



Формуляр для предоставления информации о сумме подверженностей, взвешенных с учетом риска (RWA)

№ п/п		Сумма подверженностей, взвешенных с учетом риска (RWA)		Минимальные требования капитала
		Отчетный квартал, 30.09.2021	Квартал, предшествующий отчетному, 30.06.2021	Отчетный квартал, 30.09.2021
1	Кредитный риск (исключая кредитный риск контрагента)	9 244 376 100	8 209 322 674	924 437 610
2	Из которого: стандартизованный подход	9 244 376 100	8 209 322 674	924 437 610
3	Из которого: основной подход IRB (FIRB)	X	X	X
4	Из которого: продвинутый подход IRB (AIRB)	X	X	X
5	Из которого капитальные ценные бумаги из подхода IRB согласно простому подходу с учетом риска или AMI	X	X	X
6	Кредитный риск контрагента	0	0	0
7	Из которого: метод переоценки по рынку	0	0	0
8	Из которого: метод первоначальной подверженности	0	0	0
9	Из которого: стандартизованный метод	0	0	0
10	Из которого: метод внутренней модели (MMI)	X	X	X
11	Из которых: величина подверженности риску для взносов в фонд гарантирования СРС	X	X	X
12	Из которых: корректировка кредитной оценки (CVA)	0	0	0
13	Риск расчета	0	0	0
14	Подверженности от секьюритизации в банковском портфеле (согласно потолку)	X	X	X
15	Из которого: подход IRB	X	X	X
16	Из которого: метод нормативной формулы IRB (SFA)	X	X	X
17	Из которого: подход, основанный на внутренней оценке (IAA)	X	X	X
18	Из которого: стандартизованный подход	0	0	0
19	Рыночный риск	307 042 660	235 176 510	30 704 266
20	Из которого: стандартизованный подход	307 042 660	235 176 510	30 704 266
21	Из которого: AMI	X	X	X
22	Операционный риск	1 642 222 259	1 642 222 259	164 222 226
23	Из которого: основной подход	1 642 222 259	1 642 222 259	164 222 226
24	Из которого: стандартизованный подход	0	0	0
25	Из которого: продвинутый подход оценки	X	X	X
26	Значения ниже порогов для вычета (для которых весовой коэффициент риска составляет 250%) после применения весового коэффициента риска 250%.	0	0	0
27	Итого	11 193 641 019	10 086 721 443	1 119 364 102