

Информация о принимаемых рисках, процедурах их оценки, управления рисками и капиталом
в АКБ "НООСФЕРА" (АО) на 1 октября 2018г.

Таблица 2.1.

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

тыс. руб.

Номер	Наименование показателя	Требования (обязательства), взвешенные по уровню риска		Минимальный размер капитала, необходимый для покрытия рисков
		данные на отчетную дату	данные на предыдущую отчетную дату	
1	2	3	4	5
1	Кредитный риск (за исключением кредитного риска контрагента), всего, в том числе:			
2	при применении стандартизированного подхода			
3	при применении ПВР			
4	Кредитный риск контрагента, всего, в том числе:			
5	при применении стандартизированного подхода			
6	при применении метода, основанного на 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, в том числе:			
13	при применении ПВР, основанного на рейтингах			
14	при применении ПВР с использованием формулы надзора			
15	при применении стандартизированного подхода			

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

Таблица 4.1.1.

Информация о ценных бумагах, права на которые удостоверяются депозитариями,
резервы на возможные потери по которым формируются в соответствии с Указанием
Банка России от 17 ноября 2011 года № 2732-У "Об особенностях формирования
кредитными организациями резерва на возможные потери по операциям с цennыми
бумагами, права на которые удостоверяются депозитариями"

тыс. руб.

Номер	Наименование показателя	Балансовая стоимость ценных бумаг	Справедли- вая стоимость ценных бумаг	Сформированный резерв		
				в соответ- ствии с Положением Банка России № 283-П	в соответ- ствии с Указанием Банка России № 2732-У	итого
1	2	3	4	5	6	7
1	Ценные бумаги, всего, в том числе:					
1.1	права на которые удостоверяются иностранными депозитариями					
2	Долевые ценные в том числе:					
2.1	права на которые удостоверяются иностранными депозитариями					

8	Условные обязательства кредитного характера перед контрагентами, имеющими признаки, свидетельствующие о возможном отсутствии у них реальной деятельности								
---	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--	--	--	--	--

Таблица 4.8.

Изменения величины требований (обязательств), взвешенных по уровню риска,
при применении ПВР

тыс. руб.

Номер	Наименование статьи	Величина требований
1	2	3
1	Требования (обязательства), взвешенные по уровню риска, на конец предыдущего отчетного периода	
2	Стоимость требований (обязательств)	
3	Качество требований (обязательств)	
4	Обновления модели	
5	Методология и регулирование	
6	Приобретение и продажа	
7	Изменения валютных курсов	
8	Прочее	
9	Требования (обязательства), взвешенные по уровню риска, на конец отчетного периода	

Таблица 5.7.

Изменения величины, подверженной кредитному риску контрагента,
взвешенной по уровню риска, при применении метода, основанного
на внутренних моделях, в целях расчета величины, подверженной риску дефолта

тыс. руб.

Номер	Наименование статьи	Величина, подверженная
1	2	3
1	Величина, взвешенная по уровню риска, на конец предыдущего отчетного периода	
2	Стоимость кредитного требования	
3	Кредитное качество контрагентов	
4	Обновления модели (только для метода, основанного на внутренних моделях)	
5	Методология и политика (только для метода, основанного на внутренних моделях)	
6	Приобретения и продажа	
7	Изменения валютных курсов	
8	Прочее	
9	Величина, взвешенная по уровню риска, на конец отчетного периода	

Таблица 7.2.

Изменения величины требований (обязательств), взвешенных по уровню риска, при применении подходов на основе внутренней модели в целях оценки требований к капиталу в отношении рыночного риска

тыс. руб.

Но- мер	Наименование статьи	Модель расчета стоимости под риском	Модель расчета стоимости под риском, оцененная по данным за кризисный период	Модель оценки дополнительного требования к капиталу на покрытие рыночного риска	Всеобъемлющая оценка рыночного риска	Прочее	Всего требований (обязательств), взвешенных по уровню риска
1	2	3	4	5	6	7	8
1	Требования (обязательства), взвешенные по уровню риска, на конец предыдущего отчетного квартала						
2	Изменения уровня риска						
3	Обновления модели						
4	Методология и регулирование						
5	Приобретение и продажа						
6	Изменение валютных курсов						
7	Прочее						
8	Требования (обязательства), взвешенные по уровню риска, на конец отчетного квартала						

- Справочно: 1. Информация по Таблице 1.1. Указания Банка России N 4482-У от 07.08.2017г. представлена в сооставе пояснительной информации к годовой (промежуточной) бухгалтерской (финансовой) отчетности АКБ «НООСФЕРА» (АО) за 9 месяцев 2018 года в пункте 6.5.
 2. Информация по Таблице 3.3. Указания Банка России N 4482-У от 07.08.2017г. предоставлена в сооставе пояснительной информации к годовой (промежуточной) бухгалтерской (финансовой) отчетности АКБ «НООСФЕРА» (АО) за 9 месяцев 2018 года в пункте 8.
 3. Информация по Таблице 3.4. Указания Банка России N 4482-У от 07.08.2017г. предоставлена в сооставе пояснительной информации к годовой (промежуточной) бухгалтерской (финансовой) отчетности АКБ «НООСФЕРА» (АО) за 9 месяцев 2018 года в пункте 12.

"07" ноября 2018 года