

Раскрытие информации в отношении обремененных и необремененных активов за 2019 год.



Форма А – Обремененные и необремененные активы

	Учётная стоимость обременённых активов		Справедливая стоимость обременённых активов		Учётная стоимость необременённых активов		Справедливая стоимость необременённых активов	
	010	в т.ч. номинально соответствующие EHQLA и HQLA 030	040	в т.ч. номинально соответствующие EHQLA и HQLA 050	060	в т.ч. EHQLA и HQLA 080	090	в т.ч. EHQLA и HQLA 100
010 Активы учреждения, предоставляющего отчеты	11 422 137				472 500 909			
030 Инструменты собственного капитала	0				5 856 354			
040 Долговые ценные бумаги	3 139 572		3 139 572		94 589 337		94 589 337	
050 в т.ч.: облигации с покрытием								
060 в т.ч.: ценные бумаги, обеспеченные активами								
070 в т.ч.: эмитированные центральными правительствами	104 358		104 358		63 889 490		63 889 490	
080 в т.ч.: эмитированные финансовыми обществами					13 592 613		13 592 613	
090 в т.ч.: эмитированные нефинансовыми обществами	2 517 546		2 517 546		17 222 643		17 222 643	
120 Прочие активы	8 282 565				372 055 218			
121 в т.ч.: ...								

Форма В – Полученное обеспечение

	Справедливая стоимость полученного обремененного обеспечения или собственные эмитированные долговые ценные бумаги	Необремененные		
		Справедливая стоимость полученного обеспечения, доступного для обременения, или эмитированных собственных долговых ценных бумаг	в т.ч. EHQLA и HQLA	
	10	в т.ч. номинально соответствующие EHQLA и HQLA 30	40	60
130 Обеспечение, полученное учреждением, предоставляющим отчеты	260 612 634			
140 Займы до востребования				
150 Инструменты собственного капитала				
160 Долговые ценные бумаги				
170 в т.ч.: облигации с покрытием				
180 в т.ч.: ценные бумаги, обеспеченные активами				
190 в т.ч.: эмитированные центральными правительствами				
200 в т.ч.: эмитированные финансовыми обществами				
210 в т.ч.: эмитированные нефинансовыми обществами				
220 Займы и авансы, за исключением займов до востребования	260 612 634			
230 Прочее полученное обеспечение				
231 в т.ч.: ...				
240 Эмитированные собственные долговые ценные бумаги, которые не являются собственными облигациями с покрытием или ценными бумагами, обеспеченными активами				
241 Собственные облигации с покрытием или ценные бумаги, обеспеченные активами, которые эмитированы, но еще не заложены				
250 АКТИВЫ, ПОЛУЧЕННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ И ЭМИТИРОВАННЫЕ СОБСТВЕННЫЕ ДОЛГОВЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ ИТОГО	272 034 771			

Форма С – Источники обременения

	Совпадающие обязательства, возможные обязательства или ссуженные ценные бумаги	Активы, полученное обеспечение и эмитированные собственные долговые ценные бумаги, которые не являются облигациями с покрытием и обремененными ценными бумагами, обеспеченными активами
	010	030
010 Учетная стоимость выбранных финансовых обязательств		
011 в т.ч.: ...		

Форма D – Дополнительная описательная информация

Раскрытие информации в отношении обремененных и необремененных активов подготовлено согласно требованиям Делегированной регулы Европейской комиссии (ЕС) 2017/2295. В целях разглашения информации используется медианное значение рискованной сделки – медиана соответствующих кварталов за последние двенадцать месяцев, которая рассчитана методом интерполяции. На балансе имеется небольшая доля обремененных банковских активов. Банк реализует политику управления активами и пассивами, которая позволяет обеспечивать кратковременные требования клиентов и поддерживать высокий уровень ликвидности. В бланке А в столбце 060 «Балансовая стоимость необремененных активов» в позицию 120 включены позиции, которые Банк не считает доступными для обременения в рамках обычной коммерческой деятельности. Большая часть из них – нематериальные активы, в том числе нематериальная стоимость, отложенные налоговые активы, основные средства, производные активы.