

О внесении изменений и дополнения в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 8 мая 2015 года № 75 "Об утверждении перечня, форм, сроков отчетности о выполнении пруденциальных нормативов банками второго уровня и Правил их представления"

Постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 29 ноября 2017 года № 237. Зарегистрировано в Министерстве юстиции Республики Казахстан 4 января 2018 года № 16173

В целях совершенствования нормативных правовых актов Республики Казахстан, регулирующих деятельность банков второго уровня, и в соответствии с Законом Республики Казахстан от 19 марта 2010 года "О государственной статистике" Правление Национального Банка Республики Казахстан **ПОСТАНОВЛЯЕТ:**

1. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 8 мая 2015 года № 75 "Об утверждении перечня, форм, сроков отчетности о выполнении пруденциальных нормативов банками второго уровня и Правил их представления" (зарегистрированное в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 11162, опубликованное 2 июня 2015 года в информационно-правовой системе "Эділет") следующие изменения и дополнение:

пункты 1 и 2 изложить в следующей редакции:

"1. Утвердить:

1) перечень отчетности о выполнении пруденциальных нормативов банками второго уровня согласно приложению 1 к настоящему постановлению;

2) форму отчета о выполнении пруденциальных нормативов согласно приложению 2 к настоящему постановлению;

3) форму отчета о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска, согласно приложению 3 к настоящему постановлению;

4) форму отчета о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска, согласно приложению 4 к настоящему постановлению;

5) форму отчета о расшифровке условных и возможных требований и обязательств по производным финансовым инструментам, взвешенным с учетом кредитного риска, согласно приложению 5 к настоящему постановлению;

6) форму отчета о расшифровке расчета специфического процентного риска (в разрезе валют) согласно приложению 6 к настоящему постановлению;

7) форму отчета о распределении открытых позиций по временным интервалам (в разрезе валют) согласно приложению 7 к настоящему постановлению;

8) форму отчета о расшифровке расчета общего процентного риска (в разрезе валют) согласно приложению 8 к настоящему постановлению;

9) форму отчета о расшифровке максимального размера риска на одного заемщика (в разрезе заемщиков) согласно приложению 10 к настоящему постановлению;

10) форму отчета о расшифровке коэффициента текущей ликвидности k4 согласно приложению 11 к настоящему постановлению;

11) форму отчета о расшифровке коэффициентов срочной ликвидности k4-1, k4-2, k4-3 согласно приложению 12 к настоящему постановлению;

12) форму отчета о расшифровке коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-4, k4-5, k4-6 согласно приложению 13 к настоящему постановлению;

13) форму отчета о валютных позициях по каждой иностранной валюте и валютной нетто-позиции за каждый рабочий день недели (месяца) согласно приложению 14 к настоящему постановлению;

14) форму отчета о расчете среднемесячной величины внутренних активов, внутренних и иных обязательств, коэффициента размещения части средств во внутренние активы согласно приложению 15 к настоящему постановлению;

15) форму отчета о расшифровке коэффициентов капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан согласно приложению 16 к настоящему постановлению;

16) форму отчета о расчете коэффициентов достаточности собственного капитала при секьюритизации согласно приложению 17 к настоящему постановлению;

17) форму отчета о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска, представляемого исламскими банками согласно приложению 18 к настоящему постановлению;

18) форму отчета о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска, представляемого исламскими банками, согласно приложению 19 к настоящему постановлению;

19) форму отчета о расшифровке рыночного риска, связанного с изменением рыночной стоимости товарно-материальных запасов, представляемого исламскими банками, согласно приложению 20 к настоящему постановлению;

20) форму отчета о расшифровке коэффициента покрытия ликвидности согласно приложению 20-1 к настоящему постановлению;

21) форму отчета о расшифровке коэффициента нетто стабильного фондирования согласно приложению 20-2 к настоящему постановлению;

22) Правила представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов банками второго уровня согласно приложению 21 к настоящему постановлению.

2. Банки второго уровня представляют в Национальный Банк Республики Казахстан в электронном формате:

1) ежемесячно отчетность, предусмотренную подпунктами 2), 3), 4), 5), 6), 7), 8), 9), 10), 11), 12), 14), 15), 16), 17), 18) и 19) пункта 1 настоящего постановления, - не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;

2) ежемесячно отчетность, предусмотренную подпунктами 20) и 21) пункта 1 настоящего постановления, - не позднее десятого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;

3) еженедельно отчетность, предусмотренную подпунктом 13) пункта 1 настоящего постановления, - не позднее пятого рабочего дня недели, следующей за отчетной неделей.

При завершении календарного месяца в отчетную неделю, отчетность, предусмотренная подпунктом 3) настоящего пункта, предоставляется не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за завершаемым месяцем, отдельно за календарные дни отчетной недели, относящиеся к завершаемому месяцу и за календарные дни отчетной недели месяца, следующего за завершаемым месяцем.";

приложение 1 изложить в редакции согласно приложению 1 к настоящему постановлению;

приложение 2 изложить в редакции согласно приложению 2 к настоящему постановлению;

приложение 3 изложить в редакции согласно приложению 3 к настоящему постановлению;

приложение 4 изложить в редакции согласно приложению 4 к настоящему постановлению;

приложение 6 изложить в редакции согласно приложению 5 к настоящему постановлению;

приложение 10 изложить в редакции согласно приложению 6 к настоящему постановлению;

приложение 11 изложить в редакции согласно приложению 7 к настоящему постановлению;

приложение 12 изложить в редакции согласно приложению 8 к настоящему постановлению;

приложение 13 изложить в редакции согласно приложению 9 к настоящему постановлению;

приложение 15 изложить в редакции согласно приложению 10 к настоящему постановлению;

приложение 16 изложить в редакции согласно приложению 11 к настоящему постановлению;

приложение 17 изложить в редакции согласно приложению 12 к настоящему постановлению;

приложение 20-1 изложить в редакции согласно приложению 13 к настоящему постановлению;

дополнить приложением 20-2 в редакции согласно приложению 14 к настоящему постановлению.

2. Департаменту исследований и статистики (Тутушкин В.А.) в установленном законодательством Республики Казахстан порядке обеспечить:

1) совместно с Юридическим департаментом (Сарсенова Н.В.) государственную регистрацию настоящего постановления в Министерстве юстиции Республики Казахстан;

2) в течение десяти календарных дней со дня государственной регистрации настоящего постановления направление его копии в бумажном и электронном виде на казахском и русском языках в Республиканское государственное предприятие на праве хозяйственного ведения "Республиканский центр правовой информации" для официального опубликования и включения в Эталонный контрольный банк нормативных правовых актов Республики Казахстан;

3) размещение настоящего постановления на официальном интернет-ресурсе Национального Банка Республики Казахстан после его официального опубликования;

4) в течение десяти рабочих дней после государственной регистрации настоящего постановления представление в Юридический департамент сведений об исполнении мероприятий, предусмотренных подпунктами 2), 3) настоящего пункта и пунктом 3 настоящего постановления.

3. Управлению по защите прав потребителей финансовых услуг и внешних коммуникаций (Терентьев А.Л.) обеспечить направление настоящего постановления на официальное опубликование в периодических печатных изданиях в течение десяти календарных дней после его государственной регистрации в Министерстве юстиции Республики Казахстан.

4. Контроль за исполнением настоящего постановления возложить на заместителя Председателя Национального Банка Республики Казахстан Курманова Ж.Б.

5. Настоящее постановление вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования.

Председатель
Национального Банка

Д. Акишев

" С О Г Л А С О В А Н О "

Председатель
Министерства
Р е с п у б л и к и

Комитета
национальной
К а з а х с т а н

по
статистике
экономики

Н.

А й д а п к е л о в

20 декабря 2017 года

Перечень отчетности о выполнении пруденциальных нормативов банками второго уровня

Отчетность о выполнении пруденциальных нормативов банками второго уровня включает в себя:

- 1) отчет о выполнении пруденциальных нормативов;
- 2) отчет о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска;
- 3) отчет о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска;
- 4) отчет о расшифровке условных и возможных требований и обязательств по производным финансовым инструментам, взвешенным с учетом кредитного риска;
- 5) отчет о расшифровке расчета специфичного процентного риска (в разрезе валют);
- 6) отчет о распределении открытых позиций по временным интервалам (в разрезе валют);
- 7) отчет о расшифровке расчета общего процентного риска (в разрезе валют);
- 8) отчет о расшифровке максимального размера риска на одного заемщика (в разрезе заемщиков);
- 9) отчет о расшифровке коэффициента текущей ликвидности k4;
- 10) отчет о расшифровке коэффициентов срочной ликвидности k4-1, k4-2, k4-3;
- 11) отчет о расшифровке коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-4, k4-5, k4-6;
- 12) отчет о валютных позициях по каждой иностранной валюте и валютной нетто-позиции за каждый рабочий день недели (месяца);
- 13) отчет о расчете среднемесячной величины внутренних активов, внутренних и иных обязательств, коэффициента размещения части средств во внутренние активы;
- 14) отчет о расшифровке коэффициентов капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан;
- 15) отчет о расчете коэффициентов достаточности собственного капитала при секьюритизации;
- 16) отчет о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска, представляемый исламскими банками;

17) отчет о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска, представляемый исламскими банками;

18) отчет о расшифровке рыночного риска, связанного с изменением рыночной стоимости товарно-материальных запасов, представляемый исламскими банками;

19) отчет о расшифровке коэффициента покрытия ликвидности;

20) отчет о расшифровке коэффициента нетто стабильного фондирования.

Приложение 2
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 29 ноября 2017 года № 237

Приложение 2
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 8 мая 2015 года № 75

Форма, предназначенная для сбора административных данных
Отчет о выполнении пруденциальных нормативов
Отчетный период: на "___" _____ 20___ года

(наименование банка)

Индекс: 1-BVU_Prud_norm

Периодичность: ежемесячная

Представляет: банк второго уровня

Куда представляется форма: Национальный Банк Республики Казахстан

Срок представления: не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

Форма

(в тысячах тенге)

| № | Наименование | Сумма |
|----|--|-------|
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Минимальный размер собственного капитала | |
| 2 | Собственный капитал | |
| 3 | Капитал первого уровня | |
| 4 | Основной капитал как сумма | |
| 5 | Оплаченные простые акции | |
| 6 | Дополнительный оплаченный капитал | |
| 7 | Нераспределенная чистая прибыль прошлых лет | |
| 8 | Нераспределенная чистая прибыль текущего года | |
| 9 | Накопленный раскрытый резерв | |
| 10 | Резервы по переоценке основных средств и стоимости финансовых активов, имеющих в наличии для продажи | |
| 11 | Основной капитал за минусом: | |

| | | |
|-------|---|--|
| 11.1 | собственные выкупленные простые акции | |
| 11.2 | нематериальные активы, включая гудвилл | |
| 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 | |
| 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 | |
| 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) | |
| 12 | Добавочный капитал как сумма: | |
| 12.1 | бессрочные договоры, 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 | Добавочный капитал 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 | |
| 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 | |

| | | |
|--------|---|--|
| 15 | Субординированный долг | |
| 16 | Субординированный долг, привлеченный до 1 января 2015 года, в национальной валюте | |
| 17 | Субординированный долг, привлеченный до 1 января 2015 года, в иностранной валюте | |
| 18 | Капитал второго уровня за минусом: | |
| 18.1 | выкупленный собственный субординированный долг банка (инвестиции в субординированный долг) | |
| 18.2 | 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 (десяти) процентов 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 (десять) процентов и более от выпущенных акций (долей участия в уставном капитале) юридического лица, подлежащие вычету из капитала второго уровня | |
| 19 | Положительная разница, подлежащая к вычету из собственного капитала | |
| 19.1 | Положительная разница между суммой депозитов физических лиц и собственным капиталом согласно данным бухгалтерского баланса, умноженным на 5,5, подлежащая к вычету из собственного капитала | |
| 19.2 | Положительная разница между провизиями (резервами), рассчитанными согласно приложениям 1 к Нормативным значениям и методике расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков, установленным согласно приложению 1 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 30 мая 2016 года № 144 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков, их нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков (далее - Нормативы № 144) и Нормативным значениям и методикам расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату, установленным согласно приложению 1 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 13 сентября 2017 года № 170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции" (далее - Нормативы № 170) и провизиями (резервами), сформированными и отраженными в бухгалтерском учете банка в соответствии с международными стандартами финансовой отчетности и требованиями законодательства Республики Казахстан о бухгалтерском учете и финансовой отчетности, подлежащая к вычету из собственного капитала | |
| 19.2.1 | Провизии (резервы), рассчитанные в соответствии с приложениями 1 к Нормативам №144 и Нормативам №170 | |
| 19.2.2 | Провизии (резервы), сформированные и отраженные в бухгалтерском учете банка в соответствии с международными стандартами финансовой отчетности и требованиями законодательства Республики Казахстан о бухгалтерском учете и финансовой отчетности | |
| 19.2.3 | Положительная разница между провизиями (резервами), рассчитанными согласно приложениям 1 к Нормативам №144 и Нормативам №170 и провизиями (резервами), сформированными и отраженными в бухгалтерском учете банка в соответствии с международными стандартами финансовой отчетности и требованиями законодательства Республики Казахстан о бухгалтерском учете и финансовой отчетности | |
| 20 | Коэффициент достаточности собственного капитала (k1) | |
| 21 | Коэффициент достаточности собственного капитала (k1-2) | |
| | | |

| | | |
|----|--|--|
| 22 | Коэффициент достаточности собственного капитала (k2) | |
| 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 | |
| 25 | Итого активы, взвешенные с учетом кредитного риска | |
| 26 | Итого условные и возможные обязательства, взвешенные с учетом кредитного риска | |
| 27 | Итого производные финансовые инструменты, взвешенные с учетом кредитного риска | |
| 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 индекс на акции | |
| 34 | Итого рыночный риск, связанный с изменением обменного курса иностранных валют (рыночной стоимости драгоценных металлов) | |
| 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 | |
| 40 | Активы и условные и возможные требования и обязательства, рассчитанные с учетом рыночного риска | |
| 41 | Средняя величина годового валового дохода | |
| 42 | Операционный риск | |
| 43 | Совокупная задолженность одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, не связанных с банком особыми отношениями, по любому виду обязательств перед банком | |
| 44 | Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика, не связанного с банком особыми отношениями – (k3) | |
| 45 | Совокупная задолженность одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, связанных с банком особыми отношениями, по любому виду обязательств перед банком | |
| 46 | Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика (группы заемщиков), связанного с банком особыми отношениями – (k3.1) | |
| 47 | Сумма рисков по всем заемщикам, связанным с банком особыми отношениями | |
| 48 | Коэффициент суммы рисков по заемщикам, связанным с банком особыми отношениями (Po) | |
| | 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, | |

| | | |
|------|---|--|
| 49 | за исключением требований к резидентам Республики Казахстан с рейтингом агентства Standard & Poor's или рейтингом аналогичного уровня агентств Fitch или Moody's Investors Service 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 | |
| 50 | Коэффициент максимального размера бланкового кредита (Бк) | |
| 51 | Совокупная сумма рисков банка на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10 (десять) процентов от собственного капитала банка | |
| 52 | Коэффициент совокупной суммы рисков на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10 (десять) процентов от собственного капитала (Рк) | |
| 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 | |
| 56 | Обязательства до востребования | |
| 57 | Коэффициент текущей ликвидности (к4) | |
| 58 | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до семи дней включительно | |
| 59 | Коэффициент ликвидности (к4-1) | |
| 60 | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно, включая высоколиквидные активы | |
| 61 | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно | |
| 62 | Коэффициент ликвидности (к4-2) | |
| 63 | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, включая высоколиквидные активы | |
| 64 | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно | |
| 65 | Коэффициент ликвидности (к4-3) | |
| 66 | Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности к4-4: | |
| 66.1 | 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) | |
| 66.2 | 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 | |
| 66.3 | (указывается вид валют) | |
| 66.4 | (указывается вид валют) | |
| 67 | Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности к4-4 | |
| 67.1 | 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) | |

| | | |
|------|--|--|
| 67.2 | 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 | |
| 67.3 | (указывается вид валют) | |
| 67.4 | (указывается вид валют) | |
| 68 | Коэффициент срочной валютной ликвидности (k4-4): | |
| 68.1 | 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) | |
| 68.2 | 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 | |
| 68.3 | (указывается вид валют) | |
| 68.4 | (указывается вид валют) | |
| 69 | Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-5: | |
| 69.1 | 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) | |
| 69.2 | 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 | |
| 69.3 | (указывается вид валют) | |
| 69.4 | (указывается вид валют) | |
| 70 | Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-5, умноженные на коэффициент конверсии равный 90% | |
| 70.1 | 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) | |
| 70.2 | 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 | |
| 70.3 | (указывается вид валют) | |
| 70.4 | (указывается вид валют) | |
| 71 | Коэффициент срочной валютной ликвидности (k4-5): | |
| 71.1 | 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) | |
| 71.2 | 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 | |
| 71.3 | (указывается вид валют) | |
| 71.4 | (указывается вид валют) | |

| | | |
|------|--|--|
| 72 | Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-6: | |
| 72.1 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте "Евро" (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности) | |
| 72.2 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | |
| 72.3 | (указывается вид валют) | |
| 72.4 | (указывается вид валют) | |
| 73 | Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-6, умноженные на коэффициент конверсии равный 80% | |
| 73.1 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте "Евро" (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности) | |
| 73.2 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | |
| 73.3 | (указывается вид валют) | |
| 73.4 | (указывается вид валют) | |
| 74 | Коэффициент срочной валютной ликвидности (k4-6): | |
| 74.1 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте "Евро" (с указанием суммы/коэффициента по данной группе валют в совокупности) | |
| 74.2 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | |
| 74.3 | (указывается вид валют) | |
| 74.4 | (указывается вид валют) | |
| 75 | Наличие у банка в течение отчетного периода просроченных обязательств перед кредиторами (Да/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) | |
| 77 | Наличие у банка факта несвоевременного исполнения банком плана мероприятий, одобренного уполномоченным органом (Да/Нет) | |
| 78 | Краткосрочные обязательства перед нерезидентами | |
| 79 | Коэффициент максимального лимита краткосрочных обязательств перед нерезидентами (k7) | |
| 80 | Обязательства перед нерезидентами, включаемые в расчет коэффициента k8 | |
| 81 | Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан (k8) | |
| | | |

| | | |
|----|---|--|
| 82 | Обязательства перед нерезидентами и долговые ценные бумаги, включаемые в расчет коэффициента k9 | |
| 83 | Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан (k9) | |
| 84 | Активы, финансируемые за счет средств, привлеченных по договору об инвестиционном депозите | |
| 85 | Коэффициент размещения части средств во внутренние активы | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место _____ для печати _____ (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных
 д а н н ы х ,

приведено в приложении к настоящей форме.

Приложение
 к форме отчета о выполнении
 пруденциальных нормативов

**Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора
 административных данных**

Отчет о выполнении пруденциальных нормативов

Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по
 заполнению формы "Отчет о выполнении пруденциальных нормативов" (далее - Форма
).

2. Форма разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом б) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".

3. Форма составляется ежемесячно банками второго уровня по состоянию на первое число каждого месяца. Данные в Форме заполняются в тысячах тенге.

4. Форму подписывают первый руководитель, главный бухгалтер или лица, уполномоченные ими на подписание отчета, и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению Формы

5. Форма заполняется в соответствии с постановлениями Правления Национального Банка Республики Казахстан от 30 мая 2016 года № 144 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков, их нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 13939 (далее - Постановление № 144) и от 13 сентября 2017 года № 170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №15886 (далее – Постановление № 170).

6. Строка 1 заполняется в соответствии с главой 1 "Минимальный размер уставного и собственного капиталов банка" к Нормативам № 144 и главой 2 "Минимальный размер уставного и собственного капиталов банка" к Нормативам № 170.

7. В строке 5 указываются сведения по оплаченным простым акциям, соответствующим критериям, установленным в приложении 1 к Нормативам №144 и приложении 4 к Нормативам №170.

8. В строке 11.7 указываются доходы будущих периодов в связи с полученным из условий секьюритизации ожиданием полного или частичного дохода в будущем.

9. В строке 12.1 указываются сведения по бессрочным договорам, соответствующим критериям, установленным в приложении 1 к Нормативам №144 и приложении 4 к Нормативам №170, в результате которых одновременно возникают 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.

10. В строке 12.2 указываются сведения по бессрочным финансовым инструментам в соответствии с требованиями пункта 12 Нормативов №170.

11. В строке 12.3 указываются сведения по оплаченным привилегированным акциям, соответствующим критериям, установленным в приложении 1 к Нормативам №144 и приложении 4 к Нормативам №170.

12. В строке 12.4 указываются сведения по оплаченным привилегированным акциям в соответствии с требованиями пункта 13 Нормативов №170.

13. В строке 15 указываются сведения по субординированному долгу, соответствующему критериям, установленным в приложении 1 к Нормативам №144 и приложении 4 к Нормативам №170.

14. В строке 16 указываются сведения по субординированному долгу, привлеченному до 1 января 2015 года, в национальной валюте в соответствии с требованиями пункта 9 Нормативов №144 и пункта 15 Нормативов №170.

15. В строке 17 указываются сведения по субординированному долгу, привлеченному до 1 января 2015 года, в иностранной валюте в соответствии с требованиями пункта 9 Нормативов №144 и пункта 15 Нормативов №170.

16. В строке 19 указывается сумма по строкам 19.1 и 19.2.

17. В случае если разница между суммой депозитов физических лиц и собственным капиталом согласно данным бухгалтерского баланса, умноженным на 5,5, подлежащая к вычету из собственного капитала является отрицательной, в строке 19.1 указывается 0.

18. В строке 19.2 положительная разница между провизиями (резервами) по займам и дебиторской задолженности по ранее выданным банковским займам, рассчитанными согласно приложениям 1 к Нормативам №144 и Нормативам №170 и провизиями (резервами), сформированными и отраженными в бухгалтерском учете банка в соответствии с международными стандартами финансовой отчетности и требованиями законодательства Республики Казахстан о бухгалтерском учете и финансовой отчетности указывается с учетом требований части 3 пункта 6 Нормативов №144 и пункта 7 Нормативов №170.

19. В строке 19.2.1 указываются провизии (резервы) по займам и дебиторской задолженности по ранее выданным банковским займам, рассчитанные согласно приложениям 1 к Нормативам №144 и Нормативам №170. В случае, если провизии (резервы), сформированные в соответствии с международными стандартами финансовой отчетности превышают провизии, рассчитанные согласно приложениям 1 к Нормативам №144 и Нормативам №170, то в строке 19.2.1 указываются провизии (резервы), сформированные в соответствии с международными стандартами финансовой отчетности.

20. В строке 19.2.2 указываются провизии (резервы) по тем займам и дебиторской задолженности по ранее выданным банковским займам, сформированные и

отраженные в бухгалтерском учете банка в соответствии с международными стандартами финансовой отчетности и требованиями законодательства Республики Казахстан о бухгалтерском учете и финансовой отчетности, по которым были рассчитаны провизии согласно приложениям 1 к Нормативам №144 и Нормативам №170.

21. Строка 19.2.3. рассчитывается как разница строк 19.2.1. и 19.2.2. (указывается только положительное значение), которая должна отражать сумму положительной разницы между провизиями (резервами) по займам и дебиторской задолженности по ранее выданным банковским займам, рассчитанными согласно приложениям 1 к Нормативам №144 и Нормативам №170 и провизиями (резервами), сформированными и отраженными в бухгалтерском учете банка в соответствии с международными стандартами финансовой отчетности и требованиями законодательства Республики Казахстан о бухгалтерском учете и финансовой отчетности.

22. В строке 23 указывается сумма нераспределенного чистого дохода, на который накладывается ограничение в соответствии с приложением 4 к Нормативам №144 и приложением 3 к Нормативам №170, в части прекращения выплаты дивидендов и обратного выкупа акций.

23. Строка 25 заполняется в соответствии с данными отчета о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска.

24. Строка 26 заполняется в соответствии с данными отчета о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска.

25. Строка 27 заполняется в соответствии с данными отчета о расшифровке условных и возможных требований и обязательств по производным финансовым инструментам, взвешенным с учетом кредитного риска.

26. Строка 28 заполняется в соответствии с данными отчета о расшифровке расчета специфического процентного риска (в разрезе валют).

27. Строка 29 заполняется в соответствии с данными отчета о расшифровке расчета общего процентного риска (в разрезе валют).

28. Строки 43, 44, 45, 46, 47, 48, 49, 50, 51, 52, 53 и 54 заполняются в соответствии с данными отчета о расшифровке максимального размера риска на одного заемщика.

29. Строки 55, 56 и 57 заполняются в соответствии с данными отчета о расшифровке коэффициента текущей ликвидности k4.

30. Строки 58, 59, 60, 61, 62, 63, 64 и 65 заполняются в соответствии с данными отчета о расшифровке коэффициентов срочной ликвидности k4-1, k4-2, k4-3.

31. Строки 66, 66.1, 66.2, 66.3, 66.4, 67, 67.1, 67.2, 67.3, 67.4, 68, 68.1, 68.2, 68.3, 68.4, 69, 69.1, 69.2, 69.3, 69.4, 70, 70.1, 70.2, 70.3, 70.4, 71, 71.1, 71.2, 71.3, 71.4, 72, 72.1, 72.2, 72.3, 72.4, 73, 73.1, 73.2, 73.3, 73.4, 74, 74.1, 74.2, 74.3 и 74.4 заполняются в соответствии с данными отчета о расшифровке коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-4, k4-5, k4-6.

32. Строка 77 заполняется в соответствии с пунктом 7 Правил применения мер раннего реагирования и методики определения факторов, влияющих на ухудшение финансового положения банка и банковского конгломерата, утвержденных постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 29 февраля 2016 года № 69 "Об установлении факторов, влияющих на ухудшение финансового положения банка и банковского конгломерата, а также утверждении Правил применения мер раннего реагирования и методики определения факторов, влияющих на ухудшение финансового положения банка и банковского конгломерата", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 13606.

33. Строки 78, 79, 80, 81, 82 и 83 заполняются в соответствии с данными отчета о расшифровке коэффициентов капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан.

34. Строка 85 заполняется в соответствии с данными отчета о расчете среднемесячной величины внутренних активов, внутренних и иных обязательств, коэффициента размещения части средств во внутренние активы.

35. Строки 35, 36 и 84 заполняются только исламскими банками.

36. В строках 20, 21, 22, 44, 46, 48, 50, 52, 54, 57, 59, 62, 65, 68, 68.1, 68.2, 68.3, 68.4, 71, 71.1, 71.2, 71.3, 71.4, 74, 74.1, 74.2, 74.3, 74.4, 79, 81, 83, 85 указываются значения с тремя знаками после запятой.

37. В случае отсутствия сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

Приложение 3
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 29 ноября 2017 года № 237

Приложение 3
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 8 мая 2015 года № 75

Форма, предназначенная для сбора административных данных
Отчет о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска
Отчетный период: _____ на "___" _____ 20__ года

(наименование банка)

И н д е к с : 2 - В V U _ R A

Периодичность: ежемесячная

Представляет: банк второго уровня

Куда представляется форма: Национальный Банк Республики Казахстан

Срок представления: не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

Форма

(в тысячах тенге)

| № | Наименование статей | Сумма | Степень риска в процентах | Сумма к расчету |
|----------|---|-------|---------------------------|-----------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| I группа | | | | |
| 1 | Наличные тенге | | 0 | |
| 2 | Наличная иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 0 | |
| 3 | Аффинированные драгоценные металлы | | 0 | |
| 4 | Займы, предоставленные Правительству Республики Казахстан | | 0 | |
| 5 | Займы, предоставленные центральным правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 0 | |
| 6 | Займы, предоставленные Национальному Банку Республики Казахстан | | 0 | |
| 7 | Займы, предоставленные центральным банкам стран с суверенным рейтингом не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 0 | |
| 8 | Займы, предоставленные международным финансовым организациям с долговым рейтингом не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 0 | |
| 9 | Займы, предоставленные акционерному обществу "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына" | | 0 | |
| 10 | Вклады в Национальном Банке Республики Казахстан и иные требования к Национальному Банку Республики Казахстан | | 0 | |
| 11 | Вклады в центральных банках стран с суверенным рейтингом не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 0 | |
| 12 | Вклады в международных финансовых организациях с долговым рейтингом не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 0 | |
| 13 | Дебиторская задолженность Правительства Республики Казахстан | | 0 | |
| 14 | Дебиторская задолженность местных органов власти Республики Казахстан по налогам и другим платежам в бюджет | | 0 | |
| 15 | Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Правительством Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан | | 0 | |
| 16 | Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные местными исполнительными органами городов Астаны и Алматы | | 0 | |
| 17 | Ценные бумаги, выпущенные акционерными обществами "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", "Фонд проблемных кредитов" | | 0 | |

| | | | |
|-----------|---|----|--|
| 18 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 0 | |
| 19 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 0 | |
| 20 | Требования по открытым корреспондентским счетам к банкам, имеющим долгосрочный рейтинг не ниже "BBB" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 0 | |
| 21 | Начисленное вознаграждение по активам, включенным в I группу риска | 0 | |
| II группа | | | |
| 22 | Наличная иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 20 | |
| 23 | Займы, предоставленные центральным правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| 24 | Займы, предоставленные центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| 25 | Займы, предоставленные международным финансовым организациям, имеющим долговой рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| 26 | Займы, предоставленные местным органам власти Республики Казахстан | 20 | |
| 27 | Займы, предоставленные местным органам власти стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| 28 | Займы, предоставленные организациям, имеющим долговой рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| 29 | Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| 30 | Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| 31 | Вклады в организациях, имеющих долговой рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| 32 | Дебиторская задолженность местных органов власти Республики Казахстан, за исключением дебиторской задолженности, отнесенной к I группе риска | 20 | |
| 33 | Дебиторская задолженность организаций, имеющих долговой рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| | | | |

| | | | |
|------------|---|----|--|
| 34 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Standard and Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| 35 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства Standard and Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| 36 | Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти Республики Казахстан | 20 | |
| 37 | Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, суверенный рейтинг которых не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| 38 | Ценные бумаги, выпущенные организациями, имеющими долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| 39 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на балансе и имеющие кредитный рейтинг от "ААА" до "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzААА" до "kzАА-" по национальной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 20 | |
| 40 | Начисленное вознаграждение по активам, включенным во II группу риска | 20 | |
| III группа | | | |
| 41 | Неаффинированные драгоценные металлы | 50 | |
| 42 | Займы, предоставленные центральным правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 | |
| 43 | Займы, предоставленные центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 | |
| 44 | Займы, предоставленные международным финансовым организациям, имеющим долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 | |
| 45 | Займы, предоставленные местным органам власти стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже от "А+" до "А-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 | |
| 46 | Займы, предоставленные организациям, имеющим долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 | |
| 47 | Ипотечные жилищные займы (за исключением, займов физическим лицам, указанных в строках 72, 74, 75 и 76 настоящей формы), соответствующие условию: отношение суммы предоставленного ипотечного жилищного займа к стоимости залога не превышает 50 (пятидесяти) процентов включительно от стоимости залога | 35 | |
| 48 | Ипотечные жилищные займы (за исключением, займов физическим лицам, указанных в строках 72, 74, 75 и 76 настоящей таблицы), соответствующие условию: отношение суммы предоставленного ипотечного жилищного займа к стоимости залога находится в пределах от | | |

| | | | |
|----|--|-----|--|
| | 51 (пятидесяти одного) процента до 85 (восемидесяти пяти) процентов включительно от стоимости залога | 50 | |
| 49 | Прочие ипотечные жилищные займы (за исключением, займов, выданных физическим лицам, указанных в строках 72, 74, 75 и 76 настоящей таблицы) | 100 | |
| 50 | Займы с просроченной задолженностью по основному долгу и (или) начисленному вознаграждению свыше 90 (девяноста) календарных дней, предоставленные резидентам Республики Казахстан (за исключением ипотечных жилищных займов и займов, указанных в строках 71, 72, 73, 74, 75, 76 и 102 настоящей таблицы), по которым сформировано менее 35 (тридцати пяти) процентов провизий (резервов) согласно международным стандартам финансовой отчетности от непогашенной части займов | 100 | |
| 51 | Займы с просроченной задолженностью по основному долгу и (или) начисленному вознаграждению свыше 90 (девяноста) календарных дней, предоставленные резидентам Республики Казахстан (за исключением ипотечных жилищных займов и займов, указанных в строках 71, 72, 73, 74, 75, 76 и 102 настоящей таблицы), по которым сформировано более 35 (тридцати пяти) процентов и менее 50 (пятидесяти) процентов провизий (резервов) согласно международным стандартам финансовой отчетности от непогашенной части займов | 75 | |
| 52 | Займы с просроченной задолженностью по основному долгу и (или) начисленному вознаграждению свыше 90 (девяноста) календарных дней, предоставленные резидентам Республики Казахстан (за исключением ипотечных жилищных займов и займов, указанных в строках 71, 72, 73, 74, 75, 76 и 102 настоящей таблицы), по которым сформировано более 50 (пятидесяти) процентов провизий (резервов) согласно международным стандартам финансовой отчетности от непогашенной части займов | 50 | |
| 53 | Займы, предоставленные субъектам, отнесенным к малому или среднему предпринимательству, согласно Предпринимательскому кодексу Республики Казахстан от 29 октября 2015 года, соответствующие следующим критериям: 1) сумма займа не превышает 0,02 (ноль целых две сотых) процента от собственного капитала; 2) валюта займа – тенге | 75 | |
| 54 | Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг от "BBB+" до "BBB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 | |
| 55 | Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг от "BBB+" до "BBB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 | |
| 56 | Вклады в организациях, имеющих долговой рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 | |
| 57 | Дебиторская задолженность организаций, имеющих долговой рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 | |
| 58 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "BBB+" до "BBB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 | |
| 59 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг от "BBB+" до "BBB-" | 50 | |

| | | | | |
|-----------|---|-----|--|--|
| | агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | | |
| 60 | Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 | | |
| 61 | Ценные бумаги, выпущенные организациями, имеющими долговой рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 | | |
| 62 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на балансе и имеющие кредитный рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzA+" до "kzA-" по национальной шкале агентства Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 50 | | |
| 63 | Требования по открытым корреспондентским счетам к банкам-резидентам Республики Казахстан, имеющим долговой рейтинг от "BBB-" до "BB-" (включительно) агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или банку-нерезиденту, имеющему долговой рейтинг от "BBB-" до "BB+" (включительно) агентства Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 | | |
| 64 | Требования к акционерному обществу "Казахстанская фондовая биржа" | 50 | | |
| 65 | Начисленное вознаграждение по активам, включенным в III группу риска | 50 | | |
| IV группа | | | | |
| 66 | Займы, предоставленные центральным правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг от "BB+" до "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 100 | | |
| 67 | Займы, предоставленные центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг от "BB+" до "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 100 | | |
| 68 | Займы, предоставленные международным финансовым организациям, имеющим долговой рейтинг от "BB+" до "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и международным финансовым организациям, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки | 100 | | |
| 69 | Займы, предоставленные местным органам власти стран, имеющих долговой рейтинг от "BBB+" до "BB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 100 | | |
| 70 | Займы, предоставленные организациям-резидентам, имеющим долговой рейтинг ниже "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациям-резидентам, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки, и организациям-нерезидентам, имеющим долговой рейтинг от "BBB+" до "BB-" агентства Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 | | |
| | Займы, выданные с 1 января 2016 года и предоставленные на срок более 1 года в иностранной валюте организациям-резидентам, имеющим долговой | | | |

| | | | |
|----|--|-----|--|
| 71 | рейтинг ниже "А-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациям-резидентам, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки, и организациям-нерезидентам, имеющим долговой рейтинг от "BBB+" до "BB-" агентства Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и не имеющим соответствующей валютной выручки, и (или) валютные риски которых не покрыты соответствующими инструментами хеджирования со стороны заемщика | 200 | |
| 72 | Займы, предоставленные физическим лицам до 1 января 2016 года, в том числе потребительские кредиты, за исключением отнесенных к III группе риска | 100 | |
| 73 | Займы, выданные с 1 января 2016 года и предоставленные на срок более 1 года в иностранной валюте физическим лицам, в том числе потребительские кредиты, за исключением отнесенных к III группе риска, и не имеющим соответствующей валютной выручки и (или) валютные риски которых не покрыты соответствующими инструментами хеджирования со стороны заемщика | 200 | |
| 74 | Необеспеченные займы, выданные физическим лицам с 1 января 2016 года, в том числе потребительские кредиты, соответствующие одному из следующих критериев согласно строке 74 приложения 5 к Нормативным значениям и методикам расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату, установленным согласно приложению 1 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 13 сентября 2017 года №170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №15886 (далее – Нормативы № 170) | 150 | |
| 75 | Необеспеченные займы, выданные физическим лицам с 1 января 2016 года, в том числе потребительские кредиты соответствующие одному из критериев согласно строке 75 приложения 5 к Нормативам №170 | 150 | |
| 76 | Прочие займы, предоставленные физическим лицам с 1 января 2016 года, в том числе потребительские кредиты (за исключением ипотечных жилищных займов и займов физическим лицам, указанных в строках 74 и 75 настоящей таблицы) | 100 | |
| 77 | Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг от "BB+" до "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 100 | |
| 78 | Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг от "BB+" до "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и международных финансовых организациях, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 100 | |
| 79 | Вклады в организациях-резидентах, имеющих долговой рейтинг ниже "А-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациях-резидентах, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки, и организациях-нерезидентах, | | |

| | | | | |
|----|---|--|-----|--|
| | имеющих долговой рейтинг от "BBB+" до "BB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 100 | |
| 80 | Дебиторская задолженность организаций-резидентов, имеющих долговой рейтинг ниже "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организаций-резидентов, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки, и организаций-нерезидентов, имеющих долговой рейтинг от "BBB+" до "BB-" агентства Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 100 | |
| 81 | Дебиторская задолженность физических лиц | | 100 | |
| 82 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "BBB+" до "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | | 100 | |
| 83 | Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, имеющих суверенный рейтинг от "BBB+" до "BB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | | 100 | |
| 84 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг от "BBB+" до "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и международными финансовыми организациями, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки | | 100 | |
| 85 | Ценные бумаги, выпущенные организациями-резидентами, имеющими долговой рейтинг ниже "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациями-резидентами, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки, и организациями-нерезидентами, имеющими долговой рейтинг от "BBB+" до "BB-" агентства Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 100 | |
| 86 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на балансе, и имеющие кредитный рейтинг от "BBB+" до "BBB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку от "kzBBB+" до "kzBBB-" по национальной шкале агентства Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | | 100 | |
| 87 | Ценные бумаги, выпущенные специальной финансовой компанией акционерного общества "Фонд стрессовых активов" | | 100 | |
| 88 | Требования по открытым корреспондентским счетам к банкам-резидентам Республики Казахстан, имеющим долговой рейтинг ниже "BB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или банку-нерезиденту, имеющему долговой рейтинг ниже "BBB+" агентства Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 100 | |
| 89 | Начисленное вознаграждение по активам, включенным в IV группу риска | | 100 | |
| 90 | Расчеты по платежам | | 100 | |
| 91 | Основные средства | | 100 | |
| 92 | Материальные запасы | | 100 | |

| | | | | |
|----------|---|--|-----|--|
| 93 | Предоплата суммы вознаграждения и расходов | | 100 | |
| V группа | | | | |
| 94 | Инвестиции, учитываемые по справедливой стоимости, в части акций (долей участия в уставном капитале) и вложений в субординированный долг юридических лиц, за исключением инвестиций банка | | 100 | |
| 95 | Сумма всех инвестиций банка, каждая из которых составляет менее 10 (десяти) процентов от выпущенных акций (долей участия в уставном капитале) юридического лица, финансовая отчетность которого не консолидируется при составлении финансовой отчетности банка, не превышающая 10 (десять) процентов основного капитала | | 100 | |
| 96 | Сумма всех инвестиций банка, каждая из которых составляет 10 (десять) и более процентов от выпущенных акций (долей участия в уставном капитале) юридического лица, финансовая отчетность которого не консолидируется при составлении финансовой отчетности банка, не превышающая 15 (пятнадцать) процентов основного капитала | | 250 | |
| 97 | Займы, предоставленные центральным правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 150 | |
| 98 | Займы, предоставленные центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 150 | |
| 99 | Займы, предоставленные международным финансовым организациям, имеющим долговой рейтинг ниже "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 150 | |
| 100 | Займы, предоставленные местным органам власти стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "BB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 150 | |
| 101 | Займы, предоставленные организациям-нерезидентам, имеющим долговой рейтинг ниже "BB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациям-нерезидентам, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки | | 150 | |
| 102 | Займы, выданные с 1 января 2016 года и предоставленные на срок более 1 (одного) года в иностранной валюте организациям-нерезидентам, имеющим долговой рейтинг ниже "BB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациям-нерезидентам, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки, и не имеющим соответствующей валютной выручки и (или) валютные риски которых не покрыты соответствующими инструментами хеджирования со стороны заемщика | | 200 | |
| 103 | Займы, предоставленные нерезидентам Республики Казахстан, являющимся юридическими лицами, зарегистрированными на территории нижеуказанных иностранных государств*, или их* гражданами: | | 150 | |
| 104 | Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 150 | |
| 105 | Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг ниже "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 150 | |
| | | | | |

| | | | |
|-----|--|-----|--|
| 106 | Вклады в организациях-нерезидентах, имеющих долговой рейтинг ниже "BB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациях-нерезидентах, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 150 | |
| 107 | Вклады в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, зарегистрированных на территории иностранных государств* | 150 | |
| 108 | Дебиторская задолженность организаций-нерезидентов, имеющих долговой рейтинг ниже "BB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организаций-нерезидентов, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 150 | |
| 109 | Дебиторская задолженность организаций-нерезидентов Республики Казахстан, зарегистрированных на территории иностранных государств* | 150 | |
| 110 | Ценные бумаги, выпущенные центральными правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 150 | |
| 111 | Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, суверенный рейтинг которых ниже "BB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 150 | |
| 112 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг ниже "B-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 150 | |
| 113 | Ценные бумаги, выпущенные организациями-нерезидентами, имеющими долговой рейтинг ниже "BB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациями-нерезидентами, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки | 150 | |
| 114 | Ценные бумаги, выпущенные организациями-нерезидентами Республики Казахстан, зарегистрированными на территории иностранных государств* | 150 | |
| 115 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на балансе и имеющие кредитный рейтинг от "BB+" до "BB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" до "kzBB-" по национальной шкале агентства Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 350 | |
| 116 | Начисленное вознаграждение по активам, включенным в V группу риска | 150 | |
| 117 | Итого рисковые активы: | | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а
И с п о л н и т е л ь

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных

д а н н ы х ,

приведено в приложении к настоящей форме.

Примечание:

* Перечень иностранных государств:

- 1) Княжество Андорра;
- 2) Государство Антигуа и Барбуда;
- 3) Содружество Багамских островов;
- 4) Государство Барбадос;
- 5) Государство Бахрейн;
- 6) Государство Белиз;
- 7) Государство Бруней Даруссалам;
- 8) Республика Вануату;
- 9) Республика Гватемала;
- 10) Государство Гренада;
- 11) Республика Джибути;
- 12) Доминиканская Республика;
- 13) Республика Индонезия;
- 14) Испания (только в части территории Канарских островов);
- 15) Республика Кипр;
- 16) Китайская Народная Республика (только в части территорий специальных административных районов Аомынь (Макао) и Сянган (Гонконг));
- 17) Федеральная Исламская Республика Коморские Острова;
- 18) Республика Коста-Рика;
- 19) Малайзия (только в части территории анклава Лабуан);
- 20) Республика Либерия;
- 21) Княжество Лихтенштейн;
- 22) Республика Маврикий;
- 23) Португалия (только в части территории островов Мадейра);
- 24) Мальдивская Республика;
- 25) Республика Мальта;

- 26) Республика Маршалловы острова;
- 27) Княжество Монако;
- 28) Союз Мьянма;
- 29) Республика Науру;
- 30) Нидерланды (только в части территории острова Аруба и зависимых территорий Антильских островов);
- 31) Федеративная Республика Нигерия;
- 32) Новая Зеландия (только в части территории островов Кука и Ниуэ);
- 33) Объединенные Арабские Эмираты (только в части территории города Дубай);
- 34) Республика Палау;
- 35) Республика Панама;
- 36) Независимое Государство Самоа;
- 37) Республика Сейшельские острова;
- 38) Государство Сент-Винсент и Гренадины;
- 39) Федерация Сент-Китс и Невис;
- 40) Государство Сент-Люсия;
- 41) Соединенное Королевство Великобритании и Северной Ирландии (только в части следующих территорий):
 - Острова Ангилья;
 - Бермудские острова;
 - Британские Виргинские острова;
 - Гибралтар;
 - Каймановы острова;
 - Остров Монтсеррат;
 - Острова Теркс и Кайкос;
 - Остров Мэн;
 - Нормандские острова (острова Гернси, Джерси, Сарк, Олдерни);
- 42) Соединенные Штаты Америки (только в части территорий Американских Виргинских островов, острова Гуам и содружества Пуэрто-Рико);
- 43) Королевство Тонга;
- 44) Республика Филиппины;
- 45) Демократическая Республика Шри-Ланка.

Приложение
к форме отчета о расшифровке
активов, взвешенных с
учетом кредитного риска

**Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора
административных данных**

Отчет о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска

Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по заполнению формы "Отчет о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска" (далее - Форма).

2. Форма разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом б) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".

3. Форма составляется ежемесячно банками второго уровня по состоянию на первое число каждого месяца. Данные в Форме заполняются в тысячах тенге.

4. Форму подписывают первый руководитель, главный бухгалтер или лица, уполномоченные ими на подписание отчета, и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению Формы

5. В графе 3 указывается сумма активов, подлежащих взвешиванию по степени кредитного риска.

6. В графе 4 указывается степень риска в процентах для каждой группы активов.

7. В графе 5 указывается сумма активов, указанная в графе 3, умноженная на степень риска в процентах (графа 4).

8. В случае отсутствия сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

Приложение 4
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 29 ноября 2017 года № 237

Приложение 4
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 8 мая 2015 года № 75

Форма, предназначенная для сбора административных данных
Отчет о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом
кредитного риска

Отчетный период: на " ____ " _____ 20 ____ года

(наименование банка)

Индекс: 2-BVU_RUIVO

Периодичность: ежемесячная

Представляет: банк второго уровня

Куда представляется форма: Национальный Банк Республики Казахстан

Срок представления: не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

Форма

(в тысячах тенге)

| № | Наименование статей | Сумма | Коэффициент конверсии в процентах | Коэффициент кредитного риска в процентах | Сумма к расчету |
|----------|--|-------|-----------------------------------|--|-----------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| I группа | | | | | |
| 1.1 | Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", Акционерного общества "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка; ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", Акционерного общества "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard& Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 0 | | |
| | Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard& Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, | | | | |

| | | | | |
|-----|--|---|----|--|
| 1.2 | <p>предоставленными в распоряжение банка; ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 0 | 20 | |
| 1.3 | <p>Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка; ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 0 | 50 | |
| 1.4 | <p>Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка; ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых</p> | 0 | | |

| | | | | |
|-----|---|---|-----|--|
| | агентств, выданные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 100 | |
| 1.5 | Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка; ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 150 | |
| 1.6 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, Акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", Акционерным обществом "Национальный управляющий холдинг " Байтерек" или ценных бумаг, выпущенных центральными правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, заключенные с контрапартнерами, входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 0 | |
| 1.7 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, Акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына" или ценных бумаг, выпущенных центральными правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, заключенные с | 0 | | |

| | | | | | |
|------|--|---|--|-----|--|
| | контрпартнерами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | | 20 | |
| 1.8 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, Акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына" или ценных бумаг, выпущенных центральными правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, заключенные с контрапартнерами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | | 50 | |
| 1.9 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, Акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына" или ценных бумаг, выпущенных центральными правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, заключенные с контрапартнерами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | | 100 | |
| 1.10 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, Акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына" или ценных бумаг, выпущенных центральными правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, заключенные с контрапартнерами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | | 150 | |
| | Аккредитивы банка: без финансовых обязательств банка; обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", Акционерного общества "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, | | | | |

| | | | | |
|------|--|---|----|--|
| 1.11 | <p>имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", Акционерного общества "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффилированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка, выставленные в пользу лиц, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 0 | 0 | |
| 1.12 | <p>Аккредитивы банка: без финансовых обязательств банка; обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффилированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка, выставленные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 0 | 20 | |
| 1.13 | <p>Аккредитивы банка: без финансовых обязательств банка; обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный</p> | 0 | | |

| | | | | |
|------|---|---|-----|--|
| | рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка, выставленные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 50 | |
| 1.14 | Аккредитивы банка: без финансовых обязательств банка; обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка, выставленные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 100 | |
| 1.15 | Аккредитивы банка: без финансовых обязательств банка; обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка, выставленные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 150 | |
| 1.16 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов, подлежащие | 0 | | |

| | | | | |
|------|--|---|-----|--|
| | отмене в любой момент по требованию банка, заключенные с лицами, входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 0 | |
| 1.17 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию банка, заключенные с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 20 | |
| 1.18 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию банка, заключенные с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 50 | |
| 1.19 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию банка, заключенные с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 100 | |
| 1.20 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию банка, заключенные с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 150 | |
| 1.21 | Гарантии и поручительства банка, выданные в пользу дочерних компаний банка, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска при привлечении через них внешних займов и размещении долговых обязательств банка | 0 | 0 | |
| 1.22 | Гарантии и поручительства банка, выданные в пользу дочерних компаний банка, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска при привлечении через них внешних займов и размещении долговых обязательств банка | 0 | 20 | |
| 1.23 | Гарантии и поручительства банка, выданные в пользу дочерних компаний банка, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска при привлечении через них внешних займов и размещении долговых обязательств банка | 0 | 50 | |
| 1.24 | Гарантии и поручительства банка, выданные в пользу дочерних компаний банка, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска при привлечении через них внешних займов и размещении долговых обязательств банка | 0 | 100 | |
| 1.25 | Гарантии и поручительства банка, выданные в пользу дочерних компаний банка, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска при привлечении через них внешних займов и размещении долговых обязательств банка | 0 | 150 | |
| 1.26 | Гарантии, принятые банком в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 0 | |

| | | | | |
|-----------|--|----|-----|--|
| 1.27 | Гарантии, принятые банком в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 20 | |
| 1.28 | Гарантии, принятые банком в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 50 | |
| 1.29 | Гарантии, принятые банком в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 100 | |
| 1.30 | Гарантии, принятые банком в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 0 | 150 | |
| 1.31 | Инструменты ликвидности, предоставленные банком специальной финансовой компании | 0 | - | |
| II группа | | | | |
| 2.1 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 20 | 0 | |
| 2.2 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 20 | 20 | |
| 2.3 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 20 | 50 | |
| 2.4 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 20 | 100 | |
| 2.5 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 20 | 150 | |
| 2.6 | Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poor's или рейтинг | 20 | | |

| | | | | |
|-----|---|----|-----|--|
| | аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в лиц заемщиков, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 0 | |
| 2.7 | Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 20 | 20 | |
| 2.8 | Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 20 | 50 | |
| 2.9 | Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 20 | 100 | |
| | Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до " | | | |

| | | | | | |
|------|--|----|-----|--|--|
| 2.10 | <p>AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 20 | 150 | | |
| 2.11 | <p>Аккредитивы банка, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 20 | 0 | | |
| 2.12 | <p>Аккредитивы банка, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 20 | 20 | | |
| | <p>Аккредитивы банка, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами)</p> | | | | |

| | | | | |
|------|--|----|-----|--|
| 2.13 | <p>центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 20 | 50 | |
| 2.14 | <p>Аккредитивы банка, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 20 | 100 | |
| 2.15 | <p>Аккредитивы банка, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poog's или рейтинг</p> | 20 | | |

| | | | | |
|------|---|----|-----|--|
| | аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 150 | |
| 2.16 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "AAA" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzAAA" до "kzAA-" по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 20 | 20 | |
| 2.17 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "AAA" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzAAA" до "kzAA-" по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 20 | 50 | |
| 2.18 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "AAA" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzAAA" до "kzAA-" по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 20 | 100 | |
| 2.19 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "AAA" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzAAA" до "kzAA-" по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 20 | 150 | |
| 2.20 | Инструменты ликвидности, предоставленные банком специальной финансовой компании с первоначальным сроком погашения до одного года включительно | 20 | - | |

| III группа | | | | | |
|------------|--|--|----|-----|--|
| 3.1 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 50 | 0 | |
| 3.2 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 50 | 20 | |
| 3.3 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 50 | 50 | |
| 3.4 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 50 | 100 | |
| 3.5 | Возможные (условные) обязательства по размещению банком в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 50 | 150 | |
| 3.6 | Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами | | 50 | | |

| | | | | |
|-----|--|----|----|--|
| | <p>юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | | 0 | |
| 3.7 | <p>Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 50 | 20 | |
| | <p>Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;</p> | | | |

| | | | | |
|-----|---|----|-----|--|
| 3.8 | <p>ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 50 | 50 | |
| 3.9 | <p>Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 50 | 100 | |
| | <p>Гарантии и поручительства банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poog's или рейтинг</p> | | | |

| | | | | |
|------|--|----|-----|--|
| 3.10 | <p>аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "А-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 50 | 150 | |
| 3.11 | <p>Аккредитивы банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "А-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "А-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц,</p> | 50 | | |

| | | | | |
|------|--|----|----|--|
| | входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 0 | |
| 3.12 | Аккредитивы банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 50 | 20 | |
| 3.13 | Аккредитивы банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; | 50 | | |

| | | | | |
|------|---|----|-----|--|
| | <p>ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | | 50 | |
| 3.14 | <p>Аккредитивы банка, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "А-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "А-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 50 | 100 | |
| | <p>Аккредитивы банка, обязательства по которым полностью обеспечены; встречными гарантиями (поручительствами) центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "А-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций,</p> | | | |

| | | | | | |
|------|--|----|-----|--|--|
| 3.15 | <p>имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами центральных правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "BBB-" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "A-" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "AA-" и выше агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 50 | 150 | | |
| 3.16 | <p>Возможные (условные) обязательства по обратному выкупу у акционерного общества "Казахстанская ипотечная компания" прав требований по ипотечным жилищным займам</p> | 50 | 100 | | |
| 3.17 | <p>Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzA+" до "kzA-" по национальной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 50 | 20 | | |
| 3.18 | <p>Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzA+" до "kzA-" по национальной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска</p> | 50 | 50 | | |
| 3.19 | <p>Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzA+" до "kzA-" по национальной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых</p> | 50 | | | |

| | | | | | |
|-----------|---|-----|-----|--|--|
| | агентств, по отношению к лицам, входящим в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 100 | | |
| 3.20 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzA+" до "kzA-" по национальной шкале агентства Standard & Poog's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 50 | 150 | | |
| 3.21 | Инструменты ликвидности, предоставленные банком специальной финансовой компании с первоначальным сроком погашения свыше одного года | 50 | - | | |
| IV группа | | | | | |
| 4.1 | Соглашение о продаже банку и с обязательством обратного выкупа банком финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 0 | | |
| 4.2 | Соглашение о продаже банку и с обязательством обратного выкупа банком финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 20 | | |
| 4.3 | Соглашение о продаже банку и с обязательством обратного выкупа банком финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 50 | | |
| 4.4 | Соглашение о продаже банку и с обязательством обратного выкупа банком финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 100 | | |
| 4.5 | Соглашение о продаже банку и с обязательством обратного выкупа банком финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 150 | | |
| 4.6 | Иные гарантии (поручительства) банка, выданные в пользу лиц, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 0 | | |
| 4.7 | Иные гарантии (поручительства) банка, выданные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 20 | | |
| 4.8 | Иные гарантии (поручительства) банка, выданные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 50 | | |
| 4.9 | Иные гарантии (поручительства) банка, выданные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 100 | | |
| | | | | | |

| | | | | |
|------|---|-----|-----|--|
| 4.10 | Иные гарантии (поручительства) банка, выданные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 150 | |
| 4.11 | Иные аккредитивы банка, выставленные в пользу лиц, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 0 | |
| 4.12 | Иные аккредитивы банка, выставленные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 20 | |
| 4.13 | Иные аккредитивы банка, выставленные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 50 | |
| 4.14 | Иные аккредитивы банка, выставленные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 100 | |
| 4.15 | Иные аккредитивы банка, выставленные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 150 | |
| 4.16 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "BBB+" до "BBB-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBBB+" до "kzBBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 20 | |
| 4.17 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "BBB+" до "BBB-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBBB+" до "kzBBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 50 | |
| 4.18 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "BBB+" до "BBB-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBBB+" до "kzBBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 100 | |
| | | | | |

| | | | | |
|------|---|-----|-----|--|
| 4.19 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "BBB+" до "BBB-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBBB+" до "kzBBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 150 | |
| 4.20 | Иные условные (возможные) обязательства банка, перед лицами, входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 0 | |
| 4.21 | Иные условные (возможные) обязательства банка, перед лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 20 | |
| 4.22 | Иные условные (возможные) обязательства банка, перед лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 50 | |
| 4.23 | Иные условные (возможные) обязательства банка, перед лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 100 | |
| 4.24 | Иные условные (возможные) обязательства банка, перед лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 100 | 150 | |
| 4.25 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "BB+" до "BB-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" до "kzBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 350 | 20 | |
| 4.26 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "BB+" до "BB-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" до "kzBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | 350 | 50 | |
| | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "BB+" до "BB-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других | | | |

| | | | | | |
|------|---|--|-----|-----|--|
| 4.27 | рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" до "kzBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 350 | 100 | |
| 4.28 | Позиции секьюритизации, удерживаемые банком на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "BB+" до "BB-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" до "kzBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска | | 350 | 150 | |
| 5 | Итого условные обязательства, взвешенные по степени кредитного риска: | | X | X | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

И с п о л н и т е л ь

 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место _____ для печати (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных
 д а н н ы х ,

приведено в приложении к настоящей форме.

Приложение
 к форме отчета о
 расшифровке условных и

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных

Отчет о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска

Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по заполнению формы "Отчет о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска" (далее - Форма).

2. Форма разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом б) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".

3. Форма составляется ежемесячно банками второго уровня по состоянию на первое число каждого месяца. Данные в Форме заполняются в тысячах тенге.

4. Форму подписывают первый руководитель, главный бухгалтер или лица, уполномоченные ими на подписание отчета, и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению Формы

5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 13 сентября 2017 года №170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №15886.

6. В графе 3 указывается сумма по условным и возможным обязательствам, подлежащим взвешиванию с учетом кредитного риска.

7. В графе 6 указывается сумма по условным и возможным обязательствам, указанная в графе 3, умноженная на значение коэффициента конверсии в процентах (графа 4), и значение коэффициента кредитного риска в процентах (графа 5).

8. В случае отсутствия сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

к постановлению Правления
 Национального Банка
 Республики Казахстан
 от 29 ноября 2017 года № 237
 Приложение 6
 к постановлению Правления
 Национального Банка
 Республики Казахстан
 от 8 мая 2015 года № 75

Форма, предназначенная для сбора административных данных

Отчет о расшифровке расчета специфического процентного риска (в разрезе валют)

Отчетный период: на " ___ " _____ 20__ года

(наименование банка)

Индекс: 1-BVU_RSPR

Периодичность: ежемесячная

Представляет: банк второго уровня

Куда представляется форма: Национальный Банк Республики Казахстан

Срок представления: не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

Форма

(в тысячах тенге)

| № | Наименование | Сумма | Коэффициент специфического риска в процентах | Сумма к расчету |
|---|---|-------|--|-----------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 | Сумма открытых позиций по однородным финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением ставки вознаграждения в виде государственных ценных бумаг Республики Казахстан, ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными Правительствами и центральными банками иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 0 | |
| 2 | Сумма открытых позиций по однородным финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением ставки вознаграждения со сроком погашения менее 6 месяцев в виде государственных ценных бумаг Республики Казахстан, выпущенных местными органами власти Республики Казахстан, ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными Правительствами и центральными банками иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "BBB-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, ценных бумаг, выпущенных международными финансовыми организациями, ценных бумаг, включенных в официальный список организаторов торгов Республики Казахстан и организаторов торгов, признаваемых международными фондовыми биржами | | 0,25 | |

| | | | | |
|------------------------|--|---|-----|---|
| 3 | Сумма открытых позиций по однородным финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением ставки вознаграждения со сроком погашения от 6 месяцев до 24 месяцев в виде государственных ценных бумаг Республики Казахстан, выпущенных местными органами власти Республики Казахстан, ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными Правительствами и центральными банками иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "BBB-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, ценных бумаг, выпущенных международными финансовыми организациями, ценных бумаг, включенных в официальный список организаторов торгов Республики Казахстан и организаторов торгов, признаваемых международными фондовыми биржами | | 1 | |
| 4 | Сумма открытых позиций по однородным финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением ставки вознаграждения со сроком погашения более 24 месяцев в виде государственных ценных бумаг Республики Казахстан, выпущенных местными органами власти Республики Казахстан, ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными Правительствами и центральными банками иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "BBB-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, ценных бумаг, выпущенных международными финансовыми организациями, ценных бумаг, включенных в официальный список организаторов торгов Республики Казахстан и организаторов торгов, признаваемых международными фондовыми биржами | | 1,6 | |
| 5 | Сумма открытых позиций по однородным финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением ставки | | 8 | |
| Итого специфичный риск | | 0 | X | 0 |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а

Телефон: _____

Место _____ для печати (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных, приведено в приложении к настоящей форме.

Приложение
к форме отчета о расшифровке
расчета специфического
процентного риска
(в разрезе валют)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных

Отчет о расшифровке расчета специфического процентного риска (в разрезе валют)

Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по заполнению формы "Отчет о расшифровке расчета специфического процентного риска (в разрезе валют)" (далее - Форма).

2. Форма разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом б) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".

3. Форма составляется ежемесячно банками второго уровня по состоянию на первое число каждого месяца. Данные в Форме заполняются в тысячах тенге.

4. Форму подписывают первый руководитель, главный бухгалтер или лица, уполномоченные ими на подписание отчета, и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению Формы

5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 13 сентября 2017 года №170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №15886 (далее – Постановление № 170).

6. В графе 3 указывается сумма открытых позиций по однородным финансовым инструментам.

| | | | | | | | | |
|-------|---|---|---|---|---|---|---|--|
| 2 | | | | | | | | |
| ... | | | | | | | | |
| Итого | X | X | X | X | X | X | X | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Исполнитель

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Отчет о расшифровке совокупной задолженности одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, связанных с банком особыми отношениями по любому виду обязательств перед банком

| № | Наименование заемщика | БИН / ИИН | Признак связанности с банком особыми отношениями | Признак взаимосвязанности заемщиков | Сумма требований | | Обеспечение | | Размер риска, тысяч тенге |
|-------|-----------------------|-----------|--|-------------------------------------|------------------|-------------|-----------------|-------------|---------------------------|
| | | | | | балансовый счет | тысяч тенге | вид обеспечения | тысяч тенге | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 |
| 1 | | | | | | | | | |
| 2 | | | | | | | | | |
| ... | | | | | | | | | |
| Итого | | X | X | X | X | X | X | X | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Отчет о расшифровке суммы рисков по всем заемщикам, связанным с банком особыми отношениями

| № | Наименование заемщика | БИН / ИИН | Признак связанности с банком особыми отношениями | Сумма требований | | Обеспечение | | Размер риска, тысяч тенге |
|-----|-----------------------|-----------|--|------------------|-------------|-------------------|-------------|---------------------------|
| | | | | балансовый счет | тысяч тенге | в и д обеспечения | тысяч тенге | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| 1 | | | | | | | | |
| 2 | | | | | | | | |
| ... | | | | | | | | |
| | Итого | X | X | X | X | X | X | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Отчет о расшифровке максимальной суммы 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 & Poor's или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств 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

| № | Наименование заемщика | БИН/ИИН | Признак взаимосвязанности заемщиков | Размер риска, тысяч тенге | |
|-----|-----------------------|---------|-------------------------------------|---------------------------|-------------|
| | | | | балансовый счет | тысяч тенге |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| 2 | | | | | |
| ... | | | | | |
| | Итого | X | X | X | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Отчет о расшифровке совокупной суммы рисков банка на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10 процентов от собственного капитала банка

| № | Наименование заемщика | БИН / ИИН | Признак взаимосвязанности заемщиков | Сумма требований | | Обеспечение | | Размер риска, тысяч тенге |
|-----|-----------------------|-----------|-------------------------------------|------------------|-------------|-------------------|-------------|---------------------------|
| | | | | балансовый счет | тысяч тенге | в и д обеспечения | тысяч тенге | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| 2 | | | | | | | | |
| ... | | | | | | | | |
| | Итого | X | X | X | X | X | X | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Исполнитель

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных

д а н н ы х ,

приведено в приложении к настоящей форме.

Отчет о расшифровке совокупной суммы секьюритизированных кредитов, переданных специальной финансовой компании акционерного общества "Фонд стрессовых активов"

| № | Совокупная сумма секьюритизированных кредитов, переданных специальной финансовой компании акционерного общества "Фонд стрессовых активов" | Сумма переданных секьюритизированных кредитов | | Размер риска, тысяч тенге |
|-----|---|---|-------------|---------------------------|
| | | балансовый счет | тысяч тенге | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 | | | | |
| 2 | | | | |
| ... | | | | |
| | Итого | X | | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

 — — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а
 Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

 — — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а
 Исполнитель

 — — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а
 Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных, приведено в приложении к настоящей форме.

Приложение
 к форме отчета
 о расшифровке
 максимального размера
 риска на одного заемщика
 (в разрезе заемщиков)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных

Отчет о расшифровке максимального размера риска на одного заемщика (в разрезе заемщиков)

Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по заполнению Формы "Отчет о расшифровке максимального размера риска на одного заемщика (в разрезе заемщиков)" (далее - Форма).

2. Форма разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом б) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".

3. Форма составляется ежемесячно банками второго уровня по состоянию на первое число каждого месяца. Данные в Форме заполняются в тысячах тенге.

4. Форму подписывают первый руководитель, главный бухгалтер или лица, уполномоченные ими на подписание отчета, и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению Формы

5. Форма заполняется в соответствии с постановлениями Правления Национального Банка Республики Казахстан от 30 мая 2016 года №144 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков, их нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №13939 (далее - Постановление № 144) и от 13 сентября 2017 года №170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №15886 (далее – Постановление № 170).

6. При заполнении Формы указываются сведения, рассчитанные в соответствии с главой 3 "Максимальный размер риска на одного заемщика" Нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков, установленных согласно приложению 1 к Постановлению №144 и главой 4 "Максимальный размер риска на одного заемщика"

Нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату, установленных согласно приложению 1 к Постановлению №170.

7. Форма содержит шесть таблиц. В случае отсутствия сведений в отчетном периоде указанные таблицы не заполняются и не представляются.

Приложение 7
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 29 ноября 2017 года № 237

Приложение 11
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 8 мая 2015 года № 75

Форма, предназначенная для сбора административных данных

Отчет о расшифровке коэффициента текущей ликвидности к4

Отчетный период: за _____20__ года

(наименование банка)

Индекс: 1-BVU_R_K4

Периодичность: ежемесячная

Представляет: банк второго уровня

Куда представляется форма: Национальный Банк Республики Казахстан

Срок представления: не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

Форма

(в тысячах тенге)

Отчет о расшифровке среднемесячной величины высоколиквидных активов

| № | Наименование статьи | | | | | | Среднемесячная величина |
|---|--|---|---|---|----|---|----------------------------|
| | | 1 | 2 | 3 | 31 | . | |
| 1 | Наличность в кассе | | | | | | |
| 2 | Банкноты и монеты в пути | | | | | | |
| 3 | Наличность в обменных пунктах | | | | | | |
| 4 | Наличность в банкоматах и электронных терминалах | | | | | | |
| 5 | Деньги в дорожных чеках в пути | | | | | | |
| 6 | Монеты, изготовленные из драгоценных металлов, в кассе | | | | | | |
| 7 | Деньги в дорожных чеках | | | | | | |
| 8 | Коллекционные монеты, изготовленные из недрагоценных металлов, в кассе | | | | | | |
| 9 | Аффинированные драгоценные металлы | | | | | | |

| | | | | | | |
|----|---|--|--|--|--|--|
| 10 | Аффинированные драгоценные металлы в пути | | | | | |
| 11 | Аффинированные драгоценные металлы, размещенные на металлических счетах | | | | | |
| 12 | Корреспондентский счет в Национальном Банке Республики Казахстан | | | | | |
| 13 | Собственные деньги на счетах в центральном депозитарии | | | | | |
| 14 | Собственные деньги на счетах в клиринговой организации, являющиеся гарантийными, маржевыми взносами банка | | | | | |
| 15 | Вклады в Национальном Банке Республики Казахстан (на одну ночь) | | | | | |
| 16 | Вклады до востребования в Национальном Банке Республики Казахстан | | | | | |
| 17 | Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Правительством Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан, ценные бумаги, выпущенные акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына" и акционерным обществом "Национальный управляющий холдинг " Байтерек" | | | | | |
| 18 | Вклады до востребования в банках Республики Казахстан и банках-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долгосрочный долговой рейтинг не ниже "BBB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | | | | |
| 19 | Займы "овернайт", предоставленные банкам Республики Казахстан и банкам-нерезидентам Республики Казахстан, имеющим долгосрочный долговой рейтинг не ниже "BBB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | | | | |
| 20 | Вклады, размещенные на одну ночь в банках Республики Казахстан и банках-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долгосрочный долговой рейтинг не ниже "BBB-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | | | | |
| 21 | Государственные ценные бумаги стран, имеющих суверенный долгосрочный рейтинг в иностранной валюте не ниже уровня, установленного постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 28 июня 2013 года № 141 "Об установлении рейтинговых агентств и минимального требуемого рейтинга для облигаций, с которыми банки могут осуществлять сделки", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 8594 | | | | | |
| 22 | Облигации иностранных эмитентов, имеющими рейтинг не ниже "BBB-" (по классификации рейтинговых агентств Standard & Poor's и (или) Fitch) или не ниже "Баа3" (по классификации рейтингового агентства Moody's Investors Service) | | | | | |
| 23 | Срочные депозиты в Национальном Банке Республики Казахстан со сроком погашения до 7 дней | | | | | |
| 24 | Исламские ценные бумаги, выпущенные исламской специальной финансовой компанией, созданной оригинатором - национальным холдингом, национальным управляющим холдингом, юридическими лицами, 100 процентов голосующих акций (долей участия) которых принадлежат национальному управляющему холдингу | | | | | |
| 25 | Исламские ценные бумаги стран, имеющих суверенный долгосрочный рейтинг в иностранной валюте не ниже "BBB-" агентства Standard & Poor' | | | | | |

| | | | | | | | | | |
|--------|---|--|--|--|--|--|--|--|--|
| | s или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | | | | | | | |
| 26 | Исламские ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющих рейтинг не ниже "BBB-" агентства Standard & Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | | | | | | | |
| 27 | Начисленное вознаграждение, дисконты, премии, счета положительных/отрицательных корректировок справедливой стоимости, включаемые в расчет высоколиквидных активов | | | | | | | | |
| 28 | Неинвестированные остатки средств, принятые банком на хранение на основании кастодиальных договоров и принятые в доверительное управление на основании договоров о доверительном управлении | | | | | | | | |
| 29 | Балансовая стоимость государственных ценных бумаг и прочих высоколиквидных ценных бумаг, проданных банком на условиях их обратного выкупа или переданных в залог | | | | | | | | |
| 30 | Требования по операциям валютный своп, учитываемые на балансовых счетах банка, в случае если обязательства по данным сделкам учитываются на балансовых счетах банка и включены в расчет коэффициентов срочной ликвидности | | | | | | | | |
| Итого: | | | | | | | | | |

Количество рабочих дней: ____.

Отчет о расшифровке среднемесячной величины обязательств до востребования

| № | Наименование статьи | | | | | | Среднемесячная величина |
|----|--|---|---|---|----|---|-------------------------|
| | | 1 | 2 | 3 | 31 | . | |
| 1 | Корреспондентские счета Национального Банка Республики Казахстан | | | | | | |
| 2 | Корреспондентские счета иностранных центральных банков | | | | | | |
| 3 | Корреспондентские счета других банков | | | | | | |
| 4 | Корреспондентские счета организаций, осуществляющих отдельные виды банковских операций | | | | | | |
| 5 | Вклады до востребования Национального Банка Республики Казахстан | | | | | | |
| 6 | Вклады до востребования иностранных центральных банков | | | | | | |
| 7 | Вклады до востребования других банков | | | | | | |
| 8 | Просроченная задолженность по вкладам до востребования других банков | | | | | | |
| 9 | Займы овернайт, полученные от Национального Банка Республики Казахстан | | | | | | |
| 10 | Займы овернайт, полученные от иностранных центральных банков | | | | | | |
| 11 | Займы овернайт, полученные от других банков | | | | | | |
| 12 | Вклады, привлеченные от других банков на одну ночь | | | | | | |
| 13 | Деньги государственного бюджета | | | | | | |
| 14 | Текущие счета клиентов | | | | | | |
| 15 | Срочные обязательства с безусловным правом кредитора требовать досрочного погашения обязательств, в том числе срочные и условные | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--------|---|--|--|--|--|--|--|
| | депозиты банков, за исключением срочных и условных депозитов физических и юридических лиц, аффинированных драгоценных металлов | | | | | | |
| 16 | Вклады до востребования клиентов | | | | | | |
| 17 | Прочие обязательства до востребования, в том числе обязательства, по которым не установлен срок осуществления расчета, включаемые в расчет коэффициента текущей ликвидности | | | | | | |
| 18 | Неинвестированные остатки средств, принятые банком на хранение на основании кастодиальных договоров и принятые в доверительное управление на основании договоров о доверительном управлении | | | | | | |
| 19 | Начисленное вознаграждение, дисконты, премии, счета положительных / отрицательных корректировок справедливой стоимости по обязательствам до востребования | | | | | | |
| 20 | Необеспеченные гарантии и поручительства банка, выданные при привлечении внешних займов дочерними организациями банка, аффилированными с банком юридическими лицами, а также в рамках сделок банка по секьюритизации, с правом кредитора требовать досрочного погашения обязательств должника, со сроком погашения менее трех лет, умноженный на коэффициент конверсии равный 50 процентов и коэффициент достаточности собственного капитала банка (k2) за исключением гарантий и поручительств банка, выданных при привлечении займов, включаемых в расчет норматива k4 | | | | | | |
| 21 | Необеспеченные гарантии и поручительства банка, выданные при привлечении внешних займов дочерними организациями банка, аффилированными с банком юридическими лицами, а также в рамках сделок банка по секьюритизации, с правом кредитора требовать досрочного погашения обязательств должника, со сроком погашения три года и более, умноженный на коэффициент конверсии равный 100 процентов и коэффициент достаточности собственного капитала банка (k2) за исключением гарантий и поручительств банка, выданных при привлечении займов, включаемых в расчет норматива k4 | | | | | | |
| Итого: | | | | | | | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место _____ для _____ печати _____ (при _____ наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных
д а н н ы х ,

приведено в приложении к настоящей форме.

Приложение
к форме отчета
о расшифровке коэффициента
текущей ликвидности k4

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных

Отчет о расшифровке коэффициента текущей ликвидности k4

Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по заполнению формы "Отчет о расшифровке коэффициента текущей ликвидности k4" (далее - Форма).

2. Форма разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом б) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".

3. Форма составляется ежемесячно банками второго уровня и заполняется за каждый рабочий день отчетного периода. Данные в Форме заполняются в тысячах тенге.

4. Форму подписывают первый руководитель, главный бухгалтер или лица, уполномоченные ими на подписание отчета, и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению Формы

5. Форма заполняется в соответствии с постановлениями Правления Национального Банка Республики Казахстан от 30 мая 2016 года №144 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков, их нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №13939 (далее - Постановление № 144) и от 13 сентября 2017 года №170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов

и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №15886 (далее – Постановление № 170).

6. При заполнении таблицы "Отчет о расшифровке среднемесячной величины высоколиквидных активов" указываются сведения по высоколиквидным активам в соответствии с пунктами 44 и 45 Нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков, установленных согласно приложению 1 к Постановлению №144 и пунктами 65, 66 и 67 Нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату, установленных согласно приложению 1 к Постановлению №170.

7. Строки 24, 25 и 26 таблицы "Отчет о расшифровке среднемесячной величины высоколиквидных активов" заполняются только исламскими банками.

8. При заполнении Формы в графе "Среднемесячная величина" указывается отношение совокупной суммы высоколиквидных активов/обязательств до востребования за каждый рабочий день отчетного периода к количеству рабочих дней в отчетном периоде.

9. При заполнении Формы указывается количество рабочих дней.

10. Требования по операциям валютный своп, учитываемые на балансовых счетах банка, включаются в расчет высоколиквидных активов в случае, если обязательства по данным сделкам учитываются на балансовых счетах банка и включены в расчет коэффициентов срочной ликвидности.

11. В случае отсутствия сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

Приложение 8
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 29 ноября 2017 года № 237
Приложение 12
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 8 мая 2015 года № 75

Форма, предназначенная для сбора административных данных

Отчет о расшифровке коэффициентов срочной ликвидности к4-1, к4-2, к4-3

Отчетный период: за _____ 20__ года

(наименование банка)

Индекс: 1-BVU_R_K4-1, k4-2, k4-3

Периодичность: ежемесячная

Представляет: банк второго уровня

Куда представляется форма: Национальный Банк Республики Казахстан

Срок представления: не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

Форма

(в тысячах тенге)

Отчет о расшифровке коэффициента срочной ликвидности k4-1

| Дата | Высоколиквидные активы | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до семи дней включительно |
|------|------------------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | | |
| 2 | | |
| 3 | | |
| 4 | | |
| 5 | | |
| 6 | | |
| 7 | | |
| 8 | | |
| 9 | | |
| 10 | | |
| 11 | | |
| 12 | | |
| 13 | | |
| 14 | | |
| 15 | | |
| 16 | | |
| 17 | | |
| 18 | | |
| 19 | | |
| 20 | | |
| 21 | | |
| 22 | | |
| 23 | | |
| 24 | | |
| 25 | | |
| 26 | | |
| 27 | | |
| 28 | | |

| | | |
|---|---|---|
| 29 | | |
| 30 | | |
| 31 | | |
| Количество рабочих дней | | |
| Итого: среднемесячная величина активов | | X |
| Итого: среднемесячная величина обязательств | X | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Отчет о расшифровке коэффициента срочной ликвидности k4-2

| Дата | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до одного месяца, включая высоколиквидные активы | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно |
|------|--|--|
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | | |
| 2 | | |
| 3 | | |
| 4 | | |
| 5 | | |
| 6 | | |
| 7 | | |
| 8 | | |
| 9 | | |
| 10 | | |

| | | |
|---|---|---|
| 11 | | |
| 12 | | |
| 13 | | |
| 14 | | |
| 15 | | |
| 16 | | |
| 17 | | |
| 18 | | |
| 19 | | |
| 20 | | |
| 21 | | |
| 22 | | |
| 23 | | |
| 24 | | |
| 25 | | |
| 26 | | |
| 27 | | |
| 28 | | |
| 29 | | |
| 30 | | |
| 31 | | |
| Количество рабочих дней | | |
| Итого: среднемесячная величина активов | | X |
| Итого: среднемесячная величина обязательств | X | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Отчет о расшифровке коэффициента срочной ликвидности k4-3

| Дата | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, включая высоколиквидные активы | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно |
|------|--|---|
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | | |
| 2 | | |
| 3 | | |
| 4 | | |
| 5 | | |
| 6 | | |
| 7 | | |
| 8 | | |
| 9 | | |
| 10 | | |
| 11 | | |
| 12 | | |
| 13 | | |
| 14 | | |
| 15 | | |
| 16 | | |
| 17 | | |
| 18 | | |
| 19 | | |
| 20 | | |
| 21 | | |
| 22 | | |
| 23 | | |
| 24 | | |
| 25 | | |
| 26 | | |
| 27 | | |
| 28 | | |
| 29 | | |
| 30 | | |

| | | |
|---|---|---|
| 31 | | |
| Количество рабочих дней | | |
| Итого: среднемесячная величина активов | | X |
| Итого: среднемесячная величина обязательств | X | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а

Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных
 д а н н ы х ,

приведено в приложении к настоящей форме.

Приложение
 к форме отчета
 о расшифровке коэффициентов
 срочной ликвидности
 к4-1, к4-2, к4-3

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных

Отчет о расшифровке коэффициентов срочной ликвидности к4-1, к4-2, к4-3

Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по заполнению формы "Отчет о расшифровке коэффициентов срочной ликвидности k4-1, k4-2, k4-3" (далее - Форма).

2. Форма разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом б) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".

3. Форма составляется ежемесячно банками второго уровня и заполняется за каждый рабочий день отчетного периода. Данные в Форме заполняются в тысячах тенге.

4. Форму подписывают первый руководитель, главный бухгалтер или лица, уполномоченные ими на подписание отчета, и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению Формы

5. Форма заполняется в соответствии с постановлениями Правления Национального Банка Республики Казахстан от 30 мая 2016 года №144 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков, их нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №13939 (далее - Постановление № 144) и от 13 сентября 2017 года №170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №15886 (далее – Постановление № 170).

6. При заполнении формы по расчету коэффициента срочной ликвидности k4-1 указывается среднемесячная величина высоколиквидных активов и срочных обязательств с оставшимся сроком до погашения до семи дней включительно, рассчитанных в соответствии с пунктами 44, 45, 46, 47 и 48 Нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков, установленных согласно приложению 1 к Постановлению №144 (далее – Нормативы № 144) и с пунктами 65, 66, 67, 68, 69 и 70 Нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату, установленных согласно приложению 1 к Постановлению №170 (далее – Нормативы № 170).

7. При заполнении форм по расчету коэффициентов срочной ликвидности k4-2 и k4-3 указывается среднемесячная величина ликвидных активов с оставшимся сроком до погашения до одного месяца, включая высоколиквидные активы и срочных обязательств с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно, рассчитанных в соответствии с пунктами 46, 47 и 48 Нормативов № 144 и пунктами 68, 69 и 70 Нормативов № 170.

8. При заполнении форм по расчету коэффициентов срочной ликвидности k4-1, k4-2 и k4-3 в строках "Итого: среднемесячная величина активов" и "Итого: среднемесячная величина обязательств" указывается отношение совокупной суммы включаемых в расчет ликвидных активов/обязательств за каждый рабочий день отчетного периода к количеству рабочих дней в отчетном периоде.

9. При заполнении Формы указывается количество рабочих дней.

10. Форма содержит три таблицы. В случае отсутствия сведений в отчетном периоде указанные таблицы не заполняются и не представляются.

Приложение 9
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 29 ноября 2017 года № 237

Приложение 13
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 8 мая 2015 года № 75

Форма, предназначенная для сбора административных данных

Отчет о расшифровке коэффициентов срочной валютной

ликвидности k4-4, k4-5, k4-6

Отчетный период: за _____ 20__ года

(наименование банка)

Индекс: 1-BVU_R_K4-4, k4-5, k4-6

Периодичность: ежемесячная

Представляет: банк второго уровня

Куда представляется форма: Национальный Банк Республики Казахстан

Срок представления: не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

Форма

(в тысячах тенге)

Отчет о расшифровке коэффициента срочной валютной ликвидности k4-4

| | | |
|--|--|--|
| | | |
|--|--|--|

| Дата | Высоколиквидные активы | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до семи дней включительно |
|---|------------------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | | |
| 2 | | |
| 3 | | |
| 4 | | |
| 5 | | |
| 6 | | |
| 7 | | |
| 8 | | |
| 9 | | |
| 10 | | |
| 11 | | |
| 12 | | |
| 13 | | |
| 14 | | |
| 15 | | |
| 16 | | |
| 17 | | |
| 18 | | |
| 19 | | |
| 20 | | |
| 21 | | |
| 22 | | |
| 23 | | |
| 24 | | |
| 25 | | |
| 26 | | |
| 27 | | |
| 28 | | |
| 29 | | |
| 30 | | |
| 31 | | |
| Количество рабочих дней | | |
| Итого: среднемесячная величина активов | | X |
| Итого: среднемесячная величина обязательств | X | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Отчет о расшифровке коэффициента срочной валютной ликвидности k4-5

| Дата | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до одного месяца, включая высоколиквидные активы | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно, умноженные на коэффициент конверсии равный 90% |
|------|--|--|
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | | |
| 2 | | |
| 3 | | |
| 4 | | |
| 5 | | |
| 6 | | |
| 7 | | |
| 8 | | |
| 9 | | |
| 10 | | |
| 11 | | |
| 12 | | |
| 13 | | |
| 14 | | |
| 15 | | |
| 16 | | |
| 17 | | |
| 18 | | |
| 19 | | |

| | | |
|---|---|---|
| 20 | | |
| 21 | | |
| 22 | | |
| 23 | | |
| 24 | | |
| 25 | | |
| 26 | | |
| 27 | | |
| 28 | | |
| 29 | | |
| 30 | | |
| 31 | | |
| Количество рабочих дней | | |
| Итого: среднемесячная величина активов | | X |
| Итого: среднемесячная величина обязательств | X | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Отчет о расшифровке коэффициента срочной валютной ликвидности k4-6

| | | |
|--|--|--|
| | | |
|--|--|--|

| Дата | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, включая высоколиквидные активы | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, умноженные на коэффициент конверсии равный 80% |
|--|--|---|
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | | |
| 2 | | |
| 3 | | |
| 4 | | |
| 5 | | |
| 6 | | |
| 7 | | |
| 8 | | |
| 9 | | |
| 10 | | |
| 11 | | |
| 12 | | |
| 13 | | |
| 14 | | |
| 15 | | |
| 16 | | |
| 17 | | |
| 18 | | |
| 19 | | |
| 20 | | |
| 21 | | |
| 22 | | |
| 23 | | |
| 24 | | |
| 25 | | |
| 26 | | |
| 27 | | |
| 28 | | |
| 29 | | |
| 30 | | |
| 31 | | |
| Количество рабочих дней | | |
| Итого: среднемесячная величина активов | | X |
| Итого: среднемесячная | | |

| | | |
|--------------------------|---|--|
| величина обязательств | X | |
|--------------------------|---|--|

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а

Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных
 д а н н ы х ,

приведено в приложении к настоящей форме.

Приложение
 к форме отчета
 о расшифровке коэффициентов
 срочной валютной ликвидности
 к4-4, к4-5, к4-6

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных

Отчет о расшифровке коэффициентов срочной валютной ликвидности к4-4, к4-5, к4-6

Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по заполнению формы "Отчет о расшифровке коэффициентов срочной валютной ликвидности к4-4, к4-5, к4-6" (далее - Форма).

2. Форма разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом

б) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".

3. Форма составляется ежемесячно банками второго уровня и заполняется за каждый рабочий день отчетного периода. Данные в Форме заполняются в тысячах тенге.

4. Форму подписывают первый руководитель, главный бухгалтер или лица, уполномоченные ими на подписание отчета, и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению Формы

5. Форма заполняется в соответствии с постановлениями Правления Национального Банка Республики Казахстан от 30 мая 2016 года №144 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков, их нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №13939 (далее - Постановление № 144) и от 13 сентября 2017 года №170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №15886 (далее – Постановление № 170).

6. При заполнении Формы по расчету коэффициента срочной валютной ликвидности k4-4 указывается среднемесячная величина высоколиквидных активов в иностранной валюте и срочных обязательств в этой же иностранной валюте с оставшимся сроком до погашения до семи дней включительно, рассчитанных в соответствии с пунктами 42, 43, 44, 45, 46, 47 и 48 Нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков, установленных согласно приложению 1 к Постановлению №144 (далее – Нормативы № 144) и пунктами 63, 64, 65, 66, 67, 68, 69 и 70 Нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату, установленных согласно приложению 1 к Постановлению №170 (далее – Нормативы № 170).

7. При заполнении Формы по расчету коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-5 указывается среднемесячная величина ликвидных активов в иностранной валюте с оставшимся сроком до погашения до одного месяца, включая высоколиквидные активы и срочных обязательств в этой же иностранной валюте с

оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно, рассчитанных в соответствии с пунктами 42, 43, 44, 45, 46, 47 и 48 Нормативов № 144 и пунктами 63, 64, 65, 66, 67, 68, 69 и 70 Нормативов № 170.

8. При заполнении Формы по расчету коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-6 указывается среднемесячная величина ликвидных активов в иностранной валюте с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев, включая высоколиквидные активы и срочных обязательств в этой же иностранной валюте с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, рассчитанных в соответствии с пунктами 42, 43, 44, 45, 46, 47 и 48 Нормативов № 144 и пунктами 63, 64, 65, 66, 67, 68, 69 и 70 Нормативов № 170.

9. При заполнении Формы по расчету коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-4, k4-5 и k4-6 сведения указываются в совокупности 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" и в разрезе по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" вышеуказанных рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки.

10. В строках "Итого: среднемесячная величина активов" и "Итого: среднемесячная величина обязательств" указывается отношение совокупной суммы включаемых в расчет ликвидных активов/обязательств за каждый рабочий день отчетного периода к количеству рабочих дней в отчетном периоде.

11. При заполнении Формы указывается количество рабочих дней.

12. Форма содержит три таблицы. В случае отсутствия сведений в отчетном периоде указанные таблицы не заполняются и не представляются.

Приложение 10
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 29 ноября 2017 года № 237

Приложение 15
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 8 мая 2015 года № 75

Форма, предназначенная для сбора административных данных

Отчет о расчете среднемесячной величины внутренних активов, внутренних и иных обязательств, коэффициента размещения части средств во внутренние активы

Отчетный период: за _____ 20__ года

(наименование банка)

Индекс: 1-BVU_KVA

Периодичность: ежемесячная

Представляет: банк второго уровня

Куда представляется форма: Национальный Банк Республики Казахстан

Срок представления: не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

Форма

(в тысячах тенге)

Отчет о расчете среднемесячной величины внутренних активов

| № | Активы | Внутренние активы по датам в течение отчетного периода | | | | | Среднемесячная величина |
|----|---|--|---|---|-----|----|-------------------------|
| | | 1 | 2 | 3 | ... | 31 | |
| 1 | Деньги и вклады | | | | | | |
| 2 | Займы выданные | | | | | | |
| 3 | Долевые и долговые ценные бумаги | | | | | | |
| 4 | Дебиторская задолженность | | | | | | |
| 5 | Участие в уставном капитале | | | | | | |
| 6 | Аффинированные драгоценные металлы | | | | | | |
| 7 | Движимое имущество | | | | | | |
| 8 | Недвижимое имущество | | | | | | |
| 9 | Нематериальные активы | | | | | | |
| 10 | Начисленное вознаграждение, дисконты, премии, положительные/отрицательные корректировки справедливой стоимости, провизии (резервы), сформированные на внутренние активы | | | | | | |
| 11 | Просроченная задолженность по внутренним активам | | | | | | |
| 12 | Итого величина внутренних активов | | | | | | |
| 13 | Величина внутренних активов больше или равна среднемесячной величине внутренних обязательств, субординированного долга, выпущенных банком долговых ценных бумаг, собственного капитала или уставного капитала за предыдущий отчетный месяц, умноженной на 0,95 (Да/Нет) | | | | | | |

Отчет о расчете среднемесячной величины внутренних и иных обязательств, коэффициента размещения части средств банка во внутренние активы

| № | Обязательства | Внутренние и иные обязательства по датам в течение отчетного периода | | | | | Среднемесячная величина |
|---|---------------|--|---|---|-----|----|-------------------------|
| | | 1 | 2 | 3 | ... | 31 | |
| | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|----|--|--|--|--|--|--|--|
| 1 | Вклады | | | | | | |
| 2 | Займы полученные | | | | | | |
| 3 | Кредиторская задолженность | | | | | | |
| 4 | Итого величина внутренних обязательств | | | | | | |
| 5 | Уставный капитал | | | | | | |
| 6 | Собственный капитал, за вычетом инвестиций в субординированный долг дочерних организаций-нерезидентов Республики Казахстан, в акций дочерних организаций-нерезидентов Республики Казахстан, умноженный на 0,75 | | | | | | |
| 7 | Субординированный долг | | | | | | |
| 8 | Долговые ценные бумаги, выпущенные банком, за исключением долговых ценных бумаг, выпущенных банком в иностранной валюте | | | | | | |
| 9 | Начисленное вознаграждение, дисконты, премии, положительные/отрицательные корректировки справедливой стоимости | | | | | | |
| 10 | Просроченная задолженность по внутренним и иным обязательствам | | | | | | |
| 11 | Неинвестированные остатки средств, принятые банком от резидентов на основании кастодиального договора | | | | | | |
| 12 | Итого величина внутренних обязательств, субординированного долга, выпущенных банком долговых ценных бумаг и собственного капитала или уставного капитала | | | | | | |
| 13 | Итого величина внутренних обязательств, субординированного долга, выпущенных банком долговых ценных бумаг | | | | | | |

| | | | | | | | |
|----|---|--|--|--|--|--|--|
| 14 | Количество рабочих дней | | | | | | |
| 15 | Коэффициент размещения части средств банка во внутренние активы | | | | | | |
| 16 | Среднемесячная величина внутренних обязательств, субординированного долга, выпущенных банком долговых ценных бумаг, собственного капитала или уставного капитала за предыдущий отчетный месяц | | | | | | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место _____ для печати _____ (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных

д а н н ы х ,

приведено в приложении к настоящей форме.

Приложение
к форме отчета
о расчете среднемесячной
величины внутренних активов,
внутренних и иных
обязательств,
коэффициента размещения
части средств
во внутренние активы

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных

Отчет о расчете среднемесячной величины внутренних активов, внутренних и иных обязательств, коэффициента размещения части средств во внутренние активы

Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по заполнению формы "Отчет о расчете среднемесячной величины внутренних активов, внутренних и иных обязательств, коэффициента размещения части средств во внутренние активы" (далее - Форма).

2. Форма разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом б) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".

3. Форма составляется ежемесячно банками второго уровня и заполняется за каждый рабочий день отчетного периода. Данные в Форме заполняются в тысячах тенге.

4. Форму подписывают первый руководитель, главный бухгалтер или лица, уполномоченные ими на подписание отчета, и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению Формы

5. Форма заполняется в соответствии с постановлениями Правления Национального Банка Республики Казахстан от 30 мая 2016 года №144 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков, их нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №13939 и от 13 сентября 2017 года №170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №15886.

6. По строке 6 формы "Отчет о расчете среднемесячной величины внутренних и иных обязательств, коэффициента размещения части средств банка во внутренние активы" указывается собственный капитал согласно данным бухгалтерского баланса за вычетом инвестиций в субординированный долг дочерних организаций-нерезидентов Республики Казахстан, в акции дочерних организаций-нерезидентов Республики Казахстан, умноженный на 0,75.

7. При заполнении формы "Отчет о расчете среднемесячной величины внутренних и иных обязательств, коэффициента размещения части средств банка во внутренние активы" за каждый рабочий день в строку 12 включаются данные, указанные в строке 5 либо в строке 6 в зависимости от того, среднемесячная величина по какой строке составляет минимальное значение.

8. В случае отсутствия сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

Приложение 11
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 29 ноября 2017 года № 237

Приложение 16
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 8 мая 2015 года № 75

Форма, предназначенная для сбора административных данных

Отчет о расшифровке коэффициентов капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан

Отчетный период: на " ____ " _____ 20 года

(наименование банка)

Индекс: 1-BVU_K7, K8, K9

Периодичность: ежемесячная

Представляет: банк второго уровня

Куда представляется форма: Национальный Банк Республики Казахстан

Срок представления: не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

Форма

(в тысячах тенге)

| № | Наименование | Сумма |
|----|--|-------|
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан до востребования, в том числе обязательства, по которым не установлен срок осуществления расчетов | |
| 2 | Срочные обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан с первоначальным сроком погашения до одного года включительно | |
| 3 | Срочные обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан с безусловным правом кредитора требовать досрочного погашения обязательств, в том числе срочные и условные депозиты банков, за исключением срочных и условных депозитов физических и юридических лиц | |
| 4 | Краткосрочные обязательства перед филиалами и представительствами иностранных компаний, осуществляющих свою деятельность на территории Республики Казахстан, которые входят в секторы экономики "другие финансовые организации - код 5", "государственные нефинансовые организации - код 6", "негосударственные нефинансовые организации - код 7" и "некоммерческие организации, обслуживающие домашние хозяйства - код 8" | |
| 5 | Краткосрочные обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан, являющимися международными финансовыми организациями | |
| 6 | Краткосрочные обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан, являющимися международными организациями, членом которых является Республика Казахстан, а также Евразийским банком развития | |
| 7 | Краткосрочные обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан, являющимися международными расчетными системами (ClearstreamBanking S.A. и EuroclearBankSA/NV) | |
| 8 | Неинвестированные остатки средств, принятые банком на хранение на основании кастодиального договора | |
| 9 | Субординированные долговые обязательства перед родительским банком нерезидентом Республики Казахстан | |
| 10 | Совокупные обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан | |
| 11 | Необеспеченные гарантии и поручительства банка, выданные при привлечении внешних займов дочерними организациями банка, аффилированными с банком юридическими лицами, а также в рамках сделок банка по секьюритизации, с правом кредитора требовать досрочного погашения обязательств должника по этим займам, кроме гарантий и поручительств банка, выданных при привлечении займов, включаемых в расчет норматива k8, k9 | |
| 12 | Выпущенные банком в обращение долговые ценные бумаги, находящиеся у нерезидентов Республики Казахстан | |
| 13 | Выпущенные банком в обращение ценные бумаги (за исключением акций), находящиеся у нерезидентов Республики Казахстан | |
| | | |

| | | |
|----|--|--|
| 14 | Ценные бумаги, выпущенные банком посредством дочерних организаций специального назначения в части гарантируемых банком сумм и учитываемых на бухгалтерском балансе банка | |
| 15 | Обязательства перед филиалами и представительствами иностранных компаний, осуществляющих свою деятельность на территории Республики Казахстан, которые входят в секторы экономики "другие финансовые организации - код 5", "государственные нефинансовые организации - код 6", "негосударственные нефинансовые организации - код 7" и "некоммерческие организации, обслуживающие домашние хозяйства - код 8" | |
| 16 | Обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан, являющимися международными финансовыми организациями | |
| 17 | Обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан, являющимися международными организациями, членом которых является Республика Казахстан, а также Евразийским банком развития | |
| 18 | Выпущенные банком в обращение долговые ценные бумаги | |
| 19 | Выпущенные банком в обращение ценные бумаги (за исключением акций) | |
| 20 | Долговые ценные бумаги, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан в тенге | |
| 21 | Ценные бумаги банка (за исключением акций), выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан в тенге | |
| 22 | Обязательства дочернего банка - резидента Республики Казахстан перед родительским банком - нерезидентом Республики Казахстан по полученным займам | |
| 23 | Собственный капитал | |
| 24 | Краткосрочные обязательства перед нерезидентами, включаемые в расчет коэффициента k7 | |
| 25 | Максимальный лимит краткосрочных обязательств перед нерезидентами, (k7) | |
| 26 | Обязательства перед нерезидентами, включаемые в расчет коэффициента k8 | |
| 27 | Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан, (k8) | |
| 28 | Обязательства перед нерезидентами и долговые ценные бумаги, включаемые в расчет коэффициента k9 | |
| 29 | Обязательства перед нерезидентами и исламские ценные бумаги, включаемые в расчет коэффициента k9 | |
| 30 | Коэффициент капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан, (k9) | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место _____ для печати _____ (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных

д а н н ы х ,

приведено в приложении к настоящей форме.

Приложение
к форме отчета
о расшифровке коэффициентов
капитализации банков к
обязательствам перед
нерезидентами
Республики Казахстан

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных

Отчет о расшифровке коэффициентов капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан

Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по заполнению формы "Отчет о расшифровке коэффициентов капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан" (далее - Форма).

2. Форма разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом б) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".

3. Форма составляется ежемесячно банками второго уровня по состоянию на первое число каждого месяца. Данные в Форме заполняются в тысячах тенге.

4. Форму подписывают первый руководитель, главный бухгалтер или лица, уполномоченные ими на подписание отчета, и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению Формы

5. Форма заполняется в соответствии с постановлениями Правления Национального Банка Республики Казахстан от 30 мая 2016 года №144 "Об установлении

пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков, их нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для исламских банков", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №13939 и от 13 сентября 2017 года №170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №15886.

6. В строках 4 и 15 указываются краткосрочные обязательства, обязательства перед филиалами и представительствами иностранных юридических лиц, осуществляющих свою деятельность на территории Республики Казахстан, которые входят в секторы экономики "другие финансовые организации - код 5", "государственные нефинансовые организации - код 6", "негосударственные нефинансовые организации - код 7" и "некоммерческие организации, обслуживающие домашние хозяйства - код 8" в соответствии с постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 31 августа 2016 года № 203 "Об утверждении Правил применения кодов секторов экономики и назначения платежей", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 14365.

7. В строках 6 и 17 указываются краткосрочные обязательства, обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан, являющимися международными организациями, членом которых является Республика Казахстан в соответствии с Законом Республики Казахстан от 6 декабря 2001 года "О членстве Республики Казахстан в Международном Валютном Фонде, Международном Банке Реконструкции и Развития, Международной Финансовой Корпорации, Международной Ассоциации Развития, Многостороннем Агентстве Гарантии Инвестиций, Международном Центре по Урегулированию Инвестиционных Споров, Европейском Банке Реконструкции и Развития, Азиатском Банке Развития, Исламском Банке Развития, Азиатском Банке Инфраструктурных Инвестиций", а также Евразийским банком развития.

8. Строки 6, 13, 17, 19, 21, 22 и 29 заполняются только исламскими банками.

9. Коэффициенты капитализации банков второго уровня к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан k7, k8, k9 указываются с тремя знаками после запятой.

10. В случае отсутствия сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

Форма, предназначенная для сбора административных данных
Отчет о расчете коэффициентов достаточности собственного капитала
при секьюритизации
Отчетный период: на " ___ " _____ 20__ года

(наименование банка)

Индекс: 1-BVU_KDSK

Периодичность: ежемесячная

Представляет: банк второго уровня

Куда представляется форма: Национальный Банк Республики Казахстан

Срок представления: не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

Форма

(в тысячах тенге)

| № | Наименование компонента | Значения на последнюю отчетную дату, предшествующую осуществлению сделки секьюритизации | Значения после осуществления сделки секьюритизации |
|-----|---|---|--|
| 1 | Капитал 1-го уровня | | |
| 1.1 | основной капитал | | |
| 1.2 | дополнительный капитал | | |
| 2 | Капитал 2-го уровня | | |
| 3 | Инвестиции | | |
| 4 | Собственный капитал (за минусом инвестиций) | | |
| 5 | Сумма позиций по сделке секьюритизации, удерживаемых банком и имеющих международную рейтинговую оценку от "B+" и ниже агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" и ниже по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств либо не имеющие рейтинговой оценки | X | |
| 6 | Активы | | |
| 7 | Отношение капитала первого уровня за вычетом инвестиций банка, взятых в пределах доли капитала первого уровня в общей сумме капитала первого уровня и включаемой в расчет собственного капитала части капитала второго уровня, к размеру активов банка (K1) | | |

| | | | |
|-----|---|---|--|
| 8 | Активы, взвешенные с учетом кредитного риска, в том числе: | | |
| 8.1 | сумма позиций по сделке секьюритизации, удерживаемых банком, взвешиваемых с учетом кредитного риска и имеющих международную рейтинговую оценку от "AAA" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzAAA" до "kzAA-" по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | X | |
| 8.2 | сумма позиций по сделке секьюритизации, удерживаемых банком, взвешиваемых с учетом кредитного риска и имеющих международную рейтинговую оценку от "A+" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzA+" до "kzA-" по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | X | |
| 8.3 | сумма позиций по сделке секьюритизации, удерживаемых банком, взвешиваемых с учетом кредитного риска и имеющих международную рейтинговую оценку от "BBB+" до "BBB-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBBB+" до "kzBBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | X | |
| 8.4 | сумма позиций по сделке секьюритизации, удерживаемых банком, взвешиваемых с учетом кредитного риска и имеющих международную рейтинговую оценку от "BB+" до "BB-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" до "kzBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | X | |
| 9 | Условные и возможные обязательства, взвешенные с учетом кредитного риска, в том числе: | | |
| 9-1 | сумма позиций по сделке секьюритизации, удерживаемых банком, взвешиваемых с учетом кредитного риска и имеющих международную рейтинговую оценку от "AAA" до "AA-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzAAA" до "kzAA-" по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | X | |
| 9.2 | сумма позиций по сделке секьюритизации, удерживаемых банком, взвешиваемых с учетом кредитного риска и имеющих международную рейтинговую оценку от "A+" до "A-" агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzA+" до "kzA-" по национальной шкале агентства Standard&Poor's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | X | |
| | | | |

| | | | |
|------|---|---|--|
| 9.3 | сумма позиций по сделке секьюритизации, удерживаемых банком, взвешиваемых с учетом кредитного риска и имеющих международную рейтинговую оценку от "BBB+" до "BBB-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBBB+" до "kzBBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | X | |
| 9.4 | сумма позиций по сделке секьюритизации, удерживаемых банком, взвешиваемых с учетом кредитного риска и имеющих международную рейтинговую оценку от "BB+" до "BB-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" до "kzBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | X | |
| 10 | Производные финансовые инструменты, взвешенные с учетом кредитного риска, в том числе: | | |
| 10.1 | сумма позиций по сделке секьюритизации, удерживаемых банком, взвешиваемых с учетом кредитного риска и имеющих международную рейтинговую оценку от "AAA" до "AA-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzAAA" до "kzAA-" по национальной шкале агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | X | |
| 10.2 | сумма позиций по сделке секьюритизации, удерживаемых банком, взвешиваемых с учетом кредитного риска и имеющих международную рейтинговую оценку от "A+" до "A-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzA+" до "kzA-" по национальной шкале агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | X | |
| 10.3 | сумма позиций по сделке секьюритизации, удерживаемых банком, взвешиваемых с учетом кредитного риска и имеющих международную рейтинговую оценку от "BBB+" до "BBB-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBBB+" до "kzBBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | X | |
| 10.4 | сумма позиций по сделке секьюритизации, удерживаемых банком, взвешиваемых с учетом кредитного риска и имеющих международную рейтинговую оценку от "BB+" до "BB-" агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" до "kzBB-" по национальной шкале агентства Standard&Poog's или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | X | |
| | Итого активы, условные и возможные обязательства, взвешенные по степени кредитного риска, уменьшенные на | | |

| | | | |
|----|---|--|--|
| 11 | сумму общих резервов (провизии), не включенных в расчет капитала второго уровня | | |
| 12 | Сумма специфического процентного риска | | |
| 13 | Сумма общего процентного риска | | |
| 14 | Итого рыночный риск, связанный с изменением ставки вознаграждения | | |
| 15 | Сумма специфического риска, связанного с изменением рыночной стоимости | | |
| 16 | Сумма общего риска, связанного с изменением рыночной стоимости | | |
| 17 | Итого рыночный риск, связанный с изменением рыночной стоимости | | |
| 18 | Сумма рыночного риска, связанного с изменением обменного курса | | |
| 19 | Итого активы и условные и возможные требования и обязательства, рассчитанные с учетом рыночного риска | | |
| 20 | Сумма операционного риска | | |
| 21 | Отношение собственного капитала к сумме активов, условных и возможных обязательств, взвешенных по степени кредитного риска, уменьшенных на сумму общих резервов (провизии), не включенных в расчет капитала второго уровня, активов и условных и возможных требований и обязательств, рассчитанных с учетом рыночного риска, операционного риска (K2) | | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

 — — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а
 Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

 — — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а
 Исполнитель

 — — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а
 Телефон: _____
 Место _____ для печати (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных, приведено в приложении к настоящей форме.

Приложение
к форме отчета
о расчете коэффициентов
достаточности собственного
капитала при секьюритизации

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных

Отчет о расчете коэффициентов достаточности собственного капитала при секьюритизации

Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по заполнению формы "Отчет о расчете коэффициентов достаточности собственного капитала при секьюритизации" (далее - Форма).

2. Форма разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом б) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".

3. Форма составляется ежемесячно банками второго уровня по состоянию на первое число каждого месяца. Данные в Форме заполняются в тысячах тенге.

4. Форму подписывают первый руководитель, главный бухгалтер или лица, уполномоченные ими на подписание отчета, и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению Формы

5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 13 сентября 2017 года №170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №15886 (далее – Постановление № 170).

6. Форма заполняется банками при расчете собственного капитала в соответствии с пунктами 36, 37, 38, 39, 40, 41, 42, 43, 44, 45, 46, 47, 48, 49, 50 и 51 Нормативных

значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату, установленных согласно приложению 1 к Постановлению №170.

7. В случае отсутствия сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

Приложение 13
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 29 ноября 2017 года № 237
Приложение 20-1
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 8 мая 2015 года № 75

Форма, предназначенная для сбора административных данных

Отчет о расшифровке коэффициента покрытия ликвидности

Отчетный период: на " ___ " _____ 20__ года

(наименование банка)

Индекс: 1-BVU_LCR

Периодичность: ежемесячная

Представляет: банк второго уровня

Куда представляется форма: Национальный Банк Республики Казахстан

Срок представления: не позднее десятого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

Форма

(в тысячах тенге)

| № | Наименование статей | Сумма | Коэффициент учета в процентах | Сумма к расчету |
|-----|--|-------|-------------------------------|-----------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| | Высококачественные ликвидные активы первого уровня | | | |
| 1 | Наличные деньги | | 100 | |
| 2 | Депозиты в Национальном Банке Республики Казахстан | | 100 | |
| 3 | Требования к Правительству Республики Казахстан, Национальному Банку Республики Казахстан, центральным правительствам иностранных государств и центральным банкам иностранных государств, к международным финансовым организациям, взвешиваемые по степени кредитного риска 0 (ноль) процентов, в том числе: | | 100 | |
| 3.1 | ценные бумаги, гарантированные Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан | | 100 | |
| | ценные бумаги, гарантированные центральными правительствами иностранных государств и центральными | | | |

| | | | |
|------|---|-----|--|
| 3.2 | банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 | |
| 3.3 | ценные бумаги, гарантированные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 | |
| 3.4 | займы, предоставленные Правительству Республики Казахстан | 100 | |
| 3.5 | займы, предоставленные Национальному Банку Республики Казахстан | 100 | |
| 3.6 | займы, предоставленные центральным правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 | |
| 3.7 | займы, предоставленные центральным банкам стран с суверенным рейтингом не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 | |
| 3.8 | займы, предоставленные международным финансовым организациям с долговым рейтингом не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 | |
| 3.9 | вклады в центральных банках стран с суверенным рейтингом не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 | |
| 3.10 | вклады в международных финансовых организациях с долговым рейтингом не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 | |
| 3.11 | дебиторская задолженность Правительства Республики Казахстан | 100 | |
| 3.12 | государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Правительством Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан | 100 | |
| 3.13 | ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 | |
| 3.14 | ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 | |
| 4 | Ценные бумаги центральных правительств иностранных государств и центральных банков иностранных государств, номинированные в валюте соответствующих стран, в случае взвешивания по степени кредитного риска выше 0 (нуля) процентов | 100 | |
| | Высококачественные ликвидные активы второго уровня | | |

| | | | |
|-----|---|----|--|
| 5 | Требования к местным органам власти Республики Казахстан, в том числе ценные бумаги, выпущенные местными органами власти Республики Казахстан, взвешиваемые по степени кредитного риска 20 (двадцать) процентов, в том числе: | 85 | |
| 5.1 | займы, предоставленные местным органам власти Республики Казахстан | 85 | |
| 5.2 | дебиторская задолженность местных органов власти Республики Казахстан | 85 | |
| 5.3 | ценные бумаги, выпущенные местными органами власти Республики Казахстан | 85 | |
| 6 | Требования к центральным правительствам иностранных государств, центральным банкам иностранных государств, местным органам власти иностранных государств, международным финансовым организациям, взвешиваемые по степени кредитного риска 20 (двадцать) процентов, в том числе: | 85 | |
| 6.1 | ценные бумаги, гарантированные центральными правительствами иностранных государств и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 85 | |
| 6.2 | ценные бумаги, гарантированные местными органами власти иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 85 | |
| 6.3 | ценные бумаги, гарантированные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 85 | |
| 6.4 | займы, предоставленные центральным правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 85 | |
| 6.5 | займы, предоставленные центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 85 | |
| 6.6 | займы, предоставленные международным финансовым организациям, имеющим долговой рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 85 | |
| 6.7 | займы, предоставленные местным органам власти стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 85 | |
| 6.8 | вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 85 | |
| 6.9 | вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poor's или | 85 | |

| | | | | |
|------|---|--|-----|--|
| | рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | | |
| 6.10 | ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 85 | |
| 6.11 | ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг от "A+" до "A-" агентства Standard & Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 85 | |
| 6.12 | ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, суверенный рейтинг которых не ниже "AA-" агентства Standard & Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 85 | |
| 7 | Ценные бумаги, выпущенные нефинансовыми организациями, имеющие долгосрочный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 85 | |
| 8 | Ипотечные ценные бумаги, не являющиеся обязательством банка, имеющие долгосрочный рейтинг не ниже "AA-" агентства Standard & Poog's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | | 85 | |
| | Денежные оттоки по депозитам физических лиц | | | |
| 9 | Стабильные депозиты | | 5 | |
| 10 | Менее стабильные депозиты | | 10 | |
| 11 | Иные денежные оттоки по обязательствам перед физическими лицами, не включенные в строки 9 и 10 настоящей таблицы | | 100 | |
| | Денежные оттоки по обязательствам перед юридическими лицами, субъектами малого предпринимательства, необеспеченным активами банка | | | |
| 12 | Вклады, размещенные нефинансовыми организациями, являющимися субъектами малого предпринимательства, полный объем которых не превышает в эквиваленте 1 (один) миллион долларов Соединенных Штатов Америки | | 10 | |
| 13 | Вклады, связанные с клиринговой, кастодиальной деятельностью, с деятельностью по управлению ликвидностью | | 25 | |
| 14 | Депозиты нефинансовых организаций, Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, местных органов власти Республики Казахстан, международных финансовых организаций, центральных правительств иностранных государств, центральных банков иностранных государств, местных органов власти иностранных государств | | 40 | |
| 15 | Депозиты нефинансовых организаций (группы нефинансовых организаций, в случаях когда одно юридическое лицо является крупным участником другого юридического лица, при этом размер обязательств каждого из юридических лиц превышает 0,5 (ноль целых пять десятых) процента основного капитала банка), в сумме, превышающей 5 (пять) процентов суммы обязательств банка | | 60 | |

| | | | |
|----|--|--|--|
| 16 | Обязательства перед иными юридическими лицами, в том числе обязательства по выпущенным ценным бумагам | 100 | |
| | Денежные оттоки по обязательствам перед юридическими лицами, обеспеченным активами банка | | |
| 17 | Обязательства, обеспеченные высококачественными ликвидными активами первого уровня | 0 | |
| 18 | Обязательства перед Правительством Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан | 0 | |
| 19 | Обязательства, обеспеченные высококачественными ликвидными активами второго уровня | 15 | |
| 20 | Обязательства перед местными органами власти Республики Казахстан, международными финансовыми организациями, взвешиваемые по степени кредитного риска не выше 20 (двадцати) процентов, обеспеченные активами, не являющимися высококачественными ликвидными активами первого и второго уровней | 25 | |
| 21 | Иные обеспеченные обязательства | 100 | |
| | Дополнительные денежные оттоки по условным и возможным обязательствам | | |
| 22 | Дополнительная потребность в ликвидности по условным обязательствам, сделкам с производными финансовыми инструментами и иным операциям в полном размере при снижении рейтинга банка на 1 (одну), 2 (две) либо 3 (три) ступени от текущего рейтинга банка | 100 | |
| 23 | Необходимость в дополнительной ликвидности при изменении рыночной оценки позиций по производным финансовым инструментам или иным операциям | Наибольший 30 (тридцати-дневный) нетто отток за предыдущие 24 (двадцать четыре) месяца | |
| 24 | Необходимость в дополнительной ликвидности при переоценке обеспечения (за исключением высококачественных ликвидных активов первого уровня) по производным финансовым инструментам и иным операциям | 20 | |
| 25 | Размер превышения обеспечения, удерживаемого банком в связи с поддержанием позиции по производным финансовым инструментам, по которому предусмотрен отзыв в любое время | 100 | |
| 26 | Необходимость в дополнительной ликвидности по операциям, предусматривающим предоставление банком обеспечения, по требованию контрагента в соответствии с условиями договора в случае, если обеспечение не предоставлено | 100 | |
| 27 | Необходимость в дополнительной ликвидности, связанная с возможностью замены обеспечения на активы, не являющиеся высококачественными ликвидными активами | 100 | |
| 28 | Отток по ценным бумагам, выпущенным банком, обеспеченным поступлением денег по активам, и имеющим срок погашения в течение календарного месяца, следующего за датой расчета коэффициента покрытия ликвидности (в том числе по ипотечным ценным бумагам) | 100 | |
| | | | |

| | | | |
|----|--|-----|--|
| 29 | Отток по ценным бумагам, обеспеченным поступлением денег по активам и выпущенным дочерними специальными организациями банка, имеющим срок погашения в течение календарного месяца, следующего за датой расчета коэффициента покрытия ликвидности | 100 | |
| 30 | Неиспользованная часть кредитных линий и линий ликвидности, предоставленных физическим лицам и субъектам малого предпринимательства | 5 | |
| 31 | Неиспользованная часть кредитных линий, предоставленных нефинансовым организациям, Правительству Республики Казахстан, Национальному Банку Республики Казахстан, местным органам власти Республики Казахстан и международным финансовым организациям | 10 | |
| 32 | Неиспользованная часть линий ликвидности, предоставленных нефинансовым организациям, Правительству Республики Казахстан, Национальному Банку Республики Казахстан, местным органам власти Республики Казахстан и международным финансовым организациям | 30 | |
| 33 | Неиспользованная часть кредитных линий и линий ликвидности, предоставленных другим банкам | 40 | |
| 34 | Неиспользованная часть кредитных линий, предоставленных финансовым организациям, не являющимся банками | 40 | |
| 35 | Неиспользованная часть линий ликвидности, предоставленных иным финансовым организациям, не являющимся банками | 100 | |
| 36 | Неиспользованная часть кредитных линий и линий ликвидности, предоставленных иным юридическим лицам (в том числе дочерними специальными организациями банка) | 100 | |
| 37 | Обязательства, связанные с финансированием экспорта и импорта товаров и услуг (по гарантиям и поручительствам, аккредитивам, связанным с проведением факторинговых и форфейтинговых операций) | 5 | |
| 38 | Обязательства, по гарантиям и поручительствам, аккредитивам, не связанным с финансированием экспорта и импорта товаров и услуг | 10 | |
| 39 | Иные денежные оттоки по обязательствам, не включенные в строки 12-38. | 100 | |
| | Денежные притоки | | |
| 40 | Заемные операции, обеспеченные высококачественными ликвидными активами первого уровня | 0 | |
| 41 | Заемные операции, обеспеченные высококачественными ликвидными активами второго уровня | 15 | |
| 42 | Займы, предоставленные для совершения купли-продажи ценных бумаг под обеспечение активов, не относящихся к высококачественным ликвидным активам (маржинальные сделки) | 50 | |
| 43 | Заемные операции, обеспеченные иными активами | 100 | |
| 44 | Кредитные линии, линии ликвидности, предоставленные другими банками | 0 | |
| | | | |

| | | | | |
|------|---|---|-----|--|
| 45 | Вклады, связанные с клиринговой, кастодиальной деятельностью, с деятельностью по управлению ликвидностью клиента в других финансовых организациях | | 0 | |
| 46 | Притоки по кредитам, за исключением займов с просроченной задолженностью по основному долгу и (или) начисленному вознаграждению, в том числе выданным: | | | |
| 46.1 | физическим лицам и субъектам малого предпринимательства | | 50 | |
| 46.2 | нефинансовым организациям | | 50 | |
| 46.3 | финансовым организациям | | 100 | |
| 47 | Нетто притоки по производным финансовым инструментам | | 100 | |
| 48 | Иные денежные притоки от операций, по договорам которых ожидаются денежные притоки в течение календарного месяца, следующего за датой расчета коэффициента покрытия ликвидности | | 100 | |
| 49 | Высококачественные ликвидные активы | | x | |
| 50 | Денежные притоки | | x | |
| 51 | Денежные оттоки | | x | |
| 52 | Нетто отток денежных средств по операциям банка в течение календарного месяца, следующего за датой расчета коэффициента покрытия ликвидности | x | x | |
| 53 | Коэффициент покрытия ликвидности | x | x | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)

д а т а

Телефон: _____

Место _____ для печати (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных

д а н н ы х ,

приведено в приложении к настоящей форме.

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных

Отчет о расшифровке коэффициента покрытия ликвидности

Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по заполнению формы "Отчет о расшифровке коэффициента покрытия ликвидности" (далее - Форма).

2. Форма разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом б) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".

3. Форма составляется ежемесячно банками второго уровня по состоянию на первое число каждого месяца. Данные в Форме заполняются в тысячах тенге.

4. Форму подписывают первый руководитель, главный бухгалтер или лица, уполномоченные ими на подписание отчета, и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению Формы

5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 13 сентября 2017 года №170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №15886 (далее - Постановление № 170).

6. Высококачественные ликвидные активы банка рассчитываются с учетом требований, установленных пунктом 73 Нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату, установленных согласно приложению 1 к Постановлению №170 (далее – Нормативы № 170) и с применением коэффициентов учета, установленных в приложении 13 к Нормативам №170.

7. Денежный отток (приток) рассчитывается как сумма денежных оттоков (притоков) в течение последующего календарного месяца после отчетной даты, с

применением коэффициентов оттока (притока), установленных в приложении 14 к Нормативам №170.

8. При заполнении Формы по графе 5 строки 49 суммируются данные по высококачественным ликвидным активам первого и второго уровней с учетом требований части 3 пункта 75 Нормативов №170.

9. В строке 50 суммируются данные по строкам 40-48.

10. В строке 51 суммируются данные по строкам 9-39.

11. При заполнении Формы в графе 5 строки 52 расчет производится с учетом пункта 76 Нормативов №170.

12. При заполнении Формы в строке 53 указывается отношение высококачественных ликвидных активов к нетто оттоку денежных средств по операциям банка в течение последующего календарного месяца с тремя знаками после запятой.

13. В графе 5 указываются суммы по графе 3, умноженные на коэффициенты учета в процентах, установленные в графе 4.

14. В случае отсутствия сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

Приложение 14
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 29 ноября 2017 года № 237
Приложение 20-2
к постановлению Правления
Национального Банка
Республики Казахстан
от 8 мая 2015 года № 75

Форма, предназначенная для сбора административных данных
Отчет о расшифровке коэффициента нетто стабильного фондирования
Отчетный период: на " ____ " _____ 20__ года

(наименование банка)

Индекс: 1-BVU_NFSR

Периодичность: ежемесячная

Представляет: банк второго уровня

Куда представляется форма: Национальный Банк Республики Казахстан

Срок представления: не позднее десятого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

Форма

(в тысячах тенге)

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | |
|--|--|--|--|--|

| № | Наименование статей | Сумма | Коэффициент в процентах | Сумма к расчету |
|------|--|-------|----------------------------|-----------------------|
| 1 | Доступное стабильное фондирование | | | |
| 1.1 | собственный капитал до вычета инвестиций, указанных в пункте 11 Нормативов (за исключением инструментов капитала второго уровня со сроком погашения менее 1 (одного) года) | | 100 | |
| 1.2 | иные инструменты капитала и обязательства с оставшимся сроком погашения 1 (один) год и более | | 100 | |
| 1.3 | стабильные депозиты | | 95 | |
| 1.4 | менее стабильные депозиты | | 90 | |
| 1.5 | обязательства с оставшимся сроком погашения менее 1 (одного) года, предоставленные нефинансовыми организациями | | 50 | |
| 1.6 | вклады, связанные с клиринговой, кастодиальной деятельностью, с деятельностью по управлению ликвидностью клиента | | 50 | |
| 1.7 | обязательства с оставшимся сроком погашения менее 1 (одного) года, предоставленные центральными правительствами иностранных государств, местными органами власти иностранных государств и международными финансовыми организациями | | 50 | |
| 1.8 | иные виды обязательств с оставшимся сроком погашения более 6 (шести) месяцев и менее 1 (одного) года | | 50 | |
| 1.9 | вклады юридических лиц с возможностью безусловного досрочного изъятия | | 0 | |
| 1.10 | иные обязательства, в том числе бессрочные обязательства (с установлением особого режима для отсроченных налоговых обязательств) | | 0 | |
| 1.11 | коэффициент нетто стабильного фондирования по обязательствам по производным финансовым инструментам за вычетом активов по производным финансовым инструментам, в случае если размер обязательств превышает размер активов по производным финансовым инструментам | | 0 | |
| 1.12 | платежи, возникающие от покупки финансовых инструментов, иностранной валюты в день покупки | | 0 | |
| 2 | Требуемые активы стабильного фондирования | | | |
| 2.1 | наличные деньги | | 0 | |
| 2.2 | резервы в Национальном Банке | | 0 | |
| 2.3 | требования к центральным банкам иностранных государств с оставшимся сроком погашения менее 6 (шести) месяцев | | 0 | |
| 2.4 | приток, возникающий от продажи финансовых инструментов, иностранной валюты в день продажи | | 0 | |
| 2.5 | необремененные высококачественные ликвидные активы первого уровня, за исключением денежных средств и резервов в Национальном Банке | | 5 | |
| 2.6 | необремененные займы, предоставленные финансовым организациям с оставшимся сроком погашения менее 6 (шести) месяцев, обеспеченные высококачественными ликвидными активами первого уровня, по которым банком возможен перезалог | | 10 | |
| | | | | |

| | | | |
|------|--|-----|--|
| 2.7 | иные необремененные займы, предоставленные финансовым организациям с оставшимся сроком погашения менее 6 (шести) месяцев | 15 | |
| 2.8 | необремененные высококачественные ликвидные активы второго уровня | 15 | |
| 2.9 | высококачественные ликвидные активы, обремененные на период более 6 (шести) месяцев и менее 1 (одного) года | 50 | |
| 2.10 | займы, предоставленные финансовым организациям, центральным банкам иностранных государств с оставшимся сроком погашения более 6 (шести) месяцев и менее 1 (одного) года | 50 | |
| 2.11 | вклады, связанные с клиринговой, кастодиальной деятельностью, с деятельностью по управлению ликвидностью клиента в других банках | 50 | |
| 2.12 | иные активы, не являющиеся высококачественными ликвидными активами, с оставшимся сроком погашения менее 1 (одного) года, включая займы нефинансовым организациям, потребительские займы, займы субъектам малого предпринимательства | 50 | |
| 2.13 | необремененные ипотечные кредиты с оставшимся сроком погашения 1 (один) год и более взвешиваемые по степени кредитного риска не более 35 (тридцати пяти) процентов | 65 | |
| 2.14 | иные необремененные займы, за исключением займов, предоставленных финансовым организациям с оставшимся сроком до погашения 1 (один) год и более, взвешиваемые по степени кредитного риска не более 35 (тридцати пяти) процентов | 65 | |
| 2.15 | деньги, ценные бумаги и иные активы, являющиеся обеспечением в качестве начальной маржи по сделкам с производными финансовыми инструментами, деньги или иные активы, предоставленные в качестве обязательного платежа центральному контрагенту | 85 | |
| 2.16 | необремененные кредиты, за исключением займов с просроченной задолженностью по основному долгу и (или) начисленному вознаграждению, взвешиваемые по степени кредитного риска более 35 (тридцати пяти) процентов и с оставшимся сроком погашения 1 (один) год и более, за исключением займов, предоставленных финансовым организациям | 85 | |
| 2.17 | необремененные ценные бумаги (акции) с оставшимся сроком погашения 1 (один) год и более, не являющиеся высококачественными ликвидными активами и обращающиеся на фондовых биржах | 85 | |
| 2.18 | товары, обращающиеся на фондовых биржах, включая аффинированное золото | 85 | |
| 2.19 | активы, обремененные на период от 1 (одного) года и более | 100 | |
| 2.20 | коэффициент нетто стабильного фондирования по активам по производным финансовым инструментам за вычетом обязательств по производным финансовым инструментам, в случае если размер активов превышает размер обязательств по производным финансовым инструментам | 100 | |
| 2.21 | иные активы, включая неработающие кредиты, займы, выданные финансовым организациям с оставшимся сроком погашения 1 (один) год и более | 100 | |
| | акции, не обращающиеся на фондовых биржах, материальные активы, статьи, вычтенные из собственного капитала банка, накопленное | | |

| | | | | |
|------|---|-----|--|--|
| 2.22 | вознаграждение, страховые активы, доля в дочерних организациях, процентная ставка по просроченному долгу | 100 | | |
| 3 | Требуемые условные и возможные обязательства стабильного фондирования | | | |
| 3.1 | безотзывные и условно-отзывные кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные любым клиентам (доля от неиспользованного объема) | 5 | | |
| 3.2 | иные обязательства, включая следующие инструменты: безусловно отзывные кредитные линии и линии ликвидности; обязательства по торговому финансированию (включая гарантии и поручительства); гарантии и поручительства, не связанные с финансированием экспорта и импорта товаров и услуг; не контрактные обязательства, включая, возможные требования к выкупу долга, выпущенного банком, или связанного с структурированными продуктами | 50 | | |
| 4 | Коэффициент нетто стабильного фондирования | | | |

Первый руководитель или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а

Главный бухгалтер или лицо, уполномоченное на подписание отчета

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а

И с п о л н и т е л ь

— — — —
 фамилия, имя, отчество (если оно указано в документе, удостоверяющем личность)
 д а т а

Телефон: _____

Место для печати (при наличии)

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных
 д а н н ы х ,

приведено в приложении к настоящей форме.

Приложение
 к форме отчета
 о расшифровке коэффициента
 нетто стабильного
 фондирования

Пояснение по заполнению формы, предназначенной для сбора административных данных

Отчет о расшифровке коэффициента нетто стабильного фондирования

Глава 1. Общие положения

1. Настоящее пояснение (далее - Пояснение) определяет единые требования по заполнению формы "Отчет о расшифровке коэффициента нетто стабильного фондирования" (далее - Форма).

2. Форма разработана в соответствии с Законом Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом б) пункта 1 статьи 9 Закона Республики Казахстан от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций".

3. Форма составляется ежемесячно банками второго уровня по состоянию на первое число каждого месяца. Данные в Форме заполняются в тысячах тенге.

4. Форму подписывают первый руководитель, главный бухгалтер или лица, уполномоченные ими на подписание отчета, и исполнитель.

Глава 2. Пояснение по заполнению Формы

5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 13 сентября 2017 года №170 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банка на определенную дату и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под №15886.

6. В случае отсутствия сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.