

Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігі Басқармасының «Екінші деңгейдегі банктердің бағалы қағаздар рыногында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыра алатын туынды бағалы қағаздардың және туынды қаржы құралдардың базалық активтерін сатып алу тізбесі және тәртібі туралы» 2007 жылғы 16 шілдедегі № 210 қаулысына өзгерістер мен толықтыру енгізу туралы

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2012 жылғы 25 мамырдағы № 193 қаулысы. Қазақстан Республикасы Әділет министрлігінде 2012 жылы 2 шілдеде № 7778 тіркелді

«Қазақстан Республикасындағы банктер және банк қызметі туралы» 1995 жылғы 31 тамыздағы Қазақстан Республикасының Заңына сәйкес Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:**

1. Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігі Басқармасының «Екінші деңгейдегі банктердің бағалы қағаздар рыногында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыра алатын туынды бағалы қағаздардың және туынды қаржы құралдардың базалық активтерін сатып алу тізбесі және тәртібі туралы» 2007 жылғы 16 шілдедегі № 210 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 4892 тіркелген) мынадай өзгерістер мен толықтыру енгізілсін: тақырыбы мынадай редакцияда жазылсын:

«Екінші деңгейдегі банктердің бағалы қағаздар рыногында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыра алатын туынды бағалы қағаздардың және туынды қаржы құралдарының базалық активтерін сатып алу тізбесін және тәртібін, сондай-ақ қайталама нарықта мемлекеттік бағалы қағаздармен және мемлекеттік емес бағалы қағаздармен, ұйымдаспаған бағалы қағаздар рыногында туынды қаржы құралдарымен мәмілелер жасау жағдайларын белгілеу туралы»;

кіріспесінде «Екінші деңгейдегі банктердің бағалы қағаздар рыногында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыра алатын туынды бағалы қағаздардың және туынды қаржы құралдардың базалық активтерін сатып алу тізбесін және тәртібін реттейтін нормативтік құқықтық актілерді жетілдіру мақсатында» деген сөздер «Қазақстан Республикасындағы банктер және банк қызметі туралы» 1995 жылғы 31 тамыздағы Қазақстан Республикасының Заңына сәйкес» деген сөздермен а у ы с т ы р ы л с ы н ;

2-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

«2. Базалық активтері осы қаулының 1-тармағында айқындалған туынды қаржы

құралдарымен мәмілелер Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын және қаржы ұйымдарын реттеу мен қадағалау агенттігі Басқармасының 2005 жылғы 30 қыркүйектегі № 358 қаулысымен (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 3924 тіркелген) бекітілген Екінші деңгейдегі банктер үшін пруденциалдық нормативтер есеп айырысуларының нормативтік мәні мен әдістемесі туралы нұсқаулықтың (бұдан әрі - № 358 Нұсқаулық) 4-қосымшасында көрсетілген Қазақстан Республикасының ұйымдастырылған бағалы қағаздар нарығында және (немесе) халықаралық қор биржалары таныған сауда-саттық ұйымдастырушыларының жүйесінде мынадай жағдайлардың бірін сақтаған кезде ұйымдаспаған нарықта мәмілелер жасау жағдайларын қоспағанда, жасалады:

1) Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес рейтингісі немесе Moody's Investors Service және Fitch агенттіктерінің осындай деңгейдегі рейтингісі бар ұйым болып табылатын Қазақстан Республикасының резиденті емес қарсы әріптесі не Standard & Poor's және Fitch рейтингілік агенттіктерінің жіктеуі бойынша «BB-» төмен емес немесе Moody's Investors Service рейтингілік агенттігінің жіктеуі бойынша «Ba3» төмен емес рейтингісі не жоғарыда көрсетілген рейтингілік агенттіктердің ұлттық шәкілі бойынша «kzBBB» төмен емес рейтингілік бағасы бар ұйым болып табылатын Қазақстан Республикасының резидент қ а р с ы ә р і п т е с і ;

2) Bloomberg немесе Reuters ақпараттық талдау жүйелерінде сатып алуға және (немесе) сатуға баға белгілеулері бар, не осындай баға белгілеулері болмаған жағдайда Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес рейтингісі немесе Moody's Investors Service және Fitch агенттіктерінің осындай деңгейдегі рейтингісі бар үш түрлі қарсы әріптестің кемінде үш баға белгілеуі бар;

3) туынды қаржы құралдарының базалық активі № 358 Нұсқаулықтың 4-қосымшасында көрсетілген Қазақстан Республикасының ұйымдастырылған бағалы қағаздар нарығына және (немесе) халықаралық қор биржалары таныған сауда-саттық ұйымдастырушыларының жүйесінде айналысқа жіберілген;

4) екінші деңгейдегі банктің аудитін жүзеге асыратын аудиторлық ұйым аудиторлық ұйымның мыналар туралы оң пікірін білдіруді көздейтін есепті ұсынған ж а ғ д а й д а :

екінші деңгейдегі банктің туынды қаржы құралын бағалау әдістемелері; кредиттік шығындарды, пайыздық мөлшерлемелерді немесе дисконттау мөлшерлемелерін бағалауға қатысты жасалған олқылықтар туралы ақпаратты қоса алғанда, туынды қаржы құралының құнын айқындау кезінде пайдаланылған о л қ ы л ы қ т а р ;

екінші деңгейдегі банк жүргізген стресс тестілеу, сезімталдықты талдау нәтижелері.

Екінші деңгейдегі банктер базалық активі төмендегі ұйымдардың кредиттік тәуекелі болып табылатын туынды бағалы қағаздармен және туынды қаржы

құралдарымен брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асырады:

1) Standard & Poors және «Fitch» рейтингілік агенттіктерінің жіктеуі бойынша халықаралық шәкіл бойынша «BB-» төмен емес немесе Moody's Investors Service рейтингілік агенттігінің жіктеуі бойынша «Ba3» төмен емес кредиттік рейтингісі, не жоғарыда көрсетілген рейтингілік агенттіктерінің ұлттық шәкілі бойынша «kzBBB» төмен емес рейтингілік бағасы бар Қазақстан Республикасының резиденттері;

2) Standard & Poors және Fitch рейтингілік агенттіктерінің жіктеуі бойынша халықаралық шәкіл бойынша «BBB-» төмен емес немесе Moody's Investors Service рейтингілік агенттігінің жіктеуі бойынша «BBa3» төмен емес рейтингісі бар Қазақстан Республикасының резиденті еместер;

3) берілген заемдар бойынша Қазақстан Республикасының резидент ұйымдары, сондай-ақ шығарылған кепілдіктер мен аккредитивтер бойынша Қазақстан Республикасының өтініш беруші-резиденттері.»;

мынадай мазмұндағы 3-1-тармақпен толықтырылсын:

«3-1. Банктер қайталама нарықтағы мемлекеттік және мемлекеттік емес бағалы қағаздармен мәмілелерді мынадай жағдайларды қоспағанда, ұйымдастырылған бағалы қағаздар нарығында жасайды:

1) Қазақстан Республикасының резидент эмитенттері және Қазақстан Республикасының резидент емес эмитенттері шығарған (ұсынған), № 358 Нұсқаулықтың 4-қосымшасында көрсетілген халықаралық қор биржалары таныған сауда-саттық ұйымдастырушыларының жүйесінде сатылатын мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздарды сатып алу-сату бойынша халықаралық биржадан тыс бағалы қағаздар нарықтарында мәмілелер жасау;

2) мемлекеттік бағалы қағаздарды сатып алу–сату бойынша мәмілелер жасау;

3) Қазақстан Республикасының резидент емес заңды тұлғаларымен өтімділікті тарту мақсатында жүзеге асырылатын халықаралық биржадан тыс бағалы қағаздар нарықтарында «репо» операцияларын жүргізу;

4) меншікті еурооблигацияларды сатып алу-сату бойынша мәмілелер жасау;

5) басымдықпен сатып алу құқығын іске асыру;

6) «Акционерлік қоғамдар туралы» 2003 жылғы 13 мамырдағы Қазақстан Республикасы Заңының 27-бабына сәйкес орналастырылған акцияларды акционердің талап етуі бойынша сатып алу;

7) қор биржасы делистингке ұшыратқан бағалы қағаздарды өткізу;

8) эмитенттің бағалы қағаздарын және өзге де міндеттемелерін эмитенттің міндеттемелерін қайта құрылымдау мақсатында шығарылған осы эмитенттің басқа бағалы қағаздарына айырбастау;

9) Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының «Заңды тұлғалардың банктер, банктің немесе банк холдингінің еншілес ұйымдары сатып алатын акцияларға (жарғылық капиталға қатысу үлестеріне) қойылатын талаптарды, сондай-ақ банктің

жарғылық капиталға қатысу үлестерінің не заңды тұлғалар акцияларының жиынтық құнын белгілеу туралы» 2012 жылғы 24 ақпандағы № 84 қаулысының (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 7504 тіркелген) қосымшасында көрсетілген халықаралық қор биржаларындағы еркін айналыстағы Қазақстан Республикасының резиденті емес заңды тұлғалардың акцияларын (жарғылық капиталға қатысу үлестерін) халықаралық нарықтарында биржадан тыс бағалы қағаздар сатып алу - сату бойынша мәмілелер жасау;

10) «Қазақстан Республикасындағы банктер және банк қызметі туралы» 1995 жылғы 31 тамыздағы Қазақстан Республикасы Заңының 8-бабына сәйкес заңды тұлғалардың акцияларын (жарғылық капиталдарына қатысу үлестерін) сатып алу-сату бойынша мәмілелер, сондай-ақ «Қазақстан Республикасындағы банктер және банк қызметі туралы» 1995 жылғы 31 тамыздағы Қазақстан Республикасы Заңының 5-1-бабына сәйкес мемлекеттік емес бағалы қағаздармен мәмілелер жасау.».

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

Ұ л т т ы қ Б а н к

Төрағасы

Г. Марченко