

**Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне қаржы нарығын реттеу мәселелері бойынша өзгерістер мен толықтыру енгізу туралы**

Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 2025 жылғы 16 мамырдағы № 14 қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2025 жылғы 20 мамырда № 36128 болып тіркелді

      Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігінің Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:**

      1. Осы қаулыға қосымшаға сәйкес Өзгерістер мен толықтыру енгізілетін Қазақстан Республикасының қаржы нарығын реттеу мәселелері бойынша нормативтік құқықтық актілерінің тізбесі (бұдан әрі – Тізбе) бекітілсін.

      2. Қаржы ұйымдарының әдіснамасы және пруденциялық реттеу департаменті Қазақстан Республикасының заңнамасында белгіленген тәртіппен:

      1) Заң департаментімен бірлесіп осы қаулыны Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркеуді;

      2) осы қаулыны ресми жарияланғаннан кейін Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігінің ресми интернет-ресурсына орналастыруды;

      3) осы қаулы мемлекеттік тіркелгеннен кейін он жұмыс күні ішінде Заң департаментіне осы тармақтың 2) тармақшасында көзделген іс-шараның орындалуы туралы мәліметтерді ұсынуды қамтамасыз етсін.

      3. Осы қаулының орындалуын бақылау Қазақстан Республикасының Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Төрағасының жетекшілік ететін орынбасарына жүктелсін.

      4. Осы қаулы алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі.

|  |  |
| --- | --- |
| *Қазақстан Республикасының*  *Қаржы нарығын реттеу және*  *дамыту Агенттігінің Төрағасы* | *М. Абылкасымова* |

      "КЕЛІСІЛДІ"

      Қазақстан Республикасы

      Стратегиялық жоспарлау

      және реформалар агенттігінің

      Ұлттық статистика бюросы

|  |  |
| --- | --- |
|  | Қазақстан Республикасының Қаржы нарығын реттеу және дамыту Агенттігінің  Басқармасының 2025 жылғы 16 мамырдағы № 14 Қаулыға  қосымша |

**Өзгерістер мен толықтыру енгізілетін Қазақстан Республикасының қаржы нарығын реттеу мәселелері бойынша нормативтік құқықтық актілерінің тізбесі**

      1. "Сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымының және сақтандыру тобының пруденциялық нормативтерінің және сақталуға міндетті өзге де нормалар мен лимиттердің нормативтік мәндерін және оларды есептеу әдістемелерін, сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары, сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдарының немесе сақтандыру холдингтерінің еншілес ұйымдары сатып алатын заңды тұлғалардың акцияларына (жарғылық капиталдағы қатысу үлестеріне) қойылатын талаптарды, сақтандыру холдингтері сатып алатын халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының тізбесін, сақтандыру холдингтері сатып алатын облигациялар үшін талап етілетін ең төмен рейтингті және рейтингтік агенттіктердің тізбесін, сондай-ақ сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары сатып алатын қаржы құралдарының (акциялар мен жарғылық капиталына қатысу үлестерін қоспағанда) тізбесін белгілеу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2016 жылғы 26 желтоқсандағы № 304 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 14794 болып тіркелген) мынадай өзгеріс енгізілсін:

      көрсетілген қаулымен бекітілген Сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымының және сақтандыру тобының пруденциялық нормативтерінің және сақталуға міндетті өзге де нормалар мен лимиттердің нормативтік мәндерінде және оларды есептеу әдістемелерінде:

      45-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

      "45. Сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары сақталуға міндетті мынадай өзге нормаларды сақтайды:

      1) сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары Қазақстан Республикасының резиденттері-сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдарына олар төлем қабілеттілігі маржасының жеткіліктілік нормативін сақтаған жағдайда ғана қайта сақтандыруға сақтандыру тәуекелдерін береді;

      2) РЕПО мәмілелері автоматты тәсілмен орындалады және күнтізбелік 30 (отыз) күннен аспайтын мерзімге (қор биржасының сауда жүйесінде) жасалады;

      3) 2025 жылғы 1 сәуірден бастап "РЕПО" операцияларының жиынтық баланстық құны жалпы сақтандыру резервтері сомасының 50 (елу) пайызынан аспайды, 2025 жылғы 1 шілдеден бастап жалпы сақтандыру резервтері сомасының 35 (отыз бес) пайызынан аспайды.".

      2. "Банктің пруденциялық нормативтерінің және сақталуы міндетті өзге де нормалары мен лимиттерінің нормативтік мәндері мен оларды есептеу әдістемелерін, капиталының мөлшерін және Ашық валюталық позицияны есептеу қағидалары мен оның лимиттерін белгілеу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2017 жылғы 13 қыркүйектегі № 170 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 15886 болып тіркелген) мынадай өзгерістер мен толықтыру енгізілсін:

      кіріспесі мынадай редакцияда жазылсын:

      "Қазақстан Республикасындағы банктер және банк қызметі туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 42-бабы 3-тармағына және "Мемлекеттік статистика туралы" Қазақстан Республикасының Заңына сәйкес, Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:**";

      Банктің пруденциялық нормативтерінің және сақталуы міндетті өзге де нормалары мен лимиттерінің нормативтік мәндері мен оларды есептеу әдістемелерінде, капиталының мөлшерінде:

      1-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

      "1. Банктің пруденциялық нормативтерінің және сақталуы міндетті өзге де нормалары мен лимиттерінің нормативтік мәндері мен оларды есептеу әдістемелері, капиталының мөлшері (бұдан әрі – Нормативтер) "Қазақстан Республикасындағы банктер және банк қызметі туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 42-бабы 3-тармағына сәйкес әзірленді және пруденциялық нормативтердің және банктің сақтауы міндетті өзге де нормалар мен лимиттердің нормативтік мәндері мен оларды есептеу әдістемелерін, капиталының мөлшерін белгілейді.

      Банктерге және олардың еншілес ұйымдарына арналған, шоғырландырылған қаржылық есептілік негізінде есептелетін нормативтік мәндер Банктер туралы заңның 42-бабына сәйкес белгіленеді.

      Нормативтік мәндер үтірден кейін үш таңбалы санмен көрсетіледі.

      Банктердің міндетті сақтауы үшін пруденциялық нормативтердің және банктің сақтауы міндетті өзге де нормалары мен капиталы мөлшері лимиттерінің құрамына:

      банктің жарғылық және меншікті капиталының ең төмен мөлшері;

      меншiктi капитал жеткiлiктiлiгінің коэффициенті;

      бір қарыз алушыға келетін тәуекелдің ең жоғары мөлшері;

      өтімділік коэффициенттері;

      өтімділікті және тұрақты қорландыру неттосын өтеу коэффициенттері;

      Қазақстан Республикасының бейрезиденттері алдындағы міндеттемелеріне банктердің капиталдандыруы;

      банк қаражатының бір бөлігін ішкі активтерге орналастыру коэффициенті;

      банктің қарыз алушысы борыш жүктемесінің коэффициенті;

      банк қарыз алушысының кірісіне қатысты борыш коэффиценті кіреді.";

      19-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

      "19. Кредиттік тәуекел дәрежесі бойынша мөлшерленетін активтерді, шартты және ықтимал міндеттемелерді есептеу Нормативтерге 5-қосымшаға сәйкес Салымдардың кредиттiк тәуекел дәрежесi бойынша мөлшерленген банк активтерiнiң кестесiне, Нормативтерге 5-1-қосымшаға сәйкес Борыштық жүктеме коэффициентін есептеу кезінде кепілсіз тұтынушылық қарыздар бойынша салымдардың кредиттік тәуекел дәрежесі бойынша мөлшерлеу коэффициенттерінің мәндеріне және Нормативтерге 6-қосымшаға сәйкес Банктің кредиттік тәуекел дәрежесі бойынша мөлшерленген шартты және ықтимал міндеттемелерінің кестесіне сәйкес жүргізіледі. Борыштық жүктеме коэффициентін есептеу кезінде кепілсіз тұтынушылық қарыздар бойынша салымдардың кредиттік тәуекел дәрежесі бойынша мөлшерлеу коэффициенттерінің мәндерін есептеу 2020 жылғы 1 қаңтардан кейін берілген кепілсіз тұтынушылық қарыздар бойынша жүзеге асырылады.

      Активтерді, шартты және ықтимал міндеттемелерді тәуекел дәрежесі бойынша мөлшерлеу мақсаттары үшін активтер, шартты және ықтимал міндеттемелер ХҚЕС-ке сәйкес құрылған резервтер сомасына азайтылады.

      Кредиттік тәуекел дәрежесі бойынша мөлшерленетін шартты және ықтимал міндеттемелер Нормативтерге 6-қосымшаға сәйкес Банктің кредиттік тәуекел дәрежесі бойынша мөлшерленген шартты және ықтимал міндеттемелерінің кестесіне сәйкес есептелген шартты және ықтимал міндеттемелер сомасының банк кредиттік тәуекелдер көтеретін тәуекелдің Нормативтерге 5-қосымшаға сәйкес Салымдардың кредиттiк тәуекел дәрежесi бойынша мөлшерленген банк активтерiнiң кестесiнде көрсетілген қарсы агенттің санатына сәйкес келетін дәрежесіне көбейтіндісі ретінде айқындалады.

      Своптар, фьючерстер, опциондар, форвардтар көрсетілген қаржы құралдарының нарықтық құнының және олар бойынша кредиттік тәуекел сомасын Нормативтерге 5-қосымшаға сәйкес Салымдардың кредиттiк тәуекел дәрежесi бойынша мөлшерленген банк активтерiнiң кестесiнде көрсетілген қарсы агент санатына сәйкес келетін тәуекел дәрежесіне көбейту жолымен кредиттік тәуекел ескеріле отырып мөлшерленген шартты және ықтимал міндеттемелер есебіне қосылады.

      Своп, фьючерс, опцион және форвард операциялары бойынша кредиттік тәуекел көрсетілген қаржы құралдарының номиналдық құнының Нормативтердің 7-қосымшасына сәйкес Туынды қаржы құралдарына арналған кредиттік тәуекел коэффициенттерiнiң кестесiнде көрсетілген және көрсетілген қаржы құралдарын өтеу мерзімімен айқындалатын кредиттік тәуекел коэффициентіне көбейтіндісі ретінде есептеледі.

      Орталық контрагенттің қатысуымен олар бойынша есептеу "төлемге қарсы жеткізілім" қағидаты бойынша жүзеге асырылатын бағалы қағаздар бойынша спот мәмілелер, және (немесе) олар бойынша есептеу "төлемге қарсы төлем" қағидаты бойынша жүзеге асырылатын валюта нарығындағы шетел валютасымен спот мәмілелер Нормативтерге 7-1-қосымшаға сәйкес спот мәмілелер бойынша Кредиттік тәуекел коэффициенттерінің кестесінде көрсетілген талаптар мен міндеттемелер арасындағы оң айырманы кредиттік тәуекел коэффициентіне көбейту арқылы, егер төлемдер есептеу күнінен кейін бес жұмыс күні ішінде жүргізілмеген жағдайда, кредиттік тәуекел дәрежесі ескеріле отырып сараланған шартты және ықтимал міндеттемелердің есебіне енгізіледі.

      Орталық контрагенттің қатысуымен олар бойынша есептеу "төлемге қарсы жеткізілім" қағидаты бойынша емем жүзеге асырылатын бағалы қағаздар бойынша спот мәмілелер, және (немесе) олар бойынша есептеу "төлемге қарсы төлем" қағидаты бойынша емес жүзеге асырылатын валюта нарығындағы шетел валютасымен спот мәмілелер, егер банк мәміленің бірінші бөлігін жасаған, бірақ мәміленің екінші бөлігі Нормативтерге 5-қосымшаға сәйкес Салымдардың кредиттік тәуекел дәрежесі бойынша сараланған банк активтерінің кестесінде көрсетілген контрагенттің тиісті санатының тәуекел дәрежесі бойынша сараланған талап мөлшерінде ол жасалған жұмыс күнінің соңына дейін аяқталмаған жағдайда, кредиттік тәуекел дәрежесі ескеріле отырып сараланған шартты және ықтимал міндеттемелердің есебіне енгізіледі.

      Есептеу күнінің мерзімдері бойынша талаптар бұзылмаған жоғарыда көрсетілген спот мәмілелерге қатысты кредиттік тәуекел дәрежесі 0 (нөлге) тең.

      Осы тармақта көрсетілген қаржы құралдарының нарықтық құны (ауыстыру құны):

      сатып алуға арналған мәмілелер бойынша - қаржы құралының номиналды келісімшарттық құнынан осы қаржы құралының ағымдағы нарықтық құнының асу шамасын білдіреді. Егер қаржы құралының ағымдағы нарықтық құны оның номиналды келісімшарттық құнынан аз немесе оған тең болса, ауыстыру құны 0 (нөлге) тең болады;

      сатуға арналған мәмілелер бойынша - қаржы құралының ағымдағы нарықтық құнынан осы қаржы құралының номиналды келісімшарттық құнының асу шамасын білдіреді. Егер қаржы құралының номиналды келісімшарттық құны оның ағымдағы нарықтық құнынан аз немесе оған тең болса, ауыстыру құны 0 (нөлге) тең болады.

      Бивалюталық қаржы құралдары (талабы мен міндеттемесі түрлі шетел валюталарында көрсетілген қаржы құралдары) бойынша ауыстыру құны есептілікті құру күніне белгіленген бағам бойынша айқындалған міндеттемелердің теңгемен баламасынан талаптардың теңгемен баламасының асу шамасы ретінде айқындалады. Егер талаптардың теңгемен баламасының шамасы міндеттемелердің теңгемен баламасынан аз немесе оған тең болса, ауыстыру құны 0 (нөлге) тең болады.

      Осы тармақта көрсетілген қаржы құралдарының номиналдық келісімшарттық құны бухгалтерлік есептің тиісті шоттарында мәмілелер жасалған күні көрсетілген қаржы құралдарының құнын білдіреді. Бивалюталық қаржы құралдарының номиналдық келісімшарттық құны ретінде банктің талаптары құрылатын валюта алынады.

      Сатылған опциондар кредиттік тәуекел ескеріле отырып сараланған шартты және ықтимал міндеттемелердің есебіне қосылмайды.

      Активтердің, шартты және ықтимал талаптардың және міндеттемелердің нарықтық тәуекелді есептегендегі есебі Нормативтердің, 22, 23, 24, 25, 26, 27, 28, 29, 30, 31, 32, 33 және 34-тармақтарына сәйкес жүргізіледі.

      Операциялық тәуекелдің есебі Нормативтердің 35-тармағына сәйкес жүргізіледі.

      Меншiктi капитал жеткiлiктiлiгінің k1, k1-2 және k2 коэффициенттерiн есептеу кезiнде салымдардың тәуекел дәрежесi бойынша сараланатын активтердiң мөлшерiнен банк кастодиан шарты негiзiнде сақтауға қабылдаған инвестицияланбаған қаражат қалдығы алып тасталады.

      Меншікті капитал буферлерін қоса алғанда, k1, k1-2 және k2 меншікті капитал жеткіліктілігі коэффициенттерінің ең төменгі мәндерін сақтау бойынша нормативтердің талаптары Банктер туралы заңға сәйкес қайта құрылымдауды жүзеге асыратын (жүзеге асырған), ірі акционері "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры" акционерлік қоғамы болып табылатын банктерге, сондай-ақ, егер уәкілетті орган мақұлдаған банктің қаржылық орнықтылығын арттыру, оның қаржылық жай-күйінің нашарлауына және банк қызметімен байланысты тәуекелдердің ұлғаюына жол бермеу жөніндегі ерте ден қою шараларын көздейтін іс-шаралар жоспарында k1, k1-2 және k2 меншікті капитал жеткіліктілігінің коэффициенттері және меншікті капитал жеткіліктілігі коэффициенттерінің мәндері қолданыста болатын мерзім айқындалса, жүйелік маңызы бар банктің өлшемшарттарына сәйкес келетін банктерге қолданылмайды.";

      57-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

      "57. Бір қарыз алушыға келетін, оның ішінде банктің тәуекел мөлшері:

      1) қарыздар, салымдар, дебиторлық берешек, бағалы қағаздар (Нормативтердің 11-тармағында көрсетілген инвестицияларды қоспағанда);

      2) Нормативтерге 6-қосымшаға сәйкес Банктің кредиттік тәуекел дәрежесі бойынша мөлшерленген шартты және ықтимал міндеттемелерінің кестесіне сәйкес есептелген шартты және ықтимал міндеттемелер;

      3) банкте олар бойынша секьюритилендірудің негіздемелік тәсілін қолдануға уәкілетті органның жазбаша растамасы жоқ қарыз алушыларға қатысты секьюритилендірілген активтер;

      4) секьюритилендіру позициялары;

      5) көрсетілген қаржы құралдары мен олар бойынша кредиттік тәуекелдің нарықтық құнының сомасы ретінде есептелген кредиттік тәуекел дәрежесі бойынша сараланған своптар, фьючерстер, опциондар, форвардтар түріндегі талаптар сомасы ретінде есептеледі.

      Своп, фьючерс, опцион және форвард операциялары бойынша кредиттік тәуекел көрсетілген қаржы құралдарының номиналдық құнының Нормативтерге 7-қосымшаға сәйкес Туынды қаржы құралдарына арналған кредиттік тәуекел коэффициенттерінің кестесінде көрсетілген және көрсетілген қаржы құралдарын өтеу мерзімімен айқындалатын кредиттік тәуекел коэффициентіне көбейтіндісі ретінде есептеледі.

      Осы тармақта көрсетілген қаржы құралдарының нарықтық құны (ауыстыру құны) мынаны:

      сатып алуға арналған мәмілелер бойынша – қаржы құралының ағымдағы нарықтық құнының осы қаржы құралының номиналдық келісімшарттық құнынан асу шамасын білдіреді. Егер қаржы құралының ағымдағы нарықтық құны оның номиналдық келісімшарттық құнынан аз немесе оған тең болса, ауыстыру құны 0 (нөлге) тең болады;

      сатуға арналған мәмілелер бойынша – қаржы құралының номиналдық келісімшарттық құнының осы қаржы құралының ағымдағы нарықтық құнынан асу шамасын білдіреді. Егер қаржы құралының номиналдық келісімшарттық құны оның ағымдағы нарықтық құнынан аз немесе оған тең болса, ауыстыру құны 0 (нөлге) тең болады.

      Бивалюталық қаржы құралдары (талабы мен міндеттемесі түрлі шетел валютасында көрсетілген қаржы құралдары) бойынша ауыстыру құны талаптардың теңгемен баламасының есептілікті жасау күні белгіленген бағам бойынша айқындалған міндеттемелердің теңгемен баламасынан асу шамасы ретінде айқындалады. Егер талаптардың теңгемен баламасының шамасы міндеттемелердің теңгемен баламасынан аз немесе оған тең болса, ауыстыру құны 0 (нөлге) тең болады.

      Осы тармақта көрсетілген қаржы құралдарының номиналдық келісімшарттық құны қаржы құралдарының бухгалтерлік есептің тиісті шоттарында мәмілелер жасау күні көрсетілген құнын білдіреді. Бивалюталық қаржы құралдарының номиналдық келісімшарттық құны ретінде банкте талаптар қалыптастырылатын валюта алынады.

      Сатылған опциондар бір қарыз алушыға келетін тәуекел мөлшеріне қосылмайды.

      Есеп айырысу "төлемге қарсы жеткізу" қағидаты бойынша жүзеге асырылатын бағалы қағаздар бойынша мәміленің споты және (немесе) есеп айырысу "төлемге қарсы төлем" қағидаты бойынша, оның ішінде орталық контрагенттің қатысуымен жүзеге асырылатын шетел валютасымен валюта нарығындағы мәміленің споты, егер төлемдер есеп айырысу күнінен кейін бес жұмыс күні ішінде жүргізілмеген жағдайда, бір қарыз алушыға келетін тәуекел есебіне қосылады.

      Есеп айырысу "төлемге қарсы жеткізу" қағидаты бойынша жүзеге асырылмайтын бағалы қағаздар бойынша мәміле споты және (немесе) есеп айырысу "төлемге қарсы төлем" қағидаты бойынша жүзеге асырылмайтын шетел валютасымен валюта нарығындағы мәміле споты, егер банк мәміленің бірінші бөлігін жасаған, бірақ мәміленің екінші бөлігі ол жасалған контрагенттің жұмыс күнінің соңына қарай неттингті ескере отырып талап мөлшерінде аяқталмаған жағдайда (неттинг туралы контрагентпен келісім болған кезде) бір қарыз алушыға келетін тәуекел есебіне қосылады;

      6) Нормативтерге 5-қосымшаға сәйкес Салымдардың кредиттік тәуекел дәрежесі бойынша мөлшерленген банк активтерінің кестесіне сәйкес кредиттік тәуекел ескеріле отырып мөлшерленген Қазақстан Республикасының резидент-банктеріне және Қазақстан Республикасының бейрезидент-банктеріне корреспонденттік шоттар бойынша талаптар;

      7) металл шоттар бойынша талаптар;

      мыналар:

      ХҚЕС-ке сәйкес қалыптастырылған резервтер сомасы, сондай-ақ осы міндеттемені қамтамасыз ету ретінде банк иелігіне берілген салымдар;

      Қазақстан Республикасының Үкіметі және Ұлттық Банк шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары;

      Standard & Poor’s (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "АА"-дан төмен емес тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингтік бағасы бар шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік бағалы қағаздары;

      тазартылған бағалы металдар;

      тауардың шығу тегі туралы сертификаты және құрамында кемінде 10 (он) пайыз таза алтынның бар екендігі туралы химиялық талдауы бар өңделмеген бағалы металдар (құйма түріндегі Доре қорытпасы);

      Қазақстан Республикасы Үкіметінің кепілдіктері;

      "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры" акционерлік қоғамының және "Бәйтерек" ұлттық басқарушы холдингі" акционерлік қоғамының, "ДАМУ" кәсіпкерлікті дамыту қоры" акционерлік қоғамының, "Қазақстанның Даму Банкі" акционерлік қоғамының кепілдіктері;

      Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің "А-"-дан төмен емес ұзақ мерзімді борыштық рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент-банктерінің кепілдіктері немесе Резервтік аккредитивтердің халықаралық практикасына (International Standby Practices, ISP98) немесе Талап ету бойынша кепілдіктер үшін біріздендірілген қағидаларға (Uniform Rules for Demand Guarantees, URDG758) сәйкес шығарылған резервтік аккредитивтері;

      Standard & Poor's агенттігінің (Стандарт энд Пурс) "А"-дан төмен емес ұзақ мерзімді борыштық рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар экспортты қолдау жөніндегі функцияларды жүзеге асыратын, шет мемлекеттердің қатысуымен құрылған сақтандыру ұйымдарымен және экспорттық-кредиттік агенттіктерімен жасалған сақтандыру төлемі бойынша міндеттемелерді шартсыз және қайтарымсыз орындау туралы тармақтарды қамтитын кепілдіктері мен сақтандыру шарттары;

      эмитенті "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры" акционерлік қоғамы, "Бәйтерек" ұлттық басқарушы холдингі" акционерлік қоғамы не олардың еншілес ұйымдары болып табылатын және банктің осындай қамтамасыз етуді шартсыз өндіріп алуға құқығы бар, банк сатып алған бағалы қағаздар бойынша банк шығарған және қамтамасыз ету ретінде берілген бағалы қағаздар;

      экспортты қолдау бойынша мемлекеттік кепілдігі бар Қазақстанның Экспорттық-кредиттік агенттігімен жасалған сақтандыру төлемі жөніндегі міндеттемелерді шартсыз және қайтарымсыз орындау туралы тармақтарды қамтитын бар сақтандыру шарттары түріндегі қарыз алушының міндеттемелері бойынша қамтамасыз ету сомасы шегеріле отырып есептеледі.

      Бір қарыз алушыға келетін тәуекел есебіне мыналар кірмейді:

      Қазақстан Республикасының Үкіметіне, Ұлттық Банкке, жеке тұлғалардың кәсіпкерлік қызметпен байланысты емес ипотекалық қарыздарын сатып алуды жүзеге асыратын, акцияларының 100 (жүз) пайызы Ұлттық Банкке тиесілі заңды тұлғаға, "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры" акционерлік қоғамына, "Бәйтерек" ұлттық басқарушы холдингі" акционерлік қоғамына қойылатын талаптар, банктің балансынан есептен шығарылған банктің қарыз алушыға қоятын талаптары, ХҚЕС-ке сәйкес резервтердің 100 (жүз) пайызы қалыптастырылған банктің қарыз алушыға қоятын талаптары;

      Қазақстан Республикасы Үкіметінің мемлекеттік кепілдігі бар бағалы қағаздар бойынша талаптар;

      банктің еншілес ұйымға қоятын талаптары;

      банктің Банктер туралы заңға сәйкес бұрын еншілес банк болған, қайта құрылымдауды және бір мезгілде активтер мен міндеттемелерді бас банкке беру операциясын жүзеге асырған заңды тұлғаға қоятын талаптары;

      2021 жылғы 1 шілдеден бастап қоса алғанда 2021 жылғы 31 желтоқсан аралығындағы кезеңде клиринг ұйымының (орталық контрагенттің) кепілді немесе резервтік қорларына жарна, маржалық жарна, қор биржасының сауда жүйесінде ашық сауда-саттық әдісімен және (немесе) орталық контрагенттің қатысуымен жасалған мәмілелер бойынша міндеттемелердің орындалуын толық және (немесе) ішінара қамтамасыз ету болып табылатын ақша түрінде қойылатын талаптар.".

      Өзгерістер мен толықтыру енгізілетін Қазақстан Республикасының қаржы нарығын реттеу мәселелері жөніндегі нормативтік құқықтық актілерінің тізбесіне (бұдан әрі – Тізбе) 1-қосымшаға сәйкес редакциядағы 7-1-қосымшамен толықтырылсын.

      3. "Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің түрлерін белгілеу, инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауы міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларын және әдістемесін бекіту туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 27 сәуірдегі № 79 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 17008 болып тіркелген) мынадай өзгерістер енгізілсін:

      көрсетілген қаулымен бекітілген Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға тиiстi пруденциялық нормативтердің мәндерін есеп айырысу қағидаларында:

      қосымша Тізбеге 2-қосымшаға сәйкес редакцияда жазылсын;

      көрсетілген қаулымен бекітілген Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесінде:

      6 және 7-тармақтар мынадай редакцияда жазылсын:

      "6. Инвестициялық портфельді басқарушының өтімділігі жоғары активтерінің есебіне осы қаулымен бекітілген Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларына (бұдан әрі – Қағидалар) қосымшаға сәйкес Инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің 11.1, 1.2, 1.4, 1.5, 1.6, 1.7, 1.8, 1.9, 1.10, 1.12, 1.13, 2.1, 2.2, 2.3, 2.4, 2.8, 2.10, 2.11, 2.14, 3.1, 3.2, 3.5, 4.4, 5.1, 5.2, 5.3, 5.4-жолдарында көрсетілген активтер (репо операцияларының мәні болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда) тиісті көлемдерде енгізіледі.

      Инвестициялық портфельді басқарушының өтімді активтері ретінде Қағидаларға қосымшаға сәйкес Инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің 1.3, 1.11, 2.5, 2.6, 2.7, 2.9, 2.12, 2.13, 2.15, 2.16, 3.3, 3.4, 3.6, 3.7, 4.1, 4.2, 4.3, 4.5-жолдарында көрсетілген активтер (репо операцияларының мәні болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда) тиісті көлемдерде танылады.

      Инвестициялық портфельді басқарушы әртараптандыру нормативін сақтайды, бұл ретте бір эмитентке және оның үлестес тұлғаларына инвестициялар көлемі инвестициялық портфельді басқарушының жиынтық өтімді активтерінің 20%-нан аспайды.

      Әдістеменің осы тармағының үшінші бөлігінде белгіленген норма Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарына, сондай-ақ орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздарға қатысты қолданылмайды.

      7. Әдістеменің 6-тармағында көзделген өтімділігі жоғары активтердің есебіне мыналар кірмейді:

      1) инвестициялық портфельді басқарушының міндеттемелері бойынша қамтамасыз ету болып табылатын және (немесе) инвестициялық портфельді басқарушының меншік құқығы шектелген активтер (репо операцияларын қоспағанда).

      "Кері репо" операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес Инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген көлемде инвестициялық портфельді басқарушының өтімді активтерінің есебіне (орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда) қосылады.

      Орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздар инвестициялық портфельді басқарушының өтімді активтерінің есебіне толық көлемде қосылады.

      Репо операцияларының мәні болып табылатын бағалы қағаздар репо операцияларының мәні болып табылатын бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 70% мөлшерінде инвестициялық портфельді басқарушының өтімді активтерінің есебіне қосылады.

      Репо операцияларының мәні болып табылатын есепті күнгі жағдай бойынша өтелгенге дейінгі мерзімі 1 (бір) жылдан асатын мемлекеттік бағалы қағаздар инвестициялық портфельді басқарушының өтімді активтерінің есебіне репо операцияларының мәні болып табылатын есепті күнгі жағдай бойынша өтелгенге дейінгі мерзімі 1 (бір) жылдан асатын мемлекеттік бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 85%-ы мөлшерінде енгізіледі.

      Репо операцияларының мәні болып табылатын есепті күнгі жағдай бойынша өтелгенге дейінгі мерзімі 1 (бір) жылға дейінгі мемлекеттік бағалы қағаздар инвестициялық портфельді басқарушының өтімді активтерінің есебіне репо операцияларының мәні болып табылатын есепті күнгі жағдай бойынша өтелгенге дейінгі мерзімі 1 (бір) жылға дейінгі мемлекеттік бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 95%-ы мөлшерінде енгізіледі.

      Репо операцияларының мәні болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес Инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің 6.3, 6.4, 6.5-жолдарында көрсетіледі;

      2) өлшемдері қор биржасының акциялары нарығының индексін (қор биржасының өкілдік тізімі) есептеу мақсатында пайдаланылатын қор биржасының ресми тізіміне кіретін акцияларды қоспағанда, инвестициялық портфельді басқарушыға қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын заңды тұлғалар шығарған бағалы қағаздар.".

      4. "Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің түрлерін белгілеу, бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауы міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларын және әдістемесін бекіту туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 27 сәуірдегі № 80 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 17005 болып тіркелген) мынадай өзгерістер енгізілсін:

      көрсетілген қаулымен бекітілген Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларында:

      қосымша Тізбеге 3-қосымшаға сәйкес редакцияда жазылсын;

      көрсетілген қаулымен бекітілген Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесінде:

      6 және 7-тармақтар мынадай редакцияда жазылсын:

      "6. Брокердің және (немесе) дилердің өтімділігі жоғары активтерінің есебіне осы қаулымен бекітілген Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларына (бұдан әрі – Қағидалар) қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу кестесінің 1.1, 1.2, 1.4, 1.5, 1.6, 1.7, 1.8, 1.9, 1.10, 1.12, 1.13, 2.1, 2.2, 2.3, 2.4, 2.8, 2.10, 2.11, 2.14, 3.1, 3.2, 3.5, 4.4, 5.1, 5.2, 5.3, 5.4-жолдарында көрсетілген активтер (репо операцияларының мәні болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда) тиісті көлемдерде енгізіледі.

      Қағидаларға қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу кестесінің 1.3, 1.11, 2.5, 2.6, 2.7, 2.9, 2.12, 2.13, 2.15, 2.16, 3.3, 3.4, 3.6, 3.7, 4.1, 4.2, 4.3, 4.5-жолдарында тиісті көлемдерде көрсетілген активтер (репо операцияларының мәні болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда) брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтері ретінде танылады.

      Брокер және (немесе) дилер бір эмитентке және оның үлестес тұлғаларына инвестициялар көлемі брокердің және (немесе) дилердің жиынтық өтімді активтерінің 20%-нан аспайтын әртараптандыру нормативін сақтайды.

      Әдістеменің осы тармағының үшінші бөлігінде белгіленген норма Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарына, сондай-ақ орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарға қатысты қолданылмайды.

      7. Әдістеменің 6-тармағында көзделген өтімділігі жоғары және өтімді активтердің есебіне мыналар енгізілмейді:

      1) брокердің және (немесе) дилердің міндеттемелері бойынша қамтамасыз ету болып табылатын және (немесе) брокердің және (немесе) дилердің меншік құқығы шектелген активтер (репо операцияларын қоспағанда).

      "Кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген көлемдерде брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтерінің есебіне енгізіледі (орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда).

      Орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтерінің есебіне толық көлемде енгізіледі;

      Репо операцияларының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар репо операцияларының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 70%-ы мөлшерінде брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтерінің есебіне енгізіледі;

      Репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылдан астам өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылдан астам өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 85%-ы мөлшерінде брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтерінің есебіне енгізіледі;

      Репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылға дейін өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылға дейін өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 95%-ы мөлшерінде брокердің және (немесе) дилердің өтімді активтерінің есебіне енгізіледі.

      Репо операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің 6.3, 6.4, 6.5-жолдарында көрсетіледі.

      2) өлшемдері қор биржасы акциялар нарығының индексін (қор биржасының өкілдік тізімі) есептеу мақсатында пайдаланылатын қор биржасының ресми тізіміне кіретін акцияларды қоспағанда, брокерге және (немесе) дилерге қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын заңды тұлғалар шығарған бағалы қағаздар жатады.";

      17 және 18-тармақтар мынадай редакцияда жазылсын:

      "17. Қағидаларға қосымшаға сәйкес тиісті көлемдерде Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің мынадай жолдарында көрсетілген активтер 1-ИПБ немесе 2-ИПБ жоғары өтімді активтерінің есебіне енгізіледі: 1.1, 1.2, 1.4, 1.5, 1.6, 1.7, 1.8, 1.9, 1.10, 1.12, 1.13, 2.1, 2.2, 2.3, 2.4, 2.8, 2.10, 2.11, 2.14, 3.1, 3.2, 3.5, 4.4, 5.1, 5.2, 5.3, 5.4. (репо операцияларының нысаны болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда).

      Қағидаларға қосымшаға сәйкес бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің мынадай жолдарында көрсетілген активтер 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтері ретінде танылады: 1.3, 1.11, 2.5, 2.6, 2.7, 2.9, 2.12, 2.13, 2.15, 2.16, 3.3, 3.4, 3.6, 3.7, 4.1, 4.2, 4.3, 4.5 (репо операцияларының мәні болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда).

      1-ИПБ немесе 2-ИПБ бір эмитентке және оның үлестес тұлғаларына инвестициялар көлемі 1-ИПБ немесе 2-ИПБ жиынтық өтімді активтерінің 20%-нан аспайтын әртараптандыру нормативін сақтайды.

      Әдістеменің осы тармағының үшінші бөлігінде белгіленген норма Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарына, сондай-ақ орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарға қатысты қолданылмайды.

      18. Әдістеменің 17-тармағында көзделген 1-ИПБ немесе 2-ИПБ жоғары өтімді және өтімді активтерінің есебіне мыналар енгізілмейді:

      1) 1-ИПБ немесе 2-ИПБ міндеттемелері бойынша қамтамасыз ету болып табылатын және (немесе) 1-ИПБ немесе 2-ИПБ меншік құқығы шектелген активтер (репо операцияларын қоспағанда).

      "Кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес (орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарды есепке алмағанда) Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымның пруденциялық нормативтер мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген көлемде 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтерінің есебіне енгізіледі.

      Орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтерінің есебіне толық көлемде енгізіледі;

      Репо операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар репо операцияларының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 70%-ы мөлшерінде 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтерінің есебіне енгізіледі;

      Репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылдан астам өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылдан астам өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 85%-ы мөлшерінде 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтерінің есебіне енгізіледі;

      Репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылға дейін өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар репо операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылға дейін өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздардың жиынтық көлемінің 95%-ы мөлшерінде 1-ИПБ немесе 2-ИПБ өтімді активтерінің есебіне енгізіледі.

      Репо операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес 1-ИПБ немесе 2-ИПБ пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің 6.3, 6.4, 6.5-жолында көрсетіледі.

      2) өлшемдері қор биржасының акциялар нарығының индексін есептеу мақсатында пайдаланылатын қор биржасының ресми тізіміне кіретін акцияларды қоспағанда, 1-ИПБ немесе 2-ИПБ-ге қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын заңды тұлғалар шығарған бағалы қағаздар (қор биржасының өкілдік тізімі).".

|  |  |
| --- | --- |
|  | Өзгерістер мен толықтыру  енгізілетін Қазақстан Республикасының  қаржы нарығын реттеу  мәселелері бойынша нормативтік құқықтық  актілерінің тізбесіне  1-қосымша |
|  | Банктің пруденциялық  нормативтерінің және сақталуы  міндетті өзге де нормалары мен  лимиттерінің нормативтік  мәндері мен оларды есептеу әдістемесіне, капиталының мөлшеріне 7-1-қосымша |

**Спот мәмілелер бойынша кредиттік тәуекел коэффициенттерінің кестесі**

|  |  |
| --- | --- |
| Есептеу күнінен кейінгі жұмыс күндерінің саны | Тәуекел коэффициенті пайызбен |
| 5-тен 15-ке дейін | 8 |
| 16-дан 30-ға дейін | 50 |
| 31-ден 45-ке дейін | 75 |
| 46 және одан артық | 100 |

|  |  |
| --- | --- |
|  | Өзгерістер мен толықтыру  енгізілетін Қазақстан Республикасының  қаржы нарығын реттеу  мәселелері бойынша нормативтік құқықтық актілерінің тізбесіне  2-қосымша |
|  | Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларына  қосымша |

**Инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесі**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Көрсеткіштің атауы | Баланс бойынша сомасы | Есепке алынатын көлем (пайызбен) | Есептеу сомасы |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 | Ақша және салымдардың барлығы, оның ішінде: |  |  |  |
| 1.1 | инвестициялық портфельді басқарушының балансы бойынша активтер сомасының 10 (он) пайызынан аспайтын сомадағы кассадағы ақша |  | 100 |  |
| 1.2 | осы қосымшаның 1.9 және 1.10-жолдарында көрсетілген Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің ағымдағы шоттарындағы ақша |  | 100 |  |
| 1.3 | осы қосымшаның 1.11-жолында көрсетілген Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің ағымдағы шоттарындағы ақша |  | 90 |  |
| 1.4 | қызметін Қазақстан Республикасының аумағында жүзеге асыратын немесе "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін орталық депозитарийдегі шоттардағы ақша |  | 100 |  |
| 1.5 | инвестициялық портфельді басқарушының клирингтік ұйымның (орталық контрагенттің) кепілдік немесе резервтік қорларына жарналар, маржалық жарналар, қор биржасының сауда жүйесінде ашық сауда-саттық әдісімен және (немесе) орталық контрагенттің қатысуымен жасалған мәмілелер бойынша міндеттемелердің орындалуын толық және (немесе) ішінара қамтамасыз ету болып табылатын ақшасы |  | 100 |  |
| 1.6 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВВ-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент-банктеріндегі ағымдағы шоттардағы ақша |  | 100 |  |
| 1.7 | "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасының Заңы 59-бабының 1-тармағында белгіленген функцияларды жүзеге асыратын, Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВВ"-ден төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент-ұйымдарындағы шоттардағы ақша |  | 100 |  |
| 1.8 | Бағалы қағаздарға қызмет көрсету мәселелері бойынша халықаралық қауымдастықтың мүшесі болып табылатын Қазақстан Республикасының бейрезидент-ұйымдарындағы шоттардағы ақша (International Securities Services Association) (Интернэшнл Секьюритис Сервисис Асошиайшн) |  | 100 |  |
| 1.9 | Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктері қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторының "премиум" санатына енгізілген эмитенттер немесе акциялары қор биржасы индексінің өкілдік тізіміндегі эмитенттер болып табылатын жағдайда, осы банктердегі салымдар |  | 100 |  |
| 1.10 | Мына талаптардың біреуіне сәйкес келетін, Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар: банктердің Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В"-ден төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzBB+"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар; Қазақстан Республикасының бейрезидент-бас банктері Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "А-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының резидент-еншілес банктері болып табылады |  | 100 |  |
| 1.11 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "В-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzBB"-дан "kzBB-"-ға дейін рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар |  | 90 |  |
| 1.12 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "АА-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингi бар халықаралық қаржы ұйымдарындағы салымдар, Еуразия даму банкіндегі Қазақстан Республикасының ұлттық валютасындағы салымдар |  | 100 |  |
| 1.13 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВВ-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар бейрезидент-банктердегі салымдар |  | 100 |  |
| 2 | Борыштық бағалы қағаздар – барлығы, оның ішінде: |  |  |  |
| 2.1 | Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі мен Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған, басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмиссияланғандарды қоса алғанда, Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары |  | 100 |  |
| 2.2 | қызметін Қазақстан Республикасының аумағында жүзеге асыратын қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған борыштық бағалы қағаздар |  | 100 |  |
| 2.3 | акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне тиесілі, кәсіпкерлік қызметпен байланысты емес жеке тұлғалардың ипотекалық қарыздарын сатып алуды жүзеге асыратын заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар |  | 100 |  |
| 2.4 | Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес "Қазақстан Даму банкі", "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры", "Бәйтерек" ұлттық басқарушы холдингі", "Проблемалық кредиттер қоры" акционерлік қоғамдары шығарған борыштық бағалы қағаздар |  | 100 |  |
| 2.5 | Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары, немесе қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізу үшін қор биржасының талаптарына сәйкес келетін, "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасында жария сауда-саттыққа жіберілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 90 |  |
| 2.6 | сомасы осы мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздардың номиналдық құнының кемінде 50 (елу) пайызын өтейтін, "ДАМУ" кәсіпкерлікті дамыту қоры" акционерлік қоғамының және (немесе) "Қазақстан Даму банкі"акционерлік қоғамының кепілдіктері бар, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" не "Баламалы" алаңдары "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасының Кәсіпкерлік кодексіне сәйкес шағын немесе орта кәсіпкерлікке жатқызылған субъектілер шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар |  | 95 |  |
| 2.7 | Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңының "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары немесе қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңы "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізу үшін қор биржасының талаптарына сәйкес келетін, "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасында жария сауда-саттыққа жіберілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 60 |  |
| 2.8 | Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВ-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингi немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) ұлттық шкаласы бойынша "kzA-"-тен төмен емес рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегi рейтингi бар Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 100 |  |
| 2.9 | Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В+"-тен "В-"-ке дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) ұлттық шкаласы бойынша "kzBBB+"-тен "kzBB-"-ке дейінгі рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 85 |  |
| 2.10 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің "АА-"-тен төмен емес халықаралық рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингi бар халықаралық қаржы ұйымдары шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар, сондай-ақ Еуразия Даму Банкі шығарған және Қазақстан Республикасының ұлттық валютасында номинирленген бағалы қағаздар |  | 100 |  |
| 2.11 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВВ-"-тен төмен емес тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингi бар шет мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары |  | 100 |  |
| 2.12 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВ+"-тен "ВВ-"-ке дейін тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингi бар шет мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары |  | 90 |  |
| 2.13 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В+"-тен "В-"-ке дейін тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингi бар шет мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары |  | 80 |  |
| 2.14 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВВ-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің рейтингi (эмитетінде бар) бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 100 |  |
| 2.15 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВ+"-тен "ВВ-"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің рейтингi (эмитетінде бар) бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 85 |  |
| 2.16 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В+"-тен "В-"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің рейтингi (эмитентінде бар) бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 70 |  |
| 3 | Акциялар және депозитарлық қолхаттар – барлығы, оның ішінде: |  |  |  |
| 3.1 | Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының және негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 100 |  |
| 3.2 | заңды тұлғалардың қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторы "премиум" санатының талаптарына сәйкес келетін акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 100 |  |
| 3.3 | Қазақстан Республикасының резидент-заңды тұлғаларының қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторының "стандарт" санатына енгізілген акциялары немесе Қазақстан Республикасының резидент-заңды тұлғаларының "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, жария сауда-саттыққа жіберілген акциялары және осы қосымшаның 3.4-жолында көрсетілген, базалық активі осы акциялар болып табылатын акциялар мен депозитарлық қолхаттарды қоспағанда, базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 80 |  |
| 3.4 | Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңы "акциялар" секторына енгізілген акциялары немесе Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін, жария сауда-саттыққа жіберілген қор биржасының "Өңірлік акциялар нарығының сегменті" ресми тізімінің кіші бөліміне енгізілген акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 60 |  |
| 3.5 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВВ-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 100 |  |
| 3.6 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВ+"-тен "ВВ-"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 80 |  |
| 3.7 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В+"-тен "В-"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 60 |  |
| 4 | Өзге бағалы қағаздар – барлығы, оның ішінде: |  |  |  |
| 4.1 | инвестициялық қорлардың қор биржасының ресми тізіміне енгізілген бағалы қағаздары |  | 70 |  |
| 4.2 | активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын немесе пайлары бойынша баға белгілеу негізгі қор индекстеріне байланыстырылған Exchange Traded Funds (ETF) (Эксчейндж Трэйдэд Фандс) пайлары |  | 90 |  |
| 4.3 | Morningstar рейтингтік агенттігінің "3 жұлдыздан" төмен емес рейтингтік бағасы бар Exchange Traded Funds (ETF) (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange Traded Commodities (ETC) (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (ETN) (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс) пайлары |  | 80 |  |
| 4.4 | орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар |  | 100 |  |
| 4.5 | активтерінің құрамы Қазақстан Республикасының Кәсіпкерлік кодексіне сәйкес шағын немесе орта кәсіпкерлікке жатқызылған субъектілер шығарған, тек қана мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар есебінен қалыптастырылған, олар бойынша "ДАМУ" кәсіпкерлікті дамыту қоры" акционерлік қоғамының және (немесе) "Қазақстанның Даму Банкі" акционерлік қоғамының кепілдігі бар, сомасы қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, осы мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздардың номиналды құнының кемінде 50 (елу) пайызын өтейтін инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары |  | 95 |  |
| 5 | Өзге активтер – барлығы, оның ішінде: |  |  |  |
| 5.1 | тазартылған бағалы металдар және металл шоттар |  | 100 |  |
| 5.2 | бағалы қағаздар нарығында кәсіби қызметті жүзеге асыру шеңберінде есептелген, бірақ төленбеген комиссиялық сыйақы бойынша (шарт талаптары бойынша мерзімі өтпеген) дебиторлық берешек (Ұйымның үлестес тұлғаларының дебиторлық берешегін қоспағанда) - Ұйымның балансы бойынша активтер сомасының 10 (он) пайызынан аспайтын сомада |  | 100 |  |
| 5.3 | бағалы қағаздар эмитенттеріне бағалы қағаздар шығарылымы проспектісінде көзделген олардың айналыс мерзімінің өтуіне байланысты туындаған (бағалы қағаздар шығарылымы проспектісінің талаптары бойынша мерзімі өтпеген) бағалы қағаздардың номиналдық құнын төлеуге қойылатын талаптар |  | 100 |  |
| 5.4 | Ұйымның балансы бойынша активтер сомасының 5 (бес) пайызынан аспайтын сомада жылжымайтын мүлік түріндегі Ұйымның негізгі құралдары |  | 100 |  |
| 6 | Жиынтық өтімді активтер |  |  |  |
| 6.1 | Өтімді активтер |  |  |  |
| 6.2 | Өтімділігі жоғары активтер |  |  |  |
| 6.3 | "Репо" операцияларының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар (мемлекеттік бағалы қағаздарды қоспағанда) |  | 70 |  |
| 6.4 | "Репо" операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылға дейін өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар |  | 95 |  |
| 6.5 | "Репо" операцияларының нысанасы болып табылатын есептік күнге 1 (бір) жылдан астам өтелгенге дейінгі мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар |  | 85 |  |
| 7 | Баланс бойынша жиынтық міндеттемелер, соның ішінде |  |  |  |
| 7.1 | 7 күнге дейін |  |  |  |
| 7.2 | 30 күнге дейін |  |  |  |
| 7.3 | 90 күнге дейін |  |  |  |
| 8 | Меншікті капиталдың ең төменгі мөлшері |  |  |  |
| 8.1 | ИПБ От |  |  |  |
| 8.2 | БД От |  |  |  |
| 9 | Меншікті капиталдың жеткіліктілік коэффициенті |  |  |  |
| 10 | Мерзімді өтімділік коэффициенті: |  |  |  |
| 10.1 | К2-1 |  |  |  |
| 10.2 | К2-2 |  |  |  |
| 10.3 | К2-3 |  |  |  |
| 10.4 | К2-4 |  |  |  |

|  |  |
| --- | --- |
|  | Өзгерістер мен толықтыру  енгізілетін Қазақстан Республикасының  қаржы нарығын реттеу  мәселелері бойынша нормативтік құқықтық  актілерінің тізбесіне  3-қосымша |
|  | Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларына қосымша |

**Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесі**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| № | Көрсеткіштің атауы | Баланс бойынша сомасы | Есепке алынатын көлемі (пайызбен) | Есептеу сомасы |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 1 | Ақша және салымдардың барлығы, оның ішінде: |  |  |  |
| 1.1 | Ұйымның балансы бойынша активтер сомасының 10 (он) пайызынан аспайтын сомадағы кассадағы ақша |  | 100 |  |
| 1.2 | осы қосымшаның 1.9 және 1.10-жолдарында көрсетілген Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің ағымдағы шоттарындағы ақша |  | 100 |  |
| 1.3 | осы қосымшаның 1.11-жолында көрсетілген Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің ағымдағы шоттарындағы ақша |  | 90 |  |
| 1.4 | қызметін Қазақстан Республикасының аумағында жүзеге асыратын немесе "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін орталық депозитарийдегі шоттардағы ақша |  | 100 |  |
| 1.5 | Ұйымның клиринг ұйымының (орталық контрагенттің) кепілдік немесе резервтік қорларына жарналар, маржалық жарналар, қор биржасының сауда жүйесінде ашық сауда-саттық әдісімен және (немесе) орталық контрагенттің қатысуымен жасалған мәмілелер бойынша міндеттемелердің орындалуын толық және (немесе) ішінара қамтамасыз ету болып табылатын ақшасы |  | 100 |  |
| 1.6 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВВ-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент-банктеріндегі ағымдағы шоттардағы ақша |  | 100 |  |
| 1.7 | "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасының Заңы 59-бабының 1-тармағында белгіленген функцияларды жүзеге асыратын, Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВВ"-ден төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент-ұйымдарындағы шоттардағы ақша |  | 100 |  |
| 1.8 | бағалы қағаздарға қызмет көрсету мәселелері бойынша халықаралық қауымдастықтың мүшесі болып табылатын Қазақстан Республикасының бейрезидент-ұйымдарындағы шоттардағы ақша (International Securities Services Association) (Интернэшнл Секьюритис Сервисис Асошиайшн) |  | 100 |  |
| 1.9 | Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктері қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторының "премиум" санатына енгізілген эмитенттер немесе акциялары қор биржасы индексінің өкілдік тізіміндегі эмитенттер болып табылатын жағдайда, осы банктердегі салымдар |  | 100 |  |
| 1.10 | мына талаптардың біреуіне сәйкес келетін, Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар:  Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В"-ден төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzBB+"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар;  Қазақстан Республикасының бейрезидент-бас банктері Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "А-"-тен төмен емес шетел валютасында ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының резидент-еншілес банктері болып табылады |  | 100 |  |
| 1.11 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzBB"-дан "kzBB-"-ға дейін рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар |  | 90 |  |
| 1.12 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің "АА-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингi бар халықаралық қаржы ұйымдарындағы салымдар, Еуразия даму банкіндегі Қазақстан Республикасының ұлттық валютасындағы салымдар |  | 100 |  |
| 1.13 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВВ-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар бейрезидент-банктердегі салымдар |  | 100 |  |
| 2 | Борыштық бағалы қағаздар – барлығы, оның ішінде: |  |  |  |
| 2.1 | Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі мен Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған, басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмиссияланғандарды қоса алғанда, Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары |  | 100 |  |
| 2.2 | қызметін Қазақстан Республикасының аумағында жүзеге асыратын қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған борыштық бағалы қағаздар |  | 100 |  |
| 2.3 | акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне тиесілі, кәсіпкерлік қызметпен байланысты емес жеке тұлғалардың ипотекалық қарыздарын сатып алуды жүзеге асыратын заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар |  | 100 |  |
| 2.4 | Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес "Қазақстан Даму банкі", "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры", "Бәйтерек" ұлттық басқарушы холдингі", "Проблемалық кредиттер қоры" акционерлік қоғамдары шығарған борыштық бағалы қағаздар |  | 100 |  |
| 2.5 | Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары, немесе қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізу үшін қор биржасының талаптарына сәйкес келетін, "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасында жария сауда-саттыққа жіберілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 90 |  |
| 2.6 | сомасы осы мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздардың номиналдық құнының кемінде 50 (елу) пайызын өтейтін, "ДАМУ" кәсіпкерлікті дамыту қоры" акционерлік қоғамының және (немесе) "Қазақстан Даму банкі" акционерлік қоғамының кепілдіктері бар, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" не "Баламалы" алаңдары "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасының Кәсіпкерлік кодексіне сәйкес шағын немесе орта кәсіпкерлікке жатқызылған субъектілер шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар |  | 95 |  |
| 2.7 | Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңының "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары немесе қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңы "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізу үшін қор биржасының талаптарына сәйкес келетін, "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасында жария сауда-саттыққа жіберілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 60 |  |
| 2.8 | Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВ-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингi немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) ұлттық шкаласы бойынша "kzA-"-тен төмен емес рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегi рейтингi бар (эмитентінің рейтингі бар) Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 100 |  |
| 2.9 | Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В+"-тен "В-"-ке дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) ұлттық шкаласы бойынша "kzBBB+"-тен "kzBB-"-ке дейінгі рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 85 |  |
| 2.10 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің "АА-"-тен төмен емес халықаралық рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингi бар халықаралық қаржы ұйымдары шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар, сондай-ақ Еуразия Даму Банкі шығарған және Қазақстан Республикасының ұлттық валютасында номинирленген бағалы қағаздар |  | 100 |  |
| 2.11 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВВ-"-тен төмен емес тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингi бар шет мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары |  | 100 |  |
| 2.12 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВ+"-тен "ВВ-"-ке дейін тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингi бар шет мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары |  | 90 |  |
| 2.13 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В+"-тен "В-"-ке дейін тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингi бар шет мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары |  | 80 |  |
| 2.14 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВВ-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің рейтингi (эмитетінде бар) бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 100 |  |
| 2.15 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВ+"-тен "ВВ-"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің рейтингi (эмитетінде бар) бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 85 |  |
| 2.16 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В+"-тен "В-"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің рейтингi (эмитентінде бар) бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары |  | 70 |  |
| 3 | Акциялар және депозитарлық қолхаттар – барлығы, оның ішінде: |  |  |  |
| 3.1 | Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының және негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 100 |  |
| 3.2 | заңды тұлғалардың қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторы "премиум" санатының талаптарына сәйкес келетін акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 100 |  |
| 3.3 | Қазақстан Республикасының резидент-заңды тұлғаларының қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторының "стандарт" санатына енгізілген акциялары немесе Қазақстан Республикасының резидент-заңды тұлғаларының "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, жария сауда-саттыққа жіберілген акциялары және осы қосымшаның 3.4-жолында көрсетілген, базалық активі осы акциялар болып табылатын акциялар мен депозитарлық қолхаттарды қоспағанда, базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 80 |  |
| 3.4 | Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңы "акциялар" секторына енгізілген акциялары немесе Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін, жария сауда-саттыққа жіберілген қор биржасының "Өңірлік акциялар нарығының сегменті" ресми тізімінің кіші бөліміне енгізілген акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 60 |  |
| 3.5 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВВ-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 100 |  |
| 3.6 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВ+"-тен "ВВ-"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 80 |  |
| 3.7 | Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "В+"-тен "В-"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар |  | 60 |  |
| 4 | Өзге бағалы қағаздар – барлығы, оның ішінде: |  |  |  |
| 4.1 | инвестициялық қорлардың қор биржасының ресми тізіміне енгізілген бағалы қағаздары |  | 70 |  |
| 4.2 | активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын немесе пайлары бойынша баға белгілеу негізгі қор индекстеріне байланыстырылған Exchange Traded Funds (ETF) (Эксчейндж Трэйдэд Фандс) пайлары |  | 90 |  |
| 4.3 | Morningstar рейтингтік агенттігінің "3 жұлдыздан" төмен емес рейтингтік бағасы бар Exchange Traded Funds (ETF) (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange Traded Commodities (ETC) (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (ETN) (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс) пайлары |  | 80 |  |
| 4.4 | орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар |  | 100 |  |
| 4.5 | активтерінің құрамы Қазақстан Республикасының Кәсіпкерлік кодексіне сәйкес шағын немесе орта кәсіпкерлікке жатқызылған субъектілер шығарған, тек қана мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар есебінен қалыптастырылған, олар бойынша "ДАМУ" кәсіпкерлікті дамыту қоры" акционерлік қоғамының және (немесе) "Қазақстанның Даму Банкі" акционерлік қоғамының кепілдігі бар, сомасы қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, осы мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздардың номиналды құнының кемінде 50 (елу) пайызын өтейтін инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары |  | 95 |  |
| 5 | Өзге активтер – барлығы, оның ішінде: |  |  |  |
| 5.1 | тазартылған бағалы металдар және металл шоттар |  | 100 |  |
| 5.2 | бағалы қағаздар нарығында кәсіби қызметті жүзеге асыру шеңберінде есептелген, бірақ төленбеген комиссиялық сыйақы бойынша (шарт талаптары бойынша мерзімі өтпеген) дебиторлық берешек (Ұйымның үлестес тұлғаларының дебиторлық берешегін қоспағанда) - Ұйымның балансы бойынша активтер сомасының 10 (он) пайызынан аспайтын сомада |  | 100 |  |
| 5.3 | бағалы қағаздар эмитенттеріне бағалы қағаздар шығарылымы проспектісінде көзделген олардың айналыс мерзімінің өтуіне байланысты туындаған (бағалы қағаздар шығарылымы проспектісінің талаптары бойынша мерзімі өтпеген) бағалы қағаздардың номиналдық құнын төлеуге қойылатын талаптар |  | 100 |  |
| 5.4 | Ұйымның балансы бойынша активтер сомасының 5 (бес) пайызынан аспайтын сомада жылжымайтын мүлік түріндегі Ұйымның негізгі құралдары |  | 100 |  |
| 6 | Жиынтық өтімді активтер |  |  |  |
| 6.1 | Өтімді активтер |  |  |  |
| 6.2 | Өтімділігі жоғары активтер |  |  |  |
| 6.3 | "Репо" операцияларының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар (мемлекеттік бағалы қағаздарды қоспағанда) |  | 70 |  |
| 6.4 | "Репо" операцияларының нысанасы болып табылатын, өтеу мерзімі есептік күнге дейін 1 (бір) жылға дейін өтеу мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар |  | 95 |  |
| 6.5 | "Репо" операцияларының нысанасы болып табылатын, өтеу мерзімі есептік күнге дейін 1 (бір) жылдан астам өтеу мерзімі бар мемлекеттік бағалы қағаздар |  | 85 |  |
| 7 | Баланс бойынша жиынтық міндеттемелер, соның ішінде: |  |  |  |
| 7.1 | 7 күнге дейін |  |  |  |
| 7.2 | 30 күнге дейін |  |  |  |
| 7.3 | 90 күнге дейін |  |  |  |
| 7.4 | Маржалық қамтамасыз ету бойынша міндеттемелер |  |  |  |
| 8 | Меншікті капиталдың ең төменгі мөлшері |  |  |  |
| 8.1 | ИПБ\_От |  |  |  |
| 8.2 | БД\_От |  |  |  |
| 8.3 | ЗА\_ИПБ\_От |  |  |  |
| 9 | Меншікті капиталдың жеткіліктілік коэффициенті |  |  |  |
| 10 | Мерзімді өтімділік коэффициенті: |  |  |  |
| 10.1 | К2-1 |  |  |  |
| 10.2 | К2-2 |  |  |  |
| 10.3 | К2-3 |  |  |  |
| 10.4 | К2-4 |  |  |  |

© 2012. Қазақстан Республикасы Әділет министрлігінің «Қазақстан Республикасының Заңнама және құқықтық ақпарат институты» ШЖҚ РМК