

## ИНФОРМАЦИЯ

о принимаемых рисках, процедурах их оценки, управления рисками и капиталом

Акционерный Коммерческий Банк «Классик Эконом Банк»

(Закрытое Акционерное Общество)

по состоянию на 01.07.2018 год.

### Раздел I. Информация о структуре собственных средств (капитала)

Собственные средства (капитал) АКБ «КЭБ» (ЗАО) по состоянию на 01.07.2018 года составил 422 563 тыс.руб. Уровень достаточности собственных средств (капитала) – 43,3972 процентов.

В отчетном периоде требования к уровню собственных средств (капиталу) были выполнены.

Соотношение основного капитала АКБ «КЭБ» (ЗАО) (299 612 тыс.руб.) и собственных средств (капитала) АКБ «КЭБ» (ЗАО) (422 563 тыс.руб.) составило 70,90 процентов.

Данный раздел сформирован на основании разделов 1 и 5 формы 0409808, раскрываемой в составе форм годовой (промежуточной) бухгалтерской (финансовой) отчетности.

Информация об уровне достаточности капитала отражена в следующей таблице с приведением данных бухгалтерского баланса, являющихся источниками для его составления

Таблица 1.1.

Сопоставление данных бухгалтерского баланса, являющихся источниками для составления раздела 1 отчета об уровне достаточности капитала, с элементами собственных средств (капитала)

Номер	Бухгалтерский баланс			Отчет об уровне достаточности капитала (раздел 1 формы 0409808)		
	Наименование статьи	Номер строки	Данные на отчетную дату, тыс. руб.	Наименование показателя	Номер строки	Данные на отчетную дату, тыс. руб.
1	2	3	4	5	6	7
1	"Средства акционеров (участников)", "Эмиссионный доход", всего, в том числе:	24, 26	313104	X	X	X
1.1	отнесенные в базовый капитал	X	211394	"Уставный капитал и эмиссионный доход, всего, в том числе сформированный:"	1	211394

1.2	отнесенные в добавочный капитал	X	Данные отсутствуют	"Инструменты добавочного капитала и эмиссионный доход, классифицируемые как капитал"	31	Данные отсутствуют
1.3	отнесенные в дополнительный капитал	X	101710	"Инструменты дополнительного капитала и эмиссионный доход"	46	107979
2	"Средства кредитных организаций", "Средства клиентов, не являющихся кредитными организациями", всего, в том числе:	15, 16	362889	X	X	X
2.1	субординированные кредиты, отнесенные в добавочный капитал	X	Данные отсутствуют	"Инструменты добавочного капитала и эмиссионный доход, классифицируемые как обязательства"	32	Данные отсутствуют
2.2	субординированные кредиты, отнесенные в дополнительный капитал	X	X	"Инструменты дополнительного капитала и эмиссионный доход", всего	46	107979
2.2.1		X		из них: субординированные кредиты	X	Данные отсутствуют
3	"Основные средства, нематериальные активы и материальные запасы", всего, в том числе:	10	43471	X	X	X
3.1	нематериальные активы, уменьшающие базовый капитал всего, из них:	X	Данные отсутствуют	X	X	X
3.1.1	деловая репутация (гудвил) за вычетом отложенных налоговых обязательств (строка 5.1 настоящей таблицы)	X	Данные отсутствуют	"Деловая репутация (гудвил) за вычетом отложенных налоговых обязательств" (строка 5.1 настоящей таблицы)	8	Данные отсутствуют
3.1.2	иные нематериальные активы (кроме деловой репутации) за вычетом отложенных налоговых обязательств (строка 5.2 настоящей таблицы)	X	Данные отсутствуют	"Нематериальные активы (кроме деловой репутации и сумм прав по обслуживанию ипотечных кредитов) за вычетом"	9	Данные отсутствуют

				отложенных налоговых обязательств" (строка 5.2 настоящей таблицы)		
3.2	нематериальные активы, уменьшающие добавочный капитал	X	Данные отсутствуют	"нематериальные активы", подлежащие поэтапному исключению	41.1.1	Данные отсутствуют
4	"Отложенный налоговый актив", всего, в том числе:	9	Данные отсутствуют	X	X	X
4.1	отложенные налоговые активы, зависящие от будущей прибыли	X	Данные отсутствуют	"Отложенные налоговые активы, зависящие от будущей прибыли"	10	Данные отсутствуют
4.2	отложенные налоговые активы, не зависящие от будущей прибыли	X	Данные отсутствуют	"Отложенные налоговые активы, не зависящие от будущей прибыли"	21	Данные отсутствуют
5	"Отложенные налоговые обязательства", всего, из них:	20	Данные отсутствуют	X	X	X
5.1	уменьшающие деловую репутацию (строка 3.1.1 настоящей таблицы)	X	Данные отсутствуют	X	X	
5.2	уменьшающие иные нематериальные активы (строка 3.1.2 настоящей таблицы)	X	Данные отсутствуют	X	X	
6	"Собственные акции (доли), выкупленные у акционеров (участников)", всего, в том числе:	25	Данные отсутствуют	X	X	X
6.1	уменьшающие базовый капитал	X	Данные отсутствуют	"Вложения в собственные акции (доли)"	16	Данные отсутствуют
6.2	уменьшающие добавочный капитал	X	Данные отсутствуют	"Вложения в собственные инструменты добавочного капитала", "собственные акции (доли), приобретенные (выкупленные) у акционеров (участников)", подлежащие поэтапному исключению	37, 41.1.2	Данные отсутствуют

6.3	уменьшающие дополнительный капитал	X	Данные отсутствуют	"Вложения в собственные инструменты дополнительного капитала"	52	Данные отсутствуют
7	"Средства в кредитных организациях", "Чистая ссудная задолженность", "Чистые вложения в ценные бумаги и другие финансовые активы, имеющиеся в наличии для продажи", "Чистые вложения в ценные бумаги, удерживаемые до погашения", всего, в том числе:	3, 5, 6, 7	359087	X	X	X
7.1	несущественные вложения в базовый капитал финансовых организаций	X	Данные отсутствуют	"Несущественные вложения в инструменты базового капитала финансовых организаций"	18	Данные отсутствуют
7.2	существенные вложения в базовый капитал финансовых организаций	X	Данные отсутствуют	"Существенные вложения в инструменты базового капитала финансовых организаций"	19	Данные отсутствуют
7.3	несущественные вложения в добавочный капитал финансовых организаций	X	Данные отсутствуют	"Несущественные вложения в инструменты добавочного капитала финансовых организаций"	39	Данные отсутствуют
7.4	существенные вложения в добавочный капитал финансовых организаций	X	Данные отсутствуют	"Существенные вложения в инструменты добавочного капитала финансовых организаций"	40	Данные отсутствуют
7.5	несущественные вложения в дополнительный капитал финансовых организаций	X	Данные отсутствуют	"Несущественные вложения в инструменты дополнительного капитала финансовых организаций"	54	Данные отсутствуют
7.6	существенные вложения в дополнительный капитал финансовых организаций	X	Данные отсутствуют	"Существенные вложения в инструменты дополнительного капитала финансовых организаций"	55	Данные отсутствуют

**Раздел II. Информация о системе управления рисками**

**Таблица 2.1.**

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

Номер	Наименование показателя	Требования (обязательства), взвешенные по уровню риска		тыс. руб.
		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:	848 575	799 466	67 886
2	при применении стандартизированного подхода	848 575	799 466	67 886
3	при применении ПБР	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
4	Кредитный риск контрагента, всего, в том числе:	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
5	при применении стандартизированного подхода	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
6	при применении метода, основанного на внутренних моделях	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
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	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
8	Вложения в акции, паи инвестиционных и иных фондов - сквозной подход	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
9	Вложения в акции, паи инвестиционных и иных фондов - мандатный подход	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
10	Вложения в акции, паи инвестиционных и иных фондов - резервный подход	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют

11	Риск расчетов	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
12	Риск секьюритизации (за исключением риска секьюритизации торгового портфеля), всего, в том числе:	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
13	при применении ПВР, основанного на рейтингах	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
14	при применении ПВР с использованием формулы надзора	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
15	при применении стандартизированного подхода	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
16	Рыночный риск, всего, в том числе:	17 473	35 727	1 398
17	при применении стандартизированного подхода	17 473	35 727	1 398
18	при применении метода, основанного на внутренних моделях			
19	Операционный риск, всего, в том числе:	73 163	61 925	5 853
20	при применении базового индикативного подхода	73 163	61 925	5 853
21	при применении стандартизированного подхода	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
22	при применении продвинутого (усовершенствованного) подхода	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
23	Активы (требования) ниже порога существенности для вычета из собственных средств (капитала), взвешенные с коэффициентом 250%	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
24	Минимальный размер корректировки на предельный размер снижения кредитного и операционного риска при применении ПВР и продвинутого (усовершенствованного) подхода	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
25	Итого (сумма строк 1 + 4 + 7 + 8 + 9 + 10 + 11 + 12 + 16 + 19 + 23 + 24)	897 118	744 638	71 769

**Раздел III. Сопоставление данных годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности кредитной организации (консолидированной финансовой отчетности банковской группы) и данных отчетности, представляемой кредитной организацией (банковской группой) в Банк России в целях надзора**

**Таблица 3.3.**

**Сведения об обремененных и необремененных активах**

По состоянию на 01.04.2018 года в АКБ «КЭБ» (ЗАО) отсутствовали обремененные активы.

тыс. руб.

Номер	Наименование показателя	Балансовая стоимость обремененных активов		Балансовая стоимость необремененных активов	
		всего	в том числе по обязательствам перед Банком России	всего	в том числе пригодных для предоставления в качестве обеспечения Банку России
1	2	3	4	5	6
1	Всего активов, в том числе:	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	741 170	Данные отсутствуют
2	долевые ценные бумаги, всего, в том числе:	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
2.1	кредитных организаций	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
2.2	юридических лиц, не являющихся кредитными организациями	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3	долговые ценные бумаги, всего, в том числе:	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3.1	кредитных организаций, всего, в том числе:	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3.1.1	имеющих рейтинги долгосрочной кредитоспособности	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют

3.1.2	не имеющих рейтингов долгосрочной кредитоспособности	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3.2	юридических лиц, не являющихся кредитными организациями, всего, в том числе:	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3.2.1	имеющих рейтинги долгосрочной кредитоспособности	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3.2.2	не имеющих рейтингов долгосрочной кредитоспособности	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
4	Средства на корреспондентских счетах в кредитных организациях	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	12 712	Данные отсутствуют
5	Межбанковские кредиты (депозиты)	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
6	Ссуды, предоставленные юридическим лицам, не являющимся кредитными организациями	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	424 148	Данные отсутствуют
7	Ссуды, предоставленные физическим лицам	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	177 952	Данные отсутствуют
8	Основные средства	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	123 560	Данные отсутствуют
9	Прочие активы	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	2 798	Данные отсутствуют

Таблица 3.4.

### Информация об операциях с контрагентами – нерезидентами

По состоянию на 01.04.2018 года операций с контрагентами – нерезидентами в АКБ «КЭБ» (ЗАО) не проводились.

тыс. руб.			
Номер	Наименование показателя	Данные на отчетную дату	Данные на начало отчетного года
1	2	3	4
1	Средства на корреспондентских счетах в банках-нерезидентах	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
2	Ссуды, предоставленные контрагентам-нерезидентам, всего, в том числе:	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
2.1	банкам-нерезидентам	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
2.2	юридическим лицам - нерезидентам, не являющимся кредитными организациями	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
2.3	физическим лицам - нерезидентам	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3	Долговые ценные бумаги эмитентов - нерезидентов, всего, в том числе:	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3.1	имеющих рейтинги долгосрочной кредитоспособности	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3.2	не имеющих рейтингов долгосрочной кредитоспособности	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
4	Средства нерезидентов, всего, в том числе:	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
4.1	банков-нерезидентов	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
4.2	юридических лиц - нерезидентов, не являющихся кредитными организациями	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
4.3	физических лиц - нерезидентов	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют

Раздел IV. Кредитный риск

Глава 2. Общая информация о величине кредитного риска

Таблица 4.1

Информация об активах кредитной организации (банковской группы), подверженных кредитному риску

Номер	Наименование показателя	Балансовая стоимость кредитных требований (обязательств), находящихся в состоянии дефолта	Балансовая стоимость кредитных требований (обязательств), просроченных более чем на 90 дней	Балансовая стоимость кредитных требований (обязательств), не находящихся в состоянии дефолта	Балансовая стоимость кредитных требований (обязательств), просроченных более чем на 90 дней	Резервы на возможные потери	тыс. руб.
							Чистая балансовая стоимость активов (гр.3(4)+ гр.5(6)- гр.7)
1	2	3	4	5	6	7	8
1	Кредиты	-	42 225	-	50 272	92 308	189
2	Долговые ценные бумаги	-		-	-	-	-
3	Внебалансовые позиции	-	60	-	-	60	0
4	Итого	-	42 285	-	50 272	92 368	189

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 N 2732-У "Об особенностях формирования кредитными организациями резерва на возможные потери по операциям с ценными бумагами, права на которые удостоверяются депозитариями"**

По состоянию на 01.04.2018 года операций с ценными бумагами права на которые удостоверяются депозитариями в АКБ «КЭБ» (ЗАО) не проводились.

тыс. руб.

Номер	Наименование показателя	Балансовая стоимость ценных бумаг	Справедливая стоимость ценных бумаг	Сформированный резерв на возможные потери		
				в соответствии с Положением Банка России N 283-П	в соответствии с Указанием Банка России N 2732-У	Итого
1	2	3	4	5	6	7
1	Ценные бумаги, всего, в том числе:	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
1.1	права на которые удостоверяются иностранными депозитариями	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
2	Долевые ценные бумаги, всего, в том числе:	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
2.1	права на которые удостоверяются иностранными депозитариями	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3	Долговые ценные бумаги, всего, в том числе:	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3.1	права на которые удостоверяются иностранными депозитариями	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют





Таблица 4.2

**Изменения балансовой стоимости ссудной задолженности и долговых ценных бумаг,  
находящихся в состоянии дефолта**

тыс. руб.

Номер	Наименование статьи	Балансовая стоимость ссудной задолженности и долговых ценных бумаг
1	2	3
1	Ссудная задолженность и долговые ценные бумаги, находящиеся в состоянии дефолта на конец предыдущего отчетного периода (ссудная задолженность и долговые ценные бумаги, просроченные более чем на 90 дней на конец предыдущего отчетного периода)	53 913
2	Ссудная задолженность и долговые ценные бумаги, признанные находящимися в состоянии дефолта в течение отчетного периода (ссудная задолженность и долговые ценные бумаги, просроченные более чем на 90 дней в течение отчетного периода)	42 225
3	Ссудная задолженность и долговые ценные бумаги, признанные не находящимися в состоянии дефолта в течение отчетного периода, числящиеся на начало отчетного периода активами, находящимися в состоянии дефолта (ссудная задолженность и долговые ценные бумаги, признанные не просроченными в течение отчетного периода, числящиеся на начало отчетного периода активами, просроченными более чем на 90 дней)	11 688
4	Ссудная задолженность и долговые ценные бумаги, списанные с баланса	15 277
5	Прочие изменения балансовой стоимости ссудной задолженности и долговых ценных бумаг в отчетном периоде	-
6	Ссудная задолженность и долговые ценные бумаги, находящиеся в состоянии дефолта на конец отчетного периода (ссудная задолженность и долговые ценные бумаги, просроченные более чем на 90 дней на конец отчетного периода) (ст. 1 + ст.2 - ст.3 - ст.4 ± ст. 5)	69 173

### Глава 3. Методы снижения кредитного риска

Таблица 4.3

#### Методы снижения кредитного риска

тыс. руб.

Номер	Наименование статьи	Балансовая стоимость необеспеченных кредитных требований	Балансовая стоимость обеспеченных кредитных требований		Балансовая стоимость кредитных требований, обеспеченных финансовым и гарантиями		Балансовая стоимость кредитных требований, обеспеченных кредитными ПФИ	
			всего	в том числе обеспеченная часть	всего	в том числе обеспеченная часть	всего	в том числе обеспеченная часть
1	2	3	4	5	6	7	8	9
1	Кредиты	6 724	332 612	332 612	-	-	-	-
2	Долговые ценные бумаги	-	-	-	-	-	-	-
3	Всего, из них:	6 724	332 612	332 612	-	-	-	-
4	Находящихся в состоянии дефолта (просроченные более чем на 90 дней)	4	0	0	-	-	-	-

Таблица 4.4

**Кредитный риск при применении стандартизированного подхода и эффективность от применения инструментов снижения кредитного риска в целях определения требований к капиталу**

Номер	Наименование портфеля кредитных требований (обязательств)	Стоимость кредитных требований (обязательств), тыс. руб.				Требования (обязательства), взвешенные по уровню риска, тыс. руб.	Коэффициент концентрации (удельный вес) кредитного риска в разрезе портфелей требований (обязательств), процент
		без учета применения конверсионного коэффициента и инструментов снижения кредитного риска		с учетом применения конверсионного коэффициента и инструментов снижения кредитного риска			
		балансовая	внебалансовая	балансовая	внебалансовая		
1	2	3	4	5	6	7	8
1	Центральные банки или правительства стран, в том числе обеспеченные гарантиями этих стран	-	-	-	-	-	-
2	Субъекты Российской Федерации, муниципальные образования, иные организации	-	-	-	-	-	-
3	Банки развития	-	-	-	-	-	-
4	Кредитные организации (кроме банков развития)	19 819	-	-	-	-	-
5	Профессиональные участники рынка ценных бумаг, осуществляющие брокерскую и дилерскую деятельность	-	-	-	-	-	-
6	Юридические лица	-	-	-	-	-	-
7	Розничные заемщики (контрагенты)	592 968	0	-	-	610 781	68
8	Требования (обязательства), обеспеченные жилой недвижимостью	98 124	-	-	-	104 250	12

9	Требования (обязательства), обеспеченные коммерческой недвижимостью	148 358	-	-	-	178 902	19
10	Вложения в акции	-	-	-	-	-	-
11	Просроченные требования (обязательства)	0	0	-	-	-	-
12	Требования (обязательства) с повышенными коэффициентами риска	7 273	-	-	-	7 740	1
13	Прочие	-		-	-	-	-
14	Всего	846 723		-	-	901 673	100





Раздел V. Кредитный риск контрагента

Таблица 5.1

Информация о подходах, применяемых в целях оценки кредитного риска контрагента

тыс. руб.

Номер	Наименование подхода	Текущий кредитный риск	Потенциальный кредитный риск	Эффективная ожидаемая величина риска	Коэффициент, используемый для расчета величины, подверженной риску	Величина, подверженная риску, после применения инструментов снижения кредитного риска	Величина кредитного риска контрагента
1	2	3	4	5	6	7	8
1	Стандартизированный подход (для ПФИ)	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Х	1.4	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
2	Метод, основанный на внутренних моделях (для ПФИ и операций финансирования, обеспеченных ценными бумагами)	Х	Х	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3	Упрощенный стандартизированный подход при применении инструментов снижения кредитного риска (для операций финансирования, обеспеченных ценными бумагами)	Х	Х	Х	Х	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
4	Всеобъемлющий стандартизированный подход при применении инструментов снижения кредитного риска (для	Х	Х	Х	Х	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют

	операций финансирования, обеспеченных ценными бумагами)							
5	Стоимость под риском (VaR) (для операций финансирования, обеспеченных ценными бумагами)	X	X	X	X		Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
6	Итого	X	X	X	X		X	Данные отсутствуют

Таблица 5.5

Структура обеспечения, используемого в целях определения требований к капиталу в отношении кредитного риска контрагента

Номер	Наименование статьи	Справедливая стоимость обеспечения, используемого в сделках с ПФИ				Справедливая стоимость обеспечения, используемого в операциях финансирования, обеспеченных ценными бумагами	
		полученное обособленное	не обособленное	предоставленное обособленное	не обособленное	полученное	предоставленое
1	2	3	4	5	6	7	8
1	Долговые ценные бумаги, выпущенные банком - кредитором, в закладе	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
2	Золото в слитках	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3	Долговые ценные бумаги Российской Федерации	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют

тыс. руб.



Таблица 5.6.

## Информация о сделках с кредитными ПФИ

тыс. руб.			
Номер	Наименование статьи	ПФИ приобретенные	ПФИ проданные
1	2	3	4
1	Номинальная стоимость		
2	Кредитные дефолтные свопы на базовый актив (кроме индексов)	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
3	Кредитные дефолтные свопы на индексы	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
4	Свопы на совокупный доход	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
5	Кредитные опционы	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
6	Прочие кредитные ПФИ	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
7	Итого номинальная стоимость ПФИ	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
8	Справедливая стоимость		
9	Положительная справедливая стоимость (актив)	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют
10	Отрицательная справедливая стоимость (обязательство)	Данные отсутствуют	Данные отсутствуют

## Раздел VI. Риск секьюритизации

АКБ «КЭБ» (ЗАО) не осуществляет сделок секьюритизации.

## Раздел VII. Рыночный риск

Таблица 7.1.

## Величина рыночного риска при применении стандартизированного подхода

тыс. руб.		
Номер	Наименование статьи	Величина, взвешенная по уровню риска
1	2	3
Финансовые инструменты (кроме опционов):		
1	процентный риск (общий или специальный)	

