

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

(в тысячах тенге)

№	Наименование	Сумма
1	2	
1	Уставный капитал	8,904,964
2	Дополнительный капитал	696
3	Нераспределенный чистый доход прошлых лет	0
4	Фонды, резервы, сформированные за счет дохода прошлых лет	1,233,201
5	Нематериальные активы	609
6	Убыток текущего года	0
7	Убыток прошлых лет	2,461,316
8	Итого промежуточный капитал 1 уровня	7,676,936
9	Бессрочные финансовые инструменты, а также привилегированные акции, включаемые в расчет капитала 1 уровня	
10	Итого капитал 1 уровня	7,676,936
11	Нераспределенный чистый доход текущего года	111,081
12	Переоценка основных средств и ценных бумаг	0
13	Общие резервы (проезвизии) 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 сентбря 2005 года № 358 (далее - Инструкция), часть которая не превышает не превышает 50% капитала первого уровня	2,934,359
16	Итого капитал 2 уровня	3,045,440
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	10,722,376
24	Активы	67,502,972
25	Итого активы, взвешенные с учетом кредитного риска	57,375,963
26	Неинвестированные остатки средств, принятых на условиях кастодиального договора	0
27	Итого условные и возможные обязательства, взвешенные с учетом кредитного риска	2,180,656
28	Итого производные финансовые инструменты, взвешенные с учетом кредитного риска	205
29	Специфический процентный риск	0
30	Общий процентный риск	0
31	Итого рыночный риск, связанный с изменением ставки вознаграждения	0
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)	4,705
36	Средняя величина годового валового дохода в соответствии с пунктом 31 Инструкции	2,313,944
37	Операционный риск	2,304,688
38	Активы и условные и возможные требования и обязательства, рассчитанные с учетом рыночного риска	39,052
39	Коэффициент достаточности собственного капитала k1-1	0.114
39-1	Коэффициент достаточности собственного капитала k1-2	0.124
40	Коэффициент достаточности собственного капитала k2	0.173
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	2,550,614
42	Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика, не связанного с банком особыми отношениями - K3'	0.238
43	Совокупная задолженность одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, связанных с банком особыми отношениями по любому виду обязательств перед банком согласно главе 3 Инструкции	985,722
44	Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика (группы заемщиков), связанного с банком особыми отношениями - K3	0.092
45	Сумма рисков по всем заемщикам, связанным с банком особыми отношениями	1,071,533
46	Коэффициент суммы рисков по заемщикам, связанным с банком особыми отношениями (Po)	0.100
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	453,017
48	Коэффициент максимального размера бланкового кредита (Бк)	0.042
49	Совокупная сумма рисков банка на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10 процентов от собственного капитала банка	31,150,349
50	Коэффициент совокупной суммы рисков на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10% от собственного капитала (Pк)	2.905
51	Высоколиквидные активы в соответствии с пунктами 43, 44-2 Инструкции	16,995,049
51-1	Обязательства до востребования	16,853,779
51-2	Коэффициент текущей ликвидности k-4	1.008
52	Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до семи дней включительно в соответствии с пунктами 44-1, 44-2 Инструкции	3,148,837
53	Коэффициент ликвидности k4-1	5.397
54	Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до одного месяца, включая высоколиквидные активы, в соответствии с пунктами 44, 44-2 Инструкции	29,308,948
55	Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно, в соответствии с пунктами 44-1, 44-2 Инструкции	8,697,557
56	Коэффициент ликвидности k4-2	3.370
57	Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, включая высоколиквидные активы, в соответствии с пунктами 44, 44-2 Инструкции	34,465,888
58	Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, в соответствии с пунктами 44-1, 44-2 Инструкции	14,002,311
59	Коэффициент ликвидности k4-3	2.461
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):	8,986,791
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):	2,147,651
62	Коэффициент 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):	4.184
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):	12,032,771
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):	6,474,046
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):	1.859
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):	12,807,841
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):	7,889,851
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):	1.623
69	Инвестиции банка в основные средства и другие нефинансовые активы	1,361,583
70	Коэффициент максимального размера инвестиций банка - K6	0.127
71	Краткосрочные обязательства перед нерезидентами, K7	1,270,934
72	Коэффициент максимального лимита краткосрочных обязательств перед нерезидентами, K7	0.119
73	Обязательства перед нерезидентами, включаемые в расчет коэффициента K8	1,020,205
74	Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан, (K8)	0.095
75	Обязательства перед нерезидентами и долговые ценные бумаги	1,020,205
76	Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан, (K9)	0.095

Председатель Правления: _____

И.О. Главного бухгалтера: _____ А. Нурпейсова
(фамилия и имя) (подпись)

Исполнитель: _____ Р. Елюбаева
(должность, фамилия и имя) (подпись) (номер телефона)

Дата подписания отчета «11» июля 2011 года

Место для печати