

Отчет о выполнении пруденциальных нормативов
на «01» января 2011 года
АО "КазИнвестБанк"

с учетом заключительных оборотов

(в тысячах тенге)

№	Наименование	Сумма
1	2	
1	Уставный капитал	8,433,769
2	Дополнительный капитал	696
3	Нераспределенный чистый доход прошлых лет	237,101
4	Фонды, резервы, сформированные за счет дохода прошлых лет	1,233,201
5	Нематериальные активы	724
6	Убыток текущего года	483,935
7	Убыток прошлых лет	
8	Итого промежуточный капитал 1 уровня	9,420,108
10	Итого капитал 1 уровня	9,420,108
11	Нераспределенный чистый доход текущего года	0
12	Переоценка основных средств и ценных бумаг	194
13	Общие резервы (провизии) в сумме, не превышающей 1,25% суммы активов, взвешенных с учетом кредитного риска за минусом неинвестированных остатков средств, принятых на условиях кастодиального договора	0
14	Бессрочные финансовые инструменты, а также привилегированные акции, 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 (далее - Инструкция), часть которая не превышает не превышает 50% капитала первого уровня	2,600,415
16	Итого капитал 2 уровня	2,600,609
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	0
20	Часть капитала 1-го уровня, предназначенного для покрытия рыночного риска	
21	Итого капитал 3 уровня, включаемый в собственный капитал	0
22	Инвестиции банка в акции и субординированный долг юридического лица в соответствии с пунктом 3 Инструкции	0
23	Итого собственный капитал	12,020,717
24	Активы	64,076,417
25	Итого активы, взвешенные с учетом кредитного риска	53,720,210
26	Неинвестированные остатки средств, принятых на условиях кастодиального договора	0
27	Итого условные и возможные обязательства, взвешенные с учетом кредитного риска	1,830,969
28	Итого производные финансовые инструменты, взвешенные с учетом кредитного риска	0
29	Специфический процентный риск	0
30	Общий процентный риск	998
31	Итого рыночный риск, связанный с изменением ставки вознаграждения	998
32	Специфический риск	0
33	Общий риск	0
34	Итого рыночный риск, связанный с изменением рыночной стоимости акций и рыночной стоимости производных финансовых инструментов, базовым активом которых являются акции или индекс на акции	0
35	Итого рыночный риск, связанный с изменением обменного курса иностранных валют (рыночной стоимости драгоценных металлов)	35,833

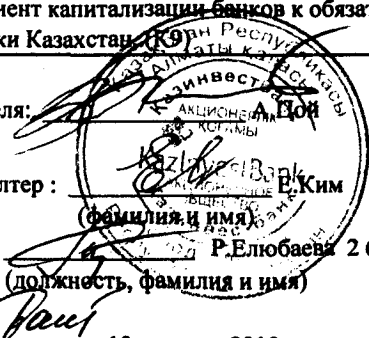
36	Средняя величина годового валового дохода в соответствии с пунктом 31 Инструкции	2,205,787
37	Операционный риск	2,196,964
38	Активы и условные и возможные требования и обязательства, рассчитанные с учетом рыночного риска	305,701
39	Коэффициент достаточности собственного капитала k1-1	0.147
39-1	Коэффициент достаточности собственного капитала k1-2	0.162
40	Коэффициент достаточности собственного капитала k2	0.207
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	2,914,376
42	Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика, не связанного с банком особыми отношениями - K3'	0.242
43	Совокупная задолженность одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, связанных с банком особыми отношениями по любому виду обязательств перед банком согласно главе 3 Инструкции	1,006,911
44	Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика (группы заемщиков), связанного с банком особыми отношениями - K3	0.084
45	Сумма рисков по всем заемщикам, связанным с банком особыми отношениями	1,113,581
46	Коэффициент суммы рисков по заемщикам, связанным с банком особыми отношениями (Po)	0.093
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 Moodys 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	627,988
48	Коэффициент максимального размера бланкового кредита (Бк)	0.052
49	Совокупная сумма рисков банка на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10 процентов от собственного капитала банка	36,430,876
50	Коэффициент совокупной суммы рисков на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10% от собственного капитала (Рк)	3.031
51	Высоколиквидные активы в соответствии с пунктами 43, 44-2 Инструкции	14,891,932
51-1	Обязательства до востребования	21,342,534
51-2	Коэффициент текущей ликвидности k-4	0.698
52	Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до семи дней включительно в соответствии с пунктами 44-1, 44-2 Инструкции	2,606,180
53	Коэффициент ликвидности k4-1	5.714
54	Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до одного месяца, включая высоколиквидные активы, в соответствии с пунктами 44, 44-2 Инструкции	25,240,293
55	Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно, в соответствии с пунктами 44-1, 44-2 Инструкции	6,790,022
56	Коэффициент ликвидности k4-2	3.717
57	Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, включая высоколиквидные активы, в соответствии с пунктами 44, 44-2 Инструкции	33,304,057
58	Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, в соответствии с пунктами 44-1, 44-2 Инструкции	11,205,258
59	Коэффициент ликвидности k4-3	2.972

60	Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-4	
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):	3,954,447
61	Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-4	
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):	592,859
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):	6.670
63	Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-5	
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):	6,530,614
64	Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-5	
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):	1,729,826
65	Коэффициент срочной валютной ликвидности k4-5	
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):	3.775
66	Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-6	
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):	8,178,536
67	Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-6	
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):	4,250,987
68	Коэффициент срочной валютной ликвидности k4-6	
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):	1.924
69	Инвестиции банка в основные средства и другие нефинансовые активы	1,411,989
70	Коэффициент максимального размера инвестиций банка - K6	0.117
71	Краткосрочные обязательства перед нерезидентами, K7	604,827
72	Коэффициент максимального лимита краткосрочных обязательств перед нерезидентами, K7	0.050
73	Обязательства перед нерезидентами, включаемые в расчет коэффициента K8	283,476
74	Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан, (K8)	0.024
75	Обязательства перед нерезидентами и долговые ценные бумаги	283,476
76	Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан	0.024

Зам.Председателя:

Главный бухгалтер:

Исполнитель:



(подпись)

Р.Елюбаева

(подпись)

(номер телефона)

Дата подписания отчета «13» января 2010 года

Место для печати