

Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының «Қазақстан Республикасы Ұлттық қорының инвестициялық операцияларын жүзеге асыру ережесін бекіту туралы» 2006 жылғы 25 шілдедегі № 65 қаулысына өзгерістер мен толықтырулар енгізу туралы

Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының 2012 жылғы 28 сәуірдегі № 161 қаулысы. Қазақстан Республикасы Әділет министрлігінде 2012 жылы 2 шілдеде № 7780 тіркелді

«Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі туралы» 1995 жылғы 30 наурыздағы Қазақстан Республикасының Заңы және «Қазақстан Республикасының Ұлттық қорын сенімгерлік басқару туралы шарт туралы» Қазақстан Республикасы Үкіметінің 2001 жылғы 18 мамырдағы № 655 қаулысымен мақұлданған Қазақстан Республикасының Ұлттық қорын сенімгерлік басқару туралы 2001 жылғы 14 маусымдағы № 299 шартқа сәйкес Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:**

1. Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының «Қазақстан Республикасы Ұлттық қорының инвестициялық операцияларын жүзеге асыру ережесін бекіту туралы» 2006 жылғы 25 шілдедегі № 65 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 4361 тіркелген) мынадай өзгерістер мен толықтырулар енгізілсін:

көрсетілген қаулымен бекітілген Қазақстан Республикасы Ұлттық қорының инвестициялық операцияларын жүзеге асыру ережесінде:

1 және 2-тараулардың тақырыптары мынадай редакцияда жазылсын:

« 1 . Ж а л п ы е р е ж е л е р » ;

« 2 . Н е г і з г і ұ ғ ы м д а р » ;

12 және 13-тармақтар мынадай редакцияда жазылсын:

«12. Облигациялардың композиттік индексі – әлемнің дамыған елдерінің кірісі белгіленген бағалы қағаздары индекстерінің мынадай өтімділігі жоғары бағалы қағаздардан тұратын индексі:

Merrill Lynch U.S. Treasuries, 1-5 Yrs (GVQ0) – 30 (отыз) пайыз;

Merrill Lynch 1-5 Year All Euro Government Index, DE, FR, NL, AT, LU, FI (EVDF) –
2 8 (ж и ы р м а с е г і з) п а ы з ;

Merrill Lynch U.K. Gilts, 1-5 Yrs (GVL0) – 10 (он) пайыз;

Merrill Lynch Japanese Governments, 1-5 Yrs (GVY0) – 10 (он) пайыз;

Merrill Lynch Australian Government, 1-5 Yrs (GVT0) – 5 (бес) пайыз;

Merrill Lynch Canadian Governments, 1-5 Yrs (GVC0) – 5 (бес) пайыз;

Merrill Lynch South Korean Government Index, 1-5 Yrs (GSKV) – 5 (бес) пайыз;

Merrill Lynch Hong Kong Government Index, 1-5 Yrs (GVHK) – 3 (үш) пайыз;

Merrill Lynch Singapore Government Index, 1-5 Yrs (GVSP) – 2 (екі) пайыз;

Merrill Lynch Danish Government Index, 1-5 Yrs (GVM0) – 2 (екі) пайыз.

Осы индексте эталондық бөлуге қайтып келу күнтізбелік тоқсанның соңғы жұмыс күні жүргізіледі. Индекстегі бағалы қағаздар құрамы нарықтық капиталдандыру негізінде ай сайын ауысады. Кірістілік және тәуекел көрсеткіштері күн сайын е с е п т е л е д і .

13. Кредиттік рейтинг – қаржы құралдары бойынша кредиттік тәуекел деңгейінің Standard and Poor’s Financial Services LLC (бұдан әрі – Standard & Poor’s) және Moody’s Investors Services (бұдан әрі – Moody’s) халықаралық рейтингілік агенттіктер беретін көрсеткіші. Кредиттік рейтингілер кестеде осы Ереженің 1-қосымшасына сәйкес кредиттік тәуекелдің ұлғаюына қарай орналастырылады.»;
мынадай мазмұндағы 16-1-тармақпен толықтырылсын:

«16-1. Туынды құралдар – форвард, своп мәмілелері, форвардтық пайыздық мөлшерлеме (ФРА) туралы келісім, опцион, фьючерс және осы мәмілелердің қиыстырылуынан тұратын басқа да операциялар.»;

3-тараудың тақырыбы мынадай редакцияда жазылсын:

«3. Тұрақтандыру және жинақ портфельдерін басқару жөніндегі жалпы стратегия»;

32-тармақтың үшінші абзацы мынадай редакцияда жазылсын:

«Осы Ережеде көзделген шектеулер кірістілік пен тәуекелдер көрсеткіштерін есептегенде ескерілмейтін қазақстандық қаржы құралдарына қолданылмайды.»;

34-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

«34. Депозиттер (салымдар) A1 (Standard & Poor’s)/P1 (Moody’s) төмен емес қысқа мерзімді кредиттік рейтингісі және A (Standard & Poor’s)/A2 (Moody’s) төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингісі бар банктерде ғана орналастырылуы мүмкін. Депозиттердің (салымдардың) ең көп мерзімі – 1 (бір) ай.»;

4 және 5-тараулардың тақырыптары мынадай редакцияда жазылсын:

«4. Тұрақтандыру портфелінің негізгі өлшемдері»;

«5. Жинақ портфелінің өлшемдері»;

47-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

«47. Жинақ портфелінің кірістілігі ауытқуының эталондық портфель кірістілігінен күтілетін өзгермелілігі (tracking error) 2 (екі) пайыздан аспауы тиіс. Нарық жағдайында, осы Ереженің 46-тармағында көрсетілген эталондық портфельден ауытқу 10 (он) пайыздан астам болған кезде, жинақ портфелінің кірістілігі ауытқуының өзгермелілік көрсеткіші Қордың Уәкілетті өкілінің рұқсатымен 2 (екі) пайыздан асуы мүмкін.»;

51-тармақтың екінші бөлігі мынадай редакцияда жазылсын:

«Ақша нарығының корпоративтік бағалы қағаздарының ең төменгі қысқа мерзімді кредиттік рейтингісі – A2 (Standard & Poor’s)/P3 (Moody’s).»;

53-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

«53. Жинақ портфелінің акциялары портфелінің активтері (бұдан әрі – акциялар портфелі) жай және артықшылықты акцияларға, акциялар портфелінің эталондық портфеліне немесе оның секторларындағы құрамдас бөліктерге негізделген индекстерге, туынды қаржы құралдарына, сондай-ақ қолма-қол ақшаға инвестициялануы мүмкін.»;

6, 7 және 8-тараулардың тақырыптары мынадай редакцияда жазылсын:

«6. Сыртқы басқарушыларды таңдау кезіндегі шектеулер»;

«7. Кастодиандарды таңдау кезіндегі шектеулер»;

«8. Құрылымдық өнімдерді пайдалану»;

69-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

«69. Құрылымдық өнімнің ұзақ мерзімді кредиттік рейтингісі А- (Standard & Poor's) немесе А3 (Moody's) төмен болмауы, ал қысқа мерзімдісі – А-1 (Standard & Poor's) немесе Р-1 (Moody's) төмен болмауы тиіс.»;

9-тараудың тақырыбы мынадай редакцияда жазылсын:

« 9 . Е с е п т і л і к » ;

мынадай мазмұндағы 10-тараумен толықтырылсын:

«10. Кредиттік тәуекел лимиттері

72. Ұлттық Банк Қорды сенімгерлік басқару кезінде инвестициялық операцияларды жүзеге асырған кезде тізбесін Ұлттық Банк айқындайтын қарсы әріптестермен операциялар жүргізеді. Қарсы әріптестерге арналған кредиттік тәуекел лимитінің ең көп мөлшері Ұлттық Банктің қарсы әріптестерімен және кастодиандарымен операциялар бойынша кредиттік тәуекелді басқару тәртібін реттейтін нормативтік құқықтық актіге сәйкес белгіленеді.

73. Қарсы әріптестерге арналған лимиттер қарсы әріптестердің кінәсінен жасалатын мәмілелер бойынша есеп айырысуларды аяқтаудың кешігуіне байланысты жағдайларды қоспағанда, екі жұмыс күні ішінде немесе мерзімді мәмілелерді жапқан күннен кейін келесі жұмыс күні Ұлттық Банктің қарсы әріптестерімен және кастодиандарымен операциялар бойынша кредиттік тәуекелді басқару тәртібін реттейтін нормативтік құқықтық актіге сәйкес белгіленген шектеулерге сәйкес келтіріледі. Бағалы қағаздардың ұзақ мерзімді кредиттік рейтингісін, сондай-ақ туынды құралдармен аяқталмаған операциялар бойынша қарсы әріптестердің кредиттік рейтингісін осы Ережеде белгіленген деңгейден төмен төмендеткен жағдайда, рейтинг төмендетілген күннен бастап 6 (алты) ай ішінде осы ұстанымдар мен мәмілелерді осы Ереженің талаптарына сәйкес келтіру бойынша шаралар қабылданады.

74. Сыртқы басқаруға берілген активтермен операциялар ең аз кредиттік рейтингісі осы Ережеде белгіленген шектеулерге сәйкес келетін қарсы әріптестермен жүзеге асырылады.»;

3 және 4-қосымшалар осы қаулының 1 және 2-қосымшаларына сәйкес редакцияда жазылсын.

2. Осы қаулы алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі және 2012 жылғы 1 маусымнан бастап туындайтын қатынастарға қолданылады.

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

Қ а р ж ы м и н и с т р л і г і

М и н и с т р _____ Б. Жәмішов

2012 жылғы 2 маусым

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 2

ж ы л ғ ы

2 8

с ә у і р д е г і

№ 1 6 1

қ а у л ы с ы н а

1-қосымша

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

и н в е с т и ц и я л ы қ

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

3-қосымша

Кірісі белгіленген бағалы қағаздар портфелінің және жинақ портфелінің құрамындағы акциялар портфелінің нарықтық құнының жол берілетін ауытқулары

	Ең төмен	Ең жоғары
Кірісі белгіленген бағалы қағаздар	70 пайыз	100 пайыз
Акциялар	0 пайыз	30 пайыз

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 2

ж ы л ғ ы

2 8

с ә у і р д е г і

№ 1 6 1

қ а у л ы с ы н а

2-қосымша

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

и н в е с т и ц и я л ы қ

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

Кірісі белгіленген бағалы қағаздар портфелінің секторлық бөлінуі

	Ең төмен	Ең жоғары
Қолда бар валюта (ағымдағы шоттардағы қалдықтар; келесі жұмыс күні қайтару мүмкіндігімен ақша нарығы қорларына орналастырылған қаражат), эталондық портфельге кіретін елдердің мемлекеттік (тәуелсіз) және агенттік борыштық міндеттемелері	60%	100%
Халықаралық қаржы ұйымдарының борыштық міндеттемелері	0%	30%
Эталондық портфельге кірмейтін елдердің мемлекеттік (тәуелсіз) борыштық міндеттемелері, агенттік борыштық міндеттемелері	0%	40%
Депозиттер (салымдар), оның ішінде репо операцияларынан депозиттерге орналастырылған қаражат	0%	30%
Туынды құралдар (Tracking Eпгог бойынша шектеумен реттеледі)	0%	50%
Құрылымдық өнімдер (MBS, ABS қоспағанда)*	0%	10%
Жылжымайтын мүлікке (MBS) және активтерге (ABS) кепілге салынған бағалы қағаздар	0%	30%
Корпоративтік және коммерциялық бағалы қағаздар (ECP)	0%	30%

* Ұлттық Қордың Өкілетті өкілінің рұқсатымен.