

**Об утверждении перечня, форм, сроков и Правил представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан)**

Постановление Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23. Зарегистрировано в Министерстве юстиции Республики Казахстан 11 марта 2021 года № 22321.

      Сноска. Заголовок - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      В соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике" Правление Национального Банка Республики Казахстан **ПОСТАНОВЛЯЕТ**:

      Сноска. Преамбула - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      1. Утвердить:

      1) перечень отчетности о выполнении пруденциальных нормативов филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) согласно приложению 1 к настоящему постановлению;

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

      16) форму отчета филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска, согласно приложению 16 к настоящему постановлению;

      17) форму отчета филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска, согласно приложению 17 к настоящему постановлению;

      18) форму отчета о расшифровке коэффициента покрытия ликвидности согласно приложению 18 к настоящему постановлению;

      19) форму отчета о расшифровке коэффициента нетто стабильного фондирования согласно приложению 19 к настоящему постановлению;

      20) Правила представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) согласно приложению 20 к настоящему постановлению.

      2. Филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан и филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан представляют в Национальный Банк Республики Казахстан в электронном формате:

      1) еженедельно – отчетность, предусмотренную подпунктом 13) пункта 1 настоящего постановления, в срок не позднее пятого рабочего дня, следующего за отчетной неделей.

      При истечении календарного месяца в отчетную неделю отчетность, предусмотренная подпунктом 13) пункта 1 настоящего постановления, представляется не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за истекшим календарным месяцем, раздельно за календарные дни отчетной недели, относящиеся к истекшему календарному месяцу, и за календарные дни отчетной недели, относящиеся к текущему календарному месяцу;

      2) ежемесячно – отчетность, предусмотренную подпунктами 2), 3), 4), 5), 6), 7), 8), 9), 10), 11), 12), 13), 14), 15), 16) и 17) пункта 1 настоящего постановления, в срок не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;

      3) ежемесячно – отчетность, предусмотренную подпунктами 18) и 19) пункта 1 настоящего постановления, в срок не позднее десятого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем.

      3. Департаменту статистики финансового рынка (Буранбаева А.М.) в установленном законодательством порядке обеспечить:

      1) совместно с Юридическим департаментом (Касенов А.С.) 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 4 настоящего постановления.

      4. Департаменту информации и коммуникаций – пресс-службе Национального Банка Республики Казахстан (Адамбаева А.Р.) обеспечить в течение десяти календарных дней после государственной регистрации настоящего постановления направление его копии на официальное опубликование в периодические печатные издания.

      5. Контроль за исполнением настоящего постановления возложить на заместителя Председателя Национального Банка Республики Казахстан Баймагамбетова А.М.

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

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

      СОГЛАСОВАНО

      Агентство Республики Казахстан

      по регулированию и развитию

      финансового рынка

      СОГЛАСОВАНО

      Бюро национальной статистики

      Агентства по стратегическому

      планированию и реформам

      Республики Казахстан

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 1 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Перечень отчетности о выполнении пруденциальных нормативов филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан**  
**(в том числе филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан)**

      Отчетность о выполнении пруденциальных нормативов филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) включает в себя:

      1) отчет о выполнении пруденциальных нормативов;

      2) отчет о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска;

      3) отчет о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска;

      4) отчет о расшифровке условных и возможных требований и обязательств по производным финансовым инструментам, взвешенным с учетом кредитного риска;

      5) отчет о расшифровке расчета специфического процентного риска (в разрезе валют);

      6) отчет о распределении открытых позиций по временным интервалам (в разрезе валют);

      7) отчет о расшифровке расчета общего процентного риска (в разрезе валют);

      8) отчет о расшифровке максимального размера риска на одного заемщика (в разрезе заемщиков);

      9) отчет о расшифровке коэффициента текущей ликвидности k4;

      10) отчет о расшифровке коэффициентов срочной ликвидности k4-1, k4-2, k4-3;

      11) отчет о расшифровке коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-4, k4-5, k4-6;

      12) отчет о валютных позициях по каждой иностранной валюте и валютной нетто-позиции за каждый рабочий день недели (месяца);

      13) отчет о расчете среднемесячной величины внутренних активов, внутренних и иных обязательств, коэффициента размещения части средств во внутренние активы;

      14) отчет о расшифровке коэффициента капитализации к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан;

      15) отчет филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска;

      16) отчет филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска;

      17) отчет о расшифровке коэффициента покрытия ликвидности;

      18) отчет о расшифровке коэффициента нетто стабильного фондирования.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 2 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет о выполнении пруденциальных нормативов**

      Сноска. Приложение 2 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_Prud\_norm

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица. Сведения о выполнении пруденциальных нормативов**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| № | Наименование | Сумма |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Минимальный размер активов, принимаемых в качестве резерва |  |
| 2 | Активы, принимаемые в качестве резерва как сумма: |  |
| 3 | Счета головного офиса |  |
| 4 | Результатов деятельности филиала банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) прошлых лет (чистые доходы) |  |
| 5 | Результатов деятельности филиала банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) текущего года (чистые доходы) |  |
| 6 | Резервов переоценки: |  |
| 7 | резервов переоценки основных средств и резервов переоценки стоимости ценных бумаг, учитываемых по справедливой стоимости через прочий совокупный доход |  |
| 8 | резервов переоценки стоимости займов, учитываемых по справедливой стоимости через прочий совокупный доход |  |
| 9 | Активы, принимаемые в качестве резерва за минусом: |  |
| 9.1 | нематериальных активов, включая гудвилл |  |
| 9.2 | результатов деятельности филиала банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) прошлых лет (чистые расходы) |  |
| 9.3 | результатов деятельности филиала банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) текущего года (чистые расходы) |  |
| 9.4 | отложенных налоговых активов (за исключением части отложенных налоговых активов, признанных в отношении вычитаемых временных разниц) |  |
| 9.5 | резервов по прочей переоценке |  |
| 9.6 | доходов или убытков от изменения справедливой стоимости финансового обязательства, в связи с изменением кредитного риска по такому обязательству |  |
| 9.7 | сумма превышения, подлежащая вычету из активов, принимаемых в качестве резерва, если инвестиции филиала банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) в финансовые инструменты финансовых организаций, в которых филиал банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиал исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) имеет менее 10 (десяти) процентов размещенных акций (долей участия в уставном капитале) в совокупности превышают 10 (десять) процентов от активов, принимаемых в качестве резерва филиала банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) после применения регуляторных корректировок, указанных в строках 9.1, 9.2, 9.3, 9.4, 9.5 и 9.6 настоящей таблицы |  |
| 9.8 | сумма превышения, подлежащая вычету из активов, принимаемых в качестве резерва, если инвестиции филиала банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) в простые акции финансовой организации, в которой филиал банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиал исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) имеет 10 (десять) и более процентов от размещенных акций (долей участия в уставном капитале)) в совокупности превышают 10 (десять) процентов от активов, принимаемых в качестве резерва после применения регуляторных корректировок, указанных в строках 9.1, 9.2, 9.3, 9.4, 9.5, 9.6 и 9.7 настоящей таблицы |  |
| 9.9 | сумма превышения, подлежащая вычету из активов, принимаемых в качестве резерва, если часть отложенных налоговых активов, признанных в отношении вычитаемых временных разниц, сниженная на пропорциональной основе на сумму отложенных налоговых обязательств (за исключением отложенных налоговых обязательств, признанных в отношении нематериальных активов, включая гудвилл) превышает 10 (десять) процентов от активов, принимаемых в качестве резерва после применения регуляторных корректировок, указанных в строках 9.1, 9.2, 9.3, 9.4, 9.5, 9.6 и 9.7 настоящей таблицы |  |
| 9.10 | сумма превышения, подлежащая вычету из активов, принимаемых в качестве резерва, если инвестиции филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан в простые акции финансовой организации, в которой филиал банка-нерезидента Республики Казахстан имеет 10 (десять) и более процентов от размещенных акций (долей участия в уставном капитале) и часть отложенных налоговых активов, признанных в отношении вычитаемых временных разниц, сниженная на пропорциональной основе на сумму отложенных налоговых обязательств (за исключением отложенных налоговых обязательств, признанных в отношении нематериальных активов, включая гудвилл) в совокупности превышают 17,65 (семнадцать целых шестьдесят пять сотых) процентов разницы активов, принимаемых в качестве резерва после применения регуляторных корректировок, указанных в строках 9.1, 9.2, 9.3, 9.4, 9.5 и 9.6 настоящей таблицы, и суммы, подлежащей вычету из активов, принимаемых в качестве резерва, указанных в строках 9.7, 9.8 и 9.9 настоящей таблицы, сниженная на суммы, подлежащие вычету из активов, принимаемых в качестве резерва, указанных в строках 9.7, 9.8, и 9.9 настоящей таблицы |  |
| 9.11 | инвестиции филиала банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) в бессрочные финансовые инструменты финансовых организаций, в которых филиал банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиал исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) имеет 10 (десять) и более процентов от выпущенных акций (долей участия в уставном капитале), подлежат вычету из активов, принимаемых в качестве резерва |  |
| 9.12 | инвестиции филиала банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) в субординированный долг финансовых организаций, в которых филиал банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиал исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) имеет 10 (десять) и более процентов от выпущенных акций (долей участия в уставном капитале) юридического лица, подлежащие вычету из активов, принимаемых в качестве резерва |  |
| 10 | Положительная разница в соответствии с параграфом 6 Методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), утвержденной постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 № 23, зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213 (далее - Методика), учитываемая при расчете регуляторного буфера |  |
| 11 | Коэффициент достаточности активов, принимаемых в качестве резерва (kl) |  |
| 12 | Результаты деятельности филиала банка-нерезидента, на который накладывается ограничение в части направления доходов банку-нерезиденту Республики Казахстан |  |
| 13 | Итого активы, взвешенные с учетом кредитного риска |  |
| 14 | Итого условные и возможные обязательства, взвешенные с учетом кредитного риска |  |
| 15 | Итого производные финансовые инструменты, взвешенные с учетом кредитного риска |  |
| 16 | Специфический процентный риск |  |
| 17 | Общий процентный риск |  |
| 18 | Итого рыночный риск, связанный с изменением ставки вознаграждения |  |
| 19 | Специфический риск |  |
| 20 | Общий риск |  |
| 21 | Итого рыночный риск, связанный с изменением рыночной стоимости акций и рыночной стоимости производных финансовых инструментов, базовым активом которых являются акции или индекс на акции |  |
| 22 | Итого рыночный риск, связанный с изменением обменного курса иностранных валют (рыночной стоимости драгоценных металлов) |  |
| 23 | Итого рыночный риск, связанный с изменением рыночной стоимости акций (включая исламские ценные бумаги, приобретенные с целью продажи) |  |
| 24 | Итого риск по товарно-материальным запасам, связанный с изменением рыночной стоимости |  |
| 25 | Сумма длинных и коротких позиций по финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением рыночной стоимости |  |
| 26 | Разница сумм длинных и коротких позиций по финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением рыночной стоимости |  |
| 27 | Сумма открытых валютных позиций |  |
| 28 | Активы и условные и возможные требования и обязательства, рассчитанные с учетом рыночного риска |  |
| 29 | Средняя величина годового валового дохода |  |
| 30 | Операционный риск |  |
| 31 | Совокупная задолженность одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, не связанных с филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан особыми отношениями, по любому виду обязательств перед филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан |  |
| 32 | Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика, не связанного с филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан особыми отношениями - (k3) |  |
| 33 | Совокупная задолженность одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, связанных с филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан особыми отношениями, по любому виду обязательств перед филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан |  |
| 34 | Коэффициент максимального размера риска на одного заемщика (группы заемщиков), связанного с филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан особыми отношениями - (k3.1) |  |
| 35 | Сумма рисков по всем заемщикам, связанным с филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан особыми отношениями |  |
| 36 | Коэффициент суммы рисков по заемщикам, связанным с филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан особыми отношениями (Ро) |  |
| 37 | Максимальная сумма бланкового займа, необеспеченных условных обязательств перед заемщиком либо за заемщика в пользу третьих лиц, по которым у филиала банка-нерезидента Республики Казахстан могут возникнуть требования к заемщику в течение текущего и двух последующих месяцев, по обязательствам соответствующих заемщиков, а также обязательств нерезидентов Республики Казахстан, зарегистрированных или являющихся гражданами офшорных зон, за исключением требований к резидентам Республики Казахстан с рейтингом агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтингом аналогичного уровня агентств Фитч (Fitch) или Мудис Инвесторс Сервис (Moody‘s Investors Service) (далее - другие рейтинговые агентства) не более чем на один пункт ниже суверенного рейтинга Республики Казахстан и нерезидентов Республики Казахстан, имеющих рейтинг не ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, за исключением нерезидентов с рейтингом не ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, в отношении одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков |  |
| 38 | Коэффициент максимального размера бланкового кредита (Бк) |  |
| 39 | Совокупная сумма рисков филиала банка-нерезидента Республики Казахстан на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10 (десять) процентов от активов, принимаемых в качестве резерва филиала банка-нерезидента Республики Казахстан |  |
| 40 | Коэффициент совокупной суммы рисков на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10 (десять) процентов-от активов, принимаемых в качестве резерва (Рк) |  |
| 41 | Совокупная сумма секьюритизированных кредитов, переданных специальной финансовой компании акционерного общества "Фонд стрессовых активов" |  |
| 42 | Коэффициент совокупной суммы секьюритизированных кредитов, переданных специальной финансовой компании акционерного общества "Фонд стрессовых активов" |  |
| 43 | Сумма риска филиала банка-нерезидента Республики Казахстан по обязательствам акционерного общества "Банк Развития Казахстана" |  |
| 44 | Коэффициент размера риска по обязательствам акционерного общества "Банк Развития Казахстана" (Рбрк) |  |
| 45 | Высоколиквидные активы |  |
| 46 | Обязательства до востребования |  |
| 47 | Коэффициент текущей ликвидности (k4) |  |
| 48 | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до семи календарных дней включительно |  |
| 49 | Коэффициент ликвидности (k4-1) |  |
| 50 | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно, включая высоколиквидные активы |  |
| 51 | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно |  |
| 52 | Коэффициент ликвидности (k4-2) |  |
| 53 | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, включая высоколиквидные активы |  |
| 54 | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно |  |
| 55 | Коэффициент ликвидности (k4-3) |  |
| 56 | Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-4: |  |
| 56.1 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте "Евро" (с указанием суммы (коэффициента) по данной группе валют в совокупности) |  |
| 56.2 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  |
| 56.3 | (указывается вид валют) |  |
| 56.4 | (указывается вид валют) |  |
| 57 | Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-4 |  |
| 57.1 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте "Евро" (с указанием суммы (коэффициента) по данной группе валют в совокупности) |  |
| 57.2 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  |
| 57.3 | (указывается вид валют) |  |
| 57.4 | (указывается вид валют) |  |
| 58 | Коэффициент срочной валютной ликвидности (k4-4): |  |
| 58.1 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте "Евро" (с указанием суммы (коэффициента) по данной группе валют в совокупности) |  |
| 58.2 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  |
| 58.3 | (указывается вид валют) |  |
| 58.4 | (указывается вид валют) |  |
| 59 | Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-5: |  |
| 59.1 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте "Евро" (с указанием суммы (коэффициента) по данной группе валют в совокупности) |  |
| 59.2 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  |
| 59.3 | (указывается вид валют) |  |
| 59.4 | (указывается вид валют) |  |
| 60 | Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-5, умноженные на коэффициент конверсии равный 90 (девяноста) процентам: |  |
| 60.1 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте "Евро" (с указанием суммы (коэффициента) по данной группе валют в совокупности) |  |
| 60.2 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  |
| 60.3 | (указывается вид валют) |  |
| 60.4 | (указывается вид валют) |  |
| 61 | Коэффициент срочной валютной ликвидности (k4-5): |  |
| 61.1 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте "Евро" (с указанием суммы (коэффициента) по данной группе валют в совокупности) |  |
| 61.2 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки: |  |
| 61.3 | (указывается вид валют) |  |
| 61.4 | (указывается вид валют) |  |
| 62 | Активы для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-6: |  |
| 62.1 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте "Евро" (с указанием суммы (коэффициента) по данной группе валют в совокупности) |  |
| 62.2 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  |
| 62.3 | (указывается вид валют) |  |
| 62.4 | (указывается вид валют) |  |
| 63 | Обязательства для расчета коэффициента срочной валютной ликвидности k4-6, умноженные на коэффициент конверсии равный 80 (восьмидесяти) процентам: |  |
| 63.1 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте "Евро" (с указанием суммы (коэффициента) по данной группе валют в совокупности) |  |
| 63.2 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  |
| 63.3 | (указывается вид валют) |  |
| 63.4 | (указывается вид валют) |  |
| 64 | Коэффициент срочной валютной ликвидности (k4-6): |  |
| 64.1 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте "Евро" (с указанием суммы (коэффициента) по данной группе валют в совокупности) |  |
| 64.2 | по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  |
| 64.3 | (указывается вид валют) |  |
| 64.4 | (указывается вид валют) |  |
| 65 | Наличие у филиала банка-нерезидента Республики Казахстан в течение отчетного периода просроченных обязательств перед кредиторами (да или нет) |  |
| 66 | Наличие у филиала банка нерезидента Республики Казахстан факта несвоевременного исполнения филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан плана мероприятий, одобренного уполномоченным органом (да или нет) |  |
| 67 | Краткосрочные обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан |  |
| 68 | Коэффициент максимального лимита краткосрочных обязательств перед нерезидентами Республики Казахстан (k7) |  |
| 69 | Активы, финансируемые за счет средств, привлеченных по договору об инвестиционном депозите |  |
| 70 | Коэффициент размещения части средств во внутренние активы |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета о выполнении пруденциальных нормативов |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о выполнении пруденциальных нормативов**  
**(индекс - 1-BVU\_Prud\_norm, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

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

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", частью четвертой пункта 6 статьи 42 и частью второй пункта 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) по состоянию на первое число каждого месяца.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213 (далее – Постановление № 23).

      6. Строка 1 заполняется в соответствии с главой 2 Методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), утвержденной Постановлением № 23 (далее – Методика).

      7. Строка 13 заполняется в соответствии с данными отчета о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска.

      8. Строка 14 заполняется в соответствии с данными отчета о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска.

      9. Строка 15 заполняется в соответствии с данными отчета о расшифровке условных и возможных требований и обязательств по производным финансовым инструментам, взвешенным с учетом кредитного риска.

      10. Строки 31, 32, 33, 34, 35, 36, 37, 38, 39, 40, 41, 42, 43 и 44 заполняются в соответствии с данными отчета о расшифровке максимального размера риска на одного заемщика (в разрезе заемщиков).

      11. Строки 45, 46 и 47 заполняются в соответствии с данными отчета о расшифровке коэффициента текущей ликвидности k4.

      12. Строки 48, 49, 50, 51, 52, 53, 54 и 55 заполняются в соответствии с данными отчета о расшифровке коэффициентов срочной ликвидности k4-1, k4-2, k4-3.

      13. Строки 56, 56.1, 56.2, 56.3, 56.4, 57, 57.1, 57.2, 57.3, 57.4, 58, 58.1, 58.2, 58.3, 58.4, 59, 59.1, 59.2, 59.3, 59.4, 60, 60.1, 60.2, 60.3, 60.4, 61, 61.1, 61.2, 61.3, 61.4, 62, 62.1, 62.2, 62.3, 62.4, 63, 63.1, 63.2, 63.3, 63.4, 64, 64.1, 64.2, 64.3 и 64.4 заполняются в соответствии с данными отчета о расшифровке коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-4, k4-5, k4-6.

      14. Строки 67 и 68 заполняются в соответствии с данными отчета о расшифровке коэффициента капитализации филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан.

      15. Строки 23, 24 и 69 заполняются только филиалами исламских банков-нерезидентов.

      16. Строка 70 заполняется в соответствии с данными отчета о расчете среднемесячной величины внутренних активов, внутренних и иных обязательств, коэффициента размещения части средств во внутренние активы.

      17. Коэффициенты указывается с тремя знаками после запятой.

      18. При отсутствии сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 3 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска**

      Сноска. Приложение 3 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 2-BVU\_RA

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица. Расшифровка активов, взвешенных с учетом кредитного риска**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование статей | Сумма | Степень риска в процентах | Сумма к расчету |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| I группа | | | | |
| 1 | Наличные тенге |  | 0 |  |
| 2 | Наличная иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня агентств Фитч (Fitch) или Мудис Инвесторс Сервис (Moody‘s Investors Service) (далее - другие рейтинговые агентства) |  | 0 |  |
| 3 | Аффинированные драгоценные металлы |  | 0 |  |
| 4 | Займы, предоставленные Правительству Республики Казахстан |  | 0 |  |
| 5 | Займы, предоставленные правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 0 |  |
| 6 | Займы, предоставленные Национальному Банку Республики Казахстан |  | 0 |  |
| 7 | Займы, предоставленные центральным банкам стран, с суверенным рейтингом не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 0 |  |
| 8 | Займы, предоставленные международным финансовым организациям, с долговым рейтингом не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 0 |  |
| 9 | Займы, предоставленные акционерному обществу "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" |  | 0 |  |
| 10 | Вклады в Национальном Банке Республики Казахстан и иные требования к Национальному Банку Республики Казахстан |  | 0 |  |
| 11 | Вклады в центральных банках стран, с суверенным рейтингом не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 0 |  |
| 12 | Вклады в международных финансовых организациях, с долговым рейтингом не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, вклады в Евразийском Банке Развития в национальной валюте Республики Казахстан |  | 0 |  |
| 13 | Дебиторская задолженность Правительства Республики Казахстан |  | 0 |  |
| 14 | Дебиторская задолженность местных исполнительных органов Республики Казахстан по налогам и другим обязательным платежам в бюджет |  | 0 |  |
| 15 | Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Правительством Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан |  | 0 |  |
| 16 | Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные местными исполнительными органами городов Астана и Алматы |  | 0 |  |
| 17 | Ценные бумаги, выпущенные Банком Развития Казахстана в соответствии с законодательством Республики Казахстан о рынке ценных бумаг, акционерными обществами "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", "Фонд проблемных кредитов", а также ценные бумаги, выпущенные Евразийским Банком Развития и номинированные в национальной валюте Республики Казахстан |  | 0 |  |
| 18 | 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 |  | 0 |  |
| 19 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 0 |  |
| 20 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 0 |  |
| 21 | Требования по открытым корреспондентским счетам к банкам, имеющим долгосрочный рейтинг не ниже "ВВВ" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 0 |  |
| 22 | Начисленное вознаграждение по активам, включенным в I группу риска |  | 0 |  |
| II группа | | | | |
| 23 | Наличная иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 20 |  |
| 24 | Займы, предоставленные правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 25 | Займы, предоставленные центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 26 | Займы, предоставленные международным финансовым организациям, имеющим долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 27 | Займы, предоставленные местным исполнительным органам Республики Казахстан |  | 20 |  |
| 28 | Займы, предоставленные местным органам власти стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 29 | Займы, предоставленные организациям, имеющим долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 30 | Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 31 | Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 32 | Вклады в организациях, имеющих долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 33 | Дебиторская задолженность местных исполнительных органов Республики Казахстан, за исключением дебиторской задолженности, отнесенной к І группе риска |  | 20 |  |
| 34 | Дебиторская задолженность организаций, имеющих долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 35 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 36 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 37 | Государственные ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан, за исключением государственных ценных бумаг, выпущенных местными исполнительными органами городов Астана и Алматы |  | 20 |  |
| 38 | Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, суверенный рейтинг которых не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 39 | Ценные бумаги, выпущенные организациями, имеющими долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 40 | Позиции секьюритизации, отражаемые филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан в отчете об активах и обязательствах и имеющие кредитный рейтинг от "ААА" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzAAA" до "kzAA-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |
| 41 | Начисленное вознаграждение по активам, включенным во II группу риска |  | 20 |  |
| III группа | | | | |
| 42 | Неаффинированные драгоценные металлы |  | 50 |  |
| 43 | Займы, предоставленные правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 44 | Займы, предоставленные центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 45 | Займы, предоставленные международным финансовым организациям, имеющим долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 46 | Займы, предоставленные местным органам власти стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 47 | Займы, предоставленные организациям, имеющим долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 48 | Займы, предоставленные физическим лицам в целях строительства жилища либо его покупки и (или) ремонта (далее - ипотечные жилищные займы), соответствующие следующему условию: отношение суммы предоставленного ипотечного жилищного займа к стоимости залога не превышает 50 (пятидесяти) процентов включительно от стоимости залога |  | 35 |  |
| 49 | Ипотечные жилищные займы, а также вознаграждения по ним, соответствующие условиям для выкупа, установленным юридическим лицом, осуществляющим выкуп ипотечных займов физических лиц, не связанных с предпринимательской деятельностью, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан |  | 35 |  |
| 50 | Требования по ипотечным жилищным займам, переуступленным юридическому лицу, осуществляющему выкуп ипотечных займов физических лиц, не связанных с предпринимательской деятельностью, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан |  | 35 |  |
| 51 | Ипотечные жилищные займы, соответствующие условию: отношение суммы предоставленного ипотечного жилищного займа к стоимости залога находится в пределах от 51 (пятидесяти одного) процента до 85 (восьмидесяти пяти) процентов включительно от стоимости залога |  | 50 |  |
| 52 | Прочие ипотечные жилищные займы |  | 100 |  |
| 53 | Займы с просроченной задолженностью по основному долгу и (или) начисленному вознаграждению свыше 90 (девяноста) календарных дней, предоставленные резидентам Республики Казахстан (за исключением ипотечных жилищных займов, а также беззалоговых потребительских займов, выданных физическим лицам) по которым сформировано менее 35 (тридцати пяти) процентов провизий (резервов) согласно международным стандартам финансовой отчетности от непогашенной части займов |  | 100 |  |
| 54 | Займы с просроченной задолженностью по основному долгу и (или) начисленному вознаграждению свыше 90 (девяноста) календарных дней, предоставленные резидентам Республики Казахстан (за исключением ипотечных жилищных займов, а также беззалоговых потребительских займов, выданных физическим лицам), по которым сформировано более 35 (тридцати пяти) процентов и менее 50 (пятидесяти) процентов провизий (резервов) согласно международным стандартам финансовой отчетности от непогашенной части займов |  | 75 |  |
| 55 | Займы с просроченной задолженностью по основному долгу и (или) начисленному вознаграждению свыше 90 (девяноста) календарных дней, предоставленные резидентам Республики Казахстан (за исключением ипотечных жилищных займов, а также беззалоговых потребительских займов, выданных физическим лицам), по которым сформировано более 50 (пятидесяти) процентов провизий (резервов) согласно международным стандартам финансовой отчетности от непогашенной части займов |  | 50 |  |
| 56 | Займы, предоставленные субъектам, отнесенным к малому или среднему предпринимательству, согласно статье 24 Предпринимательского кодекса Республики Казахстан, соответствующие следующим критериям:  1) сумма займа не превышает 0,02 (ноль целых две сотых) процента от активов, принимаемых в качестве резерва;  2) валюта займа - тенге |  | 75 |  |
| 57 | Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 58 | Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 59 | Вклады в организациях, имеющих долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 60 | Дебиторская задолженность организаций, имеющих долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 61 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 62 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 63 | Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 64 | Ценные бумаги, выпущенные организациями, имеющими долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 65 | Позиции секьюритизации отражаемые филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан в отчете об активах и обязательствах и имеющие кредитный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzA+" до "kzA-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s), или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 66 | Требования по открытым корреспондентским счетам к банкам-резидентам Республики Казахстан, имеющим долговой рейтинг от "ВВВ-" до "ВВ-" (включительно) агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или банку-нерезиденту, имеющему долговой рейтинг от "ВВВ-" до "ВВ+" (включительно) агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s), или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |
| 67 | Требования к акционерному обществу "Казахстанская фондовая биржа" |  | 50 |  |
| 68 | Начисленное вознаграждение по активам, включенным в III группу риска (за исключением начисленных вознаграждений по активам, указанных в строках 49 и 50 настоящей таблицы) |  | 50 |  |
| IV группа | | | | |
| 69 | Займы, предоставленные правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |
| 70 | Займы, предоставленные центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |
| 71 | Займы, предоставленные международным финансовым организациям, имеющим долговой рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и международным финансовым организациям, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |
| 72 | Займы, предоставленные местным органам власти стран, имеющих долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |
| 73 | Займы, предоставленные организациям-резидентам, имеющим долговой рейтинг ниже "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациям-резидентам, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки, и организациям-нерезидентам, имеющим долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s), или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 74 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 1 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), утвержденной постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213 (далее - Методика):  1) размер задолженности заемщика не превышает 120 месячных расчетных показателей (далее - МРП);  2) размер переплаты в процентном годовом выражении находится в пределах от 0 (нуля) до 30 (тридцати) процентов. |  | 100 |  |
| 75 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 2 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, не имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика не превышает 120 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении находится в пределах от 0 (нуля) до 30 (тридцати) процентов. |  | 100 |  |
| 76 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 1 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 120 МРП до 200 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении находится в пределах от 0 (нуля) до 30 (тридцати) процентов. |  | 110 |  |
| 77 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 1 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика не превышает 120 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении превышает 30 (тридцать) процентов. |  | 110 |  |
| 78 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 2 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, не имеющего официальное подтверждение приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 120 МРП до 200 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении находится в пределах от 0 (нуля) до 30 (тридцати) процентов. |  | 110 |  |
| 79 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 2 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, не имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика не превышает 120 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении превышает 30 (тридцать) процентов. |  | 110 |  |
| 80 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 1 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 200 МРП до 400 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении находится в пределах от 0 (нуля) до 30 (тридцати) процентов. |  | 120 |  |
| 81 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 1 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 120 МРП до 200 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении превышает 30 (тридцать) процентов. |  | 120 |  |
| 82 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 2 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, не имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 200 МРП до 400 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении находится в пределах от 0 (нуля) до 30 (тридцати) процентов. |  | 120 |  |
| 83 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 2 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, не имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 120 МРП до 200 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении превышает 30 (тридцать) процентов. |  | 120 |  |
| 84 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 1 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 400 МРП до 800 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении находится в пределах от 0 (нуля) до 30 (тридцати) процентов. |  | 130 |  |
| 85 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 1 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 200 МРП до 400 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении превышает 30 (тридцать) процентов. |  | 130 |  |
| 86 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 2 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, не имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 400 МРП до 800 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении находится в пределах от 0 (нуля) до 30 (тридцати) процентов. |  | 140 |  |
| 87 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 2 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, не имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 200 МРП до 400 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении превышает 30 (тридцать) процентов. |  | 130 |  |
| 88 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 1 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 800 МРП до 2000 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении находится в пределах от 0 (нуля) до 30 (тридцати) процентов. |  | 140 |  |
| 89 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 1 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 400 МРП до 800 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении превышает 30 (тридцать) процентов. |  | 140 |  |
| 90 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 2 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, не имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 800 МРП до 2000 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении находится в пределах от 0 (нуля) до 30 (тридцати) процентов. |  | 150 |  |
| 91 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 2 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, не имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 400 МРП до 800 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении превышает 30 (тридцать) процентов. |  | 150 |  |
| 92 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 1 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика превышает 2000 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении находится в пределах от 0 (нуля) до 30 (тридцати) процентов. |  | 150 |  |
| 93 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 1 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 800 МРП до 2000 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении превышает 30 (тридцать) процентов. |  | 150 |  |
| 94 | Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |
| 95 | Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и международных финансовых организациях, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |
| 96 | Вклады в организациях-резидентах, имеющих долговой рейтинг ниже "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациях-резидентах, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки, и организациях-нерезидентах, имеющих долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 97 | Дебиторская задолженность организаций-резидентов, имеющих долговой рейтинг ниже "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организаций-резидентов, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки, и организаций-нерезидентов, имеющих долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s), или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 98 | Дебиторская задолженность физических лиц |  | 100 |  |
| 99 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |
| 100 | Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |
| 101 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и международными финансовыми организациями, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |
| 102 | Ценные бумаги, выпущенные организациями-резидентами, имеющими долговой рейтинг ниже "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациями-резидентами, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки, и организациями-нерезидентами, имеющими долговой рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s), или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 103 | Позиции секьюритизации, отражаемые филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан в отчете об активах и обязательствах, и имеющие кредитный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку от "kzBBB+" до "kzBBB-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s), или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 104 | Ценные бумаги, выпущенные специальной финансовой компанией акционерного общества "Фонд стрессовых активов" |  | 100 |  |
| 105 | Требования по открытым корреспондентским счетам к банкам-резидентам Республики Казахстан, имеющим долговой рейтинг ниже "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или банку-нерезиденту, имеющему долговой рейтинг ниже "ВВ+" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s), или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 106 | Начисленное вознаграждение по активам, включенным в IV группу риска |  | 100 |  |
| 107 | Расчеты по платежам |  | 100 |  |
| 108 | Основные средства |  | 100 |  |
| 109 | Материальные запасы |  | 100 |  |
| 110 | Предоплата суммы вознаграждения и расходов |  | 100 |  |
| V группа | | | | |
| 111 | Инвестиции филиала банка-нерезидента Республики Казахстан в акции (доли участия в уставном капитале), бессрочные финансовые инструменты, субординированный долг юридических лиц, финансовая отчетность которых консолидируется при составлении финансовой отчетности филиала банка-нерезидента Республики Казахстан в соответствии с международными стандартами финансовой отчетности |  | 100 |  |
| 112 | Сумма всех инвестиций филиала банка-нерезидента Республики Казахстан, каждая из которых составляет менее 10 (десяти) процентов от выпущенных акций (долей участия в уставном капитале) юридического лица, финансовая отчетность которого не консолидируется при составлении финансовой отчетности филиала банка-нерезидента Республики Казахстан, не превышающая 10 (десяти) процентов активов, принимаемых в качестве резерва |  | 100 |  |
| 113 | Сумма инвестиций филиала банка-нерезидента Республики Казахстан в простые акции финансовой организации, в которой банк имеет 10 (десять) и более процентов от выпущенных акций (долей участия в уставном капитале), и часть отложенных налоговых активов, признанных в отношении вычитаемых временных разниц, в совокупности не превышающая 17,65 (семнадцать целых шестьдесят пять сотых) процентов разницы активов, принимаемых в качестве резерва филиала банка-нерезидента Республики Казахстан после применения регуляторных корректировок, указанных в пункте 4 Методики, и суммы, подлежащей вычету из активов, принимаемых в качестве резерва, указанной в абзацах втором, третьем и четвертом части первой пункта 5 Методики |  | 250 |  |
| 114 | Займы, предоставленные правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |
| 115 | Займы, предоставленные центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |
| 116 | Займы, предоставленные международным финансовым организациям, имеющим долговой рейтинг ниже "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |
| 117 | Займы, предоставленные местным органам власти стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |
| 118 | Займы, предоставленные организациям-нерезидентам, имеющим долговой рейтинг ниже "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациям-нерезидентам, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки |  | 150 |  |
| 119 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 2 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, не имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика превышает 2000 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении находится в пределах от 0 (нуля) до 30 (тридцати) процентов. |  | 250 |  |
| 120 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 2 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, не имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика находится в пределах от 800 МРП до 2000 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении превышает 30 (тридцать) процентов. |  | 200 |  |
| 121 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 1 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика превышает 2000 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении превышает 30 (тридцать) процентов. |  | 200 |  |
| 122 | Беззалоговые потребительские займы, выданные физическим лицам, соответствующие критериям, установленным в Таблице 2 "Значения коэффициентов взвешивания по степени кредитного риска вложений по беззалоговым потребительским займам при расчете коэффициента долговой нагрузки на основании дохода, не имеющего официальное подтверждение" приложения 3 к Методике:  1) размер задолженности заемщика превышает 2000 МРП;  2) размер переплаты в процентном годовом выражении превышает 30 (тридцать) процентов. |  | 300 |  |
| 123 | Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |
| 124 | Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг ниже "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |
| 125 | Вклады в организациях-нерезидентах, имеющих долговой рейтинг ниже "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациях-нерезидентах, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 150 |  |
| 126 | Вклады в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, зарегистрированных на территории иностранных государств, указанных в примечании |  | 150 |  |
| 127 | Дебиторская задолженность организаций-нерезидентов, имеющих долговой рейтинг ниже "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организаций-нерезидентов, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 150 |  |
| 128 | Дебиторская задолженность организаций-нерезидентов Республики Казахстан, зарегистрированных на территории иностранных государств, указанных в примечании |  | 150 |  |
| 129 | Ценные бумаги, выпущенные правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |
| 130 | Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, суверенный рейтинг которых ниже "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |
| 131 | Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг ниже "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |
| 132 | Ценные бумаги, выпущенные организациями-нерезидентами Республики Казахстан, имеющими долговой рейтинг ниже "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациями-нерезидентами, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки |  | 150 |  |
| 133 | Ценные бумаги, выпущенные организациями-нерезидентами Республики Казахстан, зарегистрированными на территории 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. |  | 150 |  |
| 134 | Позиции секьюритизации, отражаемые филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан в отчете об активах и обязательствах и имеющие кредитный рейтинг от "ВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" до "kzBB-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s), или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |
| 135 | Начисленное вознаграждение по активам, включенным в V группу риска |  | 150 |  |
| 136 | Итого рисковые активы: |  |  |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

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

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска**  
**(индекс - 2-BVU\_RA, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

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

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", частью четвертой пункта 6 статьи 42, частью второй пункта 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан по состоянию на первое число каждого месяца ежемесячно.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

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

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

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

      8. При отсутствии сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 4 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

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

      Сноска. Приложение 4 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 2-BVU\_ RUIVO

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица. Расшифровка условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование статей | Сумма | Коэффициент конверсии в процентах | Коэффициент кредитного риска в процентах | Сумма к расчету |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| I группа | | | | | |
| 1.1 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента Республики Казахстан (далее - филиал банка-нерезидента), обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", акционерного общества "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня агентств Фитч (Fitch) или Мудис Инвесторс Сервис (Moody‘s Investors Service) (далее - другие рейтинговые агентства);  деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала банка-нерезидента;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", акционерного общества "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard& Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 0 |  |
| 1.2 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала банка-нерезидента;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 20 |  |
| 1.3 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала банка-нерезидента;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 50 |  |
| 1.4 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала банка-нерезидента;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 100 |  |
| 1.5 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала банка-нерезидента;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 150 |  |
| 1.6 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, Акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", Акционерным обществом "Национальный управляющий холдинг "Байтерек" или ценных бумаг, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, предусмотренных пунктом 12 Методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских  банков-нерезидентов Республики Казахстан), утвержденной постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213 (далее - Методика), входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 0 |  |
| 1.7 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, Акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" или ценных бумаг, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, предусмотренных пунктом 12 Методики, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 20 |  |
| 1.8 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, Акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" или ценных бумаг, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, предусмотренных пунктом 12 Методики, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 50 |  |
| 1.9 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, Акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" или ценных бумаг, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг предусмотренных пунктом 12 Методики, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 100 |  |
| 1.10 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, Акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" или ценных бумаг, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, предусмотренных пунктом 12 Методики, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 150 |  |
| 1.11 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента: без финансовых обязательств банка, обязательства по которым обеспечены:  гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", акционерного общества "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", акционерного общества "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в 1 группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 0 |  |
| 1.12 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента:  без финансовых обязательств банка, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 20 |  |
| 1.13 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента:  без финансовых обязательств банка, обязательства по которым обеспечены:  гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 50 |  |
| 1.14 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента:  без финансовых обязательств банка, обязательства по которым обеспечены:  гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 100 |  |
| 1.15 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента:  без финансовых обязательств банка, обязательства по которым обеспечены:  гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 150 |  |
| 1.16 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию филиала банка-нерезидента, заключенные с лицами, входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 0 |  |
| 1.17 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию филиала банка-нерезидента, заключенные с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 20 |  |
| 1.18 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию филиала банка-нерезидента, заключенные с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 50 |  |
| 1.19 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию филиала банка-нерезидента, заключенные с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 100 |  |
| 1.20 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию филиала банка-нерезидента, заключенные с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 150 |  |
| 1.21 | Гарантии, принятые филиалом банка-нерезидента в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 0 |  |
| 1.22 | Гарантии, принятые филиалом банка-нерезидента в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 20 |  |
| 1.23 | Гарантии, принятые филиалом банка-нерезидента в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 50 |  |
| 1.24 | Гарантии, принятые филиалом банка-нерезидента в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 100 |  |
| 1.25 | Гарантии, принятые филиалом банка-нерезидента в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 150 |  |
| 1.26 | Инструменты ликвидности, предоставленные филиалом банка-нерезидента специальной финансовой компании |  | 0 | - |  |
| II группа | | | | |  |
| 2.1 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 0 |  |
| 2.2 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 20 |  |
| 2.3 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 50 |  |
| 2.4 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 100 |  |
| 2.5 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 150 |  |
| 2.6 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в лиц заемщиков, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 0 |  |
| 2.7 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 20 |  |
| 2.8 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 50 |  |
| 2.9 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 100 |  |
| 2.10 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 150 |  |
| 2.11 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 0 |  |
| 2.12 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента, обязательства, которые обеспечены: гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 20 |  |
| 2.13 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента, обязательства, которые обеспечены: гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 50 |  |
| 2.14 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 100 |  |
| 2.15 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента, обязательства, которые обеспечены: гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 150 |  |
| 2.16 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ААА" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzAAA" до "kzAA-" пo национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 20 |  |
| 2.17 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ААА" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzAAA" до "kzAA-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 50 |  |
| 2.18 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ААА" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzAAA" до "kzAA-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 100 |  |
| 2.19 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ААА" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzAAA" до "kzAA-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 150 |  |
| 2.20 | Инструменты ликвидности, предоставленные филиалом банка-нерезидента специальной финансовой компании с первоначальным сроком погашения до одного года включительно |  | 20 | - |  |
| III группа | | | | |  |
| 3.1 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 0 |  |
| 3.2 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 20 |  |
| 3.3 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 50 |  |
| 3.4 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 100 |  |
| 3.5 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 150 |  |
| 3.6 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 0 |  |
| 3.7 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 20 |  |
| 3.8 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 50 |  |
| 3.9 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 100 |  |
| 3.10 | Гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 150 |  |
| 3.11 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 0 |  |
| 3.12 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 20 |  |
| 3.13 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 50 |  |
| 3.14 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 100 |  |
| 3.15 | Аккредитивы филиала банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены; встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих долговой рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих долговой рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 150 |  |
| 3.16 | Возможные (условные) обязательства по обратному выкупу у акционерного общества "Казахстанская жилищная компания" прав требований по ипотечным жилищным займам |  | 50 | 100 |  |
| 3.17 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzA+" до "kzA-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 20 |  |
| 3.18 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzA+" до "kzA-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 50 |  |
| 3.19 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzA+" до "kzA-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 100 |  |
| 3.20 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "А+" до  "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzA+" до "kzA-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 150 |  |
| 3.21 | Инструменты ликвидности, предоставленные филиалом банка-нерезидента специальной финансовой компании с первоначальным сроком погашения свыше одного года |  | 50 | - |  |
| IV группа | | | | |  |
| 4.1 | Соглашение о продаже филиалу банка-нерезидента и с обязательством обратного выкупа филиалом банка-нерезидента финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 0 |  |
| 4.2 | Соглашение о продаже филиалу банка-нерезидента и с обязательством обратного выкупа филиалом банка-нерезидента финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 20 |  |
| 4.3 | Соглашение о продаже филиалу банка-нерезидента и с обязательством обратного выкупа филиалом банка-нерезидента финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 50 |  |
| 4.4 | Соглашение о продаже филиалу банка-нерезидента и с обязательством обратного выкупа филиалом банка-нерезидента финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 100 |  |
| 4.5 | Соглашение о продаже филиалу банка-нерезидента и с обязательством обратного выкупа филиалом банка-нерезидента финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 150 |  |
| 4.6 | Иные гарантии (поручительства) филиала банка-нерезидента, выданные в пользу лиц, входящих в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 0 |  |
| 4.7 | Иные гарантии (поручительства) филиала банка-нерезидента, выданные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 20 |  |
| 4.8 | Иные гарантии (поручительства) филиала банка-нерезидента, выданные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 50 |  |
| 4.9 | Иные гарантии (поручительства) филиала банка-нерезидента, выданные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 100 |  |
| 4.10 | Иные гарантии (поручительства) филиала банка-нерезидента, выданные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 150 |  |
| 4.11 | Иные аккредитивы филиала банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 0 |  |
| 4.12 | Иные аккредитивы филиала банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 20 |  |
| 4.13 | Иные аккредитивы филиала банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 50 |  |
| 4.14 | Иные аккредитивы филиала банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 100 |  |
| 4.15 | Иные аккредитивы филиала банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 150 |  |
| 4.16 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBBB+" до "kzBBB-" пo национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 20 |  |
| 4.17 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBBB+" до "kzBBB-" пo национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 50 |  |
| 4.18 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBBB+" до "kzBBB-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 100 |  |
| 4.19 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBBB+" до "kzBBB-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 150 |  |
| 4.20 | Иные условные (возможные) обязательства филиала банка-нерезидента, перед лицами, входящими в I группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 0 |  |
| 4.21 | Иные условные (возможные) обязательства филиала банка-нерезидента, перед лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 20 |  |
| 4.22 | Иные условные (возможные) обязательства филиала банка-нерезидента, перед лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 50 |  |
| 4.23 | Иные условные (возможные) обязательства филиала банка-нерезидента, перед лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 100 |  |
| 4.24 | Иные условные (возможные) обязательства филиала банка-нерезидента, перед лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 150 |  |
| 4.25 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" до "kzBB-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 350 | 20 |  |
| 4.26 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" до "kzBB-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 350 | 50 |  |
| 4.27 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" до "kzBB-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 350 | 100 |  |
| 4.28 | Позиции секьюритизации, удерживаемые филиалом банка-нерезидента на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от "ВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтинговую оценку от "kzBB+" до "kzBB-" по национальной шкале агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств, по отношению к лицам, входящим в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 350 | 150 |  |
| 5 | Итого условные обязательства, взвешенные по степени кредитного риска: |  | X | X |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска**  
**(индекс - 1-BVU\_ RUIVO, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

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

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан по состоянию на первое число каждого месяца.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. Форма заполняется в соответствии постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213.

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

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

      8. При отсутствии сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 5 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет о расшифровке условных и возможных требований и обязательств по производным финансовым инструментам, взвешенным с учетом кредитного риска**

      Сноска. Приложение 5 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_ RPFI

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан и филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица. Расшифровка условных и возможных требований и обязательств по производным финансовым инструментам, взвешенным с учетом кредитного риска**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| № | 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 | Сумма к расчету |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| 1 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 |  |  | 0 |  |
| 2 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 |  |  | 20 |  |
| 3 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 |  |  | 50 |  |
| 4 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 |  |  | 100 |  |
| 5 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 |  |  | 150 |  |
| 6 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0,5 |  |  | 0 |  |
| 7 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0,5 |  |  | 20 |  |
| 8 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0,5 |  |  | 50 |  |
| 9 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0,5 |  |  | 100 |  |
| 10 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0,5 |  |  | 150 |  |
| 11 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 1,5 |  |  | 0 |  |
| 12 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 1,5 |  |  | 20 |  |
| 13 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 1,5 |  |  | 50 |  |
| 14 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 1,5 |  |  | 100 |  |
| 15 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные со ставками вознаграждения, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 1,5 |  |  | 150 |  |
| 16 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 1 |  |  | 0 |  |
| 17 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 1 |  |  | 20 |  |
| 18 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 1 |  |  | 50 |  |
| 19 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 1 |  |  | 100 |  |
| 20 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 1 |  |  | 150 |  |
| 21 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в 1 группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 5 |  |  | 0 |  |
| 22 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 5 |  |  | 20 |  |
| 23 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 5 |  |  | 50 |  |
| 24 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 5 |  |  | 100 |  |
| 25 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 5 |  |  | 150 |  |
| 26 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7,5 |  |  | 0 |  |
| 27 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7,5 |  |  | 20 |  |
| 28 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7,5 |  |  | 50 |  |
| 29 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7,5 |  |  | 100 |  |
| 30 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с изменениями курсов валют и золота, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7,5 |  |  | 150 |  |
| 31 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7 |  |  | 0 |  |
| 32 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7 |  |  | 20 |  |
| 33 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7 |  |  | 50 |  |
| 34 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7 |  |  | 100 |  |
| 35 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7 |  |  | 150 |  |
| 36 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7 |  |  | 0 |  |
| 37 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7 |  |  | 20 |  |
| 38 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7 |  |  | 50 |  |
| 39 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7 |  |  | 100 |  |
| 40 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 7 |  |  | 150 |  |
| 41 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 8 |  |  | 0 |  |
| 42 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 8 |  |  | 20 |  |
| 43 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 8 |  |  | 50 |  |
| 44 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 8 |  |  | 100 |  |
| 45 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с драгоценными металлами, кроме золота, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 8 |  |  | 150 |  |
| 46 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 10 |  |  | 0 |  |
| 47 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 10 |  |  | 20 |  |
| 48 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 10 |  |  | 50 |  |
| 49 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в (V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 10 |  |  | 100 |  |
| 50 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения до одного года, совершенные с контрагентами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 10 |  |  | 150 |  |
| 51 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 12 |  |  | 0 |  |
| 52 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 12 |  |  | 20 |  |
| 53 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 12 |  |  | 50 |  |
| 54 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 12 |  |  | 100 |  |
| 55 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения от одного года до пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 12 |  |  | 150 |  |
| 56 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 15 |  |  | 0 |  |
| 57 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 15 |  |  | 20 |  |
| 58 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 15 |  |  | 50 |  |
| 59 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 15 |  |  | 100 |  |
| 60 | Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с другими ценностями, кроме драгоценных металлов, со сроком погашения более пяти лет, совершенные с контрагентами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 15 |  |  | 150 |  |
| Итого производные финансовые инструменты, взвешенные с учетом кредитного риска | |  | X |  |  | X |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета о расшифровке условных и возможных требований и обязательств по производным финансовым инструментам, взвешенным с учетом кредитного риска |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о расшифровке условных и возможных требований и обязательств по производным финансовым инструментам, взвешенным с учетом кредитного риска**  
**(индекс - 1-BVU\_ RPFI, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

      1. Настоящее пояснение определяет единые требования по заполнению формы административных данных "Отчет о расшифровке условных и возможных требований и обязательств по производным финансовым инструментам, взвешенным с учетом кредитного риска" (далее - Форма).

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) по состоянию на первое число каждого месяца.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. В графах 3 и 6 указываются номинальная и рыночная стоимость производных финансовых инструментов.

      6. В графе 5 указывается номинальная стоимость по производным финансовым инструментам, умноженная на значение коэффициента кредитного риска для производных финансовых инструментов.

      7. В графе 8 указывается сумма номинальной стоимости производных финансовых инструментов с учетом кредитного риска для производных финансовых инструментов и рыночной стоимости производных финансовых инструментов, умноженная на значение коэффициента кредитного риска для контрагента.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 6 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

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

      Сноска. Приложение 6 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_RSPR

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан и филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица. Расшифровка расчета специфичного процентного риска**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование | Сумма | Коэффициент специфичного риска в процентах | Сумма к расчету |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 | Сумма открытых позиций по однородным финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением ставки вознаграждения в виде государственных ценных бумаг Республики Казахстан, ценных бумаг, по которым имеется государственная гарантия Правительства Республики Казахстан, ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня агентств Фитч (Fitch) или Мудис Инвесторс Сервис (Moody‘s Investors Service) (далее - другие рейтинговые агентства) |  | 0 |  |
| 2 | Сумма открытых позиций по однородным финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением ставки вознаграждения со сроком погашения менее 6 месяцев в виде государственных ценных бумаг Республики Казахстан, выпущенных местными исполнительными органами Республики Казахстан, ценных бумаг, по которым имеется государственная гарантия Правительства Республики Казахстан, ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, ценных бумаг, выпущенных международными финансовыми организациями, ценных бумаг, включенных в официальный список организаторов торгов Республики Казахстан и организаторов торгов, признаваемых международными фондовыми биржами |  | 0,25 |  |
| 3 | Сумма открытых позиций по однородным финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением ставки вознаграждения со сроком погашения от 6 месяцев до 24 месяцев в виде государственных ценных бумаг Республики Казахстан, выпущенных местными исполнительными органами Республики Казахстан, ценных бумаг, по которым имеется государственная гарантия Правительства Республики Казахстан, ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, ценных бумаг, выпущенных международными финансовыми организациями, ценных бумаг, включенных в официальный список организаторов торгов Республики Казахстан и организаторов торгов, признаваемых международными фондовыми биржами |  | 1 |  |
| 4 | Сумма открытых позиций по однородным финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением ставки вознаграждения со сроком погашения более 24 месяцев в виде государственных ценных бумаг Республики Казахстан, выпущенных местными исполнительными органами Республики Казахстан, ценных бумаг, по которым имеется государственная гарантия Правительства Республики Казахстан, ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, ценных бумаг, выпущенных международными финансовыми организациями, ценных бумаг, включенных в официальный список организаторов торгов Республики Казахстан и организаторов торгов, признаваемых международными фондовыми биржами |  | 1,6 |  |
| 5 | Сумма открытых позиций по однородным финансовым инструментам с рыночным риском, связанным с изменением ставки |  | 8 |  |
| Итого специфический риск | | 0 | X | 0 |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета о расшифровке расчета специфичного процентного риска (в разрезе валют) |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о расшифровке расчета специфического процентного риска (в разрезе валют)**  
**(индекс - 1-BVU\_RSPR, периодичность – ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

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

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) по состоянию на первое число каждого месяца.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213 (далее – Постановление № 23).

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

      7. В графе 5 указывается сумма открытых позиций по однородным финансовым инструментам с учетом коэффициента специфического риска в процентах.

      8. В строках 2, 3 и 4 указывается организатор торгов, признаваемый международными фондовыми биржами, определенный в Списке организаторов торгов, признаваемых международными фондовыми биржами, согласно приложению 8 к Нормативным значениям и методикам расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов, размеру капитала банка, утвержденных 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 нормативных правовых актов Республики Казахстан под № 15886.

      9. При отсутствии сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 7 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет о распределении открытых позиций по временным интервалам (в разрезе валют)**

      Сноска. Приложение 7 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_ ROPVI

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан и филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица. Распределение открытых позиций по временным интервалам**  
**(в разрезе валют)**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Зоны | Временные интервалы | Открытые позиции | | Коэффициент взвешивания | Открытые взвешенные позиции | | Закрытые взвешенные позиции | Итоговые взвешенные открытые позиции | |
|  |  | длинная | короткая |  | длинная | короткая |  | длинная | короткая |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 |
| 1 | менее 1 месяца |  |  | 0,00 |  |  |  |  |  |
|  | 1-3 месяцев |  |  | 0,002 |  |  |  |  |  |
| 3-6 месяцев |  |  | 0,004 |  |  |  |  |  |
| 6-12 месяцев |  |  | 0,007 |  |  |  |  |  |
| Итог зоны 1 |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 2 | 1-2 года |  |  | 0,0125 |  |  |  |  |  |
|  | 2-3 года |  |  | 0,0175 |  |  |  |  |  |
| 3-4 года |  |  | 0,0225 |  |  |  |  |  |
| Итог зоны 2 |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 3 | 4-5 лет |  |  | 0,0275 |  |  |  |  |  |
|  | 5-7 лет |  |  | 0,0325 |  |  |  |  |  |
| 7-10 лет |  |  | 0,0375 |  |  |  |  |  |
| 10-15 лет |  |  | 0,045 |  |  |  |  |  |
| 15-20 лет |  |  | 0,0525 |  |  |  |  |  |
| более 20 лет |  |  | 0,06 |  |  |  |  |  |
| Итог зоны 3 |  |  |  |  |  |  |  |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета о распределении открытых позиций по временным интервалам (в разрезе валют) |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о распределении открытых позиций по временным интервалам (в разрезе валют)**  
**(индекс - 1-BVU\_ ROPVI, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

      1. Настоящее пояснение определяет единые требования по заполнению формы административных данных "Отчет о распределении открытых позиций по временным интервалам (в разрезе валют)" (далее - Форма).

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) по состоянию на первое число каждого месяца.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. В графах 3 и 4 указывается сумма открытых позиций.

      6. В графах 6 и 7 указывается сумма открытых взвешенных позиций с учетом коэффициента взвешивания.

      7. В графе 8 указывается сумма закрытых взвешенных позиций.

      8. В графах 9 и 10 указывается сумма итоговых открытых взвешенных позиций.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 8 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

      Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет о расшифровке расчета общего процентного риска (в разрезе валют)**

      Сноска. Приложение 8 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_ ROPR

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан и филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица. Расшифровка расчета общего процентного риска (в разрезе валют)**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| № | Наименование позиций | Сумма |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Расчет взвешенных позиций, компенсированных по зонам |  |
| 2 | Зона 1 |  |
| 3 | Итог по взвешенной закрытой позиции по временным интервалам |  |
| 4 | Взвешенная открытая позиция (длинная) |  |
| 5 | Взвешенная открытая позиция (короткая) |  |
| 6 | Взвешенная закрытая позиция по итоговым открытым позициям |  |
| 7 | Взвешенная открытая позиция |  |
| 8 | Зона 2 |  |
| 9 | Итог по взвешенной закрытой позиции по временным интервалам |  |
| 10 | Взвешенная открытая позиция (длинная) |  |
| 11 | Взвешенная открытая позиция (короткая) |  |
| 12 | Взвешенная закрытая позиция по итоговым открытым позициям |  |
| 13 | Взвешенная открытая позиция |  |
| 14 | Зона 3 |  |
| 15 | Итог по взвешенной закрытой позиции по временным интервалам |  |
| 16 | Взвешенная открытая позиция (длинная) |  |
| 17 | Взвешенная открытая позиция (короткая) |  |
| 18 | Взвешенная закрытая позиция по итоговым открытым позициям |  |
| 19 | Взвешенная открытая позиция |  |
| 20 | Закрытая позиция между зонами 1 и 2 |  |
| 21 | Остаточная открытая позиция по зоне 2 |  |
| 22 | Остаточная открытая позиция по зоне 1 |  |
| 23 | Закрытая позиция по зонам 2 и 3 |  |
| 24 | Остаточная открытая позиция по зоне 3 |  |
| 25 | Остаточная открытая позиция по зоне 2 |  |
| 26 | Закрытая позиция по зонам 1 и 3 |  |
| 27 | Остаточная открытая позиция по зоне 1 |  |
| 28 | Остаточная открытая позиция по зоне 3 |  |
| 29 | Оставшейся открытая взвешенная позиция |  |
| 30 | 10 процентов суммы взвешенных закрытых позиций по зонам |  |
| 31 | 40 процентов закрытой взвешенной позиции зоны 1 |  |
| 32 | 30 процентов закрытой взвешенной позиции зоны 2 |  |
| 33 | 30 процентов закрытой взвешенной позиции зоны 3 |  |
| 34 | 40 процентов закрытой взвешенной позиции между зонами 1 и 2 |  |
| 35 | 40 процентов закрытой взвешенной позиции между зонами 2 и 3 |  |
| 36 | 100 процентов закрытой взвешенной позиции между зонами 1 и 3 |  |
| 37 | 100 процентов оставшейся открытой взвешенной позиции |  |
| 38 | Итого общий процентный риск |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета о расшифровке расчета общего процентного риска (в разрезе валют) |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о расшифровке расчета общего процентного риска (в разрезе валют)**  
**(индекс - 1-BVU\_ ROPR, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

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

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) по состоянию на первое число каждого месяца.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. В графе 3 указываются суммы по взвешенным и остаточным открытым или закрытым и позициям по временным интервалам каждой из зон.

      6. В строке 38 указываются сведения по общему процентному риску.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 9 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

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

      Сноска. Приложение 9 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_ R\_MRZ\_R

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан и филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица 1. Отчет о расшифровке совокупной задолженности одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, не связанных с филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиалом исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) (далее - филиал банка-нерезидента) особыми отношениями по любому виду обязательств перед филиалом банка-нерезидента**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование заемщика | Индивидуальный идентификационный номер, бизнес-идентификационный номер, альтернативный идентификационный номер | Признак взаимосвязанности заемщиков | Сумма требований | | Обеспечение | | Размер риска, тысяч тенге |
| балансовый счет | тысяч тенге | вид обеспечения | тысяч тенге |  |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| 1 |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 2 |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | Итого | X | X | X | X | X | X |  |

**Таблица 2. Отчет о расшифровке совокупной задолженности одного заемщика или группы взаимосвязанных заемщиков, связанных с филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиалом исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) (далее – филиал банка-нерезидента) особыми отношениями по любому виду обязательств перед филиалом банка-нерезидента**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование заемщика | Индивидуальный идентификационный номер, бизнес-идентификационный номер, альтернативный идентификационный номер | Признак связанности с филиалом банка-нерезидента особыми отношениями | Признак взаимосвязанности заемщиков |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 |  |  |  |  |
| 2 |  |  |  |  |
|  | Итого | X | X | X |

      продолжение таблицы:

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Сумма требований | | Обеспечение | | Размер риска, тысяч тенге |
| балансовый счет | тысяч тенге | вид обеспечения | тысяч тенге |
| 6 | 7 | 8 | 9 | 10 |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| X | X | X | X |  |

**Таблица 3. Отчет о расшифровке суммы рисков по всем заемщикам, связанным с филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиалом исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) (далее - филиал банка-нерезидента) особыми отношениями**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование заемщика | Индивидуальный идентификационный номер, бизнес-идентификационный номер, альтернативный идентификационный номер | Признак связанности с филиалом банка-нерезидента особыми отношениями |
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| 1 |  |  |  |
| 2 |  |  |  |
|  | Итого | X | X |

      продолжение таблицы:

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Сумма требований | | Обеспечение | | Размер риска, тысяч тенге |
| балансовый счет | тысяч тенге | вид обеспечения | тысяч тенге |
| 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| X | X | X | X |  |

**Таблица 4. Отчет о расшифровке максимальной суммы бланкового займа, необеспеченных условных обязательств перед заемщиком либо за заемщика в пользу третьих лиц, по которым у филиала банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) могут возникнуть требования к заемщику в течение текущего и двух последующих месяцев, по обязательствам соответствующих заемщиков**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование заемщика | Индивидуальный идентификационный номер, бизнес-идентификационный номер, альтернативный идентификационный номер | Признак взаимосвязанности заемщиков | Размер риска, тысяч тенге | |
| балансовый счет | тысяч тенге |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| 1 |  |  |  |  |  |
|  | Итого | X | X | X |  |

**Таблица 5. Отчет о расшифровке совокупной суммы рисков филиала банка-нерезидента Республики Казахстан (в том числе филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан) на одного заемщика, размер каждого из которых превышает 10 процентов от размера активов, принимаемых в качестве резерва**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование заемщика | Индивидуальный идентификационный номер, бизнес-идентификационный номер, альтернативный идентификационный номер | Признак взаимосвязанности заемщиков |
| 1 | 2 |  | 4 |
| 1 |  |  |  |
|  | Итого |  | X |

      продолжение таблицы:

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Сумма требований | | Обеспечение | | Размер риска, тысяч тенге |
| балансовый счет | тысяч тенге | вид обеспечения | тысяч тенге |
| 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
|  |  |  |  |  |
| X | X | X | X |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

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

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о расшифровке максимального размера риска на одного заемщика**  
**(в разрезе заемщиков)**  
**(индекс - 1-BVU\_ R\_MRZ\_R, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

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

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) ежемесячно по состоянию на первое число каждого месяца.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213 (далее – Постановление № 23).

      6. При заполнении Формы указываются сведения, рассчитанные в соответствии с главой 3 Методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), утвержденной Постановлением № 23.

      7. При отсутствии сведений в отчетном периоде указанные таблицы не заполняются и не представляются.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 10 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет о расшифровке коэффициента текущей ликвидности k4**

      Сноска. Приложение 10 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_R\_K4

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: за "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан и филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица 1. Отчет о расшифровке среднемесячной величины высоколиквидных активов**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование статьи | Календарные дни месяца | Среднемесячная величина |
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| 1 | Наличность в кассе |  |  |
| 2 | Банкноты и монеты в пути |  |  |
| 3 | Наличность в обменных пунктах |  |  |
| 4 | Наличность в банкоматах и электронных терминалах |  |  |
| 5 | Деньги в дорожных чеках в пути |  |  |
| 6 | Монеты, изготовленные из драгоценных металлов, в кассе |  |  |
| 7 | Деньги в дорожных чеках |  |  |
| 8 | Коллекционные монеты, изготовленные из недрагоценных металлов, в кассе |  |  |
| 9 | Аффинированные драгоценные металлы |  |  |
| 10 | Аффинированные драгоценные металлы в пути |  |  |
| 11 | Аффинированные драгоценные металлы, размещенные на металлических счетах |  |  |
| 12 | Корреспондентский счет в Национальном Банке Республики Казахстан |  |  |
| 13 | Деньги на счетах в центральном депозитарии |  |  |
| 14 | Деньги банка, 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 |  |  |
| 15 | Вклады в Национальном Банке Республики Казахстан (на одну ночь) |  |  |
| 16 | Вклады до востребования в Национальном Банке Республики Казахстан |  |  |
| 17 | Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Правительством Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан, ценные бумаги, выпущенные акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" и акционерным обществом "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, осуществляющим выкуп ипотечных займов физических лиц, не связанных с предпринимательской деятельностью, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку |  |  |
| 18 | Ценные бумаги, по которым имеется государственная гарантия Правительства Республики Казахстан |  |  |
| 19 | Вклады до востребования в банках Республики Казахстан и банках-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долгосрочный долговой рейтинг не ниже "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня агентств Фитч (Fitch) или Мудис Инвесторс Сервис (Moody‘s Investors Service) (далее - другие рейтинговые агентства) |  |  |
| 20 | Займы "овернайт", предоставленные банкам Республики Казахстан и банкам-нерезидентам Республики Казахстан, имеющим долгосрочный долговой рейтинг не ниже "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  |  |
| 21 | Вклады, размещенные на одну ночь в банках Республики Казахстан и банках-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долгосрочный долговой рейтинг не ниже "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  |  |
| 22 | Государственные ценные бумаги стран, имеющих суверенный долгосрочный рейтинг в иностранной валюте не ниже уровня, установленного постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 29 ноября 2017 года № 234 "Об установлении перечня международных финансовых организаций, облигации которых банки и банковские холдинги приобретают в собственность, и требований к облигациям, которые банки и банковские холдинги приобретают в собственность", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 16149 |  |  |
| 23 | Облигации иностранных эмитентов, имеющие рейтинг не ниже "ВВВ-" (по классификации рейтинговых агентств Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) и (или) Фитч (Fitch) или не ниже "ВааЗ" (по классификации рейтингового агентстваМудис Инвесторс Сервис (Moody's Investors Service) |  |  |
| 24 | Срочные депозиты в Национальном Банке Республики Казахстан со сроком погашения до 7 (семи) календарных дней |  |  |
| 25 | Исламские ценные бумаги, выпущенные исламской специальной финансовой компанией, созданной оригинатором - национальным холдингом, национальным управляющим холдингом, юридическими лицами, 100 (ста) процентов голосующих акций (долей участия) которых принадлежат национальному управляющему холдингу |  |  |
| 26 | Исламские ценные бумаги стран, имеющих суверенный долгосрочный рейтинг в иностранной валюте не ниже "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  |  |
| 27 | Исламские ценные бумаги иностранных эмитентов, имеющих рейтинг не ниже "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  |  |
| 28 | Начисленное вознаграждение, дисконты, премии, счета положительных (отрицательных) корректировок справедливой стоимости, включаемые в расчет высоколиквидных активов |  |  |
| 29 | Балансовая стоимость государственных ценных бумаг и прочих высоколиквидных ценных бумаг, проданных филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан на условиях их обратного выкупа или переданных в залог |  |  |
| 30 | Требования по операциям валютный своп, учитываемые на балансовых счетах филиала банка-нерезидента Республики Казахстан, если обязательства по данным сделкам учитываются на балансовых счетах филиала банка-нерезидента Республики Казахстан и включены в расчет коэффициентов срочной ликвидности |  |  |
| 31 | Количество рабочих дней | |  |
| Итого: | |  |  |

**Таблица 2. Отчет о расшифровке среднемесячной величины обязательств до востребования**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование статьи | Календарные дни месяца | Среднемесячная  величина |
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| 1 | Корреспондентские счета Национального Банка Республики Казахстан |  |  |
| 2 | Корреспондентские счета иностранных центральных банков |  |  |
| 3 | Корреспондентские счета других банков |  |  |
| 4 | Корреспондентские счета организаций, осуществляющих отдельные виды банковских операций |  |  |
| 5 | Вклады до востребования Национального Банка Республики Казахстан |  |  |
| 6 | Вклады до востребования иностранных центральных банков |  |  |
| 7 | Вклады до востребования других банков |  |  |
| 8 | Просроченная задолженность по вкладам до востребования других банков |  |  |
| 9 | Займы овернайт, полученные от Национального Банка Республики Казахстан |  |  |
| 10 | Займы овернайт, полученные от иностранных центральных банков |  |  |
| 11 | Займы овернайт, полученные от других банков |  |  |
| 12 | Вклады, привлеченные от других банков на одну ночь |  |  |
| 13 | Деньги государственного бюджета |  |  |
| 14 | Текущие счета клиентов |  |  |
| 15 | Срочные обязательства с безусловным правом кредитора требовать досрочного погашения обязательств, в том числе срочные и условные депозиты других банков, за исключением срочных и условных депозитов физических и юридических лиц, аффинированных драгоценных металлов |  |  |
| 16 | Вклады до востребования клиентов |  |  |
| 17 | Прочие обязательства до востребования, в том числе обязательства, по которым не установлен срок осуществления расчета, включаемые в расчет коэффициента текущей ликвидности |  |  |
| 18 | Начисленное вознаграждение, дисконты, премии, счета положительных (отрицательных) корректировок справедливой стоимости по обязательствам до востребования |  |  |
| 19 | Необеспеченные гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента Республики Казахстан, выданные при привлечении внешних займов аффилиированными с филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан юридическими лицами, а также в рамках сделок филиала банка-нерезидента Республики Казахстан по секьюритизации, с правом кредитора требовать досрочного погашения обязательств должника по этим займам, со сроком до погашения менее 3 (трех) лет, умноженные на коэффициент конверсии равный 50 (пятидесяти) процентам и минимальное значение коэффициента достаточности активов, принимаемых в качестве резерва k1, выданных при привлечении займов, включаемых в расчет норматива k4 |  |  |
| 20 | Необеспеченные гарантии и поручительства филиала банка-нерезидента Республики Казахстан, выданные при привлечении внешних займов аффилиированными с филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан юридическими лицами, а также в рамках сделок филиала банка-нерезидента Республики Казахстан по секьюритизации, с правом кредитора требовать досрочного погашения обязательств должника по этим займам, со сроком до погашения 3 (три) года и более, умноженные на коэффициент конверсии равный 100 (ста) процентам и минимальное значение коэффициента достаточности активов, принимаемых в качестве резерва k1, выданных при привлечении займов, включаемых в расчет норматива k4 |  |  |
| Итого: | |  |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета о расшифровке коэффициента текущей ликвидности k4 |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о расшифровке коэффициента текущей ликвидности k4**  
**(индекс - 1-BVU\_R\_K4, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

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

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) и заполняется за каждый рабочий день отчетного периода.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213 (далее – Постановление № 23).

      6. При заполнении Таблицы 1 "Отчет о расшифровке среднемесячной величины высоколиквидных активов" указываются сведения по высоколиквидным активам в соответствии с пунктами 52 и 53 Методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), утвержденной Постановлением № 23.

      7. Строки 25, 26 и 27 Таблицы 1 заполняются только филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан.

      8. При заполнении в графы 4 Таблиц 1 и 2 указывается отношение совокупной суммы высоколиквидных активов (обязательств) до востребования за каждый рабочий день отчетного периода к количеству рабочих дней в отчетном периоде.

      9. При заполнении Формы указывается количество рабочих дней.

      10. Требования по операциям валютный своп, учитываемым на балансовых счетах филиала банка-нерезидента Республики Казахстан, включаются в расчет высоколиквидные активы, если обязательства по данным сделкам учитываются на балансовых счетах филиала банка-нерезидента Республики Казахстан и включены в расчет коэффициентов срочной ликвидности.

      11. При отсутствии сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 11 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет о расшифровке коэффициентов срочной ликвидности k4-1, k4-2, k4-3**

      Сноска. Приложение 11 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_ R\_K4-1, k4-2, k4-3

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан и филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица 1. Отчет о расшифровке коэффициента срочной ликвидности k4-1**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Дата | Высоколиквидные активы | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до семи календарных дней включительно |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 |  |  |
| Количество рабочих дней |  |  |
| Итого:  среднемесячная величина активов |  | X |
| Итого:  среднемесячная величина обязательств | X |  |

**Таблица 2. Отчет о расшифровке коэффициента срочной ликвидности k4-2**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Дата | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до одного месяца, включая высоколиквидные активы | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 |  |  |
| Количество рабочих дней |  |  |
| Итого:  среднемесячная величина активов |  | X |
| Итого:  среднемесячная величина обязательств | X |  |

**Таблица 3. Отчет о расшифровке коэффициента срочной ликвидности k4-3**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Дата | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, включая высоколиквидные активы | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 |  |  |
| Количество рабочих дней |  |  |
| Итого:  среднемесячная величина активов |  | X |
| Итого:  среднемесячная величина обязательств | X |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета о расшифровке коэффициентов срочной ликвидности k4-1, k4-2, k4-3 |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о расшифровке коэффициентов срочной ликвидности k4-1, k4-2, k4-3**  
**(индекс - 1-BVU\_R\_K4-1, k4-2, k4-3, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

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

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) и заполняется за каждый рабочий день отчетного периода.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213 (далее – Постановление № 23).

      6. При заполнении формы по расчету коэффициента срочной ликвидности k4-1 указывается среднемесячная величина высоколиквидных активов и срочных обязательств с оставшимся сроком до погашения до семи календарных дней включительно, рассчитанных в соответствии с пунктами 61, 62, 63, 64, 65 и 66 Методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), утвержденной Постановлением № 23 (далее - Методика).

      7. При заполнении форм по расчету коэффициентов срочной ликвидности k4-2 и k4-3 указывается среднемесячная величина ликвидных активов с оставшимся сроком до погашения до одного месяца, включая высоколиквидные активы и срочных обязательств с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно, рассчитанных в соответствии с пунктами 64, 65 и 66 Методики.

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

      9. При заполнении Формы указывается количество рабочих дней.

      10. При отсутствии сведений в отчетном периоде Формы не заполняются и не представляются.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 12 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет о расшифровке коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-4, k4-5, k4-6**

      Сноска. Приложение 12 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_ R\_K4-4, k4-5, k4-6

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан и филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица 1. Отчет о расшифровке коэффициента срочной валютной ликвидности k4-4**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Дата | Высоколиквидные активы | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до семи календарных дней включительно |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 |  |  |
| Количество рабочих дней |  |  |
| Итого:  среднемесячная величина активов |  | X |
| Итого:  среднемесячная величина обязательств | X |  |

**Таблица 2. Отчет о расшифровке коэффициента срочной валютной ликвидности k4-5**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Дата | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до одного месяца, включая высоколиквидные активы | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно, умноженные на коэффициент конверсии равный 90 (девяноста) процентам |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 |  |  |
| 2 |  |  |
| Количество рабочих дней |  |  |
| Итого:  среднемесячная величина активов |  | X |
| Итого:  среднемесячная величина обязательств | X |  |

**Таблица 3. Отчет о расшифровке коэффициента срочной валютной ликвидности k4-6**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Дата | Ликвидные активы с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, включая высоколиквидные активы | Срочные обязательства с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, умноженные на коэффициент конверсии равный 80 (восьмидесяти) процентам |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 |  |  |
| 2 |  |  |
| Количество рабочих дней |  |  |
| Итого:  среднемесячная величина активов |  | X |
| Итого:  среднемесячная величина обязательств | X |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета о расшифровке коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-4, k4-5, k4-6 |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о расшифровке коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-4, k4-5, k4-6**  
**(индекс - 1-BVU\_R\_K4-4, k4-5, k4-6, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

      1. Настоящее пояснение определяет единые требования по заполнению формы административных данных "Отчет о расшифровке коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-4, k4-5, k4-6" (далее - Форма).

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) и заполняется за каждый рабочий день отчетного периода.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213 (далее – Постановление № 23).

      6. При заполнении Формы по расчету коэффициента срочной валютной ликвидности k4-4 указывается среднемесячная величина высоколиквидных активов в иностранной валюте и срочных обязательств в этой же иностранной валюте с оставшимся сроком до погашения до семи календарных дней включительно, рассчитанных в соответствии с пунктами 57, 58, 59, 60, 61, 62, 63, 64, 65 и 66 Методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), утвержденной Постановлением № 23 (далее – Методика).

      7. При заполнении Формы по расчету коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-5 указывается среднемесячная величина ликвидных активов в иностранной валюте с оставшимся сроком до погашения до одного месяца, включая высоколиквидные активы и срочных обязательств в этой же иностранной валюте с оставшимся сроком до погашения до одного месяца включительно, рассчитанных в соответствии с пунктами 57, 58, 59, 60, 61, 62, 63, 64, 65 и 66 Методики.

      8. При заполнении Формы по расчету коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-6 указывается среднемесячная величина ликвидных активов в иностранной валюте с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев, включая высоколиквидные активы и срочных обязательств в этой же иностранной валюте с оставшимся сроком до погашения до трех месяцев включительно, рассчитанных в соответствии с пунктами 57, 58, 59, 60, 61, 62, 63, 64, 65 и 66 Методики.

      9. При заполнении Формы по расчету коэффициентов срочной валютной ликвидности k4-4, k4-5 и k4-6 сведения указываются в совокупности по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня агентств Фитч (Fitch) или Мудис Инвесторс Сервис (Moody‘s Investors Service), и валюте "Евро" и в разрезе по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" вышеуказанных рейтинговых агентств или не имеющих соответствующей рейтинговой оценки.

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

      11. При заполнении Формы указывается количество рабочих дней.

      12. При отсутствии сведений в отчетном периоде указанные таблицы не заполняются и не представляются.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 13 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет о валютных позициях по каждой иностранной валюте и валютной нетто-позиции за каждый рабочий день недели (месяца)**

      Сноска. Приложение 13 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_DVP

Периодичность: еженедельная, ежемесячная

Отчетный период: за "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан и филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан

      Сроки представления формы административных данных:

еженедельно, не позднее пятого рабочего дня недели, следующего за отчетной неделей

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

При истечении календарного месяца в отчетную неделю отчет представляется не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за истекшим календарным месяцем, раздельно за календарные дни отчетной недели, относящиеся к истекшему календарному месяцу, и за календарные дни отчетной недели, относящиеся к текущему календарному месяцу

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица. Валютная позиция по каждой иностранной валюте и валютной нетто-позиции за каждый рабочий день недели (месяца)**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Активы, принимаемые в качестве резерва | | | | | |  |
| Лимит открытой валютной позиции (длинной и короткой) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и валюте "Евро", а также аффинированным драгоценным металлам в размере, не превышающем 12,5 процентов величины активов, принимаемых в качестве резерва | | | | | |  |
| Лимит открытой валютной позиции (длинной и короткой) по иностранным валютам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "А" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств - 5 процентов величины активов, принимаемых в качестве резерва | | | | | |  |
| Лимит валютной нетто-позиции - 25 процентов от активов, принимаемых в качестве резерва | | | | | |  |
| Лимит открытой длинной и (или) короткой позиции филиала банка-нерезидента Республики Казахстан по производным финансовым инструментам в валюте отдельного иностранного государства (группы иностранных государств), открытых на счетах условных требований и на счетах условных обязательств - 50 процентов от активов, принимаемых в качестве резерва | | | | | |  |
| Наименование валюты | Сальдо на конец операционного дня по дням отчетного периода | | | | | |
| 1 | | | 2 | | |
| (дата) | | | (дата) | | |
| Требования | Обязательства | Позиция | Требования | Обязательства | Позиция |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| 1. Наличная иностранная валюта |  |  |  |  |  |  |
| ... |  |  |  |  |  |  |
| 2. Вклады, размещенные(привлеченные) |  |  |  |  |  |  |
| ... |  |  |  |  |  |  |
| 3. Займы, выданные (полученные) |  |  |  |  |  |  |
| ... |  |  |  |  |  |  |
| 4. Начисленное вознаграждение к получению (выплате) |  |  |  |  |  |  |
| ... |  |  |  |  |  |  |
| 5. Долговые и долевые ценные бумаги |  |  |  |  |  |  |
| ... |  |  |  |  |  |  |
| 6. Дебиторская (кредиторская) задолженность |  |  |  |  |  |  |
| … |  |  |  |  |  |  |
| 7. Производные финансовые инструменты |  |  |  |  |  |  |
| …. |  |  |  |  |  |  |
| 8. Итого по балансовым счетам |  |  |  |  |  |  |
| ... |  |  |  |  |  |  |
| 9. Производные финансовые инструменты в валюте отдельного иностранного государства (группы иностранных государств), открытых на счетах условных требований и на счетах условных обязательств |  |  |  |  |  |  |
| … |  |  |  |  |  |  |
| 10. Итого по внебалансовым счетам |  |  |  |  |  |  |
| … |  |  |  |  |  |  |
| 11. Итого по балансовым и внебалансовым счетам |  |  |  |  |  |  |
| …. |  |  |  |  |  |  |
| 12. Итого валютная нетто-позиция |  |  |  |  |  |  |

      продолжение таблицы:

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Сальдо на конец операционного дня по дням отчетного периода | | | | | | | | |
| 3 | | | 4 | | | 5 | | |
| (дата) | | | (дата) | | | (дата) | | |
| Требования | Обязательства | Позиция | Требования | Обязательства | Позиция | Требования | Обязательства | Позиция |
| 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета о валютных позициях по каждой иностранной валюте и валютной нетто-позиции за каждый рабочий день недели (месяца) |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о валютных позициях по каждой иностранной валюте и валютной нетто-позиции за каждый рабочий день недели (месяца)**  
**(индекс - 1-BVU\_DVP, периодичность - еженедельная)**

**Глава 1. Общие положения**

      1. Настоящее пояснение определяет единые требования по заполнению формы административных данных "Отчет о валютных позициях по каждой иностранной валюте и валютной нетто-позиции за каждый рабочий день недели (месяца)" (далее - Форма).

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется еженедельно, ежемесячно и заполняется за каждый рабочий день отчетного периода.

      При завершении календарного месяца в отчетную неделю, форма составляется раздельно за календарные дни отчетной недели, относящиеся к завершаемому месяцу и за календарные дни отчетной недели месяца, следующего за завершаемым месяцем.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. В строках 1, 2, 3, 4, 5, 6 и 7 указываются сведения по требованиям и обязательствам в иностранной валюте, учитываемых на балансовых счетах, за вычетом резервов, сформированных в соответствии с международными стандартами финансовой отчетности.

      6. В строке 10 указываются условные требования и обязательства в иностранной валюте, с учетом сумм, проводимых филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан хеджируемых сделок, в том числе беспоставочных сделок, за вычетом резервов, сформированных в соответствии с международными стандартами финансовой отчетности.

      7. В строке 12 по графам 4, 7, 10, 13 и 16 "позиция" указывается нетто-позиция по всем иностранным валютам за каждый рабочий день отчетного периода.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 14 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

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

      Сноска. Приложение 14 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_ KVA

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан и филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица 1. Отчет о расчете среднемесячной величины внутренних активов**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

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

**Таблица 2. Отчет о расчете среднемесячной величины внутренних и иных обязательств, коэффициента размещения части средств филиала банка-нерезидента Республики Казахстан во внутренние активы**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | Обязательства | Внутренние и иные обязательства по датам в течение отчетного периода | Среднемесячная величина |
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| 1 | Вклады |  |  |
| 2 | Займы полученные |  |  |
| 3 | Кредиторская задолженность |  |  |
| 4 | Итого величина внутренних обязательств |  |  |
| 5 | Минимальный размер активов, принимаемых в качестве резерва |  |  |
| 6 | Активы, принимаемые в качестве резерва, умноженные на 0,75 |  |  |
| 7 | Начисленное вознаграждение, дисконты, премии, положительные (отрицательные) корректировки справедливой стоимости |  |  |
| 8 | Просроченная задолженность по внутренним и иным обязательствам |  |  |
| 9 | Итого величина внутренних обязательств и активов, принимаемых в качестве резерва или минимального размера активов |  |  |
| 10 | Итого величина внутренних обязательств |  |  |
| 11 | Количество рабочих дней | |  |
| 12 | Коэффициент размещения части средств филиала банка-нерезидента Республики Казахстан во внутренние активы | |  |
| 13 | Среднемесячная величина внутренних обязательств, активов, принимаемых в качестве резерва и минимального размера активов, принимаемых в качестве резерва за предыдущий отчетный месяц | |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

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

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о расчете среднемесячной величины внутренних активов, внутренних и иных обязательств, коэффициента размещения части средств во внутренние активы**  
**(индекс - 1-BVU\_KVA, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

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

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) и заполняется за каждый рабочий день отчетного периода.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213.

      6. В строке 6 Таблицы 2 указывается резервный актив согласно данным отчета об активах и обязательствах, умноженный на 0,75.

      7. При заполнении Таблицы 2 за каждый рабочий день в строку 9 включаются сведения, указанные в строке 6.

      8. При отсутствии сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 15 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет о расшифровке коэффициента капитализации к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан**

      Сноска. Приложение 15 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_K7

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан и филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица. Расшифровка коэффициента капитализации банков к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| № | Наименование | Сумма |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | Обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан до востребования, в том числе обязательства, по которым не установлен срок осуществления расчетов |  |
| 2 | Срочные обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан с первоначальным сроком погашения до одного года включительно |  |
| 3 | Срочные обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан с безусловным правом кредитора требовать досрочного погашения обязательств, в том числе срочные и условные депозиты филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), за исключением срочных и условных депозитов физических и юридических лиц |  |
| 4 | Текущие счета юридических лиц-нерезидентов Республики Казахстан |  |
| 5 | Краткосрочные обязательства перед филиалами и представительствами иностранных компаний, осуществляющих свою деятельность на территории Республики Казахстан, которые входят в секторы экономики "другие финансовые организации - код 5", "государственные нефинансовые организации - код 6", "негосударственные нефинансовые организации - код 7" и "некоммерческие организации, обслуживающие домашние хозяйства - код 8 |  |
| 6 | Краткосрочные обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан, являющимися международными финансовыми организациями |  |
| 7 | Краткосрочные обязательства перед нерезидентами Республики Казахстан, являющимися международными расчетными системами (ClearstreamBanking S.A. и EuroclearBankSA(NV) |  |
| 8 | Активы, принимаемы в качестве резерва |  |
| 9 | Краткосрочные обязательства перед нерезидентами, включаемые в расчет коэффициента k7 |  |
| 10 | Максимальный лимит краткосрочных обязательств перед нерезидентами (k7) |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета о расшифровке коэффициента капитализации к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о расшифровке коэффициента капитализации к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан**  
**(индекс - 1-BVU\_K7, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

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

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) по состоянию на первое число каждого месяца.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213.

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

      7. Коэффициент капитализации филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) к обязательствам перед нерезидентами Республики Казахстан k7 указывается с тремя знаками после запятой.

      8. При отсутствии сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 16 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска**

      Сноска. Приложение 16 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_ RA

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица. Расшифровка активов, взвешенных с учетом кредитного риска, представляемая филиалами исламских банков-нерезидентов**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование статей | Сумма | Степень риска в процентах | Сумма к расчету |  | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |  | |
| I группа | | | | |  | |
| 1 | Наличные тенге |  | 0 |  |  | |
| 2 | Наличная иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня агентств Фитч (Fitch) или Мудис Инвесторс Сервис (Moody‘s Investors Service) (далее - другие рейтинговые агентства) |  | 0 |  |  | |
| 3 | Аффинированные драгоценные металлы |  | 0 |  |  | |
| 4 | Требования к Правительству Республики Казахстан |  | 0 |  |  | |
| 5 | Требования к правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 0 |  |  | |
| 6 | Требования к Национальному Банку Республики Казахстан |  | 0 |  |  | |
| 7 | Требования к центральным банкам стран, с суверенным рейтингом не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 0 |  |  | |
| 8 | Требования к международным финансовым организациям, с рейтингом не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 0 |  |  | |
| 9 | Требования к местным органам власти Республики Казахстан по налогам и другим платежам в бюджет |  | 0 |  |  | |
| 10 | Требования к акционерному обществу "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" |  | 0 |  |  | |
| 11 | Исламские ценные бумаги, выпущенные исламской специальной финансовой компанией, созданной оригинатором - национальным холдингом, национальным управляющим холдингом Республики Казахстан |  | 0 |  |  | |
| 12 | Исламские ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 0 |  |  | |
| 13 | Исламские ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 0 |  |  | |
| 14 | Ценные бумаги, выпущенные акционерными обществами "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", "Фонд проблемных кредитов" |  | 0 |  |  | |
| 15 | Требования по открытым корреспондентским счетам к банкам, имеющим долгосрочный рейтинг не ниже "ВВВ" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor's) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 0 |  |  | |
| II группа | | | | |  | |
| 16 | Наличная иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 20 |  |  |  |
| 17 | Требования к правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |  |  |
| 18 | Требования к центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |  |  |
| 19 | Требования к международным финансовым организациям, имеющим рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |  |  |
| 20 | Требования к местным органам власти Республики Казахстан |  | 20 |  |  |  |
| 21 | Требования к местным органам власти стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |  |  |
| 22 | Требования к организациям, имеющим рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |  |  |
| 23 | Исламские ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |  |  |
| 24 | Исламские ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |  |  |
| 25 | Исламские ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные исламской специальной финансовой компанией, созданной оригинатором - юридическим лицом, 100 (сто) процентов голосующих акций (долей участия) которых принадлежат национальному управляющему холдингу |  | 20 |  |  |  |
| 26 | Исламские ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, суверенный рейтинг которых не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |  |  |
| 27 | Исламские ценные бумаги, выпущенные организациями, имеющими рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 20 |  |  |  |
| III группа | | | | |  | |
| 28 | Неаффинированные драгоценные металлы |  | 50 |  |  |  |
| 29 | Требования к правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |  |  |
| 30 | Требования к центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |  |  |
| 31 | Требования к международным финансовым организациям, имеющим рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |  |  |
| 32 | Требования к местным органам власти стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |  |  |
| 33 | Требования к организациям, имеющим рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |  |  |
| 34 | Требования по открытым корреспондентским счетам к банкам-резидентам Республики Казахстан, имеющим долговой рейтинг от "ВВВ-" до "ВВ-" (включительно) агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor's) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или банку-нерезиденту Республики Казахстан, имеющему долговой рейтинг от "ВВВ-" до "ВВ+" (включительно) агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor's), или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |  |  |
| 35 | Ипотечные жилищные займы, соответствующие условию: отношение суммы предоставленного ипотечного жилищного займа к стоимости залога не превышает 50 (пятидесяти) процентов включительно от стоимости залога |  | 35 |  |  |  |
| 36 | Ипотечные жилищные займы, соответствующие условию: отношение суммы предоставленного ипотечного жилищного займа к стоимости залога находится в пределах от 51 (пятидесяти одного) процента до 85 (восьмидесяти пяти) процентов включительно от стоимости залога |  | 50 |  |  |  |
| 37 | Требования с просроченной задолженностью по основному долгу и (или) начисленному вознаграждению свыше 90 (девяноста) календарных дней, предоставленные резидентам Республики Казахстан (за исключением ипотечных жилищных займов) по которым сформировано менее 35 (тридцати пяти) процентов провизий (резервов) согласно международным стандартам финансовой отчетности от непогашенной части займов |  | 100 |  |  |  |
| 38 | Требования с просроченной задолженностью по основному долгу и (или) начисленному вознаграждению свыше 90 (девяноста) календарных дней, предоставленные резидентам Республики Казахстан (за исключением ипотечных жилищных займов) по которым сформировано более 35 (тридцати пяти) процентов и менее 50 (пятидесяти) процентов провизий (резервов) согласно международным стандартам финансовой отчетности от непогашенной части займов |  | 75 |  |  |  |
| 39 | Требования с просроченной задолженностью по основному долгу и (или) начисленному вознаграждению свыше 90 (девяноста) календарных дней, предоставленные резидентам Республики Казахстан (за исключением ипотечных жилищных займов) по которым сформировано более 50 (пятидесяти) процентов провизий (резервов) согласно международным стандартам финансовой отчетности от непогашенной части займов |  | 50 |  |  |  |
| 40 | Займы, предоставленные субъектам, отнесенным к малому или среднему предпринимательству, согласно Предпринимательскому кодексу Республики Казахстан от 29 октября 2015 года, соответствующие следующим критериям:  1) сумма займа не превышает 0,02 (ноль целых две сотых) процента от активов, принимаемых в качестве резерва;  2) валюта займа - тенге |  | 75 |  |  |  |
| 41 | Исламские ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |  |  |
| 42 | Исламские ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими рейтинг от "ВВВ+" до "ВВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |  |  |
| 43 | Исламские ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |  |  |
| 44 | Исламские ценные бумаги, выпущенные организациями, имеющими рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 50 |  |  |  |
| 45 | Требования к акционерному обществу "Казахстанская фондовая биржа" |  | 50 |  |  |  |
| IV группа | | | | |  | |
| 46 | Требования к правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |  | |
| 47 | Требования к центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |  | |
| 48 | Требования к международным финансовым организациям, имеющим рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и международным финансовым организациям, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |  | |
| 49 | Требования к местным органам власти стран, имеющих рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |  | |
| 50 | Требования к организациям-резидентам, имеющим рейтинг ниже "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациям- резидентам, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки, и организациям- нерезидентам, имеющим рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |  | |
| 51 | Требования по открытым корреспондентским счетам к банкам-резидентам Республики Казахстан, имеющим долговой рейтинг ниже "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или банку-нерезиденту Республики Казахстан, имеющему долговой рейтинг ниже "ВВ+" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s), или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |  | |
| 52 | Прочие ипотечные жилищные займы |  | 100 |  |  | |
| 53 | Исламские ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |  | |
| 54 | Исламские ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |  | |
| 55 | Исламские ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими рейтинг от "ВВ+" до "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и международными финансовыми организациями, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки |  | 100 |  |  | |
| 56 | Исламские ценные бумаги, выпущенные организациями резидентами, имеющими рейтинг ниже "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациями- резидентами, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки, и организациями-нерезидентами, имеющими рейтинг от "ВВВ+" до "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |  | |
| 57 | Расчеты по платежам |  | 100 |  |  | |
| 58 | Основные средства |  | 100 |  |  | |
| 59 | Материальные запасы |  | 100 |  |  | |
| V группа | | | | |  | |
| 60 | Инвестиции, учитываемые по справедливой стоимости, в части акций (долей участия в уставном капитале), за исключением инвестиций филиала банка-нерезидента Республики Казахстан |  | 100 |  |  |  |
| 61 | Сумма всех инвестиций филиала банка-нерезидента Республики Казахстан, каждая из которых составляет менее 10 (десяти) процентов от выпущенных акций (долей участия в уставном капитале) юридического лица, финансовая отчетность которого не консолидируется при составлении финансовой отчетности филиала банка-нерезидента Республики Казахстан, не превышающая 10 (десяти) процентов основного капитала |  | 100 |  |  |  |
| 62 | Сумма инвестиций филиала банка-нерезидента Республики Казахстан в простые акции финансовой организации, в которой филиал банка-нерезидента Республики Казахстан имеет 10 (десять) и более процентов от выпущенных акций (долей участия в уставном капитале), и часть отложенных налоговых активов, признанных в отношении вычитаемых временных разниц, в совокупности не превышающая 17,65 (семнадцать целых шестьдесят пять сотых) процентов разницы активов, принимаемых в качестве резерва филиала банка-нерезидента Республики Казахстан после применения регуляторных корректировок, указанных в пункте 4 Методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), утвержденной постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213 (далее - Методика), и суммы, подлежащей вычету из активов, принимаемых в качестве резерва филиала банка-нерезидента Республики Казахстан, указанной в абзацах втором, третьем и четвертом части первой пункта 5 Методики |  | 250 |  |  |  |
| 63 | Требования к правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |  |  |
| 64 | Требования к центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |  |  |
| 65 | Требования к международным финансовым организациям, имеющим рейтинг ниже "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |  |  |
| 66 | Требования к местным органам власти стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |  |  |
| 67 | Требования к организациям-нерезидентам, имеющим рейтинг ниже "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard&Poor's) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациям-нерезидентам, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки |  | 150 |  |  |  |
| 68 | Исламские ценные бумаги, выпущенные правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг ниже "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |  |  |
| 69 | Исламские ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, суверенный рейтинг которых ниже "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |  |  |
| 70 | Исламские ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими рейтинг ниже "В-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 150 |  |  |  |
| 71 | Исламские ценные бумаги, выпущенные организациями-нерезидентами, имеющими рейтинг ниже "ВВ-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациями-нерезидентами, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки |  | 150 |  |  |  |
| 72 | Исламские ценные бумаги, выпущенные организациями-нерезидентами Республики Казахстан, зарегистрированными на территории 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. |  | 150 |  |  |  |
| 73 | Итого рисковые активы: |  |  |  |  |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска**  
**(индекс - 1-BVU\_RA, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

      1. Настоящее пояснение определяет единые требования по заполнению формы административных данных "Отчет филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан о расшифровке активов, взвешенных с учетом кредитного риска" (далее - Форма).

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан по состоянию на первое число каждого месяца.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

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

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

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 17 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска**

      Сноска. Приложение 17 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 2-BVU\_ RUIVO

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее седьмого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица. Расшифровка условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска, представляемая филиалами исламских банков-нерезидентов**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование статей | Сумма | Коэффициент конверсии в процентах | Коэффициент кредитного риска | Сумма к расчету |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| I группа | | | | | |
| 1 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан (далее - филиал исламского банка-нерезидента), обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", акционерного общества "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня агентств Фитч (Fitch) или Мудис Инвесторс Сервис (Moody‘s Investors Service) (далее - другие рейтинговые агентства);  деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала исламского банка-нерезидента;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", акционерного общества "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 0 |  |
| 2 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены:  встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала исламского банка-нерезидента;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 20 |  |
| 3 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены:  встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала исламского банка-нерезидента;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 50 |  |
| 4 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены:  встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала исламского банка-нерезидента;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 100 |  |
| 5 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены:  встречными гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение филиала исламского банка-нерезидента;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 150 |  |
| 6 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", акционерным обществом "Национальный управляющий холдинг "Байтерек" или ценных бумаг, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, заключенные с контрпартнерами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 0 |  |
| 7 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" или ценных бумаг, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, заключенные с контрпартнерами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 20 |  |
| 8 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" или ценных бумаг, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, заключенные с контрпартнерами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 50 |  |
| 9 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" или ценных бумаг, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, заключенные с контрпартнерами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 100 |  |
| 10 | Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан, акционерным обществом "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" или ценных бумаг, выпущенных правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, прочих высоколиквидных ценных бумаг, заключенные с контрпартнерами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 150 |  |
| 11 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента:  без финансовых обязательств банка, обязательства по которым обеспечены:  гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", акционерного общества "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", акционерного общества "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 0 |  |
| 12 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента:  без финансовых обязательств филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым обеспечены:  гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 20 |  |
| 13 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента:  без финансовых обязательств филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым обеспечены:  гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;  деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 50 |  |
| 14 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента: без финансовых обязательств филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым обеспечены:  гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 100 |  |
| 15 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента: без финансовых обязательств филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) Правительства Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами Правительства Республики Казахстан, Национального Банка Республики Казахстан, акционерного общества "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; деньгами или аффинированными драгоценными металлами, предоставленными в распоряжение банка, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 150 |  |
| 16 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию филиала исламского банка-нерезидента, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 0 |  |
| 17 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию филиала исламского банка-нерезидента, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 20 |  |
| 18 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию филиала исламского банка-нерезидента, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 50 |  |
| 19 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию филиала исламского банка-нерезидента, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 100 |  |
| 20 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию филиала исламского банка-нерезидента, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 150 |  |
| 21 | Гарантии, принятые филиалом исламского банка-нерезидента в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 0 |  |
| 22 | Гарантии, принятые филиалом исламского банка-нерезидента в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 20 |  |
| 23 | Гарантии, принятые филиалом исламского банка-нерезидента в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 50 |  |
| 24 | Гарантии, принятые филиалом исламского банка-нерезидента в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 100 |  |
| 25 | Гарантии, принятые филиалом исламского банка-нерезидента в обеспечение выданного займа, заключенные с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 0 | 150 |  |
| II группа | | | | | |
| 26 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 0 |  |
| 27 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 20 |  |
| 28 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 50 |  |
| 29 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 100 |  |
| 30 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 года, заключенные с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 150 |  |
| 31 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц заемщиков, входящих в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 0 |  |
| 32 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 20 |  |
| 33 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 50 |  |
| 34 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 100 |  |
| 35 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 150 |  |
| 36 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 0 |  |
| 37 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 20 |  |
| 38 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 50 |  |
| 39 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 100 |  |
| 40 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым обеспечены: гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 20 | 150 |  |
| III группа | | | | | |
| 41 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 0 |  |
| 42 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 20 |  |
| 43 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 50 |  |
| 44 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 100 |  |
| 45 | Возможные (условные) обязательства по размещению филиалом исламского банка-нерезидента в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 года, заключенные с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 150 |  |
| 46 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного ив других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 0 |  |
| 47 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 20 |  |
| 48 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 50 |  |
| 49 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 100 |  |
| 50 | Гарантии и поручительства филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выданные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 150 |  |
| 51 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 0 |  |
| 52 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 20 |  |
| 53 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 50 |  |
| 54 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 100 |  |
| 55 | Аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, обязательства по которым полностью обеспечены: встречными гарантиями (поручительствами) правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; гарантиями (поручительствами) юридических лиц и страховыми полисами страховых (перестраховочных) организаций, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами правительств и центральных банков иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "ВВВ-" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами банков, имеющих рейтинг от "А-" до "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; ценными бумагами юридических лиц, имеющих рейтинг на уровне "АА-" и выше агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, выставленные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 150 |  |
| 56 | Возможные (условные) обязательства по обратному выкупу у акционерного общества "Казахстанская жилищная компания" прав требований по ипотечным жилищным займам, входящих в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 0 |  |
| 57 | Возможные (условные) обязательства по обратному выкупу у акционерного общества "Казахстанская жилищная компания" прав требований по ипотечным жилищным займам, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 20 |  |
| 58 | Возможные (условные) обязательства по обратному выкупу у акционерного общества "Казахстанская жилищная компания" прав требований по ипотечным жилищным займам, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 50 |  |
| 59 | Возможные (условные) обязательства по обратному выкупу у акционерного общества "Казахстанская жилищная компания" прав требований по ипотечным жилищным займам, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 100 |  |
| 60 | Возможные (условные) обязательства по обратному выкупу у акционерного общества "Казахстанская жилищная компания" прав требований по ипотечным жилищным займам, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 50 | 150 |  |
| IV группа | | | | | |
| 61 | Соглашение о продаже филиалу исламского банка-нерезидента и с обязательством обратного выкупа филиалом исламского банка-нерезидента финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 0 |  |
| 62 | Соглашение о продаже филиалу исламского банка-нерезидента и с обязательством обратного выкупа филиалом исламского банка-нерезидента финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 20 |  |
| 63 | Соглашение о продаже филиалу исламского банка-нерезидента и с обязательством обратного выкупа филиалом исламского банка-нерезидента финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 50 |  |
| 64 | Соглашение о продаже филиалу исламского банка-нерезидента и с обязательством обратного выкупа филиалом исламского банка-нерезидента финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 100 |  |
| 65 | Соглашение о продаже филиалу исламского банка-нерезидента и с обязательством обратного выкупа филиалом исламского банка-нерезидента финансовых инструментов, заключенное с лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 150 |  |
| 66 | Иные гарантии (поручительства) филиала исламского банка-нерезидента, выданные в пользу лиц, входящих в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 0 |  |
| 67 | Иные гарантии (поручительства) филиала исламского банка-нерезидента, выданные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 20 |  |
| 68 | Иные гарантии (поручительства) филиала исламского банка-нерезидента, выданные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 50 |  |
| 69 | Иные гарантии (поручительства) филиала исламского банка-нерезидента, выданные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 100 |  |
| 70 | Иные гарантии (поручительства) филиала исламского банка-нерезидента, выданные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 150 |  |
| 71 | Иные аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 0 |  |
| 72 | Иные аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 20 |  |
| 73 | Иные аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 50 |  |
| 74 | Иные аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента филиала исламского банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 100 |  |
| 75 | Иные аккредитивы филиала исламского банка-нерезидента, выставленные в пользу лиц, входящих в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 150 |  |
| 76 | Иные условные (возможные) обязательства филиала исламского банка-нерезидента, перед лицами, входящими в І группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 0 |  |
| 77 | Иные условные (возможные) обязательства филиала исламского банка-нерезидента, перед лицами, входящими в II группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 20 |  |
| 78 | Иные условные (возможные) обязательства филиала исламского банка-нерезидента, перед лицами, входящими в III группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 50 |  |
| 79 | Иные условные (возможные) обязательства филиала исламского банка-нерезидента, перед лицами, входящими в IV группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 100 |  |
| 80 | Иные условные (возможные) обязательства филиала исламского банка-нерезидента, перед лицами, входящими в V группу активов, взвешенных по степени кредитного риска |  | 100 | 150 |  |
| Итого условные обязательства, взвешенные по степени кредитного риска: | |  | X | X |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска ска |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска**  
**(индекс - 2-BVU\_ RUIVO, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

      1. Настоящее пояснение определяет единые требования по заполнению формы административных данных "Отчет филиала исламского банка-нерезидента Республики Казахстан о расшифровке условных и возможных обязательств, взвешенных с учетом кредитного риска" (далее – Форма).

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан по состоянию на первое число каждого месяца.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213.

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

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

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 18 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет о расшифровке коэффициента покрытия ликвидности**

      Сноска. Приложение 18 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_LCR

      Периодичность: ежемесячная

      Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

      Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан

      Срок представления формы административных данных:

      ежемесячно, не позднее десятого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица. Расшифровка коэффициента покрытия ликвидности**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование статей | Сумма | Коэффициент учета в процентах | Сумма к расчету |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Высококачественные ликвидные активы первого уровня | | | | |
| 1 | Наличные деньги |  | 100 |  |
| 2 | Депозиты в Национальном Банке Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 3 | Требования к Правительству Республики Казахстан, Национальному Банку, юридическому лицу, осуществляющему выкуп ипотечных займов физических лиц, не связанных с предпринимательской деятельностью, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку, правительствам иностранных государств, центральным банкам иностранных государств и международным финансовым организациям, взвешиваемые по степени кредитного риска 0 (ноль) процентов: |  | 100 |  |
| 3.1 | ценные бумаги, гарантированные Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 3.2 | ценные бумаги, гарантированные правительствами иностранных государств и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня агентств Фитч (Fitch) или Мудис Инвесторс Сервис (Moody‘s Investors Service) (далее - другие рейтинговые агентства) |  | 100 |  |
| 3.3 | ценные бумаги, гарантированные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 3.4 | займы, предоставленные Правительству Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 3.5 | займы, предоставленные Национальному Банку Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 3.6 | займы, предоставленные правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 3.7 | займы, предоставленные центральным банкам стран с суверенным рейтингом не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 3.8 | займы, предоставленные международным финансовым организациям с долговым рейтингом не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 3.9 | вклады в центральных банках стран с суверенным рейтингом не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 3.10 | вклады в международных финансовых организациях с долговым рейтингом не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 3.11 | дебиторская задолженность Правительства Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 3.12 | государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Правительством Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан |  | 100 |  |
| 3.13 | ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами иностранных государств, суверенный рейтинг которых не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 3.14 | ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 100 |  |
| 4 | Требования к правительствам иностранных государств и центральным банкам иностранных государств, номинированные в валюте соответствующих стран, при взвешивании по степени кредитного риска выше 0 (нуля) процентов |  | 100 |  |
| Высококачественные ликвидные активы второго уровня | | | | |
| 5 | Требования к местным исполнительным органам Республики Казахстан, взвешиваемые по степени кредитного риска 20 (двадцать) процентов |  | 85 |  |
| 5.1 | займы, предоставленные местным исполнительным органам Республики Казахстан |  | 85 |  |
| 5.2 | дебиторская задолженность местных исполнительных органов Республики Казахстан |  | 85 |  |
| 5.3 | ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан |  | 85 |  |
| 6 | Требования к правительствам иностранных государств, центральным банкам иностранных государств, местным органам власти иностранных государств, международным финансовым организациям, взвешиваемые по степени кредитного риска 20 (двадцать) процентов, в том числе: |  | 85 |  |
| 6.1 | ценные бумаги, гарантированные правительствами иностранных государств и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 6.2 | ценные бумаги, гарантированные местными органами власти иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 6.3 | ценные бумаги, гарантированные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 6.4 | займы, предоставленные правительствам стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 6.5 | займы, предоставленные центральным банкам стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 6.6 | займы, предоставленные международным финансовым организациям, имеющим долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 6.7 | займы, предоставленные местным органам власти стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 6.8 | вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 6.9 | вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 6.10 | ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 6.11 | ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговой рейтинг от "А+" до "А-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| 6.12 | ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, суверенный рейтинг которых не ниже "АА-" агентства Стэндард энд Пурс (Standard & Poor’s) или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств |  | 85 |  |
| Денежные оттоки по обязательствам перед физическими лицами | | | | |
| 7 | Стабильные депозиты |  | 5 |  |
| 8 | Менее стабильные депозиты |  | 10 |  |
| 9 | Иные денежные оттоки по обязательствам перед физическими лицами, не включенные в строки 7 и 8 настоящей таблицы |  | 100 |  |
| Денежные оттоки по обязательствам перед юридическими лицами, субъектами малого предпринимательства, необеспеченным активами филиала банка-нерезидента Республики Казахстан | | | | |
| 10 | Вклады, размещенные нефинансовыми организациями, являющимися субъектами малого предпринимательства, полный объем которых не превышает в эквиваленте 1 (один) миллион долларов Соединенных Штатов Америки |  | 10 |  |
| 11 | Вклады, связанные с клиринговой, с деятельностью по управлению ликвидностью |  | 25 |  |
| 12 | Депозиты нефинансовых организаций, Правительства Республики Казахстан, Национального Банка, местных исполнительных органов Республики Казахстан, международных финансовых организаций, правительств иностранных государств, центральных банков иностранных государств, местных органов власти иностранных государств |  | 20 |  |
| 13 | Депозиты нефинансовых организаций (группы нефинансовых организаций, когда одно юридическое лицо является крупным участником другого юридического лица, при этом размер обязательств каждого из юридических лиц превышает 0,5 (ноль целых пять десятых) процента активов, принятых в качестве резерва), в сумме, превышающей 5 (пять) процентов суммы обязательств филиала банка-нерезидента Республики Казахстан |  | 60 |  |
| 14 | Обязательства перед иными юридическими лицами |  | 100 |  |
| Денежные оттоки по обязательствам перед юридическими лицами, обеспеченным активами филиала банка-нерезидента Республики Казахстан | | | | |
| 15 | Обязательства, обеспеченные высококачественными ликвидными активами первого уровня |  | 0 |  |
| 16 | Обязательства перед Правительством Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан |  | 0 |  |
| 17 | Обязательства, обеспеченные высококачественными ликвидными активами второго уровня |  | 15 |  |
| 18 | Обязательства перед местными исполнительными органами Республики Казахстан, международными финансовыми организациями, взвешиваемые по степени кредитного риска не выше 20 (двадцати) процентов, обеспеченные активами, не являющимися высококачественными ликвидными активами первого и второго уровней |  | 25 |  |
| 19 | Иные обеспеченные обязательства |  | 100 |  |
| Дополнительные денежные оттоки по условным и возможным обязательствам | | | | |
| 20 | Дополнительная потребность в ликвидности по условным обязательствам, сделкам с производными финансовыми инструментами и иным операциям в полном размере при снижении рейтинга банка на 1 (одну), 2 (две) либо 3 (три) ступени от текущего рейтинга банка |  | 100 |  |
| 21 | Необходимость в дополнительной ликвидности при изменении рыночной оценки позиций по производным финансовым инструментам или иным операциям |  | Наибольший  30 (тридцатидневный) нетто отток за предыдущие 24 (двадцать четыре) месяца |  |
| 22 | Необходимость в дополнительной ликвидности при переоценке обеспечения (за исключением высококачественных ликвидных активов первого уровня) по производным финансовым инструментам и иным операциям |  | 20 |  |
| 23 | Размер превышения обеспечения, удерживаемого филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан в связи с поддержанием позиции по производным финансовым инструментам, по которому предусмотрен отзыв в любое время |  | 100 |  |
| 24 | Необходимость в дополнительной ликвидности по операциям, предусматривающим предоставление филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан обеспечения, по требованию контрагента в соответствии с условиями договора если обеспечение не предоставлено |  | 100 |  |
| 25 | Необходимость в дополнительной ликвидности, связанная с возможностью замены обеспечения на активы, не являющиеся высококачественными ликвидными активами |  | 100 |  |
| 26 | Неиспользованная часть кредитных линий и линий ликвидности, предоставленных физическим лицам и субъектам малого предпринимательства |  | 5 |  |
| 27 | Неиспользованная часть кредитных линий, предоставленных нефинансовым организациям, Правительству Республики Казахстан, Национальному Банку, местным исполнительным органам Республики Казахстан и международным финансовым организациям |  | 10 |  |
| 28 | Неиспользованная часть линий ликвидности, предоставленных нефинансовым организациям, Правительству Республики Казахстан, Национальному Банку, местным исполнительным органам Республики Казахстан и международным финансовым организациям |  | 30 |  |
| 29 | Неиспользованная часть кредитных линий и линий ликвидности, предоставленных другим банкам |  | 40 |  |
| 30 | Неиспользованная часть кредитных линий, предоставленных финансовым организациям, не являющимся банками |  | 40 |  |
| 31 | Неиспользованная часть линий ликвидности, предоставленных иным финансовым организациям, не являющимся банками |  | 100 |  |
| 32 | Неиспользованная часть кредитных линий и линий ликвидности, предоставленных иным юридическим лицам |  | 100 |  |
| 33 | Обязательства, связанные с финансированием экспорта и импорта товаров и услуг (по гарантиям и поручительствам, аккредитивам, связанным с проведением факторинговых и форфейтинговых операций) |  | 5 |  |
| 34 | Обязательства по гарантиям и поручительствам, аккредитивам, не связанным с финансированием экспорта и импорта товаров и услуг |  | 10 |  |
| 35 | Иные денежные оттоки по обязательствам, не включенные в строки 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, 32, 33, 34, 35 настоящей таблицы |  | 100 |  |
| Денежные притоки | | | | |
| 36 | Заемные операции, обеспеченные высококачественными ликвидными активами первого уровня |  | 0 |  |
| 37 | Заемные операции, обеспеченные высококачественными ликвидными активами второго уровня |  | 15 |  |
| 38 | Займы, предоставленные для совершения купли-продажи ценных бумаг под обеспечение активов, не относящихся к высококачественным ликвидным активам (маржинальные сделки) |  | 50 |  |
| 39 | Заемные операции, обеспеченные иными активами |  | 100 |  |
| 40 | Кредитные линии, линии ликвидности, предоставленные другими банками |  | 0 |  |
| 41 | Вклады, связанные с клиринговой, с деятельностью по управлению ликвидностью клиента в других финансовых организациях |  | 0 |  |
| 42 | Притоки по кредитам, за исключением займов с просроченной задолженностью по основному долгу и (или) начисленному вознаграждению, в том числе выданным: |  |  |  |
| 42.1 | физическим лицам и субъектам малого предпринимательства |  | 50 |  |
| 42.2 | нефинансовым организациям |  | 50 |  |
| 42.3 | финансовым организациям |  | 100 |  |
| 43 | Нетто притоки по производным финансовым инструментам |  | 100 |  |
| 44 | Иные денежные притоки от операций, по договорам которых ожидаются денежные притоки в течение календарного месяца, следующего за датой расчета коэффициента покрытия ликвидности |  | 100 |  |
| 45 | Высококачественные ликвидные активы |  | х |  |
| 46 | Денежные притоки |  | х |  |
| 47 | Денежные оттоки |  | х |  |
| 48 | Нетто отток денежных средств по операциям филиала банка-нерезидента Республики Казахстан в течение календарного месяца, следующего за датой расчета коэффициента покрытия ликвидности | х | х |  |
| 49 | Коэффициент покрытия ликвидности | х | х |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета о расшифровке коэффициента покрытия ликвидности |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о расшифровке коэффициента покрытия ликвидности**  
**(индекс - 1-BVU\_LCR, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

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

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан по состоянию на первое число каждого месяца.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213 (далее – Постановление № 23).

      6. Высококачественные ликвидные активы филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан рассчитываются с учетом требований, установленных пунктом 81 Методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), утвержденной Постановлением № 23 (далее - Методика) и с применением коэффициентов учета, установленных в приложении 13 к Методике.

      7. Денежный отток (приток) рассчитывается, как сумма денежных оттоков (притоков) в течение последующего календарного месяца после отчетной даты, с применением коэффициентов оттока (притока), установленных в приложении 9 к Методике.

      8. При заполнении Формы в графе 5 строки 45 суммируются данные по высококачественным активам первого и второго уровней с учетом требований части 2 пункта 71 Методики.

      9. В строке 46 суммируются данные по строкам, 36, 37, 38, 39, 40, 41, 42, 43 и 44.

      10. В строке 47 суммируются данные по строкам 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, 32, 33, 34 и 35.

      11. При заполнении Формы в графе 5 строки 48 расчет производится с учетом пункта 72 Методики.

      12. При заполнении Формы в строке 49 указывается отношение высококачественных ликвидных активов к нетто оттоку денежных средств по операциям филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан в течение последующего календарного месяца с тремя знаками после запятой.

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

      14. При отсутствии сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 19 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Форма, предназначенная для сбора административных данных**

      Представляется: в Национальный Банк Республики Казахстан

Форма административных данных размещена на интернет-ресурсе: www.nationalbank.kz

**Отчет о расшифровке коэффициента нетто стабильного фондирования**

      Сноска. Приложение 19 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      Индекс формы административных данных: 1-BVU\_NFSR

Периодичность: ежемесячная

Отчетный период: на "\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Круг лиц, представляющих информацию: филиалы банков-нерезидентов Республики Казахстан

Срок представления формы административных данных:

ежемесячно, не позднее десятого рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем

|  |  |
| --- | --- |
|  | Форма |

**Таблица. Расшифровка коэффициента нетто стабильного фондирования**

|  |  |
| --- | --- |
|  | (в тысячах тенге) |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование статей | Сумма | Коэффициент учета в процентах | Сумма к расчету |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 | Доступное стабильное фондирование |  |  |  |
| 1.1 | Активы, принимаемые в качестве резерва, указанные в пункте 8 Методики расчетов пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), утвержденной постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213 (далее - Методика), включается до вычетов, установленных частью третьей пункта 8 Методики |  | 100 |  |
| 1.2 | иные обязательства с оставшимся сроком погашения 1 (один) год и более |  | 100 |  |
| 1.3 | стабильные депозиты |  | 95 |  |
| 1.4 | менее стабильные депозиты |  | 90 |  |
| 1.5 | обязательства с оставшимся сроком погашения менее 1 (одного) года, предоставленные нефинансовыми организациями |  | 50 |  |
| 1.6 | вклады, связанные с клиринговой, с деятельностью по управлению ликвидностью клиента |  | 50 |  |
| 1.7 | обязательства с оставшимся сроком погашения менее 1 (одного) года, предоставленные правительствами иностранных государств, местными органами власти иностранных государств и международными финансовыми организациями |  | 50 |  |
| 1.8 | иные виды обязательств, включая вклады юридических лиц, с оставшимся сроком погашения более 6 (шести) месяцев и менее 1 (одного) года |  | 50 |  |
| 1.9 | вклады юридических лиц с оставшимся сроком погашения менее 6 (шести) месяцев |  | 0 |  |
| 1.10 | Вклады юридических лиц с возможностью безусловного досрочного изъятия |  | 0 |  |
| 1.11 | иные обязательства, в том числе бессрочные обязательства (с установлением особого режима для отсроченных налоговых обязательств) |  | 0 |  |
| 1.12 | коэффициент нетто стабильного фондирования по обязательствам по производным финансовым инструментам за вычетом активов по производным финансовым инструментам, если размер обязательств превышает размер активов по производным финансовым инструментам |  | 0 |  |
| 1.13 | платежи, возникающие от покупки финансовых инструментов, иностранной валюты в день покупки |  | 0 |  |
| 2 | Требуемые активы стабильного фондирования |  |  |  |
| 2.1 | наличные деньги |  | 0 |  |
| 2.2 | Требования к Национальному Банку Республики Казахстан |  | 0 |  |
| 2.3 | требования к центральным банкам иностранных государств с оставшимся сроком погашения менее 6 (шести) месяцев |  | 0 |  |
| 2.4 | приток, возникающий от продажи финансовых инструментов, иностранной валюты в день продажи |  | 0 |  |
| 2.5 | необремененные высококачественные ликвидные активы первого уровня, за исключением денежных средств и резервов в Национальном Банке Республики Казахстан |  | 5 |  |
| 2.6 | необремененные займы, предоставленные финансовым организациям с оставшимся сроком погашения менее 6 (шести) месяцев, обеспеченные высококачественными ликвидными активами первого уровня, по которым возможен перезалог |  | 10 |  |
| 2.7 | иные необремененные займы, предоставленные финансовым организациям с оставшимся сроком погашения менее 6 (шести) месяцев |  | 15 |  |
| 2.8 | необремененные высококачественные ликвидные активы второго уровня |  | 15 |  |
| 2.9 | Займы, выданные акционерному обществу "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" и акционерному обществу "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", займы, гарантированные Правительством Республики Казахстан, с оставшимся сроком до погашения менее 1 (одного) года |  | 25 |  |
| 2.10 | Займы, выданные акционерному обществу "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" и акционерному обществу "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", займы, гарантированные Правительством Республики Казахстан, с оставшимся сроком до погашения 1 (один) год и более |  | 30 |  |
| 2.11 | высококачественные ликвидные активы, обремененные на период более 6 (шести) месяцев и менее 1 (одного) года |  | 50 |  |
| 2.12 | займы, предоставленные финансовым организациям, центральным банкам иностранных государств с оставшимся сроком погашения более 6 (шести) месяцев и менее 1 (одного) года |  | 50 |  |
| 2.13 | вклады, связанные с клиринговой, с деятельностью по управлению ликвидностью клиента в других банках |  | 50 |  |
| 2.14 | иные активы, не являющиеся высококачественными ликвидными активами, с оставшимся сроком погашения менее 1 (одного) года, включая займы нефинансовым организациям, потребительские займы, займы субъектам малого предпринимательства |  | 50 |  |
| 2.15 | необремененные ипотечные кредиты с оставшимся сроком погашения 1 (один) год и более взвешиваемые по степени кредитного риска не более 35 (тридцати пяти) процентов |  | 65 |  |
| 2.16 | иные необремененные займы, за исключением займов, предоставленных финансовым организациям с оставшимся сроком до погашения 1 (один) год и более, взвешиваемые по степени кредитного риска не более 35 (тридцати пяти) процентов |  | 65 |  |
| 2.17 | Деньги, ценные бумаги и иные активы, являющиеся обеспечением в качестве начальной маржи по сделкам с производными финансовыми инструментами, деньги или иные активы, предоставленные в качестве обязательного платежа центральному контрагенту |  | 85 |  |
| 2.18 | необремененные кредиты, за исключением займов с просроченной задолженностью по основному долгу и (или) начисленному вознаграждению, взвешиваемые по степени кредитного риска более 35 (тридцати пяти) процентов и с оставшимся сроком погашения 1 (один) год и более, за исключением займов, предоставленных финансовым организациям |  | 85 |  |
| 2.19 | Необремененные ценные бумаги (акции) с оставшимся сроком погашения 1 (один) год и более, не являющиеся высококачественными ликвидными активами и обращающиеся на фондовых биржах |  | 85 |  |
| 2.20 | товары, обращающиеся на фондовых биржах, включая аффинированное золото |  | 85 |  |
| 2.21 | активы, обремененные на период от 1 (одного) года и более |  | 100 |  |
| 2.21 | иные активы, включая неработающие кредиты, займы, выданные финансовым организациям с оставшимся сроком погашения 1 (один) год и более |  | 100 |  |
| 2.22 | Коэффициент нетто стабильного фондирования по активам по производным финансовым инструментам за вычетом обязательств по производным финансовым инструментам, если размер активов превышает размер обязательств по производным финансовым инструментам |  | 100 |  |
| 2.23 | Акции, не обращающиеся на фондовых биржах, материальные активы, статьи, вычтенные из активов, принимаемых в качестве резерва филиала банка-нерезидента Республики Казахстан, накопленное вознаграждение, страховые активы, процентная ставка по просроченному долгу |  | 100 |  |
| 3 | Требуемые условные и возможные обязательства стабильного фондирования |  |  |  |
| 3.1 | безотзывные и условно-отзывные кредитные линии и линии ликвидности, предоставленные любым клиентам (доля от неиспользованного объема) |  | 5 |  |
| 3.2 | иные обязательства, включая следующие инструменты: безусловно отзывные кредитные линии и линии ликвидности; обязательства по торговому финансированию (включая гарантии и поручительства); гарантии и поручительства, не связанные с финансированием экспорта и импорта товаров и услуг; не контрактные обязательства, включая, возможные требования к выкупу долга, выпущенного филиалом банка-нерезидента Республики Казахстан (включая филиалы исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), или связанного с структурированными продуктами |  | 5 |  |
| 4 | Коэффициент нетто стабильного фондирования |  |  |  |

      Наименование \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Телефон \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Адрес электронной почты \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

      Исполнитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись, телефон

Руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

фамилия, имя и отчество (при его наличии) подпись

Дата "\_\_\_\_\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20\_\_ года

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение к форме отчета о расшифровке коэффициента нетто стабильного фондирования |

**Пояснение по заполнению формы административных данных**  
**Отчет о расшифровке коэффициента нетто стабильного фондирования**  
**(индекс - 1-BVU\_NFSR, периодичность - ежемесячная)**

**Глава 1. Общие положения**

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

      2. Форма разработана в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан" и подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике".

      3. Форма составляется ежемесячно филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан по состоянию на первое число каждого месяца.

      Сведения в Форме заполняются в тысячах тенге.

      4. Форму подписывают руководитель или лицо, на которое возложена функция по подписанию отчета.

**Глава 2. Пояснение по заполнению Формы**

      5. Форма заполняется в соответствии с постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка от 12 февраля 2021 года № 23 "Об установлении пруденциальных нормативов и иных обязательных к соблюдению норм и лимитов для филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), их нормативных значений и методики расчетов, включая порядок формирования активов филиалов банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалов исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан), принимаемых в качестве резерва, и их минимальный размер", зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 22213.

      6. При отсутствии сведений в отчетном периоде Форма не заполняется и не представляется.

|  |  |
| --- | --- |
|  | Приложение 20 к постановлению Правления Национального Банка Республики Казахстан от 2 марта 2021 года № 23 |

**Правила представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан)**

      Сноска. Приложение 20 - в редакции постановления Правления Национального Банка РК от 26.09.2023 № 67 (вводится в действие по истечении десяти календарных дней после дня его первого официального опубликования).

      1. Правила представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов банками второго уровня разработаны в соответствии с подпунктом 65-2) части второй статьи 15 Закона Республики Казахстан "О Национальном Банке Республики Казахстан", пунктом 1 статьи 54 Закона Республики Казахстан "О банках и банковской деятельности в Республике Казахстан", подпунктом 2) пункта 3 статьи 16 Закона Республики Казахстан "О государственной статистике" и определяют порядок представления отчетности о выполнении пруденциальных нормативов филиалами банков-нерезидентов Республики Казахстан (в том числе филиалами исламских банков-нерезидентов Республики Казахстан) в Национальный Банк Республики Казахстан.

      2. Отчетность представляется в электронном формате посредством использования информационной системы "Веб-портал Национального Банка Республики Казахстан".

      3. Отчетность, удостоверенная посредством электронной цифровой подписи руководителя или лица, на которое возложена функция по подписанию отчета, и исполнителем, хранится в электронном формате.

      4. При добровольной ликвидации филиала банка-нерезидента Республики Казахстан отчетность представляется в Национальный Банк Республики Казахстан до даты выдачи разрешения Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка (далее – уполномоченный орган) на добровольную ликвидацию филиала банка-нерезидента Республики Казахстан.

      5. При принудительной ликвидации филиала банка-нерезидента Республики Казахстан отчетность представляется в Национальный Банк Республики Казахстан до даты принятия уполномоченным органом решения о лишении лицензии филиала банка-нерезидента Республики Казахстан.

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