

Отчет о выполнении пруденциальных нормативов
на 01/ 06/ 2017 года

(тыс.тенге)

| № п/п компонента | Наименование | Сумма |
|------------------|--|-------------|
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Минимальный размер собственного капитала | 10 000 000 |
| 2 | Собственный капитал | 156 249 615 |
| 3 | Капитал первого уровня | 144 668 221 |
| 4 | Основной капитал как сумма: | 144 668 221 |
| 5 | Оплаченные простые акции | 51 500 001 |
| 6 | Дополнительный оплаченный капитал | |
| 7 | Нераспределенная чистая прибыль прошлых лет | 55 931 621 |
| 8 | Нераспределенная чистая прибыль текущего года | 6 255 786 |
| 9 | Накопленный раскрытый резерв | 47 162 702 |
| 10 | Резервы по переоценке основных средств и стоимости финансовых активов, имеющихся в наличии для продажи | -4 137 450 |
| 11 | за минусом | |
| 11.1 | Собственные выкупленные простые акции | |
| 11.2 | Нематериальные активы, включая гудвилл | 12 044 439 |
| 11.3 | Убыток прошлых лет | |
| 11.4 | Убыток текущего года | |
| 11.5 | Отложенный налоговый актив за минусом отложенных налоговых обязательств, за исключением части отложенных налоговых активов, признанных в отношении вычитаемых временных разниц | |
| 11.6 | Резервы по прочей переоценке | |
| 11.7 | Доходы от продаж, связанных с транзакциями по секьюритизации активов. К таким доходам относится предельный доход будущих периодов в связи с полученным из условий секьюритизации ожиданием полного или частичного дохода в будущем | |
| 11.8 | доходы или убытки от изменения справедливой стоимости финансового обязательства, в связи с изменением кредитного риска по такому обязательству | |
| 11.9 | Регуляторные корректировки, подлежащие вычету из добавочного капитала, но в связи с недостаточным его уровнем вычитаемые из основного капитала | |

Отчет о выполнении пруденциальных нормативов
на 01/ 06/ 2017 года

(тыс.тенге)

| № п/п компонента | Наименование | Сумма |
|------------------|---|-------|
| 1 | 2 | 3 |
| 11.10 | Сумма превышения инвестиций банка (инвестиции банка в финансовые инструменты финансовых организаций, в которых банк имеет менее 10 (десяти) процентов выпущенных акций (долей участия в уставном капитале), в совокупности превышающие 10 (десять) процентов от основного капитала банка после применения регуляторных корректировок), умноженная на долю инвестиций в простые акции в общей сумме инвестиций | |
| 11.11 | Сумма превышения инвестиций банка в простые акции финансовой организации, в которой банк имеет 10 (десять) и более процентов от выпущенных акций (долей участия в уставном капитале), а также часть отложенных налоговых активов, признанных в отношении вычитаемых временных разниц (в совокупности превышающие 15 (пятнадцать) процентов от основного капитала банка после применения регуляторных корректировок) | |
| 11.12 | Сумма инвестиций, составляющих 10 (десять) и более процентов от выпущенных акций (долей участия в уставном капитале) юридического лица, и отложенных налоговых активов, признанных в отношении вычитаемых временных разниц, не превышающая 15 (пятнадцать) процентов от основного капитала банка, после применения регуляторных корректировок | |
| 12 | Добавочный капитал как сумма: | |
| 12.1 | бессрочные договора, соответствующие критериям, в результате которых одновременно возникает финансовый актив у одного лица и финансовое обязательство или иной финансовый инструмент, подтверждающий право на долю активов юридического лица, оставшихся после вычетов всех его обязательств, у другого лица | |
| 12.2 | бессрочные финансовые инструменты, привлеченные до 1 января 2015 года | |
| 12.3 | оплаченные привилегированные акции, соответствующие установленным критериям | |
| 12.4 | оплаченные привилегированные акции, не соответствующие установленным критериям | |
| 13 | за минусом | |
| 13.1 | Инвестиции банка в собственные бессрочные финансовые инструменты прямым либо косвенным способом | |
| 13.2 | Собственные выкупленные привилегированные акции банка | |
| 13.3 | Сумма превышения инвестиций банка (инвестиции банка в финансовые инструменты финансовых организаций, в которых банк имеет менее 10 (десяти) процентов выпущенных акций (долей участия в уставном капитале), в совокупности превышающие 10 (десять) процентов от основного капитала банка после применения регуляторных корректировок), умноженная на долю инвестиций в бессрочные финансовые инструменты в общей сумме инвестиций | |

Отчет о выполнении пруденциальных нормативов
на 01/ 06/ 2017 года

(тыс.тенге)

| № п/п компонента | Наименование | Сумма |
|------------------|---|---------------|
| 1 | 2 | 3 |
| 13.4 | инвестиции банка в бессрочные финансовые инструменты финансовых организаций, в которых банк имеет 10 (десять) и более процентов от выпущенных акций (долей участия в уставном капитале) подлежащие вычету из добавочного капитала | |
| 13.5 | Регуляторные корректировки, подлежащие вычету из капитала второго уровня, но в связи с недостаточным его уровнем вычитаемые из добавочного капитала | |
| 14 | Капитал второго уровня | 11 581 394 |
| 15 | субординированный долг | |
| 16 | субординированный долг, привлеченный до 1 января 2015 года, в национальной валюте | 11 590 834 |
| 17 | субординированный долг, привлеченный до 1 января 2015 года, в иностранной валюте | |
| 18 | за минусом | |
| 18.1 | Выкупленный собственный субординированный долг банка (инвестиции в субординированный долг) | 9 440 |
| 18.2 | Сумма превышения инвестиций банка (инвестиции банка в финансовые инструменты финансовых организаций, в которых банк имеет менее 10% выпущенных акций (долей участия в уставном капитале), в совокупности превышающие 10 % от основного капитала банка после применения регуляторных корректировок), умноженная на долю инвестиций в субординированный долг в общей сумме инвестиций | |
| 18.3 | Инвестиции банка в субординированный долг финансовых организаций, в которых банк имеет 10 % и более от выпущенных акций (долей участия в уставном капитале) юридического лица, подлежащие вычету из капитала второго уровня | |
| 19 | Положительная разница между суммой депозитов физических лиц и собственным капиталом согласно данным бухгалтерского баланса, умноженным на 5,5. | |
| 20 | Коэффициент достаточности собственного капитала (k1) | 0.125 |
| 21 | Коэффициент достаточности собственного капитала (k1-2) | 0.125 |
| 22 | Коэффициент достаточности собственного капитала (k2) | 0.136 |
| 23 | Нераспределенный чистый доход банка, на который накладывается ограничение в части прекращения выплаты дивидендов и обратного выкупа акций | |
| 24 | Неинвестированные остатки средств, принятые на условиях кастодиального договора | 9 198 |
| 25 | Итого активы, взвешенные с учетом кредитного риска | 1 006 095 034 |
| 26 | Итого условные и возможные обязательства, взвешенные с учетом кредитного риска | 85 656 021 |

Отчет о выполнении пруденциальных нормативов
на 01/ 06/ 2017 года

(тыс.тенге)

| № п/п компонента | Наименование | Сумма |
|------------------|--|------------|
| 1 | 2 | 3 |
| 27 | Итого производные финансовые инструменты, взвешенные с учетом кредитного риска | 1 529 609 |
| 28 | Специфический процентный риск | |
| 29 | Общий процентный риск | |
| 30 | Итого рыночный риск, связанный с изменением ставки вознаграждения | |
| 31 | Специфический риск | |
| 32 | Общий риск | |
| 33 | Итого рыночный риск, связанный с изменением рыночной стоимости акций и рыночной стоимости производных финансовых инструментов, базовым активом которых являются акции или индексы на акции | |
| 34 | Итого рыночный риск, связанный с изменением обменного курса иностранных валют (рыночной стоимости драгоценных металлов) | 331 287 |
| 35 | Итого рыночный риск, связанный с изменением рыночной стоимости акций (включая исламские ценные бумаги, приобретенные с целью продажи) | |
| 36 | Итого риск по товарно-материальным запасам, связанный с изменением рыночной стоимости | |
| 37 | Сумма длинных и коротких позиций по финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением рыночной стоимости | |
| 38 | Разница сумм длинных и коротких позиций по финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением рыночной стоимости | |
| 39 | Сумма открытых валютных позиций | 4 141 084 |
| 40 | Активы и условные и возможные требования и обязательства, рассчитанные с учетом рыночного риска | 4 141 088 |
| 41 | Средняя величина годового валового дохода | 55 423 164 |
| 42 | Операционный риск | 55 423 164 |
| 43 | Совокупная задолженность одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, не связанных с банком особыми отношениями, по любому виду обязательств перед банком | 34 694 530 |
| 44 | Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика, не связанного с банком особыми отношениями - (к3) | 0.222 |
| 45 | Совокупная задолженность одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, связанных с банком особыми отношениями, по любому виду обязательств перед банком | 4 766 606 |
| 46 | Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика (группы заемщиков), связанного с банком особыми отношениями - (к3.1) | 0.031 |

Отчет о выполнении пруденциальных нормативов

на 01/ 06/ 2017 года

(тыс.тенге)

| № п/п компонента | Наименование | Сумма |
|------------------|---|-------------|
| 1 | 2 | 3 |
| 47 | Сумма рисков по всем заемщикам, связанным с банком особыми отношениями | 4 978 378 |
| 48 | Коэффициент суммы рисков по заемщикам, связанным с банком особыми отношениями (Po) | 0.032 |
| 49 | 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, по обязательствам соответствующих заемщиков, а также обязательств нерезидентов Республики Казахстан, зарегистрированных или являющихся гражданами оффшорных зон, за исключением требований к резидентам Республики Казахстан с рейтингом агентства Standard and 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 and Poor s или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, за исключением нерезидентов с рейтингом не ниже «А» агентства Standard and Poor s или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, в отношении одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков | 881 244 |
| 50 | Коэффициент максимального размера бланкового кредита (Бк) | 0.006 |
| 51 | Совокупная сумма рисков банка на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10 процентов от собственного капитала банка | 331 267 134 |
| 52 | Коэффициент совокупной суммы рисков на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10% от собственного капитала (Рк) | 2.120 |
| 53 | Совокупная сумма секьюритизированных кредитов, переданных специальной финансовой компании акционерного общества «Фонд стрессовых активов» | |
| 54 | Коэффициент совокупной суммы секьюритизированных кредитов, переданных специальной финансовой компании акционерного общества «Фонд стрессовых активов» | |
| 55 | Высоколиквидные активы | 546 780 845 |
| 56 | Обязательства до востребования | 354 563 374 |
| 57 | Коэффициент текущей ликвидности (к4) | 1.542 |
| 58 | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до семи дней включительно | 23 071 816 |
| 59 | Коэффициент ликвидности (к4-1) | 23.699 |
| 60 | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно, включая высоколиквидные активы | 655 488 042 |
| 61 | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно | 46 464 952 |

Отчет о выполнении пруденциальных нормативов
на 01/ 06/ 2017 года

(тыс.тенге)

| № п/п компонента | Наименование | Сумма |
|------------------|--|-------------|
| 1 | 2 | 3 |
| 62 | Коэффициент ликвидности (к4-2) | 14.107 |
| 63 | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, включая высоколиквидные активы | 736 312 646 |
| 64 | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно | 101 610 277 |
| 65 | Коэффициент ликвидности (к4-3) | 7.246 |
| 66 | Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности к4-4 | 165 343 016 |
| 66.1 | 1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства StandardandPoor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности): | 161 699 415 |
| 66.2 | 2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства StandardandPoor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки: | 3 643 601 |
| 66.3 | Российский рубль | 3 643 601 |
| 67 | Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности к4-4, умноженные на коэффициент конверсии равный 100% | 15 648 097 |
| 67.1 | 1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства StandardandPoor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности): | 8 079 983 |
| 67.2 | 2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства StandardandPoor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки: | 7 568 114 |
| 67.3 | Российский рубль | 7 568 114 |
| 68 | Коэффициент срочной валютной ликвидности (к4-4) | 10.566 |
| 68.1 | 1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства StandardandPoor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности): | 20.012 |
| 68.2 | 2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства StandardandPoor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки: | 0.481 |

**Отчет о выполнении пруденциальных нормативов
на 01/ 06/ 2017 года**

(тыс.тенге)

| № п/п компонента | Наименование | Сумма |
|------------------|--|-------------|
| 1 | 2 | 3 |
| 68.3 | Российский рубль | 0.481 |
| 69 | Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-5 | 214 522 115 |
| 69.1 | 1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства StandardandPoog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности): | 180 458 230 |
| 69.2 | 2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства StandardandPoog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки: | 34 063 885 |
| 69.3 | Российский рубль | 34 063 885 |
| 70 | Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-5, умноженные на коэффициент конверсии равный 90% | 27 584 394 |
| 70.1 | 1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства StandardandPoog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности): | 17 299 626 |
| 70.2 | 2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства StandardandPoog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки: | 10 284 768 |
| 70.3 | Российский рубль | 10 284 768 |
| 71 | Коэффициент срочной валютной ликвидности (k4-5) | 7.777 |
| 71.1 | 1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства StandardandPoog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности): | 10.431 |
| 71.2 | 2) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства StandardandPoog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки: | 3.312 |
| 71.3 | Российский рубль | 3.312 |
| 72 | Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-6 | 220 828 401 |

Отчет о выполнении пруденциальных нормативов

на 01/ 06/ 2017 года

(тыс.тенге)

| № п/п компонента | Наименование | Сумма |
|------------------|--|-------------|
| 1 | 2 | 3 |
| 72.1 | 1) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства StandardandPoor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности): | 185 461 865 |
| 72.2 | 2)по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства StandardandPoor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки: | 35 366 536 |
| 72.3 | Российский рубль | 35 366 536 |
| 73 | Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-6, умноженные на коэффициент конверсии равный 80% | 36 337 889 |
| 73.1 | 1)по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства StandardandPoor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности): | 26 458 126 |
| 73.2 | 2)по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства StandardandPoor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки: | 9 879 763 |
| 73.3 | Российский рубль | 9 879 763 |
| 74 | Коэффициент срочной валютной ликвидности (k4-6) | 6.077 |
| 74.1 | 1)по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «А» агентства StandardandPoor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте «Евро» (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности): | 7.010 |
| 74.2 | 2)по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «А» агентства StandardandPoor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки: | 3.580 |
| 74.3 | Российский рубль | 3.580 |
| 75 | Наличие у банка в течение отчетного периода просроченных обязательств перед кредиторами и вкладчиками (Да/Нет) | Нет |
| 76 | Превышение банком максимальных (рекомендуемых) ставок вознаграждения по вновь привлеченным депозитам физических лиц (в тенге и в иностранной валюте), устанавливаемых и рекомендуемых банкам для их соблюдения Советом директоров организации, осуществляющей обязательное гарантирование депозитов (Да/Нет) | Нет |

ДБ АО 'Сбербанк России'

(наименование банка)

Отчет о выполнении пруденциальных нормативов
на 01/06/2017 года

(тыс.тенге)

| № п/п компонента | Наименование | Сумма |
|------------------|--|------------|
| 1 | 2 | 3 |
| 77 | Наличие у банка в соответствии с пунктом 3-1 Постановления Правления Национального Банка Республики Казахстан от 17 июля 2015 года № 141 "Об утверждении Правил применения мер раннего реагирования и методики определения факторов, влияющих на ухудшение финансового положения банка второго уровня" факта несвоевременного исполнения банком плана мероприятий, одобренного уполномоченным органом (Да/Нет) | Нет |
| 78 | Краткосрочные обязательства перед нерезидентами | 27 943 365 |
| 79 | Коэффициент максимального лимита краткосрочных обязательств перед нерезидентами (k7) | 0.179 |
| 80 | Обязательства перед нерезидентами, включаемые в расчет коэффициента k8 | 35 028 109 |
| 81 | Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан (k8) | 0.224 |
| 82 | Обязательства перед нерезидентами и долговые ценные бумаги, включаемые в расчет коэффициента k9 | 35 028 109 |
| 83 | Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан (k9) | 0.224 |
| 84 | Активы, финансируемые за счет средств, привлеченных по договору об инвестиционном депозите | |
| 85 | Коэффициент размещения части средств во внутренние активы | 1.051 |

Руководитель

Главный бухгалтер

Исполнитель

Дата подписания отчета 9 июня 2017 года

Место для печати (при ее наличии)



Попова П.В.

Пыльникова А.С.

2663568 вн.

501137