

Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының "Қазақстан Республикасы Ұлттық қорының активтерін сыртқы басқарушыларды таңдау ережесін бекіту туралы" 2006 жылғы 25 шілдедегі № 66 қаулысына өзгерістер мен толықтыру енгізу туралы

Күшін жойған

Қазақстан Республикасы Ұлттық банкі басқармасының 2011 жылғы 26 желтоқсандағы № 202 Қаулысы. Қазақстан Республикасы Әділет министрлігінде 2012 жылы 18 ақпанда № 7428 тіркелді. Күші жойылды - Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2016 жылғы 30 мамырдағы № 126 қаулысымен

Ескерту. Күші жойылды - ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 30.05.2016 № 126 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

«Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі туралы» 1995 жылғы 30 наурыздағы Қазақстан Республикасының Заңына сәйкес және Қазақстан Республикасы Ұлттық қорының активтерін сыртқы басқарушыларды таңдау тәртібін жетілдіру мақсатында Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің

Б а с қ а р м а с ы **Қ А У Л ы** **Е Т Е Д І :**

1. Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының «Қазақстан Республикасы Ұлттық қорының активтерін сыртқы басқарушыларды таңдау ережесін бекіту туралы» 2006 жылғы 25 шілдедегі № 66 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 4360 тіркелген) мынадай өзгерістер мен толықтыру енгізілсін:

көрсетілген қаулымен бекітілген Қазақстан Республикасы Ұлттық қорының активтерін сыртқы басқарушыларды таңдау ережесінде: мынадай мазмұндағы 2-1 тармақпен толықтырылсын:

«2-1. Осы Ережеде мынадай ұғымдар пайдаланылады:

1) аймақтық мандат – инвестициялары бір елдің (нарықтың, аймақтың) шеңберінде шоғырландырылған портфель;

2) активтерді активтік басқару – кірістілік ауытқуының өзгермелілік мәні (tracking error) 0.5 пайыздан асуы мүмкін болатын басқару түрі;

3) активтерді пассивтік басқару – кірістілік ауытқуының өзгермелілік мәні (tracking error) 0.5 пайыздан аспаған кездегі басқару түрі. Пассивтік басқару кезінде сыртқы басқарудағы портфельдің кірістілігі шамамен эталондық портфельдің кірістілігіне тең болады;

4) активтерді сыртқы транзиттік басқару – бұл бір сыртқы басқарушыдан басқасына аударуға арналған активтер берілетін активтердің ауысуымен қатар жүретін тәуекелдерді төмендету мақсатында сыртқы транзиттік басқарушыға 6 (алты) айға дейінгі мерзімге берілетін басқару түрі;

5) ақпараттық коэффициент (information ratio) – тарихи жоғары кірістіліктің тәуекелдің тарихи деңгейіне (кірістілік ауытқуының өзгермелілігіне) қатысы;

6) ауқымды мандат – инвестициялары бір елдің (нарықтың, аймақтың) шеңберінен шығатын портфель;

7) бас ұйым – еншілес ұйымдар акцияларының бақылау пакетіне ие компания ;

8) жоғары кірістілік деңгейі – кірістіліктің нақты жеткен деңгейі және эталондық портфель кірістілігінің деңгейі арасындағы айырма;

9) өкілетті өкіл – Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі (бұдан әрі – Ұлттық Банк) Басқармасының шешімімен белгіленетін, өкілеттіліктеріне Ұлттық Банктің атынан Қорды сенімгерлік басқару бойынша шешімдерді жедел қабылдау кіретін арнайы лауазымды тұлға (Ұлттық Банк Төрағасының орынбасарынан төмен емес деңгейде);

10) мамандандырылған мандат – басқару стильдерін әртараптандыру және сыртқы басқарушылар арасында теріс байланыс орнату мақсатында берілетін м а н д а т ;

11) мандат – белгілі бір инвестициялық сипаттамалары бар портфель;

12) маржа шоты – бұл туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізу үшін биржалармен аффилиирленген ұйым болып табылатын, туынды қаржы құралдарымен операциялар бойынша есеп айрысулардың шынайылығын, жеткізуді және жүргізуді қамтамасыз ететін клирингтік ұйымда ашылған шот;

13) сыртқы басқарушы – клиенттердің активтерін сенімгерлік басқаруға маманданатын және қызметін халықаралық қаржы нарықтарында жүзеге асыратын инвестициялық компания және/немесе инвестициялық банк;

14) сыртқы транзиттік басқарушы – клиенттердің активтерін транзиттік басқаруға маманданатын және өз қызметін халықаралық қаржы нарығында жүзеге асыратын инвестициялық компания және/немесе инвестициялық банк;

15) уәкілетті бөлімше – Ұлттық Банктің Монетарлық операциялар департаменті . » ;

2 - т а р а у а л ы н ы п т а с т а л с ы н ;

19-1 және 19-2-тармақтар мынадай редакцияда жазылсын:

«19-1. Активтердің бір сыртқы басқарушыға берілетін бөлігінің көлемі 300 (үш жүз) миллион АҚШ доллары баламасынан асатын мандаттар үшін міндетті к р и т е р и й л е р :

1) Қордың активтерін инвестициялау болжанатын қаржы құралдарымен

кемінде 10 жыл жұмыс тәжірибесінің болуы.

Егер ауқымды мандат бойынша сыртқы басқарушыны таңдау бойынша тендер жарияланса, ал тендер қатысушысының басқаруында тек осыған ұқсас аймақтық мандаттар болса, онда ауқымды мандатты кемінде 75 (жетпіс бес) пайызын қамту құрайтын аймақтық мандаттар бойынша кемінде 10 жыл жұмыс тәжірибесінің болуы ;

2) басқарудағы активтердің мөлшері: сыртқы басқарушының басқаруында клиенттердің кемінде 25 (жиырма бес) миллиард АҚШ доллары баламасындағы жиынтық активтерінің болуы ;

3) қарастырылып отырған мандат түрі бойынша басқарудағы активтердің мөлшері: сыртқы басқарушыда қаралып отырған мандат түрі бойынша клиенттердің жиынтық активтері 1 (бір) миллиард АҚШ доллары баламасынан кем болмауы тиіс .

Егер ауқымды мандат бойынша сыртқы басқарушыны таңдау бойынша тендер жарияланса, ал тендер қатысушысының басқаруында тек қана осыған ұқсас аймақтық мандаттар болса, онда ауқымды мандатты кемінде 75 (жетпіс бес) пайызын қамту құрайтын аймақтық мандаттар бойынша кемінде 1 (бір) миллиард АҚШ доллары баламасынан кем болмауы тиіс.

19-2. Активтердің бір сыртқы басқарушыға берілетін бөлігінің көлемі 300 (үш жүз) миллион АҚШ доллары баламасынан аспайтын мамандандырылған мандаттар үшін міндетті критерийлер:

1) Қордың активтерін инвестициялау болжанатын қаржы құралдарымен кемінде 5 жыл жұмыс тәжірибесінің болуы.

Егер ауқымды мандат бойынша сыртқы басқарушыны таңдау бойынша тендер жарияланса, ал тендер қатысушысының басқаруында тек қана осыған ұқсас аймақтық мандаттар болса, онда ауқымды мандатты кемінде 75 (жетпіс бес) пайызын қамту құрайтын аймақтық мандаттар бойынша кемінде 5 жыл жұмыс тәжірибесінің болуы ;

2) басқарудағы активтердің мөлшері: басқаруында клиенттердің жиынтық активтерінің мөлшері кемінде 1 (бір) миллиард АҚШ доллары болуы тиіс баламалы құралдар мандаттары бойынша сыртқы басқарушыларды қоспағанда, сыртқы басқарушының басқаруында баламасы 3 (үш) миллиард АҚШ долларынан кем емес клиенттердің жиынтық активтері болуы тиіс;

3) қарастырылып отырған мандат түрі бойынша басқарудағы активтердің мөлшері: сыртқы басқарушыда мандаттың қарастырылып отырған түрі бойынша баламасы 500 (бес жүз) миллион АҚШ доллары баламасынан кем емес клиенттердің жиынтық активтері болуы тиіс.

Егер ауқымды мандат бойынша сыртқы басқарушыны таңдау бойынша тендер жарияланса, ал тендер қатысушысының басқаруында тек қана осыған

ұқсас аймақтық мандаттар болса, онда ауқымды мандатты кемінде 75 (жетпіс бес) пайызын қамту құрайтын аймақтық мандаттар бойынша кемінде 500 (бес жүз) миллион АҚШ доллары баламасынан кем болмауы тиіс.»;

2-қосымша осы қаулының қосымшасына сәйкес редакцияда жазылсын.

2. Осы қаулы алғашқы ресми жарияланған күнінен бастап күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі.

Төрағасы

Г. Марченко

Ұ л т т ы қ Б а н к

« К Е Л І С І Л Д І »

Қ а з а қ с т а н Р е с п у б л и к а с ы н ы ң

Қ а р ж ы м и н и с т р і

Б . Ж ә м і ш е в

2012 жылғы 19 қаңтар

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 1 1

ж ы л ғ ы

2 6

ж е л т о қ с а н д а ғ ы

№

2 0 2

қ а у л ы с ы н а

қ о с ы м ш а

« 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

қ о р ы н ы ң

а к т и в т е р і н

с ы р т қ ы

б а с қ а р у ш ы л а р д ы

т а ң д а у

е р е ж е с і н е

2-қосымша

Сыртқы басқарушылардың ұсыныстарын салыстырмалы талдауға арналған бағалау критерийлері

	Критерий	Критерийдің мәні (пайызбен)
1.	Портфельді басқарудың тарихи нәтижелері (аймақтық мандаттарға маманданған және ауқымды мандат бойынша басқарушыны таңдауға қатысатын әлеуетті сыртқы басқарушылардың ұсыныстарына салыстырмалы талдау жүргізген кезде көрсеткіштер тиісті мандаттың қамтуына байланысты нормаланады)	35
	осы мандат түрі бойынша соңғы 5 жылдағы үстеме кірістіліктің орташа деңгейі	40
	ақпараттық коэффициент	60
2.	Активтер	10
	осы мандат түрі бойынша активтер көлемінің басқарудағы жалпы активтерге пайызы (аймақтық мандаттарға маманданған және ауқымды мандат бойынша басқарушыны таңдауға қатысатын әлеуетті сыртқы басқарушылардың ұсыныстарына салыстырмалы талдау жүргізген кезде аймақтық мандаттар бойынша активтердің көлемі	65

	пайдаланылады. Бұл мән тиісті мандаттың қамтуына байланысты нормаланады)	
	институционалдық инвесторлардың активтері көлемінің басқарудағы жалпы активтерге пайызы	35
3.	Команда	15
	портфельдік менеджерлердің және талдаушылардың орташа жұмыс тәжірибесі	50
	мамандардың тұрақтамауының төмен болуы	50
4.	Кредиттік мәртебе	5
	- егер бас ұйымның кепілдігі болса не келісімге бас ұйым қол қойған жағдайда, онда бас ұйымның кредиттік рейтингісі (S&P немесе Moody's), керісінше жағдайда компанияның кредиттік рейтингісі	
	Басқару үшін төленетін комиссияның деңгейі	20
5.	Базалық комиссияның деңгейі	90
	Net new high basis since inception қағидатын қабылдау	10
6.	Сервис	10
	Ұлттық Банктің мамандарын оқыту	70
	күн сайынғы есептілік	30
7.	Тәуекелдерді бақылау және басқару бойынша арнайы бағдарламалық қамтамасыз етудің болуы	2
8.	Сыртқы басқару бойынша келісімнің талаптарын бұзған жағдайда Ұлттық Банк алдында жауапкершілік қабылдау	3