

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің РЕПО операцияларын жүзеге асыру ережесін бекіту туралы

Күшін жойған

Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының 2007 жылғы 5 ақпандағы N 10 Қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2007 жылғы 16 сәуірдегі Нормативтік құқықтық кесімдерді мемлекеттік тіркеудің тізіліміне N 4616 болып енгізілді. Күші жойылды - Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2009 жылғы 25 қыркүйектегі N 89 Қаулысы

Күші жойылды - ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 2009.09.25 N 89 қаулысымен.

Қазақстан Республикасының ішкі нарығында бағалы қағаздармен РЕПО операцияларын жүзеге асыру тәртібін реттейтін нормативтік құқықтық базаны жетілдіру мақсатында Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасы

Қ А У Л Ы Е Т Е Д І :

1. Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің РЕПО операцияларын жүзеге асыру ережесі бекітілсін.

2. Осы қаулы Қазақстан Республикасы Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркеуден өткізілген күннен бастап он төрт күн өткеннен кейін қолданысқа енгізіледі.

3. Осы қаулы қолданысқа енгізілген күннен бастап, Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде N 867 тіркелген, Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының "Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарымен РЕПО және кері РЕПО операцияларын жүргізу ережелерін бекіту туралы" 1999 жылғы 3 шілдедегі N 160 қаулысының күші жойылды деп танылсын.

4. Монетарлық операциялар департаменті (Ю.В.Герасименко):

1) Заң департаментімен (Шәріпов С.Б.) бірлесіп осы қаулыны Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркеуден өткізу шараларын қабылдасын;

2) осы қаулы Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркеуден өткен күннен бастап он күндік мерзімде оны Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі орталық аппаратының мүдделі бөлімшелеріне және аумақтық филиалдарына, Қазақстан Республикасы Қаржы нарығы мен қарұйымдарын реттеу және қадағалау агенттігіне және қаржы нарығының жекелеген

субъектілеріне

жіберсін.

5. Осы қаулының орындалуын бақылау Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Төрағасының орынбасары М.М.Сартбаевқа жүктелсін.

Ұ л т т ы қ Б а н к

Төрағасы

Қ а з а қ с т а н

Р е с п у б л и к а с ы н ы ң

Ұ л т т ы қ

Б а н к і

Б а с қ а р м а с ы н ы ң

2 0 0 7

ж ы л ғ ы

5

а қ п а н д а ғ ы

№ 10 қаулысымен бекітілген

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің РЕПО операцияларын жүзеге асыру ережесі

Осы Ереже Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкінің (бұдан әрі - Ұлттық Банк) РЕПО операцияларын жүзеге асыру тәртібін айқындау мақсатында әзірленді.

1-тарау. Жалпы ережелер

1. Осы Ережеде мынадай ұғымдар қолданылады:

1) депозитарий - орталық депозитарий;

2) депонент - депозитарийдің клиенті болып табылатын ұйым;

3) ауыстыру - РЕПО-ны жабу күні басталған кезде РЕПО операциялары бойынша бағалы қағаздарды сатып алушының оған РЕПО-ны ашу күні сатылған бағалы қағаздарды осы Ережеде айқындалған талаптармен басқа бағалы қағаздарға ауыстыру құқығы;

4) контрагент - мәміленің Ұлттық Банк РЕПО операциясын жүзеге асыратын қатысушысы;

5) купондық облигация - өтеу сәтінде оны иеленушіге номиналдық құны, сондай-ақ төлеу кезеңі мен саны осы бағалы қағаздың сертификатында көрсетілген сыйақы төленетін облигация;

6) РЕПО операциясы - бір мезгілде жасалатын екі мәміленің бірінен тұратын операция: қатысушылардың болашақ уақытта РЕПО-ны жабу кезінде алдын ала келісілген талаптармен бағалы қағаздарды кері сатып алу/сатуды жүзеге асыруға негізделген міндеттемесімен бағалы қағаздарды бастапқы сату/сатып алу болжанатын РЕПО-ны ашу;

7) тікелей РЕПО операциясы - ашылуы кезінде Ұлттық Банк бағалы қағаздарды контрагентке осы немесе ауыстыруға жарамды бағалы қағаздарды кері сатып алу міндеттемесімен сатуды жүзеге асыратын РЕПО операциясы;

8) кері РЕПО операциясы - ашылуы кезінде Ұлттық Банк бағалы қағаздарды контрагенттен осы немесе ауыстыруға жарамды бағалы қағаздарды кері сату міндеттемесімен сатып алуды жүзеге асыратын РЕПО операциясы;

9) қайтарымсыз РЕПО операциясы - РЕПО жабылғанға дейін мәмілені тоқтату құқығы жоқ РЕПО операциясы;

10) қайтарымды РЕПО операциясы - контрагенттің РЕПО-ны жабу мерзімін азайту құқығы бар РЕПО операциясы, бірақ Ұлттық Банкпен келісім бойынша бір мезгілде сыйақы ставкасын өзгерте отырып, мәміле жасалғаннан кейін үш жұмыс күнінен ерте емес;

11) РЕПО ставкасы - жылдық пайызбен есептелетін, Ұлттық Банктің Директорлар кеңесі Ұлттық Банктің Ақша-кредит және валюта саясаты жөніндегі техникалық комитетінің ұсыныстарын ескере отырып белгілейтін сыйақы ставкасы;

12) сауда бөлімшесі - Ұлттық Банктің монетарлық операциялар бөлімшесінің бағалы қағаздармен мәмілелер жасауға уәкілетті дилингтік операциялар басқармасы;

13) есеп айырысу басқармасы - Ұлттық Банктің монетарлық операциялар бөлімшесінің мәмілелер жөніндегі деректерді "Құбаж-3Ц" автоматтандырылған ақпарат жүйесіне енгізуді жүзеге асыратын есеп айырысу және кредиттеу басқармасы;

14) уәкілетті департамент - Ұлттық Банктің монетарлық операциялар бөлімшесі;

15) уәкілетті басқарма - Ұлттық Банктің контрагент пен Ұлттық Банктің арасындағы мәмілелер бойынша есеп айырысуды жүзеге асыруға уәкілетті монетарлық операцияларды есепке алу бөлімшесі;

16) РЕПО-ны ашу бағасы - РЕПО операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздың РЕПО-ны ашу жүзеге асырылатын бағасы;

17) РЕПО-ны жабу бағасы - РЕПО операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздың РЕПО-ны жабу жүзеге асырылатын бағасы.

2. Ұлттық Банк РЕПО операцияларын ұйымдасқан (биржалық) және сол сияқты ұйымдаспаған (банкаралық) нарықта жүзеге асырады.

3. Ұлттық Банк ұйымдасқан (биржалық) нарықта РЕПО операцияларын қор биржасының ішкі құжаттарына сәйкес жүзеге асырады.

4. Ұлттық Банк ұйымдаспаған (банкаралық) нарықта РЕПО операцияларын контрагентпен жасалған келісім негізінде осы Ережеге сәйкес жүзеге асырады.

5. Ұлттық Банктің ұйымдасқан (биржалық) нарықтағы контрагенті қор биржасы, ұйымдаспаған (банкаралық) нарықта депонент болып табылады.

6. РЕПО операцияларының мерзімі бір немесе одан көп күнтізбелік күнді құрайды. Бір жылдағы күндердің саны 365 күнтізбелік күнге тең болады.

7. Барлық кері РЕПО операциялары қайтарымсыз РЕПО операциялары болып табылады.

8. Тікелей және кері РЕПО операцияларын жүргізу кезінде қатысатын бағалы қағаздың түрін Ұлттық Банк айқындайды.

9. РЕПО операцияларының мерзімі ішінде РЕПО операцияларының мәні болып табылатын бағалы қағаздарды сатып алушы осы бағалы қағаздарды иелік етуге құқылы.

10. Ұлттық Банк ұйымдасқан (биржалық) және ұйымдаспаған (банкаралық) нарықтарда РЕПО операцияларын жүзеге асыру қажеттілігі туралы шешімді ақша нарығындағы ахуалға қатысты дербес қабылдайды.

2-тарау. РЕПО операцияларын жүзеге асыру тәртібі

11. Контрагенттен онымен РЕПО операциясын жүзеге асыру туралы ұсыныс алған күні сауда бөлімшесінің дилері РЕПО операциясын жүзеге асыру мүмкіндігі туралы растама алу мақсатында уәкілетті департаменттің басшылығына/сауда бөлімшесінің басшылығына хабарлайды. РЕПО операциясын жүзеге асыру мүмкіндігінің растамасы контрагенттің РЕПО операциясын жүзеге асыру туралы ұсынысы бар хатындағы уәкілетті департаменттің басшылығының/сауда бөлімшесінің басшылығының рұқсат беру бұрыштамасы болып табылады.

12. Контрагенттің РЕПО операциясын жүзеге асыру туралы ұсынысы бар х а т ы н а м ы н а д а й а қ п а р а т к і р е д і :

1) РЕПО операциясының мерзімі (РЕПО-ны ашу күні және жабу күні);

2) РЕПО операциясының түрі (тікелей/кері, қайтарымды/қайтарымсыз);

3) РЕПО операциясының мәні (бағалы қағаздың түрі, өтеу мерзімі);

4) с ы й а қ ы с т а в к а с ы ;

5) РЕПО операциясының сомасы.

13. РЕПО-ны ашу мәмілесі кейіннен бағалы қағаздар сатып алушыдан бағалы қағаздар сатушыға РЕПО-ны ашу бағасы бойынша ақша аударып отырып бағалы қағаздар сатушының жеке шотынан бағалы қағаздар сатып алушының жеке шотына бағалы қағаздарды бастапқы аударуды болжайды.

14. Ұйымдасқан (биржалық) және ұйымдаспаған (банкаралық) нарықтарда РЕПО-ны ашу бағасының есебін бірегейлендіру мақсатында ұйымдаспаған нарықта РЕПО-ны ашу бағасының есебі қор биржасының бағалы қағаздарды бағалау әдістемесіне сәйкес жүзеге асырылады.

15. РЕПО-ны жабу мәмілесі кейіннен бағалы қағаздар сатушыдан бағалы қағаздар сатып алушыға РЕПО-ны ашу бағасы бойынша ақша аударып отырып бағалы қағаздар сатып алушының жеке шотынан бағалы қағаздар сатушының

жеке шотына бағалы қағаздарды болашақ уақытқа негізделген кері аударуды болжайды.

16. РЕПО-ны жабу РЕПО операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздары өтеу күніне дейін кемінде бес күнтізбелік күннен кешіктірілмей жүргізіледі.

17. РЕПО-ны жабу бағасы, РЕПО операцияларын жасау кезіндегі бағалы қағаздар саны және мәміле сомасы РЕПО ставкасы ескеріле отырып, қор биржасының ішкі құжаттарына сәйкес есептеледі.

18. РЕПО операциясын жүргізу кезінде осы Ереженің 1-қосымшасына сәйкес нысан бойынша тікелей (кері) РЕПО операциялары бойынша мәміле паспорты (бұдан әрі - мәміле паспорты) ресімделеді.

Тікелей (кері) РЕПО операциялары бойынша мәміле паспортқа сауда бөлімшесінің дилері, сауда бөлімшесінің басшылығы, уәкілетті департаменттің басшылығы бұрыштама қояды және есеп айырысу басқармасының маманының және басшысының бұрыштамасы қойылып есеп айырысу басқармасы арқылы уәкілетті басқармаға РЕПО операциясы бойынша есеп айырысуды жүзеге асыру үшін жіберіледі.

19. Ұлттық Банк және контрагент РЕПО мәмілесінің қатысушылары арасында тараптар келіскен мөлшерде және мерзімдерде бағалы қағаздар және ақша аудару болжанатын РЕПО операцияларын жүргізу туралы келісімге сәйкес іс-әрекет жасайды.

3-тарау. РЕПО мәнін ауыстыру және қайтарымды РЕПО операциясын жүзеге асыру тәртібі

20. РЕПО-ны жабу күні РЕПО-ны ашу кезінде сатып алушы болып табылатын мәміленің қатысушысы бағалы қағаздар сатушымен осы Ереженің 2-қосымшасына сәйкес нысан бойынша жасалған РЕПО операциялары бойынша бағалы қағаздарды ауыстыру жөніндегі РЕПО мәмілесіне келісім негізінде оған РЕПО-ны ашу кезінде сатылған бағалы қағаздарды ұқсас немесе олардың мынадай сипаттамаларынан артықшылықты басқа бағалы қағаздармен а у ы с т ы р у ғ а қ ұ қ ы л ы :

- 1) бағалы қағаздардың түрі;
- 2) РЕПО-ны жабу күніне өтеуге кірістілік.

Бағалы қағаздары өтеу мерзімі РЕПО-ны ашу кезінде сатып алушыға сатылған бағалы қағаздарды өтеу мерзімінен аспауы тиіс.

21. Купондық облигацияларды сатып алушы сатушының банктік шотына сыйақы сомасын сатушы мен сатып алушының арасында осы Ереженің 3-қосымшасына сәйкес нысан бойынша жасалған купондық облигациялар

бойынша сыйақы төлеу жөніндегі РЕПО мәмілесіне келісімде көзделген мерзімдерде аударды.

22. Контрагент қайтарымды РЕПО операциясының мерзімін азайту туралы шешім қабылдаған кезде контрагент Ұлттық Банкке қайтарымды РЕПО операциясын тоқтату туралы хабарлама хат жібереді және мәміленің бұрынғы паспортының орнына осы Ереженің 1-қосымшасына сәйкес нысан бойынша мәміленің жаңа паспорты ресімделеді және РЕПО операциялары бойынша есеп айырысуды жүзеге асыру үшін уәкілетті басқармаға жіберіледі.

23. Қайтарымды РЕПО операциясын орналастыру мерзімі азайтылған кезде сыйақы ставкасы осы Ереженің 4-қосымшасына сәйкес қайта есептеледі.

24. Қайтарымды РЕПО операциясын тоқтату туралы хабарламаны Ұлттық Банк контрагенттен Алматы уақыты бойынша 16 сағатқа дейін қабылдайды.

4-тарау. Қорытынды ережелер

25. Осы Ережеде реттелмеген мәселелер Қазақстан Республикасының заңнамасында белгіленген тәртіппен шешіледі.

Қазақстан Республикасы
Ұлттық Банкінің РЕПО операцияларын
жүзеге асыру ережесіне

1-қосымша

20 ____ жылғы "___" N ____ тікелей (кері)

РЕПО операциялары бойынша мәмілелер паспорты

Контрагент: _____ Бағалы қағаздың түрі: _____

Эмиссияның ұлттық бірегейлендіру номері	Эмиссия күні	Өтеу күні	Ашу күні	Жабу күні
1	2	3	4	5

кестенің жалғасы

Операция мерзімі, күн	Ашу бағасы, теңге	Жабу бағасы, теңге	Саны, дана	Ашу көлемі, теңге	Жабу көлемі, теңге	Пайыздық ставка
6	7	8	9	10	11	12

Бағалы қағаздардың жалпы саны: _____ дана

РЕПО ашудың жалпы көлемі _____ теңге

РЕПО жабудың жалпы көлемі _____ теңге

Кері (тікелей) РЕПО операциялары бойынша кіріс _____ теңге

Орташа алынған РЕПО ставкасы _____ пайыздық ставка

Орташа алынған РЕПО мерзімі _____ күн

Монетарлық операциялар бөлімшесінің басшысы _____ (аты-жөні)

(қ о л ы)

Сауда бөлімшесінің басшысы _____ (аты-жөні)

(қ о л ы)

Сауда бөлімшесінің дилері _____ (аты-жөні)

(қ о л ы)

Есеп айырысу басқармасының басшысы _____ (аты-жөні)

(қ о л ы)

Есеп айырысу басқармасының маманы _____ (аты-жөні)

(қолы)

Қазақстан Республикасы
Ұлттық Банкінің РЕПО операцияларын
жүзеге асыру ережесіне

2-қосымша

20 ___ жылғы "___" _____

(тіркеу күні)

N _____

(Тіркеу номері)

**РЕПО операциялары бойынша бағалы қағаздарды ауыстыру
жөніндегі "___" _____ 20 ___ жылғы N ___
РЕПО мәмілесіне N _____ келісім**

(бағалы қағаздар рыногына қатысушының атауы және оның тіркелу коды)
бұдан әрі - "Сатушы" деп аталады, бір жағынан және _____

(бағалы қағаздар рыногына қатысушының атауы және оның тіркелу коды)
бұдан әрі - "Сатып алушы" деп аталады, екінші жағынан, арасында осы
РЕПО келісімі мына төмендегілер жайында жасалды:

1. Сатып алушы 20__ жылғы "___" тікелей (кері) РЕПО операция-
лары бойынша мәмілелер паспортына сәйкес сатып алынған бағалы қағаз-
дарды мынадай қағаздарға ауыстыруға міндеттенеді:

- 1) эмиссияның номері және күні _____;
- 2) бағалы қағаздардың саны _____;
- 3) жабу бағасы болды _____;
- 4) өтеуге кірістілік _____;
- 5) өтеуге дейінгі мерзім _____;
- 6) жинақталған купон _____.

РЕПО-ны жабу күніне өтеуге кірістілік РЕПО-ны ашу кезінде
Сатып алушыға сатылған бағалы қағаздарды өтеуге кірістіліктен кем
болмауы тиіс және өтеу мерзімі РЕПО-ны ашу кезінде Сатып алушыға
сатылған бағалы қағаздарды өтеу мерзімінен аспауы тиіс.

2. РЕПО-ны жабу күні 20 ____ жылғы»"__" _____ N ____ тікелей (кері) РЕПО операциялары бойынша мәмілелер паспортына сәйкес осы Келісімнің 1-тармағында көрсетілген бағалы қағаздарды сатып алуға м і н д е т т е н е д і .

3. РЕПО-ны жабу күні 20 ____ жылғы " __ " _____ N ____ тікелей (кері) РЕПО операциялары бойынша мәмілелер паспортының шарттары осы Келісіммен өзгертілмеген бөлігіне қатысты өзгермейді.

4. Осы Келісім қазақ және орыс тілдерінде екі данадан төрт дана етіп жасалды, әрқайсының заң күші бірдей.

Тараптардың мекен-жайлары және деректемелері:

С а т у ш ы

С а т ы п а л у ш ы

Б а с ш ы

Б а с ш ы

(басшының қолы)

(басшының қолы)

Қазақстан Республикасы

Ұлттық Банкінің РЕПО операцияларын

жүзеге асыру ережесіне

3-қосымша

20 ____ жылғы

" ____ "

(тіркеу күні)

N

(Тіркеу номері)

Купондық облигациялар бойынша сыйақы төлеу жөніндегі

" ____ " _____ 20 ____ жылғы N ____

РЕПО мәмілесіне

N _____ келісім

(бағалы қағаздар рыногына қатысушының атауы және оның тіркелу коды)
бұдан әрі - "Сатушы" деп аталады, бір жағынан және _____

(бағалы қағаздар рыногына қатысушының атауы және оның тіркелу коды)
бұдан әрі - "Сатып алушы" деп аталады, екінші жағынан, арасында осы
РЕПО келісімі мына төмендегілер жайында жасалды:

1. Сатып алушы бағалы қағаздар бойынша барлық сомаларды РЕПО

операциясының мерзімі ішінде Сатушының банктік шотына аударуға міндеттенеді, ол бойынша эмитенттен түскен мынадай деректерге сәйкес РЕПО операциясы жүргізіледі:

Эмиссия номері	Эмиссия күні	Сыйақы төлеу күні	Бағалы қағаздар саны	Бір бағалы қағаз бойынша сыйақы төлеу сомасы, теңгемен	Сыйақының жалпы сомасы
1	2	3	4	5	6

2. Сатып алушы осы Келісімнің 1-тармағында көзделген міндеттемелерді орындамаған немесе ойдағыдай орындамаған жағдайда Сатып алушы төлемнің әрбір мерзімі ұзартылған күн үшін қайта қаржыландыру ставкасынан 50 (елу) пайыз мөлшерінде айыппұл төлейді.

3. РЕПО-ны жабу күні 20 ____ жылғы "____" N____ тікелей (кері) РЕПО операциялары бойынша мәмілелер паспортының шарттары осы Келісіммен өзгертілмеген бөлігіне қатысты өзгермейді.

4. Осы Келісім қазақ және орыс тілдерінде екі данадан төрт дана етіп жасалды, әрқайсының заң күші бірдей.

Тараптардың мекен-жайлары және деректемелері:

С а т у ш ы

С а т ы п а л у ш ы

Б а с ш ы

Б а с ш ы

(басшының қолы)

(басшының қолы)

Қ а з а қ с т а н

Р е с п у б л и к а с ы

Ұ л т т ы қ

Б а н к і н і ң

Р Е П О

о п е р а ц и я л а р ы н

ж ү з е г е

а с ы р у

е р е ж е с і н е

4-қосымша

**Қайтарып алынған РЕПО операцияларын
орналастыру мерзімін азайту кезінде
қайтарып алынған РЕПО операциялары бойынша
сыйақы ставкаларын қайта санау тәртібі**

$$D_2 = \left((1 + \frac{D_1}{T_2/T_1 - 1})^{(T_2/T_1 - 1)} - 1 \right) * 100,$$

мұндағы D2 - қайтарып алынған РЕПО операциясын орналастыру мерзімін азайту кезінде қайта саналатын ставка (пайызбен);

D1 - бастапқы келісілген РЕПО ставкасы (пайызбен);

T2 - қайтарып алынған РЕПО операциясының жаңа мерзімі (күн);

T1 - қайтарып алынған РЕПО операциясының бастапқы келісілген мерзімі (күн).

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