

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

Отчет о выполнении пруденциальных нормативов на «01» июля 2011 года
ДО АО Банк ВТБ (Казахстан)
(краткое наименование банка)

(в тысячах)

| № | Наименование | Сумма |
|-------------|--|-------------------|
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Уставный капитал | 20 000 000 |
| 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 | 471 917 |
| 7 | Убыток прошлых лет | 705 686 |
| 8 | Итого промежуточный капитал 1 уровня | 18 822 397 |
| 9 | Бессрочные финансовые инструменты, включаемые в расчет капитала 1 уровня | - |
| 10 | Итого капитал 1 уровня | 18 822 397 |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | 18 822 397 |
| 24 | Активы | 40 620 857 |
| 25 | Итого активы, взвешенные с учетом кредитного риска | 17 991 312 |
| 26 | Неинвестированные остатки средств, принятых на условиях кастодиального договора | - |
| 27 | Итого условные и возможные обязательства, взвешенные с учетом кредитного риска | 2 839 455 |
| 28 | Итого производные финансовые инструменты, взвешенные с учетом кредитного риска | - |
| 29 | Специфический процентный риск | 12 377 |
| 30 | Общий процентный риск | 26 645 |
| 31 | Итого рыночный риск, связанный с изменением ставки вознаграждения | 39 022 |
| 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 | - |
| 35 | Итого рыночный риск, связанный с изменением обменного курса иностранных валют (рыночной стоимости драгоценных металлов) | 7 340 |
| 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 | 463 620 |
| 39 | Коэффициент достаточности собственного капитала (k1-1) (k1-1>0.050) | 0,463 |
| 39-1 | Коэффициент достаточности собственного капитала (k1-2) (k1-2>0.050) | 0,881 |
| 40 | Коэффициент достаточности собственного капитала (k2) (k2>0.100) | 0,881 |
| 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 | 2 136 490 |
| 42 | Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика, не связанного с банком особыми отношениями - (k3.1) (k3.1<0.250) | 0,114 |
| 43 | Совокупная задолженность одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, связанных с банком особыми отношениями по любому виду обязательств перед банком согласно главе 3 Инструкции | 3 650 |

| | | |
|------|---|------------------|
| 44 | Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика (группы заемщиков), связанного с банком особыми отношениями - (к3) (к3<0.100) | 0,0002 |
| 45 | Сумма рисков по всем заемщикам, связанным с банком особыми отношениями | 4 251 |
| 46 | Коэффициент суммы рисков по заемщикам, связанным с банком особыми отношениями (Ро) (Ро<1.000) | 0,0002 |
| 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 | 836 685 |
| 48 | Коэффициент максимального размера бланкового кредита (Бк) (Бк<0.100) | 0,044 |
| 49 | Совокупная сумма рисков банка на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10 процентов от собственного капитала банка | 4 271 346 |
| 50 | Коэффициент совокупной суммы рисков на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10% от собственного капитала (Рк) (Рк<5.000) | 0,227 |
| 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 | 14 752 773 |
| 51-1 | Обязательства до востребования | 4 971 998 |
| 51-2 | Коэффициент текущей ликвидности k4 (k4>0.300) | 2,967 |
| 52 | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до семи дней включительно в соответствии с пунктами 44-1, 44-2 Инструкции | 779 724 |
| 53 | Коэффициент ликвидности k4-1 (k4-1>1.000) | 18,921 |
| 54 | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно, включая высоколиквидные активы, в соответствии с пунктами 44, 44-2 Инструкции | 17 395 602 |
| 55 | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно в соответствии с пунктами 44-1, 44-2 Инструкции | 1 188 726 |
| 56 | Коэффициент ликвидности k4-2 (k4-2>0.900) | 14,634 |
| 57 | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, включая высоколиквидные активы, в соответствии с пунктами 44, 44-2 Инструкции | 19 625 663 |
| 58 | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно в соответствии с пунктами 44-1, 44-2 Инструкции | 1 230 794 |
| 59 | Коэффициент ликвидности k4-3 (k4-3>0.800) | 15,946 |
| 60 | Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-4 | 698 354 |
| | 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): | 698 354 |
| | 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 RUB | - |
| | | - |
| 61 | Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-4 | 565 |
| | 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): | 565 |
| | 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 RUB | - |
| | | - |
| 62 | Коэффициент срочной валютной ликвидности k4-4 (k4-4>1.000) | 1 236,025 |
| | 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): | 1 236,025 |
| | 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 RUB | - |
| | | - |
| 63 | Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-5 | 719 136 |

| | | |
|----|--|----------------|
| | 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): | 719,136 |
| | 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 | 4,346 |
| | 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): | 4,346 |
| | 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) | 165.471 |
| | 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): | 165.471 |
| | 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 | 719,136 |
| | 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): | 719,136 |
| | 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 | 6,004 |
| | 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): | 6,004 |
| | 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) | 119.776 |
| | 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): | 119.776 |
| | 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 | 1,441,389 |
| 70 | Коэффициент максимального размера инвестиций банка - (k6) (k6<0.500) | 0.077 |
| 71 | Краткосрочные обязательства перед нерезидентами | 612,941 |
| 72 | Коэффициент максимального лимита краткосрочных обязательств перед нерезидентами k7 (k7<1.000) | 0.033 |
| 73 | Обязательства перед нерезидентами, включаемые в расчет коэффициента k8 | 630,300 |
| 74 | Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан (k8) (k8<3.000) | 0.033 |
| 75 | Обязательства перед нерезидентами и долговые ценные бумаги, включаемые в расчет коэффициента k9 | 630,300 |
| 76 | Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан (k9) (k9<5.000) | 0.033 |

Председатель Правления **Тусаров С.Н.**

(фамилия и имя)

(подпись)

Главный бухгалтер **Лаврентьева А.В.**

(фамилия и имя)

(подпись)

Исполнитель: Главный специалист **Маришвили А.М.**
(должность, фамилия и имя)

(подпись)

т. 330 43 05
(номер телефона)

Дата подписания отчета «11» июля 2011 года.

Место для печати

(подписи)