

Код лицензии по ОКATO	Код кредитной организации по ОКПО	Код кредитной организации (филиала) регистрационный номер (/порядковый номер)
45286585	42948629	3296

СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ, НОРМАТИВЕ ФИНАНСОВОГО РЫЧАГА
И НОРМАТИВЕ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ
(публикуемая форма)
на 01.01.2021 года

Полное или сокращенное фирменное наименование кредитной организации (головной кредитной организации банковской группы) Акционерное общество "Профессионал Банк" / АО "ПроБанк"
Адрес (место нахождения) кредитной организации (головной кредитной организации банковской группы) 127473, Москва, ул. Селезневская, д.15А 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	517959	482145	482002	481861	483125	
1a	Базовый капитал при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков без учета влияния переходных мер	547104	524003	523860	523719	524983	
2	Основной капитал	517959	482145	482002	481861	483125	
2a	Основной капитал при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков	547104	524003	523860	52719	524983	
3	Собственные средства (капитал)	1338484	1376616	1346666	1377505	1228566	
3a	Собственные средства (капитал) при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков	1367629	1412000	1399925	1446208	1270424	
АКТИВЫ, взвешенные по уровню риска, тыс.руб.							
4	Активы, взвешенные по уровню риска	2257126	2542875	2246862	2351317	2157041	
НОРМАТИВЫ ДОСТАТОЧНОСТИ КАПИТАЛА, процент							
5	Норматив достаточности базового капитала H1.1 (H20.1)	23.571	19.407	22.025	21.015	23.021	
5a	Норматив достаточности базового капитала при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков	24.898	21.091	23.938	22.841	25.016	
6	Норматив достаточности основного капитала H1.2 (H20.2)	23.571	19.407	22.025	21.015	23.021	
6a	Норматив достаточности основного капитала при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков	24.898	21.091	23.938	22.841	25.016	
7	Норматив достаточности собственных средств (капитала) H1.0 (H1цк, H1.3, H20.0)	59.3	54.136	59.935	58.584	56.956	
7a	Норматив достаточности собственных средств (капитала) при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков	60.592	55.528	62.306	61.506	58.897	
НАДБАВКИ К БАЗОВОМУ КАПИТАЛУ (в процентах от суммы активов, взвешенных по уровню риска), процент							
8	Надбавка поддержания достаточности капитала	2.5	2.5	2.5	2.5	2.25	
9	Антициклическая надбавка	0	0	0	0	0	
10	Надбавка за системную значимость	0	0	0	0	0	
11	Надбавки к нормативам достаточности собственных средств (капитала), всего (стр.8+стр.9+стр.10)	2.5	2.5	2.5	2.5	2.25	
12	Базовый капитал, доступный для направления на поддержание надбавок к нормативам достаточности собственных средств (капитала)	17.571	13.407	16.025	15.015	17.021	
НОРМАТИВ ФИНАНСОВОГО РЫЧАГА							
13	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета норматива финансового рычага, тыс.руб.	2905975	3059810	2898836	3022488	2962297	
14	Норматив финансового рычага (H1.4), банковской группы (H20.4), процент	17.8	15.8	16.6	15.9	16.3	
14a	Норматив финансового рычага при полном применении модели ожидаемых кредитных убытков, процент	18.8	17.1	18.1	17.3	17.7	
НОРМАТИВ КРАТКОСРОЧНОЙ ЛИКВИДНОСТИ							
15	Высоколиквидные активы, тыс.руб.						
16	Чистый ожидаемый отток денежных средств, тыс.руб.						
17	Норматив краткосрочной ликвидности H26 (H27), 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) H28 (H29), процент						
НОРМАТИВЫ, ОГРАНИЧИВАЮЩИЕ ОТДЕЛЬНЫЕ ВИДЫ РИСКОВ, процент							
21	Норматив мгновенной ликвидности H2	104.16	91.89	113.44	77.9	260.5	
22	Норматив текущей ликвидности H3	410.5	411.12	309.85	209.27	288.8	
23	Норматив долгосрочной ликвидности H4	31.49	28.95	27.45	27.28	31.9	

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		3033463
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 байковской группы		Неприменимо для отчетности кредитной организации как юридического лица
3	Поправка в части филиальных 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)		0
5	Поправка в части операций кредитования ценными бумагами		0
6	Поправка в части приведения к кредитному эквиваленту условных обязательств кредитного характера		56572
7	Прочие поправки		113429
8	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском с учетом поправок для расчета норматива финансового рычага, итого		2977546

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		2851084.00
2	Уменьшающая поправка на сумму показателей, принимаемых в уменьшение величины источников основного капитала		1681.00
3	Величина балансовых активов под риском с учетом поправки (разность строк 1 и 2), всего		2849403.00
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		0.00
6	Поправка на размер номинальной суммы предоставленного обеспечения по операциям с ПФИ, подлежащей списанию с баланса		неприменимо
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, итого (сумма строк 4, 5, 9 за вычетом строк 7, 8, 10)		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, 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		458211.00
18	Поправка в части применения коэффициентов кредитного эквивалента		401639.00
19	Величина риска по условным обязательствам кредитного характера с учетом поправок, итого (разность строк 17 и 18)		56572.00
Капитал и риски			
20	Основной капитал		517959.00
21	Величина балансовых активов и внебалансовых требований под риском для расчета норматива финансового рычага, всего (сумма строк 3, 11, 16, 19)		2905975.00
Норматив финансового рычага			
22	Норматив финансового рычага банка (Н1.4), байковской группы (Н20.4), процент (строка 20 : строка 21)		17.82

Раздел 3. Информация о расчете норматива краткосрочной ликвидности

Номер строки	Наименование показателя	Номер пояснения	Данные на 01.04.2020		Данные на 01.07.2020		Данные на 01.10.2020		Данные на 01.01.2021	
			величина требований (обязательств), тыс. руб.	взвешенная величина требований (обязательств), тыс. руб.	величина требований (обязательств), тыс. руб.	взвешенная величина требований (обязательств), тыс. руб.	величина требований (обязательств), тыс. руб.	взвешенная величина требований (обязательств), тыс. руб.	величина требований (обязательств), тыс. руб.	взвешенная величина требований (обязательств), тыс. руб.
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
ВЫСОКОКАЧЕСТВЕННЫЕ ЛИКВИДНЫЕ АКТИВЫ										
1	Высоколиквидные активы (ВЛА) с учетом дополнительных требований (активов), включенных в числитель Н26 (Н27)		X		X		X		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		X		X		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 долговым 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 условным обязательствам									
16	Суммарный отток денежных средств, итого (строка 2 + строка 5 + строка 9 + строка 10 + строка 14 + строка 15)		X		X		X		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 учетом ограничений на максимальную величину ВЛА-2Б и ВЛА-2		X		X		X		X	
22	Чистый ожидаемый отток денежных средств		X		X		X		X	
23	Норматив краткосрочной ликвидности банковской группы (Н2Б), кредитной организации (Н27), процент		X		X		X		X	

Председатель Правления

Главный бухгалтер

Главный бухгалтер
Телефон: (499) 973-14-14

21.04.2021
Контрольная сумма:
 ☉.813 Раздел 1 : 4062
 ☉.813 Раздел 2.1 : 4678
 ☉.813 Раздел 2.2 : 17983
 ☉.813 Раздел 3 : 34973

Версия файла описателей (.PAK) : 09.12.2020

