3 | Активы с коэффициентом риска 50 процентов, всего, из них: | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

| | | | | | | | | |
|---------|--|---|--------|--------|-------|--------|--------|-------|
| 1.3.1 | кредитные требования и другие требования в иностранной валюте, обеспеченные гарантиями Российской Федерации, Минфина России и Банка России и залогом государственных долговых ценных бумаг Российской Федерации, Минфина России и Банка России, номинированных в иностранной валюте | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1.3.2 | кредитные требования и другие требования к центральным банкам или правительствам стран, имеющих страновую оценку "3", в том числе обеспеченные их гарантиями (залогом ценных бумаг) | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1.3.3 | кредитные требования и другие требования к кредитным организациям - резидентам стран со страновой оценкой "0", "1", не имеющих рейтингов долгосрочной кредитоспособности, и к кредитным организациям - резидентам стран со страновой оценкой "2", в том числе обеспеченные их гарантиями | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1.4 | Активы с коэффициентом риска 100%, всего, из них: | | 26652 | 25991 | 25991 | 22095 | 21526 | 21526 |
| 1.5 | Активы с коэффициентом риска 150 процентов - кредитные требования и другие требования к центральным банкам или правительствам стран, имеющих страновую оценку "7" | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2 | Активы с иными коэффициентами риска, всего, в том числе: | X | X | X | X | X | X | X |
| 2.1 | с пониженными коэффициентами риска, всего, в том числе: | | 330152 | 330152 | 53858 | 267449 | 267449 | 13372 |
| 2.1.1 | ипотечные ссуды с коэффициентом риска 50 процентов | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.1.2 | ипотечные ссуды с коэффициентом риска 70 процентов | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.1.3 | требования участников клиринга | | 330152 | 330152 | 53858 | 267449 | 267449 | 13372 |
| 2.2 | с повышенными коэффициентами риска, всего, в том числе: | | 3318 | 3318 | 4313 | 1620 | 1620 | 2106 |
| 2.2.1 | с коэффициентом риска 110 процентов | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.2.2 | с коэффициентом риска 130 процентов | | 3318 | 3318 | 4313 | 1620 | 1620 | 2106 |
| 2.2.3 | с коэффициентом риска 150 процентов | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.2.4 | с коэффициентом риска 250 процентов | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.2.5 | с коэффициентом риска 1250 процентов, всего, из них: | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.2.5.1 | по сделкам по уступке ипотечным агентам или специализированным обществам денежных требований, в том числе удостоверенных вкладами | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3 | Кредиты на потребительские цели, всего, в том числе: | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3.1 | с коэффициентом риска 110 процентов | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3.2 | с коэффициентом риска 140 процентов | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3.3 | с коэффициентом риска 170 процентов | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3.4 | с коэффициентом риска 200 процентов | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3.5 | с коэффициентом риска 300 процентов | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3.6 | с коэффициентом риска 600 процентов | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 4 | Кредитный риск по условным обязательствам кредитного характера, всего, в том числе: | | 5000 | 5000 | 0 | 5000 | 5000 | 0 |
| 4.1 | по финансовым инструментам с высоким риском | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 4.2 | по финансовым инструментам со средним риском | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 4.3 | по финансовым инструментам с низким риском | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 4.4 | по финансовым инструментам без риска | | 5000 | 5000 | 0 | 5000 | 5000 | 0 |

5 | Кредитный риск по производным финансовым инструментам | | | 0 | | | 0 | | | 0 | | | 0 |

- <1> Классификация активов по группам риска произведена в соответствии с пунктом 2.3 Инструкции Банка России № 139-И.
 <2> Страновые оценки указаны в соответствии с классификацией экспортных кредитных агентств, участвующих в Соглашении стран - членов Организации экономического сотрудничества и развития (ОЭСР) "Об основных принципах предоставления и использования экспортных кредитов, имеющих официальную поддержку" (информация о страновых оценках публикуется на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет" в разделе "Банковский надзор").
 <3> Рейтинги долгосрочной кредитоспособности кредитной организации определяются на основе рейтингов присвоенных международными рейтинговыми агентствами: Standard & Poor's, или Fitch Rating's, или Moody's Investors Service.

Подраздел 2.2. Кредитный риск при применении подхода на основе внутренних рейтингов

| Номер строки | Наименование показателя | Номер пояснения | Данные на отчетную дату | | | Данные на начало отчетного года | | |
|--------------|---|-----------------|--|--|---|--|--|---|
| | | | Стоимость активов (инструментов), оцениваемых по подходу на основе внутренних рейтингов, тыс. руб. | Активы (инструменты) за вычетом сформированных резервов на возможные потери, тыс. руб. | Совокупная величина кредитного риска, тыс. руб. | Стоимость активов (инструментов), оцениваемых по подходу на основе внутренних рейтингов, тыс. руб. | Активы (инструменты) за вычетом сформированных резервов на возможные потери, тыс. руб. | Совокупная величина кредитного риска, тыс. руб. |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| 1 | Кредитный риск, рассчитанный с использованием базового подхода на основе внутренних рейтингов | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2 | Кредитный риск, рассчитанный с использованием продвинутого подхода на основе внутренних рейтингов | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

Подраздел 2.3. Операционный риск

| Номер строки | Наименование показателя | Номер пояснения | Данные на отчетную дату | Данные на начало отчетного года |
|--------------|--|-----------------|-------------------------|---------------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 6 | Операционный риск, (тыс. руб.), всего, в том числе: | | 4250.0 | 4250.0 |
| 6.1 | Доходы для целей расчета капитала на покрытие операционного риска, всего, в том числе: | | 85003.0 | 85003.0 |
| 6.1.1 | чистые процентные доходы | | 47916.0 | 47916.0 |
| 6.1.2 | чистые непроцентные доходы | | 37087.0 | 37087.0 |
| 6.2 | Количество лет, предшествующих дате расчета величины операционного риска | | 3.0 | 3.0 |

Подраздел 2.4. Рыночный риск

| Номер строки | Наименование показателя | Номер пояснения | Данные на отчетную дату, тыс. руб. | Данные на начало отчетного года, тыс. руб. |
|--------------|---|-----------------|------------------------------------|--|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 7 | Совокупный рыночный риск, всего, в том числе: | | 615046.0 | 637129.9 |
| 7.1 | процентный риск, всего, в том числе: | | 47989.8 | 48885.3 |
| 7.1.1 | общий | | 10278.7 | 10964.6 |
| 7.1.2 | специальной | | 37711.1 | 37920.7 |
| 7.1.3 | гамма-риск и вега-риск по опционам, включаемым в расчет процентного риска | | 0.0 | 0.0 |
| 7.2 | фондовый риск, всего, | | 0.0 | 0.0 |

| | | | | |
|-------|--|--|--------|--------|
| | в том числе: | | | |
| 7.2.1 | общий | | 0.0 | 0.0 |
| 7.2.2 | специальный | | 0.0 | 0.0 |
| 7.2.3 | гама-риск и вега-риск по опционам, включаемым в расчет фондового риска | | 0.0 | 0.0 |
| 7.3 | валютный риск, всего в том числе: | | 1213.8 | 2085.1 |
| 7.3.1 | гама-риск и вега-риск по опционам, включаемым в расчет валютного риска | | 0.0 | 0.0 |
| 7.4 | товарный риск, всего, в том числе: | | 0.0 | 0.0 |
| 7.4.1 | основной товарный риск | | 0.0 | 0.0 |
| 7.4.2 | дополнительный товарный риск | | 0.0 | 0.0 |
| 7.4.3 | гама-риск и вега-риск по опционам, включаемым в расчет товарного риска | | 0.0 | 0.0 |

Раздел 3. Сведения о величине отчетных видов активов, условных обязательств кредитного характера и величине сформированных резервов на возможные потери

Подраздел 3.1. Информация о величине резервов на возможные потери по ссудам и иным активам

| Номер строки | Наименование показателя | Номер пояснения | Данные на отчетную дату, тыс. руб. | Прирост (+)/снижение (-) за отчетный период, тыс. руб. | Данные на начало отчетного года, тыс. руб. |
|--------------|---|-----------------|------------------------------------|--|--|
| | | | | | |
| 1 | фактически сформированные резервы на возможные потери, всего, в том числе: | 5.3 | 4306 | 2265 | 2041 |
| 1.1 | по ссудам, ссудной и приравненной к ней задолженности | | 260 | -15 | 275 |
| 1.2 | по иным балансовым активам, по которым существует риск понесения потерь, и прочим потерям | | 404 | 108 | 296 |
| 1.3 | по условным обязательствам кредитного характера и ценным бумагам, права на которые удостоверяются депозитариями, не удовлетворяющими критериям Банка России, отраженным на внебалансовых счетах | | 0 | 0 | 0 |
| 1.4 | под операции с резидентами офшорных зон | | 3642 | 2172 | 1470 |

Подраздел 3.2. Сведения об активах и условных обязательствах кредитного характера, классифицированных на основании решения уполномоченного органа управления кредитной организации в более высокую категорию качества, чем это вытекает из формализованных критериев оценки кредитного риска

| Номер строки | Наименование показателя | Сумма требований, тыс. руб. | Сформированный резерв на возможные потери | | | | Изменение объемов сформированных резервов | |
|--------------|---|-----------------------------|--|-----------|-----------------------------------|-----------|---|-----------|
| | | | в соответствии с минимальными требованиями, установленными Положением Банка России № 254-П и Положением Банка России № 283-П | | по решению уполномоченного органа | | процент | тыс. руб. |
| | | | процент | тыс. руб. | процент | тыс. руб. | | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| 1 | Требования к контрагентам, имеющие признаки, свидетельствующие о возможном отсутствии у них реальной деятельности, всего, в том числе: | 3392 | 21.00 | 712 | 3.00 | 102 | -18.00 | -610 |
| 1.1 | ссуды | 3392 | 21.00 | 712 | 3.00 | 102 | -18.00 | -610 |
| 2 | Реструктурированные ссуды | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 |

| | | | | | | | | |
|------|--|---|------|---|------|---|------|---|
| 13 | Ссуды, предоставленные заемщикам для погашения долга по ранее предоставленным ссудам | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 |
| 14 | Ссуды, использованные для предоставления займов третьим лицам и погашения ранее имевшихся обязательств других заемщиков, всего, в том числе: | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 |
| 14.1 | перед отчитывающейся кредитной организацией | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 |
| 15 | Ссуды, использованные для приобретения и (или) погашения эмиссионных ценных бумаг | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 |
| 16 | Ссуды, использованные для осуждения вложений в уставные капиталы других юридических лиц | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 |
| 17 | Ссуды, возникшие в результате прекращения ранее существовавших обязательств заемщика новацией или отступным | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 |
| 18 | Условные обязательства кредитного характера перед контрагентами, имеющими признаки, свидетельствующие о возможном отсутствии у них реальной деятельности | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | 0 |

Подраздел 3.3. Информация о ценах бумагах, права на которые удостоверяются депозитариями, резервы на возможные потери по которым формируются в соответствии с Указанием Банка России № 2732-У

тыс. руб.

| Номер строки | Наименование показателя | Балансовая стоимость ценных бумаг | Справедливая стоимость ценных бумаг | Сформированный резерв на возможные потери | | |
|--------------|--|-----------------------------------|-------------------------------------|--|--|-------|
| | | | | в соответствии с Положением Банка России № 283-П | в соответствии с Указанием Банка России № 2732-У | итого |
| | | | | 5 | 6 | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| 1. | Ценные бумаги, всего, в том числе: | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1.1 | права на которые удостоверяются иностранными депозитариями | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2. | Долевые ценные бумаги, всего, в том числе: | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.1 | права на которые удостоверяются иностранными депозитариями | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3. | Долговые ценные бумаги, всего, в том числе: | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3.1 | права на которые удостоверяются иностранными депозитариями | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

Раздел 4. Информация о показателе финансового рычага

| Номер строки | Наименование показателя | Номер пояснения | Значение на отчетную дату | Значение на дату, отстоящую на один квартал от отчетной | Значение на дату, отстоящую на два квартала от отчетной | Значение на дату, отстоящую на три квартала от отчетной |
|--------------|---|-----------------|---------------------------|---|---|---|
| | | | 01.04.2017 | 01.01.2017 | 01.10.2016 | 01.07.2016 |
| | | | 4 | 5 | 6 | 7 |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| 1 | Основной капитал, тыс.руб. | | 455653.0 | 336053.0 | 128822.0 | 128922.0 |
| 2 | Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета показателя финансового рычага, тыс.руб. | | 1492084.0 | 1451998.0 | 739302.0 | 358786.0 |
| 3 | Показатель финансового рычага по "Базелю III", процент | 6 | 30.5 | 23.1 | 17.4 | 35.9 |

Раздел 5. Основные характеристики инструментов капитала

| № п.п. / Наименование характеристики инструмента | Сокращенное фирменное наименование эмитента инструмента капитала | Идентификационный номер инструмента | Применимое право | Регулятивные условия | | | | | |
|---|---|--|---|---|---|--|--|--|---|
| | | | | Уровень капитала, в который инструмент включается в течение переходного периода "Бавель III" | Уровень капитала, в который инструмент включается после окончания переходного периода "Бавель III" | Уровень консолидации, на котором инструмент включается в капитал | Тип инструмента | Стоимость инструмента, включенная в расчет капитала | Номинальная стоимость инструмента |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | |
| 1 | ООО "ФФИИ Банк" | не применимо | 643 (РОССИЙСКИЙ ЗАКОН О АКЦИОНЕРНОМ ОБЩЕСТВЕ) | не применимо | базовый капитал | на индивидуальной осн ове | доли в уставном капитале | 178627 | 178627 |
| 2 | ООО ИК "Фридом Финанс" | не применимо | 643 (РОССИЙСКИЙ ЗАКОН О АКЦИОНЕРНОМ ОБЩЕСТВЕ) | не применимо | дополнительный капитал | на индивидуальной осн ове | субординированный кредит (депозит, займ) | 12500 | 12500 |
| 3 | ООО ИК "Фридом Финанс" | не применимо | 643 (РОССИЙСКИЙ ЗАКОН О АКЦИОНЕРНОМ ОБЩЕСТВЕ) | не применимо | дополнительный капитал | на индивидуальной осн ове | субординированный кредит (депозит, займ) | 60000 | 60000 |
| 4 | ООО ИК "Фридом Финанс" | не применимо | 643 (РОССИЙСКИЙ ЗАКОН О АКЦИОНЕРНОМ ОБЩЕСТВЕ) | не применимо | дополнительный капитал | на индивидуальной осн ове | субординированный кредит (депозит, займ) | 135000 | 135000 |

Раздел 5. Продолжение

| № п.п. / Наименование характеристики инструмента | Регулятивные условия | | | | | | | Проценты/дивиденды/купонный доход | | | | |
|---|--|---|---------------------------------------|----------------------------------|---|--|--|------------------------------------|--------------|---|---|---|
| | Классификация инструмента для целей бухгалтерского учета | Дата выпуска (привлечения, размещения) инструмента | Наличие срока по инструменту | Дата погашения инструмента | Наличие права досрочного выкупа (погашения) инструмента, согласованного с Банком России | Первоначальная дата (даты) возможной реализации права выкупа (погашения) инструмента, условия такого права и срока выкупа (погашения) | Последующая дата (даты) возможной реализации права досрочного вы- купа (погашения) инструмента | Тип ставки по инструменту | Ставка | Наличие условий инструмента превращения выплат дивидендов по обыкновенным акциям | Обязательность выплат дивидендов | Наличие условий, предусматривающих увеличение пла- тежей по инстру- менту или иных стимулов к досрочному вы- купу (погашению) инструмента |
| 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 | 20 | 21 | |
| 1 | акционерный капитал | 10.12.1990 | бессрочный | не применимо | нет | не применимо | не применимо | не применимо | не применимо | нет | полностью по у смотрению кред итной организа ции | нет |
| 2 | обязательство, учитываемое по балансовой стоимости | 27.06.2012 | бессрочный | не применимо | да | не применимо | не применимо | фиксированная ст авка | 3.00 | не применимо | полностью по у смотрению кред итной организа ции | нет |
| 3 | обязательство, учитываемое по балансовой стоимости | 19.12.2011 | бессрочный | не применимо | да | не применимо | не применимо | фиксированная ст авка | 3.00 | не применимо | полностью по у смотрению кред итной организа ции | нет |
| 4 | обязательство, учитываемое по балансовой стоимости | 01.12.2014 | бессрочный | не применимо | да | не применимо | не применимо | фиксированная ст авка | 3.00 | не применимо | полностью по у смотрению кред итной организа ции | нет |

Раздел 5. Продолжение

| № п.п. / Наименование характеристики инструмента | Проценты/дивиденды/купонный доход | | | | | | | | | | | |
|---|-----------------------------------|---------------------------------|---|---|-----------------------|-------------------------------|--|--|--|--|--|--|
| | Характер выплат | Конвертируемость инструмента | Условия, при на- ступлении которых осуществляется конвертация инструмента | Полная либо частичная конвертация | Ставка конвертации | Обязательность конвертации | Уровень капитала, в который инструмент конвертируется | Сокращенное фирменное наименование инструмента, в который конвертируется инструмент | Возможность списания инструмента на покрытие убытков | Условия, при на- ступлении которых осуществляется списание инструмента | Полное или частичное списание | Постоянное или временное списание |
| 22 | 23 | 24 | 25 | 26 | 27 | 28 | 29 | 30 | 31 | 32 | 33 | |

| | | | | | | | | | | | | |
|---|----------------|------------------|--|------------------------|--------------|--------------|-----------------|-----------------|-----|--|------------------------|--------------|
| 1 | некумулятивный | неконвертируемый | не применимо | не применимо | не применимо | не применимо | не применимо | не применимо | нет | не применимо | не применимо | не применимо |
| 2 | некумулятивный | конвертируемый | В случае наступления оснований (в том числе, в случае наступления одного из оснований)), предусмотренных абз. 5 и 6 п. 2) .3.4 Положения № 395-П | полностью или частично | не применимо | обязательная | базовый капитал | ООО "ФФИИ Банк" | да | В случае наступления оснований (в том числе, в случае наступления одного из оснований)), предусмотренных абз. 5 и 6 п. 2) .3.4 Положения № 395-П | полностью или частично | постоянный |
| 3 | некумулятивный | конвертируемый | В случае наступления оснований (в том числе, в случае наступления одного из оснований)), предусмотренных абз. 5 и 6 п. 2) .3.4 Положения № 395-П | полностью или частично | не применимо | обязательная | базовый капитал | ООО "ФФИИ Банк" | да | В случае наступления оснований (в том числе, в случае наступления одного из оснований)), предусмотренных абз. 5 и 6 п. 2) .3.4 Положения № 395-П | полностью или частично | постоянный |
| 4 | некумулятивный | конвертируемый | В случае наступления оснований (в том числе, в случае наступления одного из оснований)), предусмотренных абз. 5 и 6 п. 2) .3.4 Положения № 395-П | полностью или частично | не применимо | обязательная | базовый капитал | ООО "ФФИИ Банк" | да | В случае наступления оснований (в том числе, в случае наступления одного из оснований)), предусмотренных абз. 5 и 6 п. 2) .3.4 Положения № 395-П | полностью или частично | постоянный |

Раздел 5. Продолжение

| № п.п. / Наименование характеристики инструмента | Механизм восстановления | Субординированность инструмента | Соответствие требованиям Положения Банка России № 395-П и Положения Банка России № 509-П | Описание несоответствий |
|---|----------------------------|------------------------------------|--|-------------------------|
| | 34 | 35 | 36 | 37 |
| 1 | не применимо | не применимо | да | |
| 2 | не применимо | субординированный | да | |
| 3 | не применимо | субординированный | да | |
| 4 | не применимо | субординированный | да | |

Раздел "Справочно". Информация о движении резерва на возможные потери по ссудам, ссудной и приравненной к ней задолженности.

1. Формирование (доначисление) резерва в отчетном периоде (тыс. руб.),
всего 0, в том числе владение:

- 1.1. выдачи ссуд 0;
- 1.2. изменения качества ссуд 0;
- 1.3. изменения официального курса иностранной валюты по отношению к рублю,
установленного Банком России 0;
- 1.4. иных причин 0.

2. Восстановление (уменьшение) резерва в отчетном периоде (тыс. руб.),
всего 15, в том числе владение:

- 2.1. списания безнадежных ссуд 0;
- 2.2. погашения ссуд 15;
- 2.3. изменения качества ссуд 0;
- 2.4. изменения официального курса иностранной валюты по отношению к
рублю, установленного Банком России 0;

2.5. иных причин 0.

Председатель Правления
Главный бухгалтер

Начальник отдела отчетности
Телефон: 8 (495) 249-1162

16.05.2017



Салык Г.Г.

Дерюгина Т.В.

Пирожкин Е.В.