

О внесении изменений и дополнений в Положение о пруденциальных нормативах для компаний по управлению пенсионными активами, утвержденное постановлением Национальной комиссии Республики Казахстан по ценным бумагам от 29 августа 1997 года № 133

Утративший силу

Постановление Национальной комиссии Республики Казахстан по ценным бумагам от 11 августа 1999 года N 40. Зарегистрирован в Министерстве юстиции Республики Казахстан 22.09.99г. за N 898. Утратило силу постановлением Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 1 июня 2010 года № 75

Сноска. Утратило силу постановлением Правления Агентства РК по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 01.06.2010 № 75.

О внесении изменений и дополнений в Положение V970363_ о пруденциальных нормативах для компаний по управлению пенсионными активами, утвержденное постановлением Национальной комиссии Республики Казахстан по ценным бумагам от 29 августа 1997 года N 133

В связи с введением в действие постановления Национальной комиссии Республики Казахстан по ценным бумагам (далее именуемой "Национальная комиссия") V980665_ "Об уставном капитале компании по управлению пенсионными активами" от 20 ноября 1998 года N 16 (зарегистрированного Министерством юстиции Республики Казахстан 14 января 1999 года за N 665) и во исполнение статьи 58 Закона Республики Казахстан Z970136_ "О пенсионном обеспечении в Республике Казахстан" от 20 июня 1997 года, а также в целях повышения эффективности деятельности по управлению пенсионными активами и регулирования деятельности компаний по управлению пенсионными активами по инвестированию собственных активов Национальная комиссия постановляет:

1. Внести следующие изменения и дополнения в Положение V970363_ о пруденциальных нормативах для компаний по управлению пенсионными активами, утвержденное постановлением Национальной комиссии от 29 августа

1997 года N 133 и зарегистрированное Министерством юстиции Республики Казахстан 9 сентября 1997 года за N 363:

- 1) главу 1 "Минимальный размер уставного капитала" исключить;
- 2) главу 2 изложить в следующей редакции:

"2. Достаточность собственных средств

2.1. Достаточность собственных средств Компании характеризуется коэффициентом K1, рассчитываемым как отношение размера собственных средств

Компании к размеру ее собственных активов и пенсионных активов, принятых ею в инвестиционное управление, по формуле:

СС

$K1 = \frac{СС}{СА + ПА}$, где

СА + ПА

K1 - коэффициент достаточности собственных средств;

СС - размер собственных средств Компании, рассчитанный в соответствии с пунктом 2.2 настоящего Положения;

СА - размер собственных активов Компании;

ПА - размер пенсионных активов, принятых Компанией в инвестиционное управление.

2.2. Собственные средства Компании включают:

- 1) объявленный уставный капитал;
 - 2) дополнительный оплаченный капитал;
 - 3) дополнительный неоплаченный капитал;
 - 4) резервный капитал;
 - 5) нераспределенный доход отчетного года;
 - 6) нераспределенный доход предыдущих лет;
- за вычетом:
- 7) неоплаченного капитала;
 - 8) изъятого капитала;
 - 9) нематериальных активов;
 - 10) непокрытого убытка отчетного года;
 - 11) непокрытого убытка предыдущих лет;
 - 12) активов, находящихся в залоге, или подвергнутых иному обременению;

13) дебиторской задолженности организаций, являющихся по отношению к Компании аффилированными лицами, в соответствии с постановлением Директората Национальной комиссии V980680_ "О практике применения понятия "аффилированное лицо" от 26 октября 1998 года N 181;

14) дебиторской задолженности организаций по поставке Компании нематериальных активов, основных средств и материалов со сроком погашения более двух месяцев;

15) финансовых инвестиций (по покупной стоимости) за исключением инвестиций в финансовые инструменты, которые определены Правилами V980642_ осуществления инвестиционной деятельности компаний по управлению пенсионными активами, утвержденными постановлением Национальной комиссии от 13 августа 1998 года N 11;

16) авансов выданных.

2.3. Значение коэффициента K1 должно быть не менее:

1) 0,02 - при размере пенсионных активов, принятых Компаний в инвестиционное управление, составляющем менее 5 миллиардов тенге;

2) 0,015 - при размере пенсионных активов, принятых Компаний в инвестиционное управление, составляющем от 5 до 10 миллиардов тенге;

3) 0,01 - при размере пенсионных активов, принятых Компаний в инвестиционное управление, составляющем 10 и более миллиардов тенге.";

3) в пункте 3.2:

в части одиннадцатой символы "п. 4.8" заменить словами "пункту 4.8";
часть тринадцатую изложить в следующей редакции:

"Собственные активы Компании, соответствующие суммарной величине ее основного и дополнительного резервных капиталов, должны размещаться Компанией исключительно в финансовые инструменты, которые определены Правилами V980642_ осуществления инвестиционной деятельности компаниями по управлению пенсионными активами, утвержденными постановлением Национальной комиссии Республики Казахстан по ценным бумагам (далее именуемой "Национальная комиссия") от 13 августа 1998 года N 11. Суммарная балансовая стоимость инвестиций в указанные финансовые инструменты, осуществляемых за счет собственных активов Компании, должна ежедневно составлять не менее суммарной величины ее основного и дополнительного

резервных капиталов, рассчитанных в соответствии с условиями настоящего пункта.";

4) в пункте 4.4 слова "представить в НКЦБ" заменить словами "представлять в Национальную комиссию";

5) в пункте 4.8:

в части первой аббревиатуру "НКЦБ" заменить словами "Национальной комиссией";

6) главу 5 изложить в следующей редакции:

"5. Максимальный размер инвестиций в негосударственные ценные бумаги одного эмитента, на депозиты в одном банке второго уровня и в депозитные сертификаты одного банка второго уровня

5.1. Суммарный размер инвестиций Компании в негосударственные ценные бумаги одного эмитента, на депозиты в одном банке второго уровня и в депозитные сертификаты одного банка второго уровня, которые могут быть осуществлены в соответствии с настоящим Положением и Правилами осуществления инвестиционной деятельности компаниями по управлению пенсионными активами, утвержденными постановлением Национальной комиссии от 13 августа 1998 года N 11, не должен превышать следующих значений :

1) в ценные бумаги, эмитированные одним банком второго уровня, а также на депозиты в данном банке и в его депозитные сертификаты:

при инвестировании пенсионных активов - 10% от объема пенсионных активов каждого отдельного накопительного пенсионного фонда, находящихся у Компании в инвестиционном управлении,

при инвестировании собственных активов - 10% от объема собственных активов Компании,

но в совокупности не более 25% от размера собственного капитала данного банка ;

2) в облигации эмитента, не являющегося банком второго уровня:

при инвестировании пенсионных активов - 5% от объема пенсионных активов каждого отдельного накопительного пенсионного фонда, находящихся у Компании в инвестиционном управлении,

при инвестировании собственных активов - 5% от объема собственных активов Компании,

но в совокупности не более 25% от размера собственного капитала данного эмитента или не более 25% от общего количества облигаций одной эмиссии данного эмитента (в зависимости от того, какая из указанных величин является наименьшей) ;

3) в акции эмитента, не являющегося банком второго уровня:

при инвестировании пенсионных активов - 5% от объема пенсионных активов каждого отдельного накопительного пенсионного фонда, находящихся у Компании в инвестиционном управлении,

при инвестировании собственных активов - 5% от объема собственных

а к т и в о в

К о м п а н и и ,

но в совокупности не более 5% от общего количества акций данного э м и т е н т а .

5.2. При расчете суммарного размера инвестиций Компании в негосударственные ценные бумаги одного эмитента, на депозиты в одном банке второго уровня и в депозитные сертификаты одного банка второго уровня:

1) собственный капитал банка (эмитента) - организации Республики Казахстан определяется на основании его последнего квартального баланса, опубликованного в печатном издании в соответствии с законодательством, регулирующим банковскую деятельность, или законодательством об акционерных обществах, либо предоставленного ЗАО "Казахстанская фондовая биржа" в соответствии с листинговыми процедурами;

2) собственный капитал иностранного эмитента определяется на основании его последнего доступного для Компании квартального или годового баланса;

3) аффилированные по отношению друг к другу банки (эмитенты) признаются в качестве одного банка (эмитента).

5.3. Нормы, установленные пунктами 5.1 и 5.2 настоящего Положения, не распространяются на ценные бумаги международных финансовых организаций, которые могут быть приобретены Компанией в соответствии с настоящими Положением и Правилами осуществления инвестиционной деятельности

компаниями по управлению пенсионными активами, утвержденными постановлением Национальной комиссии от 13 августа 1998 года N 11.";

7) в пункте 7.1:

в части первой аббревиатуру "НКЦБ" заменить словами "Национальную комиссию";

8) в пункте 7.2 аббревиатуру "НКЦБ" заменить словами "Национальная комиссия";

9) в пункте 7.3:

в части первой аббревиатуру "НКЦБ" заменить словами "Национальная комиссия";

в части второй аббревиатуру "НКЦБ" заменить словами "Национальная комиссия";

10) в пункте 7.5:

в первом и втором предложениях аббревиатуру "НКЦБ" заменить словами "Национальной комиссии".

2. Установить, что настоящее Постановление вводится в действие с даты его

регистрации Министерством юстиции Республики Казахстан.

3. Отделу пенсионной реформы Управления лицензирования и надзора центрального аппарата Национальной комиссии:

1) довести настоящее Постановление до сведения компаний по управлению пенсионными активами, банков-кастодианов, ЗАО "Государственный накопительный пенсионный фонд", Национального Банка Республики Казахстан, Министерства финансов Республики Казахстан и Комитета по регулированию деятельности накопительных пенсионных фондов Министерства труда и социальной защиты населения Республики Казахстан;

2) доводить настоящее Постановление до сведения организаций,

намеренных получить лицензию на осуществление деятельности по инвестиционному управлению пенсионными активами;

3) установить контроль за исполнением настоящего Постановления.

4. Управлению анализа и стратегии - Службе Председателя центрального аппарата Национальной комиссии довести настоящее Постановление до сведения ЗАО "Казахстанская фондовая биржа" (с возложением на него обязанности по доведению настоящего Постановления до сведения его членов) и ЗАО "Центральный депозитарий ценных бумаг".

Председатель Национальной комиссии

Члены Национальной комиссии

(Специалисты:

Цай Л.Г.

Склярова И.В.)