

Приложение 1
к Правилам представления отчетности о выполнении
пруденциальных нормативов банками второго уровня

Отчет о выполнении пруденциальных нормативов на «01» апреля 2011 года
ДО АО Банк ВТБ (Казахстан)

(краткое наименование банка)

(в тысячах тенге)

№	Наименование	Сумма
1	2	3
1	Уставный капитал	9 000 000
2	Дополнительный капитал	-
3	Нераспределенный чистый доход прошлых лет	-
4	Фонды, резервы, сформированные за счет дохода прошлых лет	-
5	Нематериальные активы	-
6	Убыток текущего года	- 183 662
7	Убыток прошлых лет	- 711 227
8	Итого промежуточный капитал 1 уровня	8 105 111
9	Бессрочные финансовые инструменты, включаемые в расчет капитала 1 уровня	-
10	Итого капитал 1 уровня	8 105 111
11	Нераспределенный чистый доход текущего года	-
12	Переоценка основных средств и ценных бумаг	-
13	Общие резервы (провизии) в сумме, не превышающей 1,25 процентов суммы активов, взвешенных с учетом кредитного риска за минусом неинвестированных остатков средств, принятых на условиях кастодиального договора	-
14	Бессрочные финансовые инструменты, включаемые в расчет капитала 2 уровня	-
15	Субординированный долг банка за минусом выкупленного собственного субординированного долга банка, включаемый в капитал 2 уровня, в соответствии с пунктами 11 и 12 Инструкции о нормативных значениях и методике расчетов пруденциальных нормативов для банков второго уровня, утвержденной постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 30 сентября 2005 года № 358 (зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов Республики Казахстан 7 ноября 2005 года под № 3924) (далее - Инструкция), часть которая не превышает не превышает 50% капитала первого уровня	-
16	Итого капитал 2 уровня	-
17	Субординированный долг 3 уровня в соответствии с пунктом 14 Инструкции	-
18	Субординированный долг банка за минусом выкупленного собственного субординированного долга банка, включаемый в капитал 2 уровня, в соответствии с пунктами 11 и 12 Инструкцией, часть которая не включена в капитал 2 уровня	-
19	Итого капитал 3 уровня	-
20	Часть капитала 1 уровня, предназначенного для покрытия рыночного риска	-
21	Итого капитал 3 уровня, включаемый в собственный капитал	-
22	Инвестиции банка в акции и субординированный долг юридического лица в соответствии с пунктом 3 Инструкции	-
23	Итого собственный капитал	8 105 111
24	Активы	23 512 811
25	Итого активы, взвешенные с учетом кредитного риска	13 649 614
26	Неинвестированные остатки средств, принятых на условиях кастодиального договора	-
27	Итого условные и возможные обязательства, взвешенные с учетом кредитного риска	2 554 982
28	Итого производные финансовые инструменты, взвешенные с учетом кредитного риска	-
29	Специфический процентный риск	-
30	Общий процентный риск	20 925
31	Итого рыночный риск, связанный с изменением ставки вознаграждения	20 925
32	Специфический риск	-
33	Общий риск	-
34	Итого рыночный риск, связанный с изменением рыночной стоимости акций и рыночной стоимости производных финансовых инструментов, базовым активом которых являются акции или индексы на акции	-
35	Итого рыночный риск, связанный с изменением обменного курса иностранных валют (рыночной стоимости драгоценных металлов)	3 895
36	Средняя величина годового валового дохода в соответствии с пунктом 31 Инструкции	58 777
37	Операционный риск	58 777
38	Активы и условные и возможные требования и обязательства, рассчитанные с учетом рыночного риска	248 200
39	Коэффициент достаточности собственного капитала (k1-1) (k1-1>0.050)	0,345
39-1	Коэффициент достаточности собственного капитала (k1-2) (k1-2>0.050)	0,491
40	Коэффициент достаточности собственного капитала (k2) (k2>0.100)	0,491
41	Совокупная задолженность одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, не связанных с банком особыми отношениями по любому виду обязательств перед банком согласно главе 3 Инструкции	1 854 296

42	Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика, не связанного с банком особыми отношениями - (к3.1) (к3.1<0.250)	0,229
43	Совокупная задолженность одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, связанных с банком особыми отношениями по любому виду обязательств перед банком согласно главе 3 Инструкции	-
44	Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика (группы заемщиков), связанного с банком особыми отношениями - (к3) (к3<0.100)	0,000
45	Сумма рисков по всем заемщикам, связанным с банком особыми отношениями	-
46	Коэффициент суммы рисков по заемщикам, связанным с банком особыми отношениями (Ро) (Ро<1.000)	0,000
47	Максимальная сумма бланкового займа, необеспеченных условных обязательств перед заемщиком либо за заемщика в пользу третьих лиц, по которым у банка могут возникнуть требования к заемщику в течение текущего и двух последующих месяцев, а также обязательств нерезидентов Республики Казахстан, зарегистрированных или являющихся гражданами оффшорных зон, за исключением требований к резидентам Республики Казахстан с рейтингом агентства Standard & Poor's или рейтингом аналогичного уровня агентств Fitch или Moody's Investors Service (далее - другие рейтинговые агентства) не более чем на один пункт ниже суверенного рейтинга Республики Казахстан и нерезидентов, имеющих рейтинг не ниже «А» агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, за исключением нерезидентов с рейтингом не ниже «А» агентства Standard & Poor's или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, в отношении одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков	654 522
48	Коэффициент максимального размера бланкового кредита (Бк) (Бк<0.100)	0,081
49	Совокупная сумма рисков банка на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10 процентов от собственного капитала банка	8 428 107
50	Коэффициент совокупной суммы рисков на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10% от собственного капитала (Рк) (Рк<5.000)	1,040
50-1	Совокупная сумма секьюритизированных кредитов, переданных специальной финансовой компании Акционерного общества «Фонд стрессовых активов»	-
50-2	Коэффициент максимальной суммы секьюритизированных кредитов, переданных специальной финансовой компании Акционерного общества «Фонд стрессовых активов»	-
51	Высоколиквидные активы в соответствии с пунктами 43, 44-2 Инструкции	11 500 841
51-1	Обязательства до востребования	2 106 260
51-2	Коэффициент текущей ликвидности k4 (k4>0.300)	5,460
52	Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до семи дней включительно в соответствии с пунктами 44-1, 44-2 Инструкции	552 800
53	Коэффициент ликвидности k4-1 (k4-1>1.000)	20,805
54	Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно, включая высоколиквидные активы, в соответствии с пунктами 44, 44-2 Инструкции	13 254 754
55	Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно в соответствии с пунктами 44-1, 44-2 Инструкции	1 494 534
56	Коэффициент ликвидности k4-2 (k4-2>0.900)	8,869
57	Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, включая высоколиквидные активы, в соответствии с пунктами 44, 44-2 Инструкции	14 773 995
58	Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно в соответствии с пунктами 44-1, 44-2 Инструкции	1 510 826
59	Коэффициент ликвидности k4-3 (k4-3>0.800)	9,779
60	Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-4	1 510 602
	1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности):	1 510 602
	2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки:	-
	RUB	-
61	Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-4	543 267
	1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности):	543 267
	2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки:	-
	RUB	-
62	Коэффициент срочной валютной ликвидности k4-4 (k4-4>1.000)	2,781
	1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности):	2,781
	2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки:	-
	RUB	-
63	Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-5	1 525 490

	1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности):	1,525,490
	2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей RUB	-
64	Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-5	1,295,425
	1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности):	1,295,425
	2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей RUB	-
65	Коэффициент срочной валютной ликвидности k4-5 (k4-5>0.900)	1.178
	1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности):	1.178
	2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей RUB	-
66	Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-6	1,525,490
	1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности):	1,525,490
	2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей RUB	-
67	Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-6	1,295,425
	1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности):	1,295,425
	2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей RUB	-
68	Коэффициент срочной валютной ликвидности k4-6 (k4-6>0.800)	1.178
	1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности):	1.178
	2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей RUB	-
69	Инвестиции банка в основные средства и другие нефинансовые активы	1,029,958
70	Коэффициент максимального размера инвестиций банка - (k6) (k6<0.500)	0.127
71	Краткосрочные обязательства перед нерезидентами	229,444
72	Коэффициент максимального лимита краткосрочных обязательств перед нерезидентами k7 (k7<1.000)	0.028
73	Обязательства перед нерезидентами, включаемые в расчет коэффициента k8	238,461
74	Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан (k8) (k8<3.000)	0.029
75	Обязательства перед нерезидентами и долговые ценные бумаги, включаемые в расчет коэффициента k9	238,461
76	Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан (k9) (k9<5.000)	0.029

Председатель Правления: Гусаров С.Н.

(фамилия и имя)

(подпись)

Главный бухгалтер: Лавренко А.В.

(фамилия и имя)

(подпись)

Исполнитель: Главный специалист Маринкина Т.Н.

(должность, фамилия и имя)

т. 330 43 05

(номер телефона)

Дата подписания отчета «11» апреля 2011 года.

Место для печати