

25	Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, суверенный рейтинг которых не ниже «АА-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	20
26	Ценные бумаги, выпущенные организациями, имеющими долговую рейтинг не ниже «АА-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	20
27	Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на балансе и имеющие кредитный рейтинг от «ААА» до «АА-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтингую оценку от «кzAAA» до «кzАА-» национальной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств	20
III группа		
28	Неафинированные драгоценные металлы	50
29	Займы, предоставленные организациями, имеющим долговую рейтинг от «А+» до «А-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	50
30	Долговые ценные бумаги, выпущенные Акционерным обществом «Банк Развития Казахстана»	50
31	Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг от «ВВВ+» до «ВВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	50
32	Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговую рейтинг от «ВВВ+» до «ВВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	50
33	Вклады в организациях, имеющих долговую рейтинг от «А+» до «А-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	50
34	Деньги на корреспондентских счетах в организациях, имеющих долговую рейтинг от «А+» до «А-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	50
35	Дебиторская задолженность организаций, имеющих долговую рейтинг от «А+» до «А-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	50
36	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от «ВВВ+» до «ВВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	50
37	Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговую рейтинг от «ВВВ+» до «ВВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	50
38	Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, имеющих суверенный рейтинг от «А+» до «А-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	50
39	Ценные бумаги, выпущенные организациями, имеющими долговую рейтинг от «А+» до «А-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	50
40	Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на балансе и имеющие кредитный рейтинг от «А+» до «А-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтингую оценку от «кzА+» до «кzА-» национальной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств	50
IV группа		
41	Займы, предоставленные организациям-резидентам Республики Казахстан, имеющим долговую рейтинг ниже «А-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациям-резидентам Республики Казахстан, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки, и организациям-нерезидентам Республики Казахстан, имеющим долговую рейтинг от «ВВВ+» до «ВВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	100
42	Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг от «ВВ+» до «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки	100
43	Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговую рейтинг от «ВВ+» до «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и международных финансовых организациях, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки	100
44	Вклады в организациях-резидентах Республики Казахстан, имеющих долговую рейтинг ниже «А-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациях-резидентах Республики Казахстан, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки, и организациях-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долговую рейтинг от «ВВВ+» до «ВВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	100
45	Деньги на корреспондентских счетах в организациях-резидентах Республики Казахстан, имеющих долговую рейтинг ниже «А-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациях-резидентах Республики Казахстан, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки, и организациях-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долговую рейтинг от «ВВВ+» до «ВВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	100
46	Дебиторская задолженность организаций-резидентов Республики Казахстан, имеющих долговую рейтинг ниже «А-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организаций-резидентов Республики Казахстан, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки, и организаций-нерезидентов Республики Казахстан, имеющих долговую рейтинг от «ВВВ+» до «ВВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	100
47	Дебиторская задолженность физических лиц	100
48	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг от «ВВ+» до «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки	100
49	Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, имеющих суверенный рейтинг от «ВВВ+» до «ВВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и стран, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки	100
50	Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговую рейтинг от «ВВ+» до «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и международными финансовыми организациями, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки	100
51	Ценные бумаги, выпущенные организациями-резидентами Республики Казахстан, имеющими долговую рейтинг ниже «А-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, организациями-резидентами Республики Казахстан, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки, и организациями-нерезидентами Республики Казахстан, имеющими долговую рейтинг от «ВВВ+» до «ВВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	100
52	Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на балансе и имеющие кредитный рейтинг от «ВВВ+» до «ВВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтингую оценку от «кzВВВ+» до «кzВВВ-» по национальной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств	100
53	Расчеты по платежам	100
54	Основные средства	100
55	Материальные запасы	100
56	Предоплата суммы вознаграждения и расходов	100
V группа		
57	Лицензионное программное обеспечение, приобретенное для целей основной деятельности организатора торгов и соответствующее Международному стандарту финансовой отчетности 38	100
58	Займы, предоставленные организациям-резидентам Республики Казахстан, имеющим долговую рейтинг ниже «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациям-нерезидентам Республики Казахстан, не имеющим соответствующей рейтинговой оценки	150
59	Займы, предоставленные нерезидентам Республики Казахстан, являющимся юридическими лицами, зарегистрированными на территории иностранных государств, указанных в примечании к настоящему приложению, или их гражданами	200
60	Вклады в центральных банках стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	150
61	Вклады в международных финансовых организациях, имеющих долговую рейтинг ниже «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	150
62	Вклады в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долговую рейтинг ниже «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациях-нерезидентах Республики Казахстан, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки	150
63	Деньги на корреспондентских счетах в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, имеющих долговую рейтинг ниже «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациях-нерезидентах Республики Казахстан, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки	150
64	Вклады в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, зарегистрированных на территории иностранных государств, указанных в примечании к настоящему приложению	200
65	Деньги на корреспондентских счетах в организациях-нерезидентах Республики Казахстан, зарегистрированных на территории иностранных государств, указанных в примечании к настоящему приложению	200
66	Дебиторская задолженность организаций-нерезидентов Республики Казахстан, имеющих долговую рейтинг ниже «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организаций-нерезидентов Республики Казахстан, не имеющих соответствующей рейтинговой оценки	150
67	Дебиторская задолженность организаций-резидентов Республики Казахстан, зарегистрированных на территории иностранных государств, указанных в примечании к настоящему приложению	200
68	Ценные бумаги, выпущенные центральными правительствами стран, имеющих суверенный рейтинг ниже «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	150
69	Ценные бумаги, выпущенные местными органами власти стран, суверенный рейтинг которых ниже «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	150
70	Ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями, имеющими долговую рейтинг ниже «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	150
71	Ценные бумаги, выпущенные организациями-резидентами Республики Казахстан, имеющими долговую рейтинг ниже «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, и организациями-нерезидентами Республики Казахстан, не имеющими соответствующей рейтинговой оценки	150
72	Ценные бумаги, выпущенные организациями-резидентами Республики Казахстан, зарегистрированными на территории иностранных государств, указанных в примечании к настоящему приложению	200
73	Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на балансе и имеющие кредитный рейтинг от «ВВВ+» до «ВВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтингую оценку от «кzВВВ+» до «кzВВВ-» по национальной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств	350
74	Негосударственные долговые ценные бумаги организаций Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и (или) других государств, включенные в список фондовой биржи, эмитент которых соответствует требованиям категории «долговые ценные бумаги без рейтинговой оценки первой подкатегории (наивысшая категория)», предусмотренной постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 27 марта 2017 года № 54 «Об утверждении Требований к эмитентам и их ценным бумагам, допускаемым (допускаемым) к обращению на фондовой бирже, а также к отдельным категориям списка фондовой биржи и внесении изменений в некоторые нормативные правовые акты Республики Казахстан по вопросам регулирования рынка ценных бумаг» (зарегистрированным в Реестре государственной регистрации нормативных правовых актов под № 15175) (далее – постановление № 54)	250

75	Негосударственные долговые ценные бумаги организаций Республики Казахстан, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, включенные в список фондовой биржи, эмитент которых соответствует требованиям категории «долговые ценные бумаги без рейтинговой оценки второй подкатегории (следующая за наивысшей категорией)», предусмотренной постановлением № 54	250
76	Прочие финансовые инструменты	400
Итого:		

- Примечание:
Перечень иностранных государств:
1) Княжество Андорра;
2) Государство Антигуа и Барбуда;
3) Содружество Багамских островов;
4) Государство Барбадос;
5) Государство Бахрейн;
6) Государство Белиз;
7) Государство Бруней Даруссалам;
8) Республика Вануату;
9) Республика Гватемала;
10) Государство Гренада;
11) Республика Джибути;
12) Доминиканская Республика;
13) Республика Индонезия;
14) Испания (только в части территории Канарских островов);
15) Республика Кипр;
16) Китайская Народная Республика (только в части территорий специальных административных районов Аомынь (Макао) и Янган (Гонконг));
17) Федеральная Исламская Республика Коморские Острова;
18) Республика Коста-Рика;
19) Малайзия (только в части территории анклава Лабуан);
20) Республика Либерия;
21) Княжество Лихтенштейн;
22) Республика Маврикий;
23) Португалия (только в части территории островов Мадейра);
24) Мальдивская Республика;
25) Республика Мальта;
26) Республика Маршалловы острова;
27) Княжество Монако;
28) Союз Мьянма;
29) Республика Науру;
30) Нидерланды (только в части территории острова Аруба и зависимых территорий Антильских островов);
31) Федеративная Республика Нигерия;
32) Новая Зеландия (только в части территории островов Кука и Ниуэ);
33) Объединенные Арабские Эмираты (только в части территории города Дубай);
34) Республика Палау;
35) Республика Панама;
36) Независимое Государство Самоа;
37) Республика Сейшельские острова;
38) Государство Сент-Винсент и Гренадины;
39) Федерация Сент-Китс и Невис;
40) Государство Сент-Люсия;
41) Соединенное Королевство Великобритании и Северной Ирландии (только в части следующих территорий):
Острова Ангилья; Бермудские острова;
Британские Виргинские острова;
Гибралтар;
Каймановы острова;
Остров Монтсеррат;
Острова Теркс и Кайкос;
Остров Мэн;
Нормандские острова (острова Гернси, Джерси, Сарк, Олдерни);
42) Соединенные Штаты Америки (только в части территорий Американских Виргинских островов, острова Гуам и содружества Пуэрто-Рико);
43) Королевство Тонга;
44) Республика Филиппины;
45) Демократическая Республика Шри-Ланка.

Приложение 2
к Перечню нормативных правовых актов
Республики Казахстан по вопросам
пруденциального регулирования, в которые
вносятся изменения и дополнения

Приложение 2
к Правилам и методикам расчета
значений пруденциальных
нормативов для организатора торгов

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

№	Наименование статей	Кoeffициент конверсии в процентах
I группа		
1	Условные (возможные) обязательства по приобретению либо продаже ценных бумаг, выпущенных Правительством Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан или ценных бумаг, выпущенных центральными правительствами и центральными банками иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг на уровне «АА» и выше агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0
2	Возможные (условные) обязательства по размещению организатором торгов в будущем займов и вкладов, подлежащие отмене в любой момент по требованию организатора торгов	0
II группа		
3	Возможные (условные) обязательства по размещению организатором торгов в будущем займов и вкладов со сроком погашения менее 1 (одного) года	20
4	Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от «ААА» до «АА» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтингую оценку от «кzААА» до «кzАА» по национальной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств	20
III группа		
5	Возможные (условные) обязательства по размещению организатором торгов в будущем займов и вкладов со сроком погашения более 1 (одного) года	50
6	Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от «А+» до «А-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтингую оценку от «кzА+» до «кzА» по национальной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств	50
IV группа		
7	Соглашение о продаже организатором торгов с обязательством обратного выкупа организатором торгов финансовых инструментов	100
8	Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от «ВВВ+» до «ВВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтингую оценку от «кzВВВ+» до «кzВВВ-» по национальной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств	100
9	Иные аккредитивы организатора торгов	100
10	Иные условные (возможные) обязательства организатора торгов	100
11	Позиции секьюритизации, удерживаемые организатором торгов на счетах условных обязательств и имеющие кредитный рейтинг от «ВВ+» до «ВВ-» агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств или рейтингую оценку от «кzВВ+» до «кzВВ-» по национальной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинг аналогичного уровня по национальной шкале одного из других рейтинговых агентств	350

Приложение 3
к Перечню нормативных правовых актов
Республики Казахстан по вопросам
пруденциального регулирования, в которые
вносятся изменения и дополнения

Приложение 3
к Правилам и методикам расчета значений
пруденциальных нормативов
для организатора торгов

Таблица производных финансовых инструментов, взвешенных с учетом кредитного риска

№	Наименование статей	Номинальная стоимость производных финансовых инструментов	Кoeffициент кредитного риска для производных финансовых инструментов в процентах	Сумма с учетом кредитного риска для производных финансовых инструментов	Рыночная стоимость производных финансовых инструментов	Кoeffициент кредитного риска для контрагента в процентах в соответствии с приложением 1 к настоящим Правилам	Сумма по расчету
1	2	3	4	5 = 3 * 4	6	7	8 = (5 + 6) * 7
1	Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с государственными ценными бумагами, со сроком погашения до 1 (одного) года		0,02				
2	Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с государственными ценными бумагами, со сроком погашения от 1 (одного) года до 5 (пяти) лет		0,03				
3	Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с государственными ценными бумагами, со сроком погашения более 5 (пяти) лет		0,04				
4	Операции с производными финансовыми инструментами, связанные с валютными сделками, со сроком погашения до 1 (одного) года		0,05				

№	Дата	Высоколиквидные активы	Сумма обязательств организатора торгов перед участниками торгов по деньгам участников торгов, которые находятся на корреспондентских счетах организатора торгов	Сумма нетто-требуемой участниками торгов к организатору торгов по всем категориям членства, которая подлежит возмещению организатором торгов в результате наступления технического сбоя	Сумма максимального ущерба членам организатора торгов по всем категориям членства, которая подлежит возмещению организатором торгов в результате наступления технического сбоя
5			0,07		
6			0,09		
7			0,03		
8			0,06		
9			0,09		
10			0,06		
11			0,08		
12			0,10		
13			0,07		
14			0,07		
15			0,08		
16			0,10		
17			0,12		
18			0,15		
Итого производные финансовые инструменты, взвешенные в учетом кредитного риска			X		X

Приложение 4
к Перечню нормативных правовых актов
Республики Казахстан по вопросам
пруденциального регулирования, в которые
вносятся изменения и дополнения

Приложение 4
к Правилам и методикам расчета значений
пруденциальных нормативов
для организатора торгов

Таблица коэффициента текущей ликвидности K_t

№	Дата	Высоколиквидные активы	Сумма обязательств организатора торгов перед участниками торгов по деньгам участников торгов, которые находятся на корреспондентских счетах организатора торгов	Сумма нетто-требуемой участниками торгов к организатору торгов по всем категориям членства, которая подлежит возмещению организатором торгов в результате наступления технического сбоя	Сумма максимального ущерба членам организатора торгов по всем категориям членства, которая подлежит возмещению организатором торгов в результате наступления технического сбоя
1					
2					
3					
4					
5					
6					
7					
8					
9					
10					
11					
12					
13					
14					
15					
16					
17					
18					
19					
20					
21					
22					
23					
24					
25					
26					
27					
28					
29					
30					
31					
Итого					
Итого средняя величина					
Количество рабочих дней					
Кoeffициент текущей ликвидности					

