

**О внесении изменений и дополнений в некоторые нормативные правовые акты Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования**

Постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 28 ноября 2019 года № 214. Зарегистрировано в Министерстве юстиции Республики Казахстан 4 декабря 2019 года № 19688.

      Примечание ИЗПИ!

Настоящее постановление вводится в действие с 1 января 2020 года.

      В соответствии с законами Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", от 23 декабря 1995 года "Об ипотеке недвижимого имущества", от 18 декабря 2000 года "О страховой деятельности", от 2 июля 2003 года "О рынке ценных бумаг", от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций", от 19 марта 2010 года "О государственной статистике", от 21 июня 2013 года "О пенсионном обеспечении в Республике Казахстан" и от 9 апреля 2016 года "О почте" Правление Национального Банка Республики Казахстан ПОСТАНОВЛЯЕТ:

      1. Утвердить Перечень нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения, согласно приложению к настоящему постановлению.

      2. Департаменту методологии и регулирования финансовых организаций в установленном законодательством Республики Казахстан порядке обеспечить:

      1) совместно с Юридическим департаментом государственную регистрацию настоящего постановления в Министерстве юстиции Республики Казахстан;

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

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

      3. Департаменту внешних коммуникаций – пресс-службе Национального Банка обеспечить в течение десяти календарных дней после государственной регистрации настоящего постановления направление его копии на официальное опубликование в периодические печатные издания.

      4. Контроль за исполнением настоящего постановления возложить на заместителя Председателя Национального Банка Республики Казахстан Смолякова О.А.

      5. Настоящее постановление вводится в действие с 1 января 2020 года и подлежит официальному опубликованию.

|  |  |
| --- | --- |
| *Председатель*  *Национального Банка* | *Е. Досаев* |

      "СОГЛАСОВАНО"

Комитет по статистике

Министерства национальной экономики

Республики Казахстан

"\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 2019 года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 28 ноября 2019 года № 214 |

**Перечень нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения**

      1. Внести в постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 29 марта 2010 года № 41 "Об утверждении Правил и методик расчета значений пруденциальных нормативов для организатора торгов" (зарегистрировано в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 6207) следующие изменения:

      в заголовок внесено изменение на государственном языке, текст на русском языке не меняется;

      в пункт 1 внесено изменение на государственном языке, текст на русском языке не меняется;

      в Правилах и методиках расчета значений пруденциальных нормативов для организатора торгов, утвержденных указанным постановлением:

      в заголовок внесено изменение на государственном языке, текст на русском языке не меняется;

      часть первую подпункта 2) пункта 6 изложить в следующей редакции:

      "2) Кр - кредитный риск, рассчитываемый как сумма активов, условных и возможных обязательств, производных финансовых инструментов, взвешенных по степени кредитного риска в соответствии с Таблицей активов организатора торгов, взвешенных по степени кредитного риска вложений, согласно приложению 1 (далее - приложение 1) к настоящим Правилам, Таблицей условных и возможных обязательств организатора торгов, взвешенных по степени кредитного риска, согласно приложению 2 (далее - приложение 2) к настоящим Правилам, Таблицей производных финансовых инструментов, взвешенных с учетом кредитного риска, согласно приложению 3 (далее - приложение 3) к настоящим Правилам.";

      пункт 7 изложить в следующей редакции:

      "7. Коэффициент текущей ликвидности организатора торгов - К2 составляет не менее 0,015.

      Организатор торгов производит расчеты значения коэффициента К2 ежемесячно по состоянию на конец последнего рабочего дня отчетного месяца в соответствии с Таблицей коэффициента текущей ликвидности К2 согласно приложению 4 (далее - приложение 4) к настоящим Правилам.";

      главу 5 исключить;

      Таблицу активов организатора торгов, взвешенных по степени кредитного риска вложений, согласно приложению 1 изложить в редакции согласно приложению 1 к настоящему Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения (далее - Перечень);

      Таблицу условных и возможных обязательств организатора торгов, взвешенных по степени кредитного риска, согласно приложению 2 изложить в редакции согласно приложению 2 к Перечню;

      Расшифровку производных финансовых инструментов, взвешенных с учетом кредитного риска, согласно приложению 3 изложить в редакции согласно приложению 3 к Перечню;

      Расшифровку коэффициента текущей ликвидности К2 согласно приложению 4 изложить в редакции согласно приложению 4 к Перечню.

      2. Утратил силу постановлением Правления Агентства РК по регулированию и развитию финансового рынка от 07.06.2023 № 41 (вводится в действие с 01.07.2023).

      3. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 26 декабря 2016 года № 304 "Об установлении нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов страховой (перестраховочной) организации и страховой группы и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов, перечня, форм, сроков представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов страховыми (перестраховочными) организациями и страховыми группами, Правил представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов страховыми (перестраховочными) организациями и страховыми группами, требований к приобретаемым страховыми (перестраховочными) организациями, дочерними организациями страховых (перестраховочных) организаций или страховых холдингов акциям (долям участия в уставном капитале) юридических лиц, перечня облигаций международных финансовых организаций, приобретаемых страховыми холдингами, минимального требуемого рейтинга для облигаций, приобретаемых страховыми холдингами, и перечня рейтинговых агентств, а также перечня финансовых инструментов (за исключением акций и долей участия в уставном капитале), приобретаемых страховыми (перестраховочными) организациями" (зарегистрировано в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 14794, опубликовано 24 февраля 2017 года в Эталонном контрольном банке нормативных правовых актов Республики Казахстан) следующие изменения:

      заголовок изложить в следующей редакции:

      "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов страховой (перестраховочной) организации и страховой группы и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов, требований к приобретаемым страховыми (перестраховочными) организациями, дочерними организациями страховых (перестраховочных) организаций или страховых холдингов акциям (долям участия в уставном капитале) юридических лиц, перечня облигаций международных финансовых организаций, приобретаемых страховыми холдингами, минимального требуемого рейтинга для облигаций, приобретаемых страховыми холдингами, и перечня рейтинговых агентств, а также перечня финансовых инструментов (за исключением акций и долей участия в уставном капитале), приобретаемых страховыми (перестраховочными) организациями";

      подпункт 1) пункта 1 изложить в следующей редакции:

      "1) нормативные значения и методики расчетов пруденциальных нормативов страховой (перестраховочной) организации и страховой группы и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов (далее – Нормативы) согласно приложению 1 к настоящему постановлению;";

      подпункты 2) и 3) пункта 1 исключить;

      в Нормативных значениях и методике расчетов пруденциальных нормативов страховой (перестраховочной) организации и страховой группы и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов, утвержденных указанным постановлением:

      заголовок изложить в следующей редакции:

      "Нормативные значения и методики расчетов пруденциальных нормативов страховой (перестраховочной) организации и страховой группы и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов";

      пункт 1 изложить в следующей редакции:

      "1. Настоящие Нормативные значения и методики расчетов пруденциальных нормативов страховой (перестраховочной) организации и страховой группы и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов (далее - Нормативы) разработаны в соответствии с законами Республики Казахстан от 18 декабря 2000 года "О страховой деятельности" (далее - Закон), от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций" и устанавливают нормативные значения и методики расчетов пруденциальных нормативов страховой (перестраховочной) организации и страховой группы и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов.";

      пункт 9 изложить в следующей редакции:

      "9. Минимальный размер маржи платежеспособности страховой (перестраховочной) организации увеличивается на сумму обязательств, передаваемых (переданных) в перестрахование страховым (перестраховочным) организациям - резидентам и нерезидентам Республики Казахстан по действующим договорам перестрахования, в зависимости от рейтинговой оценки перестраховщика или значения норматива достаточности маржи платежеспособности перестраховочной организации-резидента Республики Казахстан на предыдущую отчетную дату, в соответствии с суммой увеличения минимального размера маржи платежеспособности, рассчитанной по Таблице увеличения минимального размера маржи платежеспособности согласно приложению 3 к Нормативам.";

      абзац четвертый подпункта 1) пункта 34 изложить в следующей редакции:

      "деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, соответствующих требованиям подпункта 5) пункта 38 Нормативов, - в объемах, указанных в Расчете активов страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности в соответствии с Таблицей активов страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности согласно приложению 4 к Нормативам;";

      подпункты 2), 3), 4) и 5) пункта 34 изложить в следующей редакции:

      "2) вклады, размещенные в банках второго уровня Республики Казахстан, соответствующих требованиям подпункта 5) пункта 38 Нормативов, - в объемах, указанных в Таблице активов страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности согласно приложению 4 к Нормативам;

      3) вклады, размещенные в международных финансовых организациях, соответствующих требованиям подпункта 6) пункта 38 Нормативов, - в объемах, указанных в Таблице активов страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности согласно приложению 4 к Нормативам;

      4) вклады, размещенные в банках-нерезидентах, соответствующих требованиям подпункта 7) пункта 38 Нормативов, - в объемах, указанных в Таблице активов страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности согласно приложению 4 к Нормативам;

      5) финансовые инструменты, указанные в подпунктах 8), 9), 10), 11), 12), 13), 14), 15), 16), 17), 18), 19), 20), 21), 22), 23), 24), 25), 26) и 27) пункта 38 Нормативов, - в объемах, указанных в Таблице активов страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности согласно приложению 4 к Нормативам;";

      часть третью пункта 38 изложить в следующей редакции:

      "Финансовые инструменты, указанные в настоящем пункте, включаются в расчет высоколиквидных активов в объемах, указанных в Таблице высоколиквидных активов страховой (перестраховочной) организации согласно приложению 5 к Нормативам.";

      подпункт 1) пункта 40 изложить в следующей редакции:

      "1) активы, являющиеся обеспечением по обязательствам страховой (перестраховочной) организации и (или) на которые право собственности страховой (перестраховочной) организации ограничено (за исключением операций РЕПО).

      Ценные бумаги, являющиеся предметом операции обратного РЕПО, включаются в расчет стоимости активов страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности в объемах, указанных в Таблице активов страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности согласно приложению 4 к Нормативам.

      Ценные бумаги, являющиеся предметом операции обратного РЕПО, включаются в расчет высоколиквидных активов страховой (перестраховочной) организации в объемах, указанных в Таблице высоколиквидных активов страховой (перестраховочной) организации согласно приложению 5 к Нормативам;";

      дополнить приложением 3 в редакции согласно приложению 6 к Перечню;

      дополнить приложением 4 в редакции согласно приложению 7 к Перечню;

      дополнить приложением 5 в редакции согласно приложению 8 к Перечню.

      4. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 26 декабря 2016 года № 307 "Об установлении пруденциального норматива для Национального оператора почты, а также формы, срока представления отчетности о его выполнении" (зарегистрировано в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 14786, опубликовано 28 февраля 2017 года в Эталонном контрольном банке нормативных правовых актов Республики Казахстан) следующие изменения:

      заголовок изложить в следующей редакции:

      "Об установлении пруденциальных нормативов для Национального оператора почты";

      пункты 1, 2 и 3 изложить в следующей редакции:

      "1. Установить для Национального оператора почты следующие пруденциальные нормативы:

      1) коэффициент достаточности собственных средств, значение которого на конец отчетного месяца составляет не менее 0,12.

      Коэффициент достаточности собственных средств рассчитывается как отношение собственного капитала Национального оператора почты к сумме его активов;

      2) коэффициент ликвидности, значение которого на конец отчетного месяца составляет не менее 0,30.

      Коэффициент ликвидности рассчитывается как отношение размера высоколиквидных активов к величине обязательств до востребования.

      2. Собственный капитал Национального оператора почты рассчитывается как сумма:

      оплаченного уставного капитала (в пределах сумм, оплаченных деньгами);

      дополнительного капитала;

      нераспределенного чистого дохода прошлых лет (в том числе фондов, резервов, сформированных за счет нераспределенного чистого дохода);

      превышения доходов текущего года над расходами текущего года;

      за минусом:

      нематериальных активов;

      убытков прошлых лет;

      превышения расходов текущего года над доходами текущего года;

      участия в уставном капитале других юридических лиц.

      3. В расчет высоколиквидных активов включаются:

      1) деньги, в том числе:

      деньги в кассе, не более 10 (десяти) процентов от суммы активов по балансу Национального оператора почты;

      деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан;

      деньги на счетах в центральном депозитарии;

      деньги Национального оператора почты, являющиеся взносами в гарантийные или резервные фонды клиринговой организации (центрального контрагента), маржевыми взносами, полным и (или) частичным обеспечением исполнения обязательств по сделкам, заключенным в торговой системе фондовой биржи методом открытых торгов и (или) с участием центрального контрагента;

      деньги на текущих счетах в банках-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долгосрочный кредитный рейтинг не ниже категории "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor’s или рейтинг аналогичного уровня рейтинговых агентств Moody’s Investors Service, Fitch или их дочерних рейтинговых организаций (далее - другие рейтинговые агентства);

      деньги на счетах в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, осуществляющих функции, установленные пунктом 1 статьи 59 Закона Республики Казахстан от 2 июля 2003 года "О рынке ценных бумаг", имеющих долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "ВВВ" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;

      2) государственные ценные бумаги Республики Казахстан, включая эмитированные в соответствии с законодательством других государств, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан;

      3) депозиты до востребования в Национальном Банке Республики Казахстан, в банках второго уровня Республики Казахстан;

      4) акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "В" по международной шкале агентства Standard & Poor’s или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг не ниже "kzB" по национальной шкале Standard & Poor’s, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции, за вычетом резервов на возможные потери;

      5) негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "В" по международной шкале агентства Standard & Poor’s или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг не ниже "kzBВ" по национальной шкале Standard & Poor’s (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери;

      6) долговые ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor’s или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери;

      7) негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВB-" по международной шкале агентства Standard & Poor’s или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств (с учетом сумм основного долга и начисленного вознаграждения), за вычетом резервов на возможные потери;

      8) акции иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor’s или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции, за вычетом резервов на возможные потери;

      9) паи Exchange Traded Funds (ETF), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам;

      10) паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN), имеющие рейтинговую оценку не ниже "3 звезды" рейтингового агентства Morningstar;

      11) аффинированные драгоценные металлы и металлические депозиты;

      12) инструменты исламского финансирования с рейтинговой оценкой ценной бумаги и (или) эмитента не ниже "B" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;

      13) инструменты исламского финансирования исламского банка при соблюдении следующих условий:

      наличие у организации, являющейся крупным акционером исламского банка, рейтинговой оценки не ниже "BВ+" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговой оценки аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;

      выполнение требований по соблюдению пруденциальных нормативов, установленных для исламского банка в соответствии с банковским законодательством Республики Казахстан.

      Ценные бумаги, указанные в настоящем пункте, не включаются в расчет высоколиквидных активов в случаях:

      продажи ценных бумаг Национальным оператором почты на условиях их обратного выкупа или передачи в залог, или обременения иным образом в соответствии с законодательством Республики Казахстан;

      покупки ценных бумаг Национальным оператором почты на рынке автоматического "репо" на условиях их обратной продажи;

      если данные ценные бумаги выпущены юридическими лицами, являющимися аффилированными лицами по отношению к Национальному оператору почты.";

      пункты 6 и 7 исключить.

      5. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 26 декабря 2016 года № 309 "Об установлении нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банковского конгломерата на определенную дату, перечня, форм, сроков представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов банковским конгломератом, а также Правил представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов банковским конгломератом" (зарегистрировано в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 14790, опубликовано 23 февраля 2017 года в Эталонном контрольном банке нормативных правовых актов Республики Казахстан) следующие изменения:

      заголовок изложить в следующей редакции:

      "Об установлении нормативных значений и методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов, размера капитала банковского конгломерата";

      пункт 1 изложить в следующей редакции:

      "1. Установить нормативные значения и методику расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов, размер капитала банковского конгломерата согласно приложению 1 к настоящему постановлению.";

      пункт 2 исключить;

      в Нормативных значениях и методике расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов размера капитала банковского конгломерата на определенную дату, утвержденных указанным постановлением:

      заголовок изложить в следующей редакции:

      "Нормативные значения и методика расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов, размер капитала банковского конгломерата";

      пункт 1 изложить в следующей редакции:

      "1. Нормативные значения и методика расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов, размер капитала банковского конгломерата (далее - Нормативы) разработаны в соответствии с законами Республики Казахстан от 31 августа 1995 года "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" (далее - Закон о банках), от 4 июля 2003 года "О государственном регулировании, контроле и надзоре финансового рынка и финансовых организаций" и устанавливают нормативные значения и методику расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов, размер капитала банковского конгломерата.";

      часть первую пункта 2 изложить в следующей редакции:

      "2. В состав пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов, размера капитала банковского конгломерата для обязательного соблюдения банковским конгломератом входят:";

      подпункт 3) пункта 3 изложить в следующей редакции:

      "3) риски - активы, условные и возможные обязательства участников банковского конгломерата, рассчитанные 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 и Правил расчета и лимитов открытой валютной позиции", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 15886 (далее – постановление № 170);";

      часть вторую пункта 9 изложить в следующей редакции:

      "Активы, условные и возможные обязательства участников банковского конгломерата взвешиваются по степени кредитного риска вложений (для банка - по степени рисков) в соответствии с постановлением № 170.";

      часть первую пункта 12 изложить в следующей редакции:

      "12. Размер риска на одного заемщика рассчитывается аналогично требованиям, установленным постановлением № 170.".

      6. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 27 апреля 2018 года № 79 "Об установлении видов пруденциальных нормативов, а также показателей, характеризующих соблюдение их значений для организаций, осуществляющих управление инвестиционным портфелем, утверждении Правил расчета значений пруденциальных нормативов, подлежащих соблюдению организациями, осуществляющими управление инвестиционным портфелем" (зарегистрировано в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 17008, опубликовано 12 июня 2018 года в Эталонном контрольном банке нормативных правовых актов Республики Казахстан) следующие изменения и дополнение:

      в Правилах расчета значений пруденциальных нормативов, подлежащих соблюдению организациями, осуществляющими управление инвестиционным портфелем, утвержденных указанным постановлением:

      пункт 9 изложить в следующей редакции:

      "9. Помимо рейтинговых оценок агентства Standard & Poor's уполномоченным органом по регулированию, контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций (далее - уполномоченный орган) также признаются рейтинговые оценки агентств Moody's Investors Service и Fitch (далее - другие рейтинговые агентства), установленные постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 24 декабря 2012 года № 385 "Об установлении минимального рейтинга для юридических лиц и стран, необходимость наличия которого требуется в соответствии с законодательством Республики Казахстан, регулирующим деятельность финансовых организаций, перечня рейтинговых агентств, присваивающих данный рейтинг", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 8318.";

      пункт 11 изложить в следующей редакции:

      "11. В качестве ликвидных активов управляющего инвестиционным портфелем признаются активы, указанные в Таблице расчета значений пруденциальных нормативов управляющего инвестиционным портфелем согласно приложению к Правилам, в соответствующих объемах.";

      пункт 13 изложить в следующей редакции:

      "13. Управляющий инвестиционным портфелем производит расчет значений пруденциальных нормативов управляющего инвестиционным портфелем по Таблице расчета значений пруденциальных нормативов управляющего инвестиционным портфелем согласно приложению к Правилам каждый рабочий день по состоянию на конец предшествующего рабочего дня, а также на конец каждого из выходных дней, непосредственно предшествовавших текущему рабочему дню.";

      часть вторую подпункта 1) пункта 14 изложить в следующей редакции:

      "Ценные бумаги, являющиеся предметом операции обратного репо, включаются в расчет ликвидных активов управляющего инвестиционным портфелем в объемах, указанных в Таблице расчета значений пруденциальных нормативов управляющего инвестиционным портфелем согласно приложению к Правилам;";

      главу 2 дополнить пунктом 14-1 следующего содержания:

      "14-1. В случае нарушения коэффициента достаточности собственного капитала и (или) коэффициента ликвидности управляющий инвестиционным портфелем в течение 3 (трех) рабочих дней с даты нарушения сообщает уполномоченному органу о факте и причинах нарушения соответствующего пруденциального норматива с приложением плана мероприятий по его устранению.";

      главу 3 исключить;

      Расчет значений пруденциальных нормативов управляющего инвестиционным портфелем согласно приложению изложить в редакции согласно приложению 9 к Перечню.

      7. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 27 апреля 2018 года № 80 "Об установлении видов пруденциальных нормативов, а также показателей, характеризующих соблюдение их значений, для организаций, осуществляющих брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, утверждении Правил расчета значений пруденциальных нормативов, подлежащих соблюдению организациями, осуществляющими брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг" (зарегистрировано в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 17005, опубликовано 13 июня 2018 года в Эталонном контрольном банке нормативных правовых актов Республики Казахстан) следующие изменения и дополнение:

      в Правилах расчета значений пруденциальных нормативов, подлежащих соблюдению организациями, осуществляющими брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, утвержденных указанным постановлением:

      пункт 2 изложить в следующей редакции:

      "2. Правила не распространяются на Национальный Банк Республики Казахстан, банки второго уровня Республики Казахстан, Национального оператора почты, добровольные накопительные пенсионные фонды, управляющие пенсионными активами единого накопительного пенсионного фонда в соответствии с договором на инвестиционное управление активами, заключенным с Национальным Банком Республики Казахстан.";

      главу 1 дополнить пунктом 4-1 изложить в следующей редакции:

      "4-1. В случае нарушения пруденциальных нормативов организации, осуществляющие брокерскую и (или) дилерскую деятельность, в течение 3 (трех) рабочих дней с даты нарушения сообщают уполномоченному органу по регулированию, контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций (далее - уполномоченный орган) о факте и причинах нарушения соответствующего пруденциального норматива с приложением плана мероприятий по его устранению.";

      пункт 9 изложить в следующей редакции:

      "9. В качестве ликвидных активов брокера и (или) дилера признаются активы, указанные в Таблице расчета значений пруденциальных нормативов организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг согласно приложению к Правилам, в соответствующих объемах.";

      пункт 11 изложить в следующей редакции:

      "11. Брокер и (или) дилер производит расчет значений пруденциальных нормативов организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, по Таблице расчета значений пруденциальных нормативов организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг согласно приложению к Правилам, каждый рабочий день по состоянию на конец предшествующего рабочего дня, а также на конец каждого из выходных дней, непосредственно предшествовавших текущему рабочему дню.";

      пункт 15 изложить в следующей редакции:

      "15. В качестве ликвидных активов ДНПФ признаются собственные активы ДНПФ, указанные в Таблице расчета значений пруденциальных нормативов организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг согласно приложению к Правилам, в соответствующих объемах.";

      часть вторую подпункта 1) пункта 16 изложить в следующей редакции:

      "Ценные бумаги, являющиеся предметом операции обратного репо, включаются в расчет ликвидных активов ДНПФ в объемах, указанных в Таблице расчета значений пруденциальных нормативов организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг согласно приложению к Правилам;";

      пункт 18 изложить в следующей редакции:

      "18. ДНПФ производит расчет значений пруденциальных нормативов организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, по Таблице расчета значений пруденциальных нормативов организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг согласно приложению к Правилам, каждый рабочий день по состоянию на конец предшествующего рабочего дня, а также на конец каждого из выходных дней, непосредственно предшествовавших текущему рабочему дню.";

      пункт 24 изложить в следующей редакции:

      "24. В качестве ликвидных активов УИП1 или УИП2 признаются активы, указанные в Таблице расчета значений пруденциальных нормативов организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг согласно приложению к Правилам, в соответствующих объемах.";

      часть вторую подпункта 1) пункта 25 изложить в следующей редакции:

      "Ценные бумаги, являющиеся предметом операции обратного репо, включаются в расчет ликвидных активов УИП1 или УИП2 в объемах, указанных в Таблице расчета значений пруденциальных нормативов организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг согласно приложению к Правилам;";

      пункт 26 изложить в следующей редакции:

      "26. УИП1 или УИП2 производит расчет значений пруденциальных нормативов организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, по Таблице расчета значений пруденциальных нормативов организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг согласно приложению к Правилам, каждый рабочий день по состоянию на конец предшествующего рабочего дня, а также на конец каждого из выходных дней, непосредственно предшествовавших текущему рабочему дню.";

      главу 5 исключить;

      Расчет значений пруденциальных нормативов организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг согласно приложению изложить в редакции согласно приложению 10 к Перечню.

      8. Внести в постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 31 января 2019 года № 14 "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов исламской страховой (перестраховочной) организации и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов, перечня, форм, сроков представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов исламскими страховыми (перестраховочными) организациями, Правил представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов исламскими страховыми (перестраховочными) организациями, требований к приобретаемым исламскими страховыми (перестраховочными) организациями, дочерними организациями исламских страховых (перестраховочных) организаций акциям (долям участия в уставном капитале) юридических лиц, а также перечня финансовых инструментов (за исключением акций и долей участия в уставном капитале), приобретаемых исламскими страховыми (перестраховочными) организациями" (зарегистрировано в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 18293, опубликовано 20 февраля 2019 года в Эталонном контрольном банке нормативных правовых актов Республики Казахстан) следующие изменения:

      заголовок изложить в следующей редакции:

      "Об установлении нормативных значений и методик расчетов пруденциальных нормативов исламской страховой (перестраховочной) организации и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов, требований к приобретаемым исламскими страховыми (перестраховочными) организациями, дочерними организациями исламских страховых (перестраховочных) организаций акциям (долям участия в уставном капитале) юридических лиц, а также перечня финансовых инструментов (за исключением акций и долей участия в уставном капитале), приобретаемых исламскими страховыми (перестраховочными) организациями";

      подпункты 2) и 3) пункта 1 исключить;

      в Нормативных значениях и методиках расчетов пруденциальных нормативов исламской страховой (перестраховочной) организации и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов, утвержденных указанным постановлением:

      пункт 9 изложить в следующей редакции:

      "9. Минимальный размер маржи платежеспособности исламской страховой (перестраховочной) организации увеличивается на сумму обязательств, передаваемых (переданных) в перестрахование исламским страховым (перестраховочным) организациям - резидентам и нерезидентам Республики Казахстан по действующим договорам исламского перестрахования в зависимости от рейтинговой оценки исламского перестраховщика или значения норматива достаточности маржи платежеспособности исламской перестраховочной организации-резидента Республики Казахстан на предыдущую отчетную дату, в соответствии с суммой увеличения минимального размера маржи платежеспособности, рассчитанной по Таблице увеличения минимального размера маржи платежеспособности согласно приложению 3 к Нормативам.";

      абзац четвертый подпункта 1) пункта 32 изложить в следующей редакции:

      "деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, соответствующих требованиям подпункта 5) пункта 34 Нормативов, - в объемах, указанных в Таблице активов исламской страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности согласно приложению 4 к Нормативам;";

      подпункты 2), 3), 4) и 5) пункта 32 изложить в следующей редакции:

      "2) вклады, размещенные в банках второго уровня Республики Казахстан, соответствующих требованиям подпункта 5) пункта 34 Нормативов, - в объемах, указанных в Таблице активов исламской страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности согласно приложению 4 к Нормативам;

      3) вклады, размещенные в международных финансовых организациях, соответствующих требованиям подпункта 6) пункта 34 Нормативов, - в объемах, указанных в Таблице активов исламской страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности согласно приложению 4 к Нормативам;

      4) вклады, размещенные в банках-нерезидентах, соответствующих требованиям подпункта 7) пункта 34 Нормативов, - в объемах, указанных в Таблице активов исламской страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности согласно приложению 4 к Нормативам;

      5) финансовые инструменты, указанные в подпунктах 8), 9), 10), 11), 12), 13), 14), 15), 16), 17), 18), 19), 20), 21), 22), 23), 24), 25), 26) и 27) пункта 34 Нормативов, - в объемах, указанных в Таблице активов исламской страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности согласно приложению 4 к Нормативам;";

      часть третью пункта 34 изложить в следующей редакции:

      "Финансовые инструменты, указанные в настоящем пункте, включаются в расчет высоколиквидных активов в объемах, указанных в Таблице высоколиквидных активов исламской страховой (перестраховочной) организации согласно приложению 5 к Нормативам.";

      дополнить приложением 3 в редакции согласно приложению 11 к настоящему Перечню;

      дополнить приложением 4 в редакции согласно приложению 12 к Перечню;

      дополнить приложением 5 в редакции согласно приложению 13 к Перечню.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 1 к Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые носятся изменения и дополнения |
|  | Приложение 1 к Правилам и методикам расчета значений пруденциальных нормативов для организатора торгов |

**Таблица активов организатора торгов, взвешенных по степени кредитного риска вложений**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| № | Наименование статей | Степень риска в процентах |
| I группа | | |
| 1 | Наличные тенге | 0 |
| 2 | Наличная иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 0 |
| 3 | Аффинированные драгоценные металлы | 0 |
| 4 | Вклады в Национальном Банке Республики Казахстан | 0 |
| 5 | Вклады в центральных банках стран, с суверенным рейтингом не ниже "АА-" агентства "Standard & Poor's" или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 0 |
| 6 | Вклады в международных финансовых организациях, с долговым рейтингом не ниже "АА-" агентства "Standard & Poor's" или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 0 |
| 7 | Дебиторская задолженность Правительства Республики Казахстан | 0 |
| 8 | Дебиторская задолженность местных органов власти Республики Казахстан по налогам и другим платежам в бюджет | 0 |
| 9 | Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Правительством Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан | 0 |
| 10 | Ценные бумаги, выпущенные акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына" |  |
| 11 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "АА-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинга аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 0 |
| 12 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 0 |
| II группа | | |
| 13 | Наличная иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "АА-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 20 |
| 14 | Деньги на корреспондентских счетах в Республиканском государственном предприятии на праве хозяйственного ведения "Казахстанский центр межбанковских расчетов Национального Банка Республики Казахстан" |  |
| 15 | Займы, предоставленные организациям, имеющим долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 |
| 16 | Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+"до "А-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 |
| 17 | Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг от "А+"до "А-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 |
| 18 | Вклады в организациях, имеющих долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 |
| 19 | Деньги на корреспондентских счетах в организациях, имеющих долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 |
| 20 | Дебиторская задолженность местных органов власти Республики Казахстан, за исключением дебиторской задолженности, отнесенной к І группе риска | 20 |
| 21 | Дебиторская задолженность организаций, имеющих долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 |
| 22 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+"до "А-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 |
| 23 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг от "А+"до "А-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 |
| 24 | Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти Республики Казахстан | 20 |
| 25 | 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 |
| 26 | Ценные бумаги, выпущенные организациями, имеющими долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 20 |
| 27 | Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов 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 "kzAAA" до "kzAA-"по национальной шкале агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 20 |
| III группа | | |
| 28 | Неаффинированные драгоценные металлы | 50 |
| 29 | Займы, предоставленные организациям, имеющим долговой рейтинг от "А+"до "А-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 |
| 30 | Долговые ценные бумаги, выпущенные Акционерным обществом "Банк Развития Казахстана" | 50 |
| 31 | Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 |
| 32 | Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг от "ВВВ+"до "ВВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 |
| 33 | Вклады в организациях, имеющих долговой рейтинг от "А+"до "А-"агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 |
| 34 | Деньги на корреспондентских счетах в организациях, имеющих долговой рейтинг от "А+"до "А-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 |
| 35 | Дебиторская задолженность организаций, имеющих долговой рейтинг от "А+"до "А-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 |
| 36 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+"до "ВВВ-"агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 |
| 37 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг от "ВВВ+"до "ВВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 |
| 38 | Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+"до "А-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 |
| 39 | Ценные бумаги, выпущенные организациями, имеющими долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 50 |
| 40 | Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на балансе и имеющие кредитный рейтинг от "А+"до "А-" 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 |
| IV группа | | |
| 41 | Займы, предоставленные организациям- резидентам Республики Казахстан, имеющим долговой рейтинг ниже "А-"агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациям- резидентам Республики Казахстан, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки, и организациям-нерезидентам Республики Казахстан, имеющим долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 |
| 42 | Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 100 |
| 43 | Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и международных финансовых организациях, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 100 |
| 44 | Вклады в организациях-резидентах Республики Казахстан, имеющих долговой рейтинг ниже "А-"агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациях-резидентах Республики Казахстан, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки, и организациях- нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 |
| 45 | Деньги на корреспондентских счетах в организациях-резидентах Республики Казахстан, имеющих долговой рейтинг ниже "А-"агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациях- резидентах Республики Казахстан, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки, и организациях-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 |
| 46 | Дебиторская задолженность организаций- резидентов Республики Казахстан, имеющих долговой рейтинг ниже "А-"агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организаций-резидентов Республики Казахстан, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки, и организаций-нерезидентов Республики Казахстан, имеющих долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 |
| 47 | Дебиторская задолженность физических лиц | 100 |
| 48 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 100 |
| 49 | Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 100 |
| 50 | Ценные бумаги, выпущенные: международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и международными финансовыми организациями, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки | 100 |
| 51 | Ценные бумаги, выпущенные организациями- резидентами Республики Казахстан, имеющими долговой рейтинг ниже "А-"агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациями-резидентами Республики Казахстан, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки, и организациями-нерезидентами Республики Казахстан, имеющими долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100 |
| 52 | Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на балансе и имеющие кредитный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" 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 |
| 53 | Расчеты по платежам | 100 |
| 54 | Основные средства | 100 |
| 55 | Материальные запасы | 100 |
| 56 | Предоплата суммы вознаграждения и расходов | 100 |
| V группа | | |
| 57 | Лицензионное программное обеспечение, приобретенное для целей основной деятельности организатора торгов и соответствующее Международному стандарту финансовой отчетности 38 | 100 |
| 58 | Займы, предоставленные организациям- нерезидентам Республики Казахстан, имеющим долговой рейтинг ниже "ВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациям- нерезидентам Республики Казахстан, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки | 150 |
| 59 | Займы, предоставленные нерезидентам Республики Казахстан, являющимся юридическими лицами, зарегистрированными на территории иностранных государств, указанных в примечании к настоящему приложению, или их гражданами | 200 |
| 60 | Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "В-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 150 |
| 61 | Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг ниже "В-"агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 150 |
| 62 | Вклады в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долговой рейтинг ниже "ВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациях-нерезидентах Республики Казахстан, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 150 |
| 63 | Деньги на корреспондентских счетах в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долговой рейтинг ниже "ВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациях-нерезидентах Республики Казахстан, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 150 |
| 64 | Вклады в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, зарегистрированных на территории иностранных государств, указанных в примечании к настоящему приложению | 200 |
| 65 | Деньги на корреспондентских счетах в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, зарегистрированных на территории иностранных государств, указанных в примечании к настоящему приложению | 200 |
| 66 | Дебиторская задолженность организаций-нерезидентов Республики Казахстан, имеющих долговой рейтинг ниже "ВВ-"агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организаций-нерезидентов Республики Казахстан, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки | 150 |
| 67 | Дебиторская задолженность организаций- нерезидентов Республики Казахстан, зарегистрированных на территории иностранных государств, указанных в примечании к настоящему приложению | 200 |
| 68 | Ценные бумаги, выпущенные центральными правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "В-"агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 150 |
| 69 | Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, суверенный рейтинг которых ниже "ВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 150 |
| 70 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг ниже "В-"агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 150 |
| 71 | Ценные бумаги, выпущенные организациями- нерезидентами Республики Казахстан, имеющими долговой рейтинг ниже "ВВ-" агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациями - нерезидентами Республики Казахстан, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки | 150 |
| 72 | Ценные бумаги, выпущенные организациями-нерезидентами Республики Казахстан, зарегистрированными на территории иностранных государств, указанных в примечании к настоящему приложению | 200 |
| 73 | Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на балансе и имеющие кредитный рейтинг от "ВВ+"до "ВВ-" 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 |
| 74 | Негосударственные долговые ценные бумаги организаций Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и (или) других государств, включенные в список фондовой биржи, эмитент которых соответствует требованиям категории "долговые ценные бумаги без рейтинговой оценки первой подкатегории (наивысшая категория)", предусмотренной постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 27 марта 2017 года № 54 "Об утверждении Требований к эмитентам и их ценным бумагам, допускаемым (допущенным) к обращению на фондовой бирже, а также к отдельным категориям списка фондовой биржи и внесении изменений в некоторые нормативные правовые акты Республики Казахстан по вопросам регулирования рынка ценных бумаг" (зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 15175) (далее - постановление № 54) | 250 |
| 75 | Негосударственные долговые ценные бумаги организаций Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в список фондовой биржи, эмитент которых соответствует требованиям категории "долговые ценные бумаги без рейтинговой оценки второй подкатегории (следующая за наивысшей категорией)", предусмотренной постановлением № 54 | 250 |
| 76 | Прочие финансовые инструменты | 400 |
|  | Итого: |  |

      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 2 к Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения |
|  | Приложение 2 к Правилам и методикам расчета значений пруденциальных нормативов для организатора торгов |

**Таблица условных и возможных обязательств организатора торгов, взвешенных по степени кредитного риска**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| № | Наименование статей | Коэффициент конверсии в процентах |
| I группа | | |
| 1 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан или ценных бумаг, выпущенных центральными правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА"и выше агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 0 |
| 2 | Возможные (условные) обязательства по размещению организатором торгов в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию организатора торгов | 0 |
| II группа | | |
| 3 | Возможные (условные) обязательства по размещению организатором торгов в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 (одного) года | 20 |
| 4 | Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на счетах условных обязательств 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 "kzAAA" до "kzAA" по национальной шкале агентства "Standard & Poor's" или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 20 |
| III группа | | |
| 5 | Возможные (условные) обязательства по размещению организатором торгов в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 (одного) года | 50 |
| 6 | Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "А+" до "А" 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 |
| IV группа | | |
| 7 | Соглашение о продаже организатором торгов с обязательством обратного выкупа организатором торгов финансовых инструментов | 100 |
| 8 | Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ" 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 |
| 9 | Иные аккредитивы организатора торгов | 100 |
| 10 | Иные условные (возможные) обязательства организатора торгов | 100 |
| 11 | Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ВВ+"до "ВВ"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 |

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 3 к Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения |
|  | Приложение 3 к Правилам и методикам расчета значений пруденциальных нормативов для организатора торгов |

**Таблица производных финансовых инструментов, взвешенных с учетом кредитного риска**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование статей | Номинальная стоимость производных финансовых инструментов | Коэффициент кредитного риска для производных финансовых инструментов в процентах | Сумма с учетом кредитного риска для производных финансовых инструментов | Рыночная стоимость производных финансовых инструментов | Коэффициент кредитного риска для контрагента в процентах в соответствии с приложением 1 к настоящим Правилам | Сумма к расчету |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5=3\*4 | 6 | 7 | 8= (5+6)\*7 |
| 1 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с государственными ценными бумагами, со сроком погашения до 1 (одного) года |  | 0,02 |  |  |  |  |
| 2 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с государственными ценными бумагами, со сроком погашения от 1 (одного) года до 5 (пяти) лет |  | 0,03 |  |  |  |  |
| 3 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с государственными ценными бумагами, со сроком погашения более 5 (пяти) лет |  | 0,04 |  |  |  |  |
| 4 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с валютными сделками, со сроком погашения до 1 (одного) года |  | 0,05 |  |  |  |  |
| 5 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с валютными сделками, со сроком погашения от 1 (одного) года до 5 (пяти) лет |  | 0,07 |  |  |  |  |
| 6 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с валютными сделками, со сроком погашения более 5 (пяти) лет |  | 0,09 |  |  |  |  |
| 7 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с процентными сделками, со сроком погашения до 1 (одного) года |  | 0,03 |  |  |  |  |
| 8 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с процентными сделками, со сроком погашения от 1 (одного) года до 5 (пяти) лет |  | 0,06 |  |  |  |  |
| 9 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с процентными сделками, со сроком погашения более 5 (пяти) лет |  | 0,09 |  |  |  |  |
| 10 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с не государственными ценными бумагами, со сроком погашения до 1 (одного) года |  | 0,06 |  |  |  |  |
| 11 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с не государственными ценными бумагами, со сроком погашения от 1 (одного) года до 5 (пяти) лет |  | 0,08 |  |  |  |  |
| 12 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с не государственными ценными бумагами, со сроком погашения более 5 (пяти) лет |  | 0,10 |  |  |  |  |
| 13 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, со сроком погашения до 1 (одного) года |  | 0,07 |  |  |  |  |
| 14 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, со сроком погашения от 1 (одного) года до 5 (пяти) лет |  | 0,07 |  |  |  |  |
| 15 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, со сроком погашения более 5 (пяти) лет |  | 0,08 |  |  |  |  |
| 16 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с прочими операциями, со сроком погашения до 1 (одного) года |  | 0,10 |  |  |  |  |
| 17 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с прочими операциями, со сроком погашения от 1 (одного) года до 5 (пяти) лет |  | 0,12 |  |  |  |  |
| 18 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с прочими операциями, со сроком погашения более 5 (пяти) лет |  | 0,15 |  |  |  |  |
| Итого производные финансовые инструменты, взвешенные с учетом кредитного риска | |  | Х |  |  | Х |  |

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 4 к Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения |
|  | Приложение 4 к Правилам и методикам расчета значений пруденциальных нормативов для организатора торгов |

**Таблица коэффициента текущей ликвидности К2**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Дата | Высоколиквидные активы | Сумма обязательств организатора торгов перед участниками торгов по деньгам участников торгов, которые находятся на корреспондентских счетах организатора торгов | Сумма нетто-требований участников торгов к организатору торгов, по которой организатор торгов несет ответственность собственными средствами | Сумма максимального ущерба членам организатора торгов по всем категориям членства, которая подлежит возмещению организатором торгов в результате наступления технического сбоя |
| 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 |  |  |  |  |  |
| Итого: |  |  |  |  |  |
| Итого среднемесячная величина |  |  |  |  |  |
| Количество рабочих дней |  | | | | |
| Коэффициент текущей ликвидности |  | | | | |

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 5 |
|  | к Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения |

      Сноска. Приложение 5 утратило силу постановлением Правления Агентства РК по регулированию и развитию финансового рынка от 07.06.2023 № 41 (вводится в действие с 01.07.2023).

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 6 к Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения |
|  | Приложение 3 к Нормативным значениям и методике расчетов пруденциальных нормативов страховой (перестраховочной) организации и страховой группы и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов |

**Таблица увеличения минимального размера маржи платежеспособности**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Наименование перестраховочной организации | Рейтинговая оценка перестраховщика по международной или национальной шкале (норматив достаточности маржи платежеспособности) | Объем обязательств, переданных (передаваемых) в перестрахование по действующим договорам перестрахования, всего (в тысячах тенге) | Процент от объема обязательств, переданных (передаваемых) в перестрахование по действующим договорам перестрахования | Сумма увеличения минимального размера маржи платежеспособности (в тысячах тенге) (графа 3 х графа 4) |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Договоры перестрахования, заключенные с перестраховщиками-нерезидентами Республики Казахстан, за исключением перестраховщиков стран-участниц Договора о Евразийском экономическом союзе, ратифицированного Законом Республики Казахстан от 14 октября 2014 года "О ратификации Договора о Евразийском экономическом союзе" (далее - Договор о ЕАЭС) | | | | |
| Группа 1 | "АА-" или выше |  | 0% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 2 | с "А+" по "А-" |  | 0% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 3 | с "ВВВ+" по "ВВВ-" |  | 0,2% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 4 | с "ВВ+" по "ВВ-" |  | 0,75% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 5 | с "В+" по "В-" |  | 3,8% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 6 | ниже "В- " или отсутствует |  | 22% |  |
| Договоры перестрахования, заключенные с перестраховщиками-резидентами Республики Казахстан | | | | |
| Группа 7 | не ниже "В" или "kzBB" |  | 0% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 8 | "В-", "kzBB-", "kzB+" |  | 0,2% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 9 | > 1,75 |  | 0,05% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 10 | > 1,5 |  | 0,1% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 11 | > 1,25 |  | 0,2% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 12 | > 1,1 |  | 0,5% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 13 | >= 1,0 |  | 3,8% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 14 | < 1,0 |  | 5% |  |
|  |  |  |  |  |
| Договоры перестрахования, заключенные с перестраховщиками-стран-участниц Договора о ЕАЭС | | | | |
| Группа 15 | с "ВВВ+" по "ВВВ-" |  | 0% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 16 | с "ВВ+" по "ВВ-" |  | 0,2% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 17 | с "В+" по "В-" |  | 0,5% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 18 | ниже "В-" или отсутствует |  | 22% |  |
|  |  |  |  |  |
| Итого: |  |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 7 к Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения |
|  | Приложение 4 к Нормативным значениям и методике расчетов пруденциальных нормативов страховой (перестраховочной) организации и страховой группы и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов |

**Таблица активов страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| № | Наименование показателя | Учитываемый объем |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Деньги – всего, в том числе: |  |
| 1.1 | деньги в кассе в сумме, не превышающей 1 (один) процент от суммы активов страховой (перестраховочной) организации за минусом активов перестрахования | 100% |
| 1.2 | деньги в пути, в банках второго уровня Республики Казахстан | 100% |
| 1.3 | деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанных в строках 2.1 и 2.2 настоящего приложения | 100% |
| 1.4 | деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанных в строке 2.3 настоящего приложения | 90% |
| 1.5 | деньги страховой (перестраховочной) организации на счетах у организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, находящиеся в банках второго уровня Республики Казахстан и в центральном депозитарии | 100% |
| 1.6 | деньги страховой (перестраховочной) организации на счетах у организации, осуществляющей деятельность по управлению инвестиционным портфелем, находящиеся в банках второго уровня Республики Казахстан | 100% |
| 2 | Вклады – всего, в том числе: |  |
| 2.1 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан при условии, что данные банки являются эмитентами, акции которых включены в категорию "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи или находятся в представительском списке индекса фондовой биржи | 100% |
| 2.2 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, соответствующих одному из следующих требований:  имеют долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "B" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB+" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств;  являются дочерними банками-резидентами Республики Казахстан, родительские банки-нерезиденты Республики Казахстан которых имеют долгосрочный кредитный рейтинг в иностранной валюте не ниже "А-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 2.3 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный кредитный рейтинг "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку от "kzBB" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 2.4 | вклады в международных финансовых организациях, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, вклады в Евразийском Банке Развития в национальной валюте Республики Казахстан | 100% |
| 2.5 | вклады в банках-нерезидентах, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3 | Долговые ценные бумаги – всего, в том числе: |  |
| 3.1 | государственные ценные бумаги Республики Казахстан, включая эмитированные в соответствии с законодательством других государств, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан | 100% |
| 3.2 | долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан, включенные в официальный список фондовой биржи, осуществляющей деятельность на территории Республики Казахстан | 100% |
| 3.3 | долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, осуществляющим выкуп ипотечных займов физических лиц, не связанных с предпринимательской деятельностью, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан | 100% |
| 3.4 | долговые ценные бумаги, выпущенные акционерными обществами "Банк Развития Казахстана", "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", "Фонд проблемных кредитов" в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств | 100% |
| 3.5 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, номинированные в иностранной валюте и допущенные к публичным торгам на фондовой бирже, функционирующей на территории Международного финансового центра "Астана" | 90% |
| 3.6 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Альтернативная" официального списка фондовой биржи | 60% |
| 3.7 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг не ниже "kzA-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3.8 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzBBB+" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 85% |
| 3.9 | негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими рейтинговую оценку не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, а также долговые ценные бумаги, выпущенные Евразийским Банком Развития и номинированные в национальной валюте Республики Казахстан | 100% |
| 3.10 | долговые ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3.11 | долговые ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 3.12 | долговые ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 80% |
| 3.13 | негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3.14 | негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного их других рейтинговых агентств | 85% |
| 3.15 | негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного их других рейтинговых агентств | 70% |
| 4 | Акции и депозитарные расписки – всего, в том числе: |  |
| 4.1 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, входящих в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 100% |
| 4.2 | акции юридических лиц, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям категории "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции | 100% |
| 4.3 | акции юридических лиц – резидентов Республики Казахстан, включенные в категорию "стандарт" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или акции юридических лиц – резидентов Республики Казахстан, номинированные в иностранной валюте, допущенные к публичным торгам на фондовой бирже, функционирующей на территории Международного финансового центра "Астана", и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции | 80% |
| 4.4 | акции юридических лиц Республики Казахстан, включенные в сектор "акции" площадки "Альтернативная" официального списка фондовой биржи, и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции | 60% |
| 4.5 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 100% |
| 4.6 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 80% |
| 4.7 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 60% |
| 4.8 | акции акционерного общества "Фонд гарантирования страховых выплат" | 100% |
| 5 | Иные ценные бумаги – всего, в том числе: |  |
| 5.1 | ценные бумаги инвестиционных фондов, включенные в официальный список фондовой биржи | 70% |
| 5.2 | паи Exchange Traded Funds (ETF), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам | 90% |
| 5.3 | паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN), имеющие рейтинговую оценку не ниже "3 звезды" рейтингового агентства Morningstar | 80% |
| 5.4 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг не ниже "kzAAA" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 5.5 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтингов оценку от "BB+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzAA+" до "kzA-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 5.6 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzBBB+" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 80% |
| 5.7 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, родительские организации которых имеют рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 6 | Иные активы – всего, в том числе: |  |
| 6.1 | аффинированные драгоценные металлы и металлические депозиты | 100% |
| 6.2 | займы страхователям страховой (перестраховочной) организации, осуществляющей деятельность по отрасли "страхование жизни", в объеме 100 (ста) процентов от суммы основного долга | 100% |
| 6.3 | основные средства в виде недвижимого имущества в сумме, не превышающей 5 (пяти) процентов от суммы высоколиквидных активов страховой (перестраховочной) организации | 100% |
| 6.4 | программное обеспечение, приобретенное для целей основной деятельности страховой (перестраховочной) организации (в размере себестоимости с учетом накопленной амортизации и не превышающем 10 (десяти) процентов от суммы высоколиквидных активов страховой (перестраховочной) организации) | 100% |
| 6.5 | суммы к получению от перестраховщиков, страховые премии к получению от страхователей (перестрахователей) и посредников в сумме, не превышающей 10 (десяти) процентов от суммы высоколиквидных активов страховой (перестраховочной) организации | 100% |
| 6.6 | требования к эмитентам ценных бумаг по выплате номинальной стоимости ценных бумаг, возникшие в связи с истечением срока их обращения, предусмотренного проспектом выпуска ценных бумаг (не просроченные по условиям проспекта выпуска ценных бумаг) | 100% |

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 8 к Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения |
|  | Приложение 5 к Нормативным значениям и методике расчетов пруденциальных нормативов страховой (перестраховочной) организации и страховой группы и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов |

**Таблица высоколиквидных активов страховой (перестраховочной) организации**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| № | Наименование показателя | Учитываемый объем |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Деньги – всего, в том числе: |  |
| 1.1 | деньги в кассе в сумме, не превышавшей 1 (один) процент от суммы активов страховой (перестраховочной) организации за минусом активов перестрахования | 100% |
| 1.2 | деньги страховой (перестраховочной) организации на счетах у организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, находящиеся в банках второго уровня Республики Казахстан и в центральном депозитарии | 100% |
| 1.3 | деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанных в строках 2.1 и 2.2 настоящего приложения | 100% |
| 1.4 | деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанных в строке 2.3 настоящего приложения | 90% |
| 1.5 | деньги страховой (перестраховочной) организации на счетах у организации, осуществляющей деятельность по управлению инвестиционным портфелем, находящиеся в банках второго уровня Республики Казахстан | 100% |
| 2 | Вклады – всего, в том числе: |  |
| 2.1 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан при условии, что данные банки являются эмитентами, акции которых включены в категорию "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи или находятся в представительском списке индекса фондовой биржи | 100% |
| 2.2 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, соответствующих одному из следующих требований:  имеют долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "B" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB+" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств;  являются дочерними банками-резидентами Республики Казахстан, родительские банки-нерезиденты Республики Казахстан которых имеют долгосрочный кредитный рейтинг в иностранной валюте не ниже "А-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 2.3 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный кредитный рейтинг "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку от "kzBB" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 2.4 | вклады в международных финансовых организациях, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, вклады в Евразийском Банке Развития в национальной валюте Республики Казахстан | 100% |
| 2.5 | вклады в банках-нерезидентах, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3 | Долговые ценные бумаги – всего, в том числе: |  |
| 3.1 | государственные ценные бумаги Республики Казахстан, включая эмитированные в соответствии с законодательством других государств, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан | 100% |
| 3.2 | долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан, включенные в официальный список фондовой биржи, осуществляющей деятельность на территории Республики Казахстан | 100% |
| 3.3 | долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, осуществляющим выкуп ипотечных займов физических лиц, не связанных с предпринимательской деятельностью, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан | 100% |
| 3.4 | долговые ценные бумаги, выпущенные акционерными обществами "Банк Развития Казахстана", "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", "Фонд проблемных кредитов" в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств | 100% |
| 3.5 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, номинированные в иностранной валюте и допущенные к публичным торгам на фондовой бирже, функционирующей на территории Международного финансового центра "Астана" | 90% |
| 3.6 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Альтернативная" официального списка фондовой биржи | 60% |
| 3.7 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг не ниже "kzA-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3.8 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzBBB+" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 85% |
| 3.9 | негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими рейтинговую оценку не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, а также долговые ценные бумаги, выпущенные Евразийским Банком Развития и номинированные в национальной валюте Республики Казахстан | 100% |
| 3.10 | долговые ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3.11 | долговые ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 3.12 | долговые ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 80% |
| 3.13 | негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3.14 | негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного их других рейтинговых агентств | 85% |
| 3.15 | негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного их других рейтинговых агентств | 70% |
| 4 | Акции и депозитарные расписки – всего, в том числе: |  |
| 4.1 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, входящих в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 100% |
| 4.2 | акции юридических лиц, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям категории "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции | 100% |
| 4.3 | акции юридических лиц – резидентов Республики Казахстан, включенные в категорию "стандарт" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или акции юридических лиц – резидентов Республики Казахстан, номинированные в иностранной валюте, допущенные к публичным торгам на фондовой бирже, функционирующей на территории Международного финансового центра "Астана", и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции | 80% |
| 4.4 | акции юридических лиц Республики Казахстан, включенные в сектор "акции" площадки "Альтернативная" официального списка фондовой биржи, и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции | 60% |
| 4.5 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 100% |
| 4.6 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 80% |
| 4.7 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 60% |
| 5 | Иные ценные бумаги – всего, в том числе: |  |
| 5.1 | ценные бумаги инвестиционных фондов, включенные в официальный список фондовой биржи | 70% |
| 5.2 | паи Exchange Traded Funds (ETF), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам | 90% |
| 5.3 | паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN), имеющие рейтинговую оценку не ниже "3 звезды" рейтингового агентства Morningstar | 80% |
| 5.4 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг не ниже "kzAAA" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 5.5 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие рейтингов оценку от "BB+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzAA+" до "kzA-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 5.6 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzBBB+" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 80% |
| 5.7 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, родительские организации которых имеют рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 6 | Иные активы – всего, в том числе: |  |
| 6.1 | аффинированные драгоценные металлы и металлические депозиты | 100% |
| 6.2 | требования к эмитентам ценных бумаг по выплате номинальной стоимости ценных бумаг, возникшие в связи с истечением срока их обращения, предусмотренного проспектом выпуска ценных бумаг (не просроченные по условиям проспекта выпуска ценных бумаг) | 100% |

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 9 к Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения |
|  | Приложение к Правилам расчета значений пруденциальных нормативов, подлежащих соблюдению организациями, осуществляющими управление инвестиционным портфелем |

**Таблица расчета значений пруденциальных нормативов управляющего инвестиционным портфелем**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование показателя | Сумма по балансу | Учитываемый объем (в процентах) | Сумма к расчету |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 | Деньги и вклады всего, в том числе: |  |  |  |
| 1.1 | деньги в кассе в сумме, не превышающей 10 (десять) процентов от суммы активов по балансу управляющего инвестиционным портфелем |  | 100 |  |
| 1.2 | деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанных в строках 1.9 и 1.10 настоящего приложения |  | 100 |  |
| 1.3 | деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанных в строке 1.11 настоящего приложения |  | 90 |  |
| 1.4 | деньги на счетах в центральном депозитарии |  | 100 |  |
| 1.5 | деньги управляющего инвестиционным портфелем являющиеся взносами в гарантийные или резервные фонды клиринговой организации (центрального контрагента), маржевыми взносами, полным и (или) частичным обеспечением исполнения обязательств по сделкам, заключенным в торговой системе фондовой биржи методом открытых торгов и (или) с участием центрального контрагента |  | 100 |  |
| 1.6 | деньги на текущих счетах в банках-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 1.7 | деньги на счетах в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, осуществляющих функции, установленные пунктом 1 статьи 59 Закона Республики Казахстан от 2 июля 2003 года "О рынке ценных бумаг", имеющих долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "ВВВ" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 1.8 | деньги на счетах в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, являющихся членом Международной ассоциации по вопросам обслуживания ценных бумаг (International Securities Services Association) |  | 100 |  |
| 1.9 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан при условии, что данные банки являются эмитентами, включенными в категорию "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или эмитентами, акции которых находятся в представительском списке индекса фондовой биржи |  | 100 |  |
| 1.10 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, соответствующих одному из следующих требований:  имеют долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "B" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB+" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств;  являются дочерними банками-резидентами Республики Казахстан, родительские банки-нерезиденты Республики Казахстан которых имеют долгосрочный кредитный рейтинг в иностранной валюте не ниже "А-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 1.11 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный кредитный рейтинг "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzBB" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств |  | 90 |  |
| 1.12 | вклады в международных финансовых организациях, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, вклады в Евразийском Банке Развития в национальной валюте Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 1.13 | вклады в банках-нерезидентах, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 2 | Долговые ценные бумаги – всего, в том числе |  |  |  |
| 2.1 | государственные ценные бумаги Республики Казахстан, включая эмитированные в соответствии с законодательством других государств, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 2.2 | долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан, включенные в официальный список фондовой биржи, осуществляющей деятельность на территории Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 2.3 | долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, осуществляющим выкуп ипотечных займов физических лиц, не связанных с предпринимательской деятельностью, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 2.4 | долговые ценные бумаги, выпущенные акционерными обществами "Банк Развития Казахстана", "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", "Фонд проблемных кредитов" в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств |  | 100 |  |
| 2.5 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, номинированные в иностранной валюте и допущенные к публичным торгам на фондовой бирже, функционирующей на территории Международного финансового центра "Астана" |  | 90 |  |
| 2.6 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Альтернативная" официального списка фондовой биржи |  | 60 |  |
| 2.7 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг не ниже "kzA-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 2.8 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzBBB+" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 2.9 | негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими международную рейтинг не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, а также ценные бумаги, выпущенные Евразийским Банком Развития и номинированные в национальной валюте Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 2.10 | долговые ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 2.11 | долговые ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 90 |  |
| 2.12 | долговые ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 80 |  |
| 2.13 | негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 2.14 | негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного их других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 2.15 | негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного их других рейтинговых агентств |  | 70 |  |
| 3 | Акции и депозитарные расписки – всего, в том числе: |  |  |  |
| 3.1 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, входящих в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции |  | 100 |  |
| 3.2 | акции юридических лиц, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям категории "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции |  | 100 |  |
| 3.3 | акции юридических лиц – резидентов Республики Казахстан, включенные в категорию "стандарт" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или акции юридических лиц – резидентов Республики Казахстан, номинированные в иностранной валюте, допущенные к публичным торгам на фондовой бирже, функционирующей на территории Международного финансового центра "Астана", и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции |  | 80 |  |
| 3.4 | акции юридических лиц Республики Казахстан, включенные в сектор "акции" площадки "Альтернативная" официального списка фондовой биржи, и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции |  | 60 |  |
| 3.5 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции |  | 100 |  |
| 3.6 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции |  | 80 |  |
| 3.7 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции |  | 60 |  |
| 4 | Иные ценные бумаги – всего, в том числе: |  |  |  |
| 4.1 | ценные бумаги инвестиционных фондов, включенные в официальный список фондовой биржи |  | 70 |  |
| 4.2 | паи Exchange Traded Funds (ETF), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам |  | 90 |  |
| 4.3 | паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN), имеющие рейтинговую оценку не ниже "3 звезды" рейтингового агентства Morningstar |  | 80 |  |
| 5 | Иные активы – всего, в том числе: |  |  |  |
| 5.1 | Аффинированные драгоценные металлы и металлические депозиты |  | 100 |  |
| 5.2 | Дебиторская задолженность (за исключением дебиторской задолженности аффилированных лиц управляющего инвестиционным портфелем) по начисленному, но не выплаченному комиссионному вознаграждению в рамках осуществления профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг (не просроченная по условиям договора) - в сумме, не превышающей 10 (десять) процентов от суммы активов по балансу управляющего инвестиционным портфелем |  | 100 |  |
| 5.3 | Требования к эмитентам ценных бумаг по выплате номинальной стоимости ценных бумаг, возникшие в связи с истечением срока их обращения, предусмотренного проспектом выпуска ценных бумаг (не просроченные по условиям проспекта выпуска ценных бумаг) |  | 100 |  |
| 5.4 | Основные средства управляющего инвестиционным портфелем в виде недвижимого имущества в сумме, не превышающей 5 (пяти) процентов от суммы активов по балансу управляющего инвестиционным портфелем |  | 100 |  |
| 6 | Итого ликвидные активы |  |  |  |
| 7 | Обязательства по балансу |  |  |  |
| 8 | Минимальный размер собственного капитала |  |  |  |
| 9 | Коэффициент достаточности собственного капитала |  |  |  |
| 10 | Коэффициент ликвидности |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 10 к Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения |
|  | Приложение к Правилам расчета значений пруденциальных нормативов, подлежащих соблюдению организациями, осуществляющими брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг |

**Таблица расчета значений пруденциальных нормативов организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование показателя | Сумма по балансу | Учитываемый объем (в процентах) | Сумма к расчету |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 | Деньги и вклады всего, в том числе: |  |  |  |
| 1.1 | деньги в кассе в сумме, не превышающей 10 (десять) процентов от суммы активов по балансу Организации |  | 100 |  |
| 1.2 | деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанных в строках 1.9 и 1.10 настоящего приложения |  | 100 |  |
| 1.3 | деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанных в строке 1.11 настоящего приложения |  | 90 |  |
| 1.4 | деньги на счетах в центральном депозитарии |  | 100 |  |
| 1.5 | деньги Организации, являющиеся взносами в гарантийные или резервные фонды клиринговой организации (центрального контрагента), маржевыми взносами, полным и (или) частичным обеспечением исполнения обязательств по сделкам, заключенным в торговой системе фондовой биржи методом открытых торгов и (или) с участием центрального контрагента |  | 100 |  |
| 1.6 | деньги на текущих счетах в банках-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 1.7 | деньги на счетах в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, осуществляющих функции, установленные пунктом 1 статьи 59 Закона Республики Казахстан от 2 июля 2003 года "О рынке ценных бумаг", имеющих долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "ВВВ" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 1.8 | деньги на счетах в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, являющихся членом Международной ассоциации по вопросам обслуживания ценных бумаг (International Securities Services Association) |  | 100 |  |
| 1.9 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан при условии, что данные банки являются эмитентами, включенными в категорию "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или эмитентами, акции которых находятся в представительском списке индекса фондовой биржи |  | 100 |  |
| 1.10 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, соответствующих одному из следующих требований:  имеют долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "B" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB+" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств;  являются дочерними банками-резидентами Республики Казахстан, родительские банки-нерезиденты Республики Казахстан которых имеют долгосрочный кредитный рейтинг в иностранной валюте не ниже "А-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 1.11 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный кредитный рейтинг "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzBB" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств |  | 90 |  |
| 1.12 | вклады в международных финансовых организациях, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, вклады в Евразийском Банке Развития в национальной валюте Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 1.13 | вклады в банках-нерезидентах, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 2 | Долговые ценные бумаги – всего, в том числе |  |  |  |
| 2.1 | государственные ценные бумаги Республики Казахстан, включая эмитированные в соответствии с законодательством других государств, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 2.2 | долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан, включенные в официальный список фондовой биржи, осуществляющей деятельность на территории Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 2.3 | долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, осуществляющим выкуп ипотечных займов физических лиц, не связанных с предпринимательской деятельностью, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 2.4 | долговые ценные бумаги, выпущенные акционерными обществами "Банк Развития Казахстана", "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", "Фонд проблемных кредитов" в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств |  | 100 |  |
| 2.5 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, номинированные в иностранной валюте и допущенные к публичным торгам на фондовой бирже, функционирующей на территории Международного финансового центра "Астана" |  | 90 |  |
| 2.6 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Альтернативная" официального списка фондовой биржи |  | 60 |  |
| 2.7 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг не ниже "kzA-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 2.8 | негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzBBB+" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 2.9 | негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими международную рейтинг не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, а также ценные бумаги, выпущенные Евразийским Банком Развития и номинированные в национальной валюте Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 2.10 | долговые ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 2.11 | долговые ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 90 |  |
| 2.12 | долговые ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 80 |  |
| 2.13 | негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 2.14 | негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного их других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 2.15 | негосударственные долговые ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного их других рейтинговых агентств |  | 70 |  |
| 3 | Акции и депозитарные расписки – всего, в том числе: |  |  |  |
| 3.1 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, входящих в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции |  | 100 |  |
| 3.2 | акции юридических лиц, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям категории "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции |  | 100 |  |
| 3.3 | акции юридических лиц – резидентов Республики Казахстан, включенные в категорию "стандарт" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или акции юридических лиц – резидентов Республики Казахстан, номинированные в иностранной валюте, допущенные к публичным торгам на фондовой бирже, функционирующей на территории Международного финансового центра "Астана", и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции |  | 80 |  |
| 3.4 | акции юридических лиц Республики Казахстан, включенные в сектор "акции" площадки "Альтернативная" официального списка фондовой биржи, и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции |  | 60 |  |
| 3.5 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции |  | 100 |  |
| 3.6 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции |  | 80 |  |
| 3.7 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции |  | 60 |  |
| 4 | Иные ценные бумаги – всего, в том числе: |  |  |  |
| 4.1 | ценные бумаги инвестиционных фондов, включенные в официальный список фондовой биржи |  | 70 |  |
| 4.2 | паи Exchange Traded Funds (ETF), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам |  | 90 |  |
| 4.3 | паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN), имеющие рейтинговую оценку не ниже "3 звезды" рейтингового агентства Morningstar |  | 80 |  |
| 5 | Иные активы – всего, в том числе: |  |  |  |
| 5.1 | Аффинированные драгоценные металлы и металлические депозиты |  | 100 |  |
| 5.2 | Дебиторская задолженность (за исключением дебиторской задолженности аффилированных лиц Организации) по начисленному, но не выплаченному комиссионному вознаграждению в рамках осуществления профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг (не просроченная по условиям договора) - в сумме, не превышающей 10 (десять) процентов от суммы активов по балансу Организации |  | 100 |  |
| 5.3 | Требования к эмитентам ценных бумаг по выплате номинальной стоимости ценных бумаг, возникшие в связи с истечением срока их обращения, предусмотренного проспектом выпуска ценных бумаг (не просроченные по условиям проспекта выпуска ценных бумаг) |  | 100 |  |
| 5.4 | Основные средства Организации в виде недвижимого имущества в сумме, не превышающей 5 (пяти) процентов от суммы активов по балансу Организации |  | 100 |  |
| 6 | Итого ликвидные активы |  |  |  |
| 7 | Обязательства по балансу |  |  |  |
| 8 | Минимальный размер собственного капитала |  |  |  |
| 9 | Коэффициент достаточности собственного капитала |  |  |  |
| 10 | Коэффициент ликвидности |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 11 к Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения |
|  | Приложение 3 к Нормативным значениям и методикам расчетов пруденциальных нормативов исламской страховой (перестраховочной) организации и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов |

**Таблица увеличения минимального размера маржи платежеспособности**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Наименование исламской перестраховочной организации | Рейтинговая оценка исламского перестраховщика по международной или национальной шкале (норматив достаточности маржи платежеспособности) | Объем обязательств, переданных (передаваемых) в перестрахование по действующим договорам исламского перестрахования, всего | Процент от объема обязательств, переданных (передаваемых) в перестрахование по действующим договорам исламского перестрахования | Сумма увеличения минимального размера маржи платежеспособности (в тысячах тенге) (графа 3 х графа 4) |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Договоры исламского перестрахования, заключенные с исламскими перестраховщиками-нерезидентами Республики Казахстан, за исключением исламских перестраховщиков стран-участниц Договора о Евразийском экономическом союзе, ратифицированного Законом Республики Казахстан от 14 октября 2014 года "О ратификации Договора о Евразийском экономическом союзе" (далее - Договор о ЕАЭС) | | | | |
| Группа 1 | "АА-" или выше |  | 0% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 2 | с "А+" по "А-" |  | 0% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 3 | с "ВВВ+" по "ВВВ-" |  | 0,2% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 4 | с "ВВ+" по "ВВ-" |  | 0,75% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 5 | с "В+" по "В-" |  | 3,8% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 6 | ниже "В-" или отсутствует |  | 22% |  |
| Договоры исламского перестрахования, заключенные с исламскими перестраховщиками-резидентами Республики Казахстан | | | | |
| Группа 7 | не ниже "В" или "kzBB" |  | 0% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 8 | "В-", "kzBB-", "kzB+" |  | 0,2% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 9 | > 1,75 |  | 0,05% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 10 | > 1,5 |  | 0,1% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 11 | > 1,25 |  | 0,2% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 12 | > 1,1 |  | 0,5% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 13 | >= 1,0 |  | 3,8% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 14 | < 1,0 |  | 5% |  |
| Договоры исламского перестрахования, заключенные с исламскими перестраховщиками-стран-участниц Договора о ЕАЭС | | | | |
| Группа 15 | с "ВВВ+" по "ВВВ-" |  | 0% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 16 | с "ВВ+" по "ВВ-" |  | 0,2% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 17 | с "В+" по "В-" |  | 0,5% |  |
|  |  |  |  |  |
| Группа 18 | ниже "В-" или отсутствует |  | 22% |  |
|  |  |  |  |  |
| Итого: |  |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 12 к Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения |
|  | Приложение 4 к Нормативным значениям и методикам расчетов пруденциальных нормативов исламской страховой (перестраховочной) организации и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов |

**Таблица активов исламской страховой (перестраховочной) организации с учетом их классификации по качеству и ликвидности**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| № | Наименование показателя | Учитываемый объем |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Деньги – всего, в том числе: |  |
| 1.1 | деньги в кассе в сумме, не превышающей 1 (один) процент от суммы активов исламской страховой (перестраховочной) организации за минусом активов исламского перестрахования | 100% |
| 1.2 | деньги в пути, в банках второго уровня Республики Казахстан | 100% |
| 1.3 | деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанных в строках 2.1 и 2.2 настоящего приложения | 100% |
| 1.4 | деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанных в строке 2.3 настоящего приложения | 90% |
| 1.5 | деньги исламской страховой (перестраховочной) организации на счетах у организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, находящиеся в банках второго уровня Республики Казахстан, и в центральном депозитарии | 100% |
| 1.6 | деньги исламской страховой (перестраховочной) организации на счетах у организации, осуществляющей деятельность по управлению инвестиционным портфелем, находящиеся в банках второго уровня Республики Казахстан | 100% |
| 2 | Вклады – всего, в том числе: |  |
| 2.1 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан при условии, что данные банки являются эмитентами, акции которых включены в категорию "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи или находятся в представительском списке индекса фондовой биржи | 100% |
| 2.2 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, соответствующих одному из следующих требований:  имеют долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "B" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB+" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств;  являются дочерними банками-резидентами Республики Казахстан, родительские банки-нерезиденты Республики Казахстан которых имеют долгосрочный кредитный рейтинг в иностранной валюте не ниже "А-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 2.3 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный кредитный рейтинг "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку от "kzBB" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 2.4 | вклады в международных финансовых организациях, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, вклады в Евразийском Банке Развития в национальной валюте Республики Казахстан | 100% |
| 2.5 | вклады в банках-нерезидентах, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3 | Долговые ценные бумаги – всего, в том числе: |  |
| 3.1 | государственные ценные бумаги Республики Казахстан, включая эмитированные в соответствии с законодательством других государств, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан | 100% |
| 3.2 | долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан, включенные в официальный список фондовой биржи, осуществляющей деятельность на территории Республики Казахстан | 100% |
| 3.3 | долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, осуществляющим выкуп ипотечных займов физических лиц, не связанных с предпринимательской деятельностью, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан | 100% |
| 3.4 | долговые ценные бумаги, выпущенные акционерными обществами "Банк Развития Казахстана", "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", "Фонд проблемных кредитов" в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств | 100% |
| 3.5 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, номинированные в иностранной валюте и допущенные к публичным торгам на фондовой бирже, функционирующей на территории Международного финансового центра "Астана" | 90% |
| 3.6 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Альтернативная" официального списка фондовой биржи | 60% |
| 3.7 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтингов оценку не ниже "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг не ниже "kzA-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3.8 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzBBB+" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 85% |
| 3.9 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими международную рейтинг не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, а также долговые исламские ценные бумаги, выпущенные Евразийским Банком Развития и номинированные в национальной валюте Республики Казахстан | 100% |
| 3.10 | долговые исламские ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3.11 | долговые исламские ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 3.12 | долговые исламские ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 80% |
| 3.13 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3.14 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного их других рейтинговых агентств | 85% |
| 3.15 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного их других рейтинговых агентств | 70% |
| 4 | Акции и депозитарные расписки – всего, в том числе: |  |
| 4.1 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, входящих в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 100% |
| 4.2 | акции юридических лиц, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям категории "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции | 100% |
| 4.3 | акции юридических лиц – резидентов Республики Казахстан, включенные в категорию "стандарт" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или акции юридических лиц – резидентов Республики Казахстан, номинированные в иностранной валюте, допущенные к публичным торгам на фондовой бирже, функционирующей на территории Международного финансового центра "Астана", и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции | 80% |
| 4.4 | акции юридических лиц Республики Казахстан, включенные в сектор "акции" площадки "Альтернативная" официального списка фондовой биржи, и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции | 60% |
| 4.5 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 100% |
| 4.6 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 80% |
| 4.7 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 60% |
| 4.8 | акции акционерного общества "Фонд гарантирования страховых выплат" | 100% |
| 5 | Иные ценные бумаги – всего, в том числе: |  |
| 5.1 | ценные бумаги инвестиционных фондов, включенные в официальный список фондовой биржи | 70% |
| 5.2 | паи Exchange Traded Funds (ETF), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам | 90% |
| 5.3 | паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN), имеющие рейтинговую оценку не ниже "3 звезды" рейтингового агентства Morningstar | 80% |
| 5.4 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг не ниже "kzAAA" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 5.5 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие рейтингов оценку от "BB+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzAA+" до "kzA-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 5.6 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzBBB+" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 80% |
| 5.7 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, родительские организации которых имеют рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 6 | Иные активы – всего, в том числе: |  |
| 6.1 | аффинированные драгоценные металлы и металлические депозиты | 100% |
| 6.2 | основные средства в виде недвижимого имущества в сумме, не превышающей 5 (пяти) процентов от суммы высоколиквидных активов исламской страховой (перестраховочной) организации | 100% |
| 6.3 | программное обеспечение, приобретенное для целей основной деятельности исламской страховой (перестраховочной) организации (в размере себестоимости с учетом накопленной амортизации и не превышающем 10 (десяти) процентов от суммы высоколиквидных активов исламской страховой (перестраховочной) организации) | 100% |
| 6.4 | суммы к получению от исламских перестраховщиков, страховые премии к получению от страхователей (перестрахователей) и посредников в сумме, не превышающей 10 (десяти) процентов от суммы высоколиквидных активов исламской страховой (перестраховочной) организации | 100% |
| 6.5 | требования к эмитентам ценных бумаг по выплате номинальной стоимости ценных бумаг, возникшие в связи с истечением срока их обращения, предусмотренного проспектом выпуска ценных бумаг (не просроченные по условиям проспекта выпуска ценных бумаг) | 100% |

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 13 к Перечню нормативных правовых актов Республики Казахстан по вопросам пруденциального регулирования, в которые вносятся изменения и дополнения |
|  | Приложение 5 к Нормативным значениям и методикам расчетов пруденциальных нормативов исламской страховой (перестраховочной) организации и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов |

**Таблица высоколиквидных активов исламской страховой (перестраховочной) организации**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| № | Наименование показателя | Учитываемый объем |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Деньги – всего, в том числе: |  |
| 1.1 | деньги в кассе в сумме, не превышавшей 1 (один) процент от суммы активов исламской страховой (перестраховочной) организации за минусом активов исламского перестрахования | 100% |
| 1.2 | деньги исламской страховой (перестраховочной) организации на счетах у организации, осуществляющей брокерскую и (или) дилерскую деятельность на рынке ценных бумаг, находящиеся в банках второго уровня Республики Казахстан и в центральном депозитарии | 100% |
| 1.3 | деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанных в строках 2.1 и 2.2 настоящего приложения | 100% |
| 1.4 | деньги на текущих счетах в банках второго уровня Республики Казахстан, указанных в строке 2.3 настоящего приложения | 90% |
| 1.5 | деньги исламской страховой (перестраховочной) организации на счетах у организации, осуществляющей деятельность по управлению инвестиционным портфелем, находящиеся в банках второго уровня Республики Казахстан | 100% |
| 2 | Вклады – всего, в том числе: |  |
| 2.1 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан при условии, что данные банки являются эмитентами, акции которых включены в категорию "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи или находятся в представительском списке индекса фондовой биржи | 100% |
| 2.2 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, соответствующих одному из следующих требований:  имеют долгосрочный кредитный рейтинг не ниже "B" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже "kzBB+" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств;  являются дочерними банками-резидентами Республики Казахстан, родительские банки-нерезиденты Республики Казахстан которых имеют долгосрочный кредитный рейтинг в иностранной валюте не ниже "А-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 2.3 | вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих долгосрочный кредитный рейтинг "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку от "kzBB" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 2.4 | вклады в международных финансовых организациях, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, вклады в Евразийском Банке Развития в национальной валюте Республики Казахстан | 100% |
| 2.5 | вклады в банках-нерезидентах, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3 | Долговые ценные бумаги – всего, в том числе: |  |
| 3.1 | государственные ценные бумаги Республики Казахстан, включая эмитированные в соответствии с законодательством других государств, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан | 100% |
| 3.2 | долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан, включенные в официальный список фондовой биржи, осуществляющей деятельность на территории Республики Казахстан | 100% |
| 3.3 | долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, осуществляющим выкуп ипотечных займов физических лиц, не связанных с предпринимательской деятельностью, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан | 100% |
| 3.4 | долговые ценные бумаги, выпущенные акционерными обществами "Банк Развития Казахстана", "Фонд национального благосостояния "Самрук-Казына", "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", "Фонд проблемных кредитов" в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств | 100% |
| 3.5 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или негосударственные долговые ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, номинированные в иностранной валюте и допущенные к публичным торгам на фондовой бирже, функционирующей на территории Международного финансового центра "Астана" | 90% |
| 3.6 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Альтернативная" официального списка фондовой биржи | 60% |
| 3.7 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzAA+" до "kzA-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3.8 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги юридических лиц Республики Казахстан, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzBBB+" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 85% |
| 3.9 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими международную рейтинг не ниже "АА-" агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, а также долговые исламские ценные бумаги, выпущенные Евразийским Банком Развития и номинированные в национальной валюте Республики Казахстан | 100% |
| 3.10 | долговые исламские ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3.11 | долговые исламские ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 3.12 | долговые исламские ценные бумаги иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 80% |
| 3.13 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 3.14 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного их других рейтинговых агентств | 85% |
| 3.15 | негосударственные долговые исламские ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг одного их других рейтинговых агентств | 70% |
| 4 | Акции и депозитарные расписки – всего, в том числе: |  |
| 4.1 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, входящих в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 100% |
| 4.2 | акции юридических лиц, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям категории "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции | 100% |
| 4.3 | акции юридических лиц – резидентов Республики Казахстан, включенные в категорию "стандарт" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи, или акции юридических лиц – резидентов Республики Казахстан, номинированные в иностранной валюте, допущенные к публичным торгам на фондовой бирже, функционирующей на территории Международного финансового центра "Астана", и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции | 80% |
| 4.4 | акции юридических лиц Республики Казахстан, включенные в сектор "акции" площадки "Альтернативная" официального списка фондовой биржи, и депозитарные расписки, базовым активов которых являются данные акции | 60% |
| 4.5 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 100% |
| 4.6 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку от "ВВ+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 80% |
| 4.7 | акции юридических лиц Республики Казахстан и иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции | 60% |
| 5 | Иные ценные бумаги – всего, в том числе: |  |
| 5.1 | ценные бумаги инвестиционных фондов, включенные в официальный список фондовой биржи | 70% |
| 5.2 | паи Exchange Traded Funds (ETF), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам | 90% |
| 5.3 | паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN), имеющие рейтинговую оценку не ниже "3 звезды" рейтингового агентства Morningstar | 80% |
| 5.4 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг не ниже "kzAAA" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 100% |
| 5.5 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "BB+" до "ВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzAA+" до "kzA-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 5.6 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющие (эмитент которых имеет) рейтинговую оценку от "В+" до "В-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинг от "kzBBB+" до "kzBB-" по национальной шкале Standard & Poor's, или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств | 80% |
| 5.7 | инструменты исламского финансирования юридических лиц Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, родительские организации которых имеют рейтинговую оценку не ниже "ВВВ-" по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 90% |
| 6 | Иные активы – всего, в том числе: |  |
| 6.1 | аффинированные драгоценные металлы и металлические депозиты | 100% |
| 6.2 | требования к эмитентам ценных бумаг по выплате номинальной стоимости ценных бумаг, возникшие в связи с истечением срока их обращения, предусмотренного проспектом выпуска ценных бумаг (не просроченные по условиям проспекта выпуска ценных бумаг) | 100% |

© 2012. РГП на ПХВ «Институт законодательства и правовой информации Республики Казахстан» Министерства юстиции Республики Казахстан