

Орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жүйесіне, орталық контрагенттің тәуекелдері мониторингінің, оларды бақылау мен басқарудың шарттары мен тәртібіне қойылатын талаптарды бекіту туралы

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2016 жылғы 28 қаңтардағы № 11 қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2016 жылы 29 ақпанда № 13314 болып тіркелді.

"Бағалы қағаздар рыногы туралы" 2003 жылғы 2 шілдедегі Қазақстан Республикасының Заңына сәйкес Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:**

1. Қоса беріліп отырған Орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жүйесіне, орталық контрагенттің тәуекелдері мониторингінің, оларды бақылау мен басқарудың шарттары мен тәртібіне қойылатын талаптар бекітілсін.

2. Бақылау және қадағалау әдіснамасы департаменті (Әбдірахманов Н.А.) Қазақстан Республикасының заңнамасында белгіленген тәртіппен:

1) Құқықтық қамтамасыз ету департаментімен (Сәрсенова Н.В.) бірлесіп осы қаулыны Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркеуді;

2) осы қаулыны "Қазақстан Республикасы Әділет министрлігінің Республикалық құқықтық ақпарат орталығы" шаруашылық жүргізу құқығындағы республикалық мемлекеттік кәсіпорнына;

Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркелгенінен кейін күнтізбелік он күн ішінде "Әділет" ақпараттық-құқықтық жүйесінде ресми жариялауға;

Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркелгеннен кейін оны Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі алған күннен бастап күнтізбелік он күн ішінде Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің мемлекеттік тізіліміне, Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің эталондық бақылау банкіне енгізуге жіберуді;

3) осы қаулы ресми жарияланғаннан кейін оны Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ресми интернет-ресурсына орналастыруды қамтамасыз етсін

3. Халықаралық қатынастар және жұртшылықпен байланыс департаменті (Қазыбаев А.Қ.) осы қаулыны Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркелгеннен кейін күнтізбелік он күн ішінде мерзімді баспасөз басылымдарында ресми жариялауға жіберуді қамтамасыз етсін.

4. Осы қаулының орындалуын бақылау Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Төрағасының орынбасары О.А. Смоляковқа жүктелсін.

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

Ұлттық Банк
Төрағасы

Д. Ақышев

Қазақстан Республикасының
Ұлттық Банкі Басқармасының
2016 жылғы 28 қаңтардағы
№ 11 қаулысымен бекітілген

Орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жүйесіне, орталық контрагенттің тәуекелдері мониторингінің, оларды бақылау мен басқарудың шарттары мен тәртібіне қойылатын талаптар

1. Осы Орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жүйесіне, орталық контрагенттің тәуекелдері мониторингінің, оларды бақылау мен басқарудың шарттары мен тәртібіне қойылатын талаптар (бұдан әрі – Талаптар) "Бағалы қағаздар рыногы туралы" 2003 жылғы 2 шілдедегі Қазақстан Республикасының Заңына (бұдан әрі – Бағалы қағаздар рыногы туралы заң) сәйкес әзірленді және орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жүйесіне, орталық контрагенттің тәуекелдер мониторингінің шарттары мен тәртібіне, бақылау мен басқаруға қойылатын талаптарды белгілейді.

2. Талаптарда мынадай ұғымдар пайдаланылады:

1) баға тәуекелі – қаржы құралдары құнының қаржы құралдарының, тауарлардың нарықтық құнына әсер ететін қаржы нарықтарының талаптары өзгерген жағдайда туындайтын өзгеруі салдарынан шығыстардың (зиянның) туындау тәуекелі;

2) бедел тәуекелі – қоғамда орталық контрагенттің қаржылық сенімділігі, көрсетілетін қызметтердің сапасы немесе жалпы алғанда орталық контрагент қызметінің сипаты туралы жағымсыз пікір қалыптасуы салдарынан клиенттік базаның тарылуы, өзге де даму көрсеткіштерінің төмендеуі нәтижесінде залалдардың туындау, жоспарланған кірістердің алынбау ықтималдығы;

3) валюталық тәуекел – орталық контрагент өз қызметін жүзеге асырған кезде шетел валюталары бағамдарының жағымсыз өзгерістері салдарынан қаржылай шығындардың туындау ықтималдығы;

4) есеп айырысу ұйымы – қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша есеп айырысуларды (төлемдерді) ұйымдастыруды жүзеге асыратын ұйым;

5) кепілдік беру қоры – клирингтік қатысушылардың жарналары есебінен қалыптастырылған және клирингтік қатысушыларға қызмет көрсету кезінде клиринг ұйымы (орталық контрагент) қызметінің тәуекелдерін төмендету үшін арналған қаражат;

6) кредиттік тәуекел – контрагенттің келісілген талаптарға сәйкес өз міндеттемелерін орындамауы салдарынан туындайтын залалдардың туындау ықтималдығы;

7) құқықтық тәуекел – мыналардың:

контрагенттің Қазақстан Республикасының нормативтік құқықтық актілерінің талаптарын, сондай-ақ жасасқан шарттардың талаптарын бұзуы;

құқықтық жүйенің жетілдірілмеуі (орталық контрагент қызметінің барысында туындайтын жекелеген мәселелерді реттеу бойынша заңнама қайшылығы, құқықтық нормалардың болмауы);

қызметті жүзеге асыру кезінде құқықтық қателер жіберу (дұрыс емес заңдық консультациялар немесе құжаттарды дұрыс жасамау, оның ішінде сот органдарында даулы мәселелерді қарау кезінде);

орталық контрагенттің Қазақстан Республикасы заңнамасының, ал Қазақстан Республикасының бейрезиденттерімен қатынастарда – басқа мемлекеттердің қолданылатын заңнамасының талаптарын сақтамауы;

орталық контрагенттің жасасқан шарттардың талаптарын сақтамауы салдарынан залалдардың туындау ықтималдығы;

8) операциялық тәуекел – барабар емес немесе жеткіліксіз ішкі процестер, адам ресурстары мен жүйелері немесе сыртқы оқиғалар нәтижесінде залалдардың туындау ықтималдығы, оның ішінде:

ақпараттық технологиялар саласындағы барабар емес стратегиялар, саясаттар және (немесе) стандарттар, бағдарламалық қамтамасыз етуді пайдаланудағы кемшіліктер нәтижесінде туындаған тәуекел;

барабар емес ақпаратқа не оны тиісінше пайдаланбауға байланысты тәуекел;

бизнес-процестердің барабар емес құрылуына не ішкі құжаттар мен қағидалардың сақталуының әлсіз бақылануына байланысты тәуекел;

жауапкершілікті бөлуді, есептілік пен басқарудың құрылымын қоса алғанда, орталық контрагенттің белгісіз, барабар емес ұйымдық құрылымымен байланысты тәуекел;

қызметкерлерді тиісінше басқармауға және (немесе) орталық контрагенттің біліксіз қызметкерлеріне байланысты тәуекел;

орталық контрагенттің ішкі құжаттарының заңнама талаптарына сәйкес келмеуіне байланысты тәуекел;

орталық контрагенттің қызметіне теріс әсер етуі мүмкін банк қызметкерлерінің іс-әрекеттеріне, алаяқтыққа байланысты тәуекел;

орталық контрагенттің операцияларына сыртқы ықпал етудің болжанбаған немесе бақыланбайтын факторларымен туындаған тәуекел;

9) орталық контрагент – қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша клирингтік қызметті, сондай-ақ банк операцияларының жекелеген түрлерін жүзеге асыратын және қаржы құралын әрбір сатушы және әрбір сатып алушы үшін бағалы қағаздардың ұйымдастырылған және ұйымдастырылмаған нарықтарында, сондай-ақ тауар биржасында жасалатын мәмілелер бойынша тарап болатын клиринг ұйымы;

10) өтімділікті жоғалту тәуекелі – орталық контрагенттің өз міндеттемелерін белгіленген мерзімде айтарлықтай шығындар шекпей орындауға қабілетсіздігі нәтижесінде залалдардың туындау ықтималдығы;

11) пайыздық тәуекел – активтер, пассивтер мен баланстан тыс құралдар бойынша нарықтық пайыздық мөлшерлемелердің жағымсыз өзгеруі салдарынан қаржылай залалдардың туындау ықтималдығы;

12) резервтік қор – орталық контрагенттің меншікті активтері есебінен қалыптастырылған және орталық контрагент қызметінің тәуекелдерін төмендетуге арналған қаражат;

13) стресс - тестинг - орталық контрагенттің қызметіне ықпал ететін орталық контрагенттің қаржылық жағдайына ерекше болатын, бірақ ықтимал оқиғалардың әлеуетті ықпал етуді өлшеу әдістері;

14) тәуекел – күтілетін немесе болжанбаған оқиғалар орталық контрагентке, оның капиталына немесе кірістеріне жағымсыз әсер ететін ықтималдық;

15) уәкілетті орган – қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын реттеу, бақылау және қадағалау жөніндегі уәкілетті орган.

Ескерту. 2-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

3. Орталық контрагенттің директорлар кеңесі тәуекелдерді басқару жүйесінің Талаптарға сәйкес келуін қамтамасыз етеді және орталық контрагент органдарының, бөлімшелерінің және қызметкерлерінің оларға тәуекелдерді басқару саласы бойынша жүктелген міндеттерді орындауы үшін жағдайлар жасайды.

4. Орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жүйесіне қойылатын талаптар былайша бөлінеді:

1) тәуекелдерді басқару жүйесінің болуына қойылатын базалық талаптар;

2) ұйымдық құрылымына қойылатын талаптар;

3) мониторингке, бақылауға және тәуекелдерді басқару тәртібіне қойылатын талаптар;

4) қаржы құралдарымен жасалатын мәмілелерді жүзеге асыру қызметін ұйымдастыруға қойылатын талаптар;

5) ішкі бақылау жүйесінің болуына қойылатын талаптар.

Ескерту. 4-тармаққа өзгеріс енгізілді – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

5. Орталық контрагент жыл сайын есепті жылдан кейінгі жылдың

1 (бірінші) шілдесінен кешіктірмей уәкілетті органға Талаптарға қосымшаға сәйкес нысан бойынша тәуекелдерді басқару жүйесіне қойылатын талаптардың орындалуын бағалау бойынша есеп береді.

6. Орталық контрагент Талаптардың 30-тармағының 1), 2), 3), 4), 5) және 6) тармақшаларында көрсетілген тәуекелдердің түрлері бойынша орталық контрагенттің

тәуекелдерді басқару жөніндегі саясатында көзделген тәртіппен тоқсанына кемінде бір рет стресс-тестинг жүргізеді.

Ескерту. 6-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 21.09.2020 № 84 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

7. Талаптардың 30-тармағының 1), 2), 3), 4), 5) және 6) тармақшаларында көрсетілген тәуекелдер бойынша стресс-тестинг нәтижелері орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жөніндегі саясатында белгіленген тәртіппен ресімделеді және стресс-тест сценарийінің сипатын, таңдалған стресс-тест сценарийінің негіздемесін және стресс-тестинг нәтижелері бойынша ұсынымдарды қамтиды.

Ескерту. 7-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 21.09.2020 № 84 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

8. Алып тасталды – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 21.09.2020 № 84 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

9. Орталық контрагентте тәуекелдерді басқару жүйесінің болуы орталық контрагент қызметінің корпоративтік басқару талаптарына сәйкес келуін, бағалы қағаздар нарығында қызметтің кәсіби түрін жүзеге асыру шеңберінде операциялар жүргізу тәжірибесінің болуын көздейді.

Орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жүйесі оның қызметіне тән тәуекелдерді бақылауды, мониторингтеуді, сондай-ақ барынша азайтуды қамтамасыз етеді.

Ескерту. 9-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 21.09.2020 № 84 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

10. Орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жүйесі өз қызметінде мынадай бағыттарды қамтиды:

1) клирингтік қатысушылар, қор (тауар) биржасы, орталық депозитарий және (немесе) есеп айырысу ұйымы ұсынатын ақпаратты жинау, енгізу, сақтау және тарату;

2) қор биржасының сауда жүйесінде жасалған сауда-саттық және мәмілелер, сондай-ақ клиринг бойынша ақпарат жинау, талдау және сақтау;

3) орталық контрагенттің мүдделі органдарының шешімдер қабылдауы және орталық контрагенттің органдары мен бөлімшелері арасында ақпарат алмасу үшін ақпарат ұсыну;

4) орталық контрагенттің активтерін қаржы құралдарына инвестициялау;

5) резервтік немесе кепілдік беру қорларын, клирингтік қатысушылардың маржалық жарналарын және өзге де қамтамасыз етуін қалыптастыру және пайдалану;

6) орталық контрагентті басқарудың ұйымдық құрылымын құру және жетілдіру;

7) клирингтік қатысушылармен жұмысты ұйымдастыру тәртібін айқындау, оның ішінде дауларды қарау және шешу, сондай-ақ клирингтік қатысушылардың өз міндеттемелерін орындамаған жағдайда тиісті шаралар қолдану рәсімдерін айқындау;

8) мынадай әдістердің көмегімен тәуекелдерді анықтау және сәйкестендіру:

процестің үздіксіз, үзіліссіз болуын қамтамасыз ету мақсатында орталық контрагенттің жүйесіне тұрақты мониторинг жүргізу;

орталық контрагенттің пайдаланылатын бағдарламалық-техникалық қамтамасыз етуінің аудиті;

орталық контрагенттің Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар рыногы туралы заңнамасында және орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару саласы жөніндегі саясатында белгілеген талаптарды сақтау мониторингі;

клирингтік қатысушылардың қаржылық жай-күйінің, сондай-ақ олардың орталық контрагенттің ішкі құжаттары талаптарына сәйкестігі мониторингі;

орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару саласы жөніндегі саясатында көзделген тәртіппен стресс-тестинг өткізу;

9) ішкі құжаттарды әзірлеу және бекіту.

Ескерту. 10-тармаққа өзгеріс енгізілді – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

11. Тәуекелдерді басқару жүйесінде мынадай ішкі құжаттардың болуы көзделеді, бірақ онымен шектелмейді:

1) орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жөніндегі саясаттары;

2) орталық контрагенттің активтерін инвестициялау тәртібі;

3) орталық контрагенттің резервтік немесе кепілдік беру қорларын қалыптастыру, сондай-ақ пайдалану тәртібі мен шарттары;

4) ішкі бақылауды және ішкі аудитті жүзеге асыру рәсімдері;

5) орталық контрагентте орын алған және әлеуетті мүдделер қақтығысын басқару рәсімдері;

6) орталық контрагенттің басшы және өзге қызметкерлерінің инсайдерлік ақпаратты және бағалы қағаздар нарығында коммерциялық құпияны құрайтын ақпаратты пайдалануына жол бермеуге бағытталған рәсімдер;

7) клирингтік қатысушылардың клирингтік қатысушылар ретіндегі қызметінің тәртібін реттейтін Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасының, орталық контрагенттің ішкі құжаттарының талаптарына және клирингтік қатысушылардың қаржылық жай-күйіне қойылатын талаптарға сәйкестігі мәніне мониторинг және бақылау жасаудың шарттары мен тәртібі;

8) клирингтік қатысушыларға қойылатын талаптар;

9) орталық контрагенттің ақпараттық саясаты.

Ескерту. 11-тармаққа өзгеріс енгізілді – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

12. Орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жөніндегі саясаты:

1) орталық контрагенттің директорлар кеңесінің, басқармасының, тәуекелдерді басқару жөніндегі жауапты бөлімшесінің және орталық контрагенттің клирингтік қатысушыларға мониторинг және бақылау жүргізу бөлімшесінің өкілеттіктері мен функционалдық міндеттері, сондай-ақ осы органдар мен бөлімшелердің арасында ақпарат алмасу тәртібі;

2) орталық контрагенттің қызметіне және оның жүйесінің жұмыс істеуіне байланысты тәуекелдер көрсеткіштерінің сандық мәнін анықтау тәртібін қоса алғанда, тәуекелдерді сәйкестендіру және бағалау жөніндегі рәсімдерді;

3) стресс-тестинг жүргізу жөніндегі рәсімдерді, сондай-ақ тәуекелдер көрсеткіштерінің барынша жоғары қолжетімді мәнін белгілеу жөніндегі рәсімдерді;

4) орталық контрагенттің қызметіне және оның жүйесінің жұмыс істеуі барысында туындайтын тәуекелдерді басқару жөніндегі шараларды;

5) осы тармақтың 2) тармақшасында белгіленген рәсімдер тиімділігі, орталық контрагенттің тәуекелдер көрсеткіштерінің мәндерін және тәуекелдерді басқару жөніндегі шараларды бағалаудың барабарлығы мониторингінің тетігін;

6) осы тармақтың 2) тармақшасында белгіленген рәсімдерге және осы тармақтың 3) тармақшасында шараларға сәйкес келмеген жағдайда қабылданатын шаралар тиімділігі мониторингінің тетігін;

7) тәуекелдер мониторингі, бағалау және бақылау жөніндегі рәсімдерді, оның ішінде:

орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жөніндегі жауапты бөлімшесінің орталық контрагенттің басқа бөлімшелерімен бірлесе отырып, тәуекелдер мониторингі бойынша қабылдайтын шараларын;

тәуекелдердің туындау жиілігін бағалауды, осы тәуекелдердің ықпалынан болған әсерлерді кейіннен ранжирлеуді және тәуекелдер көрсеткіштерінің жол берілетін ең жоғары мәндерін белгілеуді қоса алғанда, орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жөніндегі жауапты бөлімшесі жүзеге асыратын тәуекелдерді бағалауды;

орталық контрагент тәуекелдері көрсеткіштері мәндерінің және осы көрсеткіштердің жол берілетін ең жоғары мәндерінің өзгеруіне, сондай-ақ тәуекелдер көрсеткіштерінің мәндері тәуекелдер көрсеткіштерінің жол берілетін ең жоғары мәндеріне сәйкес келмеген жағдайда, тәуекелдерді барынша азайту мақсатында қабылданатын шараларға мониторинг жасауды қамтитын, орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жөніндегі жауапты бөлімшесі жүргізетін тәуекелдер мониторингі;

клирингтік қатысушылар қор биржасының сауда жүйесінде жасасқан мәмілелер бойынша орталық контрагенттің жауапкершілігіне әкеп соғуға мүмкіндігі бар

кез-келген маңызды жағдайлар туралы осындай жағдайларды анықтау функцияларына кіретін бөлімшенің директорлар кеңесіне дереу есептілік беру тетігі;

клирингтік қатысушылар тәуекелдерінің көрсеткіштері мәндерінің және тәуекелдердің осы көрсеткіштерінің жол берілетін ең жоғары мәндерінің өзгеруіне, сондай-ақ тәуекелдер көрсеткіштерінің мәндері тәуекелдер көрсеткіштерінің жол берілетін ең жоғары мәндеріне сәйкес келмеген жағдайда тәуекелдерді азайту мақсатында қабылданатын шараларға мониторинг жасау қамтылатын, орталық контрагенттің клирингтік қатысушыларға мониторинг және бақылау жүргізу жөніндегі жауапты бөлімшесі жүргізетін тәуекелдер мониторингі.

Ескерту. 12-тармаққа өзгеріс енгізілді – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

13. Орталық контрагенттің активтерін инвестициялаудың тәртібі қаржы құралдарымен мәмілелерді жүзеге асырудың шарттары мен тәртібін, қаржы құралдарымен мәмілелерді жүзеге асыру барысында қолданылатын құжаттардың үлгі нысандарын белгілейді және мыналар бойынша рәсімдердің сипаттауын қамтиды:

1) орталық контрагенттің активтерін инвестициялау саясатын әзірлеу;

2) мыналарды көздейтін орталық контрагенттің активтеріне қатысты инвестициялық шешімдерді қабылдау үшін ұсынымдар дайындау:

ұсынымдар беруге уәкілетті тұлғалар лауазымдарының тізбесі;

инвестициялық портфельдің жай-күйін талдауды жүзеге асыру тәртібі;

инвестициялауды жүзеге асыру болжанатын қаржы құралдары айналымының және кірістілігінің болуын талдауды жүзеге асыру тәртібі;

инвестициялауды жүзеге асыру болжанатын қаржы құралдарымен байланысты тәуекелдерді талдауды жүзеге асыру тәртібі;

ұсынымдарды беру үшін маңызды факторлардың талдауын жүзеге асыру тәртібі;

3) инвестициялық комитет жұмысының сипаттамасы, отырыстарды өткізудің және рәсімдеудің кезеңділігі болатын орталық контрагенттің активтеріне қатысты инвестициялық шешімдерді қабылдау;

4) инвестициялық шешімдерді дайындау, қабылдау және орындау барысында, оның ішінде орталық контрагенттің функцияларын жүзеге асыру және орталық контрагенттің активтерін инвестициялау арасындағы мүдделердің әлеуетті қақтығыстарын басқару бөлігінде орталық контрагенттің органдары мен бөлімшелерінің өзара іс-қимыл ету;

5) көмегі арқылы мәмілелер жасау болжанатын (осындай бар болса) делдалмен (брокермен) өзара іс-қимыл ету процестерінің сипаттамасы бар қаржы құралдарымен мәмілелер жасасу және олардың орындалуын бақылауды жүзеге асыру, мәмілелер жасасуға бақылау, активтердің құрамы мен қозғалысын салыстырып тексеруді жүзеге асыру, жасалған мәмілелердің ішкі есепке алуын және құжат айналымын жүргізу,

сондай-ақ қаржы құралдарымен мәмілелер жасасуға бақылауды жүзеге асыратын басшы қызметкерлердің тізбесі;

б) орталық контрагенттің басқармасы қаржы құралдарымен операциялар бойынша қызмет нәтижелері туралы есептілікті дайындау.

Ескерту. 13-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

14. Орталық контрагенттің қаржы құралдарымен мәмілелер жасасуды қамтамасыз ету мақсатында, мыналар кіретін, бірақ олармен шектелмейтін активтерді инвестициялау саясаты әзірленеді:

- 1) активтерді инвестициялау мақсаты мен стратегиясы;
- 2) активтерді инвестициялау объектілерінің сипаттамасы мен тізбесі;
- 3) қаржы құралдарының түрлері бойынша активтерді инвестициялау лимиттері;
- 4) қаржы құралдарымен мәмілелерге қатысты белгіленген шарттар мен шектеулер;
- 5) хеджирлеу құралдарының тізбесі мен сипаттамасын көрсете отырып, активтерді хеджирлеу және әртараптандыру шарттары;

б) активтерді инвестициялауға байланысты негізгі тәуекелдер туралы ақпарат.

Ескерту. 14-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

15. Орталық контрагенттің активтерін инвестициялау саясатын және оған енгізілетін барлық өзгерістер мен толықтыруларды орталық контрагенттің директорлар кеңесі бекітеді.

Ескерту. 15-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

16. Резервтік, кепілдік беру қорларын, клирингтік қатысушылардың маржалық жарналарын және өзге де қамтамасыз етуін қалыптастыру, сондай-ақ пайдалану тәртібі мен шарттары мыналарды қамтиды:

1) орталық контрагенттің резервтік немесе кепілдік беру қорларының, клирингтік қатысушылардың маржалық жарналарының және өзге де қамтамасыз етуінің мөлшерлерін айқындау және бағалау әдістемесі;

2) клирингтік қатысушылардың маржалық жарналарын және өзге де қамтамасыз етуін, клирингтік қатысушылардың орталық контрагенттің кепілдік беру қорына жарналарды төлеу, орталық контрагенттің резервтік қорын қалыптастыру тәртібі мен шарттары;

3) орталық контрагенттің резервтік немесе кепілдік беру қорларынан төлемдерді жүзеге асыру тәртібі мен шарттары;

4) орталық контрагенттің резервтік немесе кепілдік беру қорларының активтерін:

Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкінде ашылған корреспонденттік шоттағы немесе "Бағалы қағаздардың орталық депозитарийі" акционерлік қоғамында ашылған банк шотындағы ақшаға;

Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BBB-" төмен емес ұзақмерзімді халықаралық рейтингі немесе Fitch немесе Moody's Investors Service агенттіктерінің халықаралық шәкілі бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар корреспондент шетелдік банктердің шоттарындағы ақшаға;

Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "B+" төмен емес ұзақмерзімді рейтингі немесе Fitch немесе Moody's Investors Service агенттіктерінің халықаралық шәкілі бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің ағымдағы шоттарындағы ақшаға;

Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарына;

Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "AA" төмен емес ұзақмерзімді халықаралық рейтингі немесе Fitch немесе Moody's Investors Service агенттіктерінің халықаралық шәкілі бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар шет мемлекеттердің мемлекеттік облигацияларына;

"автоматты" тәсілмен жүзеге асырылатын репо құралдарына;

Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BB+" төмен емес ұзақмерзімді рейтингі немесе Fitch немесе Moody's Investors Service агенттіктерінің халықаралық шәкілі бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттерге;

Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BBB-" төмен емес ұзақмерзімді халықаралық рейтингі немесе Fitch немесе Moody's Investors Service агенттіктерінің халықаралық шәкілі бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезиденттері банктердегі депозиттерге;

Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BB-" төмен емес рейтингі немесе Fitch немесе Moody's Investors Service агенттіктерінің халықаралық шәкілі бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар корпоративтік облигацияларға (оның ішінде купондық халықаралық облигацияларға);

Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BB+" төмен емес ұзақмерзімді халықаралық рейтингі немесе Fitch немесе Moody's Investors Service агенттіктерінің халықаралық шәкілі бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасы резиденттерінің квазимемлекеттік борыштық бағалы қағаздарына инвестициялау тәртібі мен шарттары;

5) маржалық жарналарды төлеу үшін және (немесе) өзге де қамтамасыз ету ретінде енгізілген ақшаны:

Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкінде ашылған корреспонденттік шоттағы немесе "Бағалы қағаздардың орталық депозитарийі" акционерлік қоғамында ашылған банк шотындағы ақшаға;

Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB-" төмен емес ұзақмерзімді халықаралық рейтингі немесе Fitch немесе Moody's Investors Service

агенттіктерінің халықаралық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар корреспондент шетелдік банктердің шоттарындағы ақшаға;

Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B+" төмен емес ұзақмерзімді рейтингі немесе Fitch немесе Moody's Investors Service агенттіктерінің халықаралық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің ағымдағы шоттарындағы ақшаға;

Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарына;

Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "AA" төмен емес ұзақмерзімді халықаралық рейтингі немесе Fitch немесе Moody's Investors Service агенттіктерінің халықаралық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар шет мемлекеттердің мемлекеттік облигацияларына;

Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB-" төмен емес рейтингі немесе Fitch немесе Moody's Investors Service агенттіктерінің халықаралық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар борыштық бағалы қағаздарына (оның ішінде купондық халықаралық облигацияларға);

"автоматты" тәсілмен жүзеге асырылатын репо құралдарына;

СВОП операцияларына;

Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB-" төмен емес ұзақмерзімді халықаралық рейтингі немесе Fitch немесе Moody's Investors Service агенттіктерінің халықаралық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент-банктеріндегі депозиттерге;

Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB-" төмен емес ұзақмерзімді рейтингі немесе Fitch немесе Moody's Investors Service агенттіктерінің халықаралық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттерге инвестициялау тәртібі мен шарттары.

Осы тармақтың 5) тармақшасында көзделген құралдардың тізбесі орталық контрагент клирингтік қатысушылардың береуінің міндеттемелерді орындамау фактісін реттеу мақсатында қаржы құралдарын сатып алған жағдайда қолданылмайды.

Ескерту. 16-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 21.09.2020 № 84 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

17. Қаржы құралдарымен мәмілелерді жүзеге асыру қызметін ұйымдастыруға қойылатын талаптар орталық контрагенттің функцияларын жүзеге асыратын тұлғалардың қызметін реттейтін Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасында белгіленеді.

Ескерту. 17-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

18. Орталық контрагент әрбір нарық бойынша қалыптастыратын орталық контрагенттің клирингтік (кепілдік берілген және резервтік) қорларының жиынтық мөлшерін орталық контрагент олардың мөлшерін клирингке екі қатысушының міндеттемелерін көрсетілген міндеттемелердің ең көп көлемімен орындамаған жағдайда, орталық контрагенттің әлеуетті зияндары мөлшерінен төмен емес деңгейде ұстап тұру қажеттілігін ескере отырып айқындайды.

Орталық контрагент клирингтік (кепілдік беру және резервтік) қорларын құрайтын ақшаны, клирингтік қатысушылардың маржалық жарналарын және ақшасын орталық контрагенттің ішкі құжаттарына сәйкес орналастырады.

Орталық контрагент қатысушылардың позицияларын ағымдағы нарықтық құны бойынша бағалайды және ағымдағы тәуекелдердің жинақталуын шектеу үшін кемінде күніне бір рет клирингтік қатысушылардан маржалық қамтамасыз етуді алады.

Орталық контрагенттің клирингтік қатысушылардың қамтамасыз ету мөлшеріне қоятын талаптары кемінде тоқсан тоғыз пайыз сенімділік деңгейіне сәйкес келетін ықтималдылыққа жол бере отырып айқындалады.

Ескерту. 18-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 10.09.2019 № 151 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

19. Ішкі аудитті және ішкі бақылауды жүзеге асыру рәсімдері:

1) ішкі аудит қызметінің құрамын, оның функцияларын, міндеттері мен өкілеттіктерін;

2) ішкі аудитті және ішкі бақылауды жүзеге асыратын қызметкерлерге қойылатын талаптарды;

3) ішкі аудит пен ішкі бақылаудың мәнін және объектісін;

4) ішкі аудит қызметінің тексеру жүргізу ауқымын және жиілігін;

5) ішкі аудитті жүргізу кезінде тәуекелдерді басқару жүйесінің тиімділігін бағалау жүйесін міндетті түрде пайдалануды;

6) ішкі аудитті жүргізу жоспарын жасауға қойылатын талаптарды;

7) ішкі аудит қызметінің орталық контрагенттің директорлар кеңесіне тексеру нәтижелері туралы есептерді ұсыну мерзімдерін және нысанын айқындайды.

20. Орталық контрагенттің қызметін жүзеге асыру барысында оның органдарымен және (немесе) бөлімшелері арасында туындайтын орталық контрагенттегі орын алған және әлеуетті мүдделер қақтығысын басқару рәсіміне:

1) төмендегілерді қамтамасыз етуге бағытталған орталық контрагент органдарының шешім қабылдау рәсімдері:

орталық контрагент органдарының мүшелері қабылдайтын шешімдердің тәуелсіздігін;

орталық контрагент органдары мүшелерінің қабылданатын шешімдерге мүдделі болмауын;

орталық контрагент органдары мүшелерінің және қызметкерлерінің орталық контрагент органдарының отырыстарын жүргізу барысында алынған ақпаратты тұлғалардың көпшілік тобы арасында осы ақпаратты ресми жариялағанға дейін, оны өзінің жеке мақсатында не үшінші тұлғалардың мүддесінде пайдалануын шектеу;

2) орталық контрагент органдарының отырыстарын жүргізу қорытындылары бойынша хаттамаларды міндетті жасау мен сақтау бойынша талаптар;

3) орталық контрагенттің бөлімшелері арасында, орталық контрагенттің органдары мен бөлімшелері арасында, орталық контрагенттің бөлімшелері арасында орын алған және әлеуетті мүдделер қақтығысын сипаттау;

4) орын алған мүдделер қақтығысын реттеу мақсатында орталық контрагенттің жүргізетін іс-шаралары, сондай-ақ әлеуетті мүдделер қақтығысын реттеуге бағытталған алдын алу шаралары кіреді.

21. Инсайдерлік ақпаратты және бағалы қағаздар нарығында коммерциялық құпияны құрайтын ақпаратты орталық контрагенттің басшылары мен өзге қызметкерлерінің пайдалануын болдырмауды көздейтін рәсімдер:

1) инсайдерлік және өзге конфиденциалдық ақпаратты өзінің мүддесі немесе үшінші тұлғалардың мүддесі үшін пайдалануға отырып мәмілелер жасасуды болдырмауға;

2) Қазақстан Республикасының заңдарында көзделген жағдайларды қоспағанда, инсайдерлік немесе оған негізделген ақпаратты үшінші тұлғаларға беруді және тұлғалардың көпшілік тобы арасында оны таратуды болдырмауға;

3) орталық контрагент қызметкерлерінің инсайдерлік және өзге конфиденциалдық ақпаратқа негізделген қаржы құралдарымен жасалған мәмілелер туралы ұсынымдарды үшінші тұлғалар беру мүмкіндігін шектеуге;

4) Бағалы қағаздар туралы заңның 56-1-бабында көзделген орталық контрагенттің инсайдерлік ақпаратына иелік етуге және оны пайдалануға бақылау бойынша шараларға бағытталған.

22. Клирингтік қатысушылар ретінде олардың қызметінің тәртібін реттейтін Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасының талаптарына, клирингтік қатысушылардың қаржылық жай-күйіне қойылатын талаптарға сәйкестігі мәніне клирингтік қатысушылардың мониторингі мен бақылау тәртібі және шарттары мыналарды қамтиды:

1) клирингтік қатысушылар есептерінің және олардың қаржылық жай-күйінің мониторингі үшін қажетті өзге ақпараттың тізбесі;

2) осы тармақтың 1) тармақшасында көрсетілген есептерді және өзге ақпаратты ұсыну шарттары мен мерзімдері;

3) орталық контрагенттің осы тармақтың 1) тармақшасында көрсетілген есептерді және өзге ақпаратты қарау тәртібі мен мерзімдері;

4) клирингтік қатысушылардың қаржылық жай-күйін бағалау әдістемесі;

5) орталық контрагенттің басшы қызметкерлері мен бөлімшелеріне клирингтік қатысушылардың қаржылық жай-күйі туралы жиынтық есептерді жасау және ұсыну тәртібі мен мерзімдері;

6) клирингтік қатысушылардың қаржылық жай-күйіне белгіленген талаптарға сәйкес келмейтін клирингтік қатысушыға қатысты шаралар қолдану тәртібі мен шарттары;

7) клирингтік қатысушылар ретінде олардың қызметінің тәртібін реттейтін Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасы және орталық контрагенттің ішкі құжаттарының талаптарына сәйкестігі мәніне клирингтік қатысушылар мониторингінің жылдық жоспары;

8) клирингтік қатысушылар ретінде олардың қызметінің тәртібін реттейтін Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасы және орталық контрагенттің ішкі құжаттарының талаптарына сәйкестігі мәніне клирингтік қатысушыларды тексеру жүргізу тәртібі мен шарттары;

9) клирингтік қатысушылар ретінде олардың қызметінің тәртібін реттейтін Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасы және орталық контрагенттің ішкі құжаттарының талаптарына клирингтік қатысушылардың сәйкестігін бағалау әдістемесі;

10) клирингтік қатысушыларды тексеру нәтижелерін ресімдеу және клиринг ұйымының басшы қызметкерлері мен бөлімшелеріне осы ақпаратты ұсыну тәртібі мен мерзімдері;

11) клирингтік қатысушылар ретінде олардың қызметінің тәртібін реттейтін Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасы және орталық контрагенттің ішкі құжаттарының талаптарына сәкес келмеген клирингтік қатысушыға қатысты шараларды қолдану тәртібі мен шарттары.

Ескерту. 22-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

23. Клирингтік қатысушыларға қойылатын талаптарда:

1) қаржылық жағдайына;

2) тәуекелдерді басқарудың және ішкі бақылаудың тиісті жүйелерінің болуына;

3) қор биржасының сауда-саттық жүйесінде жасалатын мәмілелер бойынша міндеттемелерді қамтамасыз ету, оның ішінде осындай мәмілелер бойынша қажетті қамтамасыз етуді қалыптастыру бойынша шараларды сақтауына талаптарды қамтиды.

Ескерту. 23-тармаққа өзгеріс енгізілді – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

24. Орталық контрагенттің ақпараттық саясаты мыналардан тұрады, бірақ мыналармен шектелмейді:

1) орталық контрагенттің ақпаратты жариялау тәртібі мен талаптары;

2) орталық контрагенттің беделіне ықпал етуі мүмкін ақпаратқа тұрақты мониторинг жүргізу бойынша талаптар;

3) орталық контрагенттің беделіне зиян келтіруі мүмкін ақпарат пайда болған және таралған жағдайда қажетті шараларды уақытылы қабылдау бойынша талаптар.

25. Қауіпсіздік техникасы бойынша нұсқаулық:

1) өрт қауіпсіздігі бойынша негізгі талаптардан;

2) төтенше жағдайлар және (немесе) күтпеген жағдайлар орын алған жағдайда орталық контрагент қызметкерлерінің іс-әрекеттері сипатталған төтенше жағдайлар және (немесе) күтпеген жағдайлар туындаған жағдайдағы іс-қимылдар жоспарынан;

3) орталық контрагент қызметкерлерінің бағдарламалық-техникалық кешендерді және өзге жабдықтарды пайдалану тәртібінен;

4) орталық контрагенттің үй-жайларды жабудың алдында қараудың жүйелілігінен тұрады.

26. Орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жүйелерін құруды және олардың тиімді жұмыс істеуін қамтамасыз ету мақсатында орталық контрагенттің ұйымдық құрылымында тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын жеке бөлімше құрылады.

27. Тәуекелдерді басқару бөлімшесінің басшысы мен қызметкерлері жоғары білімді, кәсіби құзыреті және тәуекелдерді басқару саласында кем дегенде 3 (үш) жыл жұмыс тәжірибесі болады, сондай-ақ Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар рыногы туралы заңнамаларын біледі.

28. Орталық контрагенттің ұйымдық құрылымында негізгі функциясы клирингтік қатысушылар ретінде олардың қызметінің тәртібін реттейтін Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасы және орталық контрагенттің ішкі құжаттарының талаптарына сәйкестігі мәніне клирингтік қатысушылардың мониторингі мен бақылау болып табылатын бөлімше қамтылады.

Ескерту. 28-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

29. Орталық контрагенттің қызметін жүзеге асыру барысында оның органдары және (немесе) бөлімшелері арасында туындайтын мүдделердің орын алған және әлеуетті қақтығысын басқару мақсатында мынадай шаралар қабылданады:

1) мүдделер қақтығысы орын алған немесе туындауы мүмкін бөлімшелердің орталық контрагенттің түрлі басшы қызметкерлеріне есептілігін қамтамасыз етеді;

2) орын алған және әлеуетті мүдделер қақтығысын ескере отырып, орталық контрагенттің бөлімшелері мен органдары арасында ақпарат алмасу тәртібі әзірленеді және енгізіледі;

3) ішкі аудит қызметі орталық контрагенттің бөлімшелері және қызметкерлерінің қызметін орын алған және әлеуетті мүдделер қақтығысын басқару бойынша қабылданған рәсімдерге сәйкестігіне тексеруді үнемі жүзеге асырады.

30. Орталық контрагент өз қызметінде тәуекелдердің мынадай түрлеріне мониторингті жүзеге асырады:

- 1) кредиттік тәуекел;
- 2) өтімділікті жоғалту тәуекелі;
- 3) баға тәуекелі;
- 4) валюталық тәуекел;
- 5) пайыздық тәуекел;
- 6) операциялық тәуекел;
- 7) бедел тәуекелі;
- 8) құқықтық тәуекел;

9) орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жөніндегі саясатына сәйкес өзге тәуекелдер.

31. Тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімше клирингтік қатысушылардың мониторингі мен бақылауын жүзеге асыратын бөлімшесімен және орталық контрагенттің құқықтық қамтамасыз ету бөлімшесімен (заң бөлімшесі) бірлесе отырып орталық контрагенттің Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасының талаптарын бұзуы, оның ішінде орталық контрагенттің ішкі құжаттарының Қазақстан Республикасының нормативтік құқықтық актілерінің талаптарына сәйкессіздігі, орталық контрагенттің қызмет практикасының оның ішкі құжаттарына сәйкессіздігі салдарынан туындайтын құқықтық тәуекелдерді реттеуді:

1) орталық контрагент қызметінің Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар рыногы туралы заңнамасына, орталық контрагенттің ішкі қағидаларына және рәсімдеріне сәйкес келуін бақылауды жүзеге асыру;

2) орталық контрагент қызметінің Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар рыногы туралы заңнамасымен, орталық контрагенттің ішкі құжаттарымен белгіленген талаптарға сәйкестігіне бақылауды жүзеге асыру;

3) орталық контрагенттің қызметін реттейтін Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар рыногы туралы заңнамасымен орталық контрагент қызметкерлерін тұрақты негізде таныстырып отыру;

4) орталық контрагенттің Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар рыногы туралы заңнамасымен белгіленген талаптарын, оның өзгеруіне байланысты орындамау тәуекелдеріне бағалау жүргізу арқылы қамтамасыз етеді.

Ескерту. 31-тармаққа өзгеріс енгізілді – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

32. Тәуекелдер мониторингін жүргізу, бақылау мен басқарудың мақсаты:

- 1) тәуекелдер мен қауіп-қатерлерді уақытылы айқындау;
- 2) тәуекелдер көрсеткішінің ең жоғары рұқсат етілген мәндерін бағалаудың сапасын арттыру;

3) тәуекелдерді басқарудың балама тетіктерін дамыту;

4) тәуекелдерді барынша азайту және басқару бойынша уақытылы шаралар қабылдауды қамтамасыз ету;

5) тәуекелдерді басқару жөніндегі бөлімшені қоса алғанда, орталық контрагенттің жеке бөлімшелерін тәуекелдерге мониторинг жүргізу және бағалау процесіне тарту.

33. Тәуекелдерді айқындау рәсімі тәуекелдерді басқару жөніндегі бөлімшемен бірлесе отырып жүргізген бөлімше қызметіне байланысты орталық контрагенттің әр бөлімшесі жүзеге асыратын мұқият шолу және мониторинг жүргізуге негізделеді.

34. Айқындалған тәуекелдер мынадай сипаттамалар бойынша талданады:

1) тәуекелдердің орын алу жиілігі;

2) тәуекелдердің ықпал ету көлемі.

35. Талдаудың нәтижелері негізінде рұқсат етілген түрде белгіленген тәуекелдердің мәніне қарай, тәуекелдер қабылданатын және қабылданбайтын боп сараланады.

36. Тәуекелдерді бағалау және бақылаудың нәтижелері тәуекел көрсеткішінің жалпы (интегралды мәні), сол сияқты орталық контрагент қызметінің әр жеке түрі үшін сандық мәнін айқындау үшін пайдаланылады.

37. Тәуекелдер көрсеткішінің сандық мәні тәуекелдер көрсеткішінің ең жоғары рұқсат етілген мәнін, тәуекелдердің белгіленген рұқсат етілген көрсеткіштеріне сәйкестігін, сондай-ақ белгіленген рұқсат етілген көрсеткіштерге сәйкес келмейтін тәуекелдерді азайту және басқару үшін тиісті шешімдері қабылдау қажеттігін бағалауға мүмкіндік береді.

38. Орталық контрагент қызметінің әрбір жеке түріне тән тәуекелдер көрсеткішінің сандық мәнін қызметтің осы түрін жүзеге асыратын орталық контрагенттің бөлімшесі тәуекелдерді басқару жөніндегі бөлімшемен бірлесе отырып есептейді.

39. Орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жөніндегі бөлімшесі орталық контрагенттің оның клиенттері алдындағы міндеттемелерді орындаудың бұзылуын туғызған техникалық іркілістер және жағдайлар туралы директорлар кеңесі мен басқармаға аталған бұзушылықтар туындаған күннен кейінгі жұмыс күні ішінде хабарлайды.

Ескерту. 39-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 21.09.2020 № 84 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

40. Орталық контрагенттің директорлар кеңесі осы Талаптардың 39-тармағында көрсетілген жағдайлар туралы ақпаратты уәкілетті органға аталған бұзушылықтар туындаған күннен кейінгі жұмыс күнінен кешіктірмей беруді қамтамасыз етеді.

Ескерту. 40-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 21.09.2020 № 84 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

41. Орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жөніндегі бөлімшесі туындаған тәуекелдер жағдайының саны және тәуекелдердің туындауы нәтижесінде шеккен зиянның мөлшері туралы директорлар кеңесі мен басқармаға тоқсан сайын есеп жасайды, сондай-ақ тәуекелдердің өзін, сол сияқты олар туғызған салдарларды азайту бойынша іс-шаралар жоспары ұсынылады.

Ескерту. 41-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 21.09.2020 № 84 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

42. Орталық контрагенттің басқармасы орталық контрагенттің тәуекелдерді басқару жөніндегі бөлімшесінің тәуекелдер көрсеткішінің сандық мәнін бағалау жөніндегі қорытынды негізінде орталық контрагенттің директорлар кеңесі бекітетін тәуекелдер көрсеткіштерінің барынша рұқсат етілген мәндерін айқындайды.

43. Жаңа тәуекелдер туындаған жағдайда және (немесе) тәуекел көрсеткіштерінің мәндері тәуекелдер көрсеткіштерінің барынша рұқсат етілген мәндерімен сәйкес келмеген жағдайда тәуекелді және (немесе) осы сәйкессіздікті анықтаған орталық контрагенттің бөлімшесі директорлар кеңесін және басқарманы хабардар етеді.

44. Тәуекелдерді бағалау нәтижелерінің негізінде оларды барынша азайтуға бағытталған ықтимал шаралар айқындалады.

45. Тәуекелдерді барынша азайту тәуекелдердің мәні тәуекелдер көрсеткіштерінің жол берілетін шекті мәніне жуық болғанда не шектен асып кеткен жағдайларда қажетті болып табылады. Тәуекелдерді барынша азайту мына шаралардың біреуін немесе бірнешеуін қабылдау арқылы жүзеге асырылады:

1) орталық контрагенттің қызметі барысында оның органдары қабылдайтын барлық шешімдерге тән тәуекелдер туындаған жағдайда залалды анықтау және барынша азайту бойынша рәсімдерді жетілдіру;

2) тәуекелдерді басқару саласында орталық контрагент қызметкерлерінің біліктілігін арттыру;

3) ішкі аудит қызметінің орталық контрагент жүйесінің жұмыс істеуіне және (немесе) орталық контрагент бөлімшелерінің жұмысына жоспардан тыс тексерулер жүргізуі;

4) орталық контрагенттің басшы қызметкерлерінің тарапынан тәуекелдерді барынша азайтуға бағытталған іс-шараларға бақылауды арттыру;

5) орталық контрагенттің ішкі құжаттарында көзделген жағдайларда орталық контрагенттің қосымша кепілдік беру немесе резервтік қорларын қалыптастыру.

Ескерту. 45-тармаққа өзгеріс енгізілді – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

46. Орталық контрагенттің директорлар кеңесі тәуекелдер басталуының орын алған жағдайлары бойынша есептілікті беру тәртібін бекітеді, оның мақсаты болып мыналар табылады:

1) тәуекелдердің туындау салдарынан болған шығындар туралы ақпараттық базаны қалыптастыру;

2) тәуекелдердің туындау нәтижесінде шыққан нақты зиян туралы ақпаратты талдау арқылы тәуекелдерді басқару және барынша азайту процестерін жетілдіру;

3) тәуекелдердің туындау нәтижесінде пайда болатын зиянның құнына кезеңді бағалау жүргізу;

4) тәуекелдер туындауының маңызды жағдайларына уақтылы және тиісінше ден қоюды қамтамасыз ету;

5) деректерді жинау, енгізу, өңдеу және сақтау жөніндегі рәсімдерді толық синхрондауды қамтамасыз ету, сондай-ақ ақпаратты қайталау және (немесе) жіберіп алу бойынша қателерді болдырмау.

47. Орталық контрагенттің активтері есебінен қаржы құралдарымен мәмілелерді жүзеге асыру қызметін ұйымдастыруға қойылатын талаптар орталық контрагенттің активтерін инвестициялау тәртібін айқындайтын орталық контрагенттің ішкі құжаттарында белгіленеді.

Ескерту. 47-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

48. Орталық контрагенттің директорлар кеңесі ішкі бақылаудың барабар жүйесінің болуын қамтамасыз етеді және орталық контрагент қызметкерлерінің ішкі бақылау саласында өз міндеттерін орындауы үшін жағдай жасайды.

49. Орталық контрагенттегі ішкі бақылау жүйесі мынадай мақсаттарға:

1) орталық контрагенттің активтерін басқарудың және ықтимал шығындарды айқындаудың тиімділігін тексеруді көздейтін орталық контрагент қызметінің операциялық және қаржылық тиімділігіне;

2) қаржылық және басқарушылық ақпараттың сенімділігіне, толықтығы мен уақтылығына қолжеткізу үшін құрылады. Аталған мақсат дәйекті және сапалы қаржылық есептіліктің жасалуын және шешімдер қабылдаған кезде орталық контрагент пайдаланған басқа қаржы құжаттарын тексеруді болжайды;

3) Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасының талаптарын, сондай-ақ орталық контрагенттің ішкі саясаты мен рәсімдерін айқындайтын құжаттардың талаптарын сақтауға қолжеткізу үшін құрылады.

Ескерту. 49-тармаққа өзгеріс енгізілді – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 10.09.2019 № 151 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

50. Ішкі бақылау жүйесінің жұмысы мынадай үш кезеңнің үздіксіз кезекті түрде жүру қағидаты бойынша қамтамасыз етіледі:

- 1) орталық контрагенттің ішкі регламенттеріне рәсімдерді қосу арқылы ішкі бақылау жүйесін (тиімділікті бағалау нәтижелерін есепке ала отырып) қалыптастыру;
- 2) жұмыста орталық контрагенттің ішкі құжаттарын орындау;
- 3) ішкі бақылау жүйесінің тиімділігіне бағалау жүргізу.

51. Ішкі бақылау жүйесі мына рәсімдерді жүргізуді қамтиды:

1) қызметтің жоспарлы көрсеткіштерін қоса бере отырып, орталық контрагент қызметінің ағымдағы нәтижелері туралы есептерді директорлар кеңесіне беру арқылы орталық контрагенттің алға қойылған мақсаттар мен міндеттерге қолжеткізу процесін тоқсан сайын тексеру;

2) бөлімше қызметінің нәтижелері туралы стандартты жан-жақты есептерді бөлімше басшыларының ай сайынғы негізде тексеруі;

3) материалдық маңызды ақпаратқа және орталық контрагенттің бағдарламалық-техникалық қамтамасыз етуіне кіру рұқсатын шектеуге бақылау жүргізу мақсатымен тексеру;

4) тәуекелдің белгіленген лимиттерінің сақталуын тексеру және анықталған сәйкессіздіктерді жою жөніндегі іс-шараларды іске асыру;

5) міндетті авторизацияны талап ететін операциялардың тізбесіне орталық контрагенттің директорлар кеңесінің талаптар белгілеуі;

6) операциялардың талаптарын және орталық контрагенттің қызметіне байланысты тәуекелдерді басқару үлгілерін қолдану нәтижелерін тексеру;

7) жүргізілген операцияларды орталық контрагенттің есебінде және есептілігінде көрсетудің уақтылығын, дұрыстығын, толықтығы мен дәлдігін тексеру;

8) орталық контрагенттің бағдарламалық-техникалық қамтамасыз етілуінің сенімді жұмыс істеуін тексеру;

9) орталық контрагентке қатысты қадағалау рәсімдерінің тиімділігін тексеру;

10) орталық контрагентте орын алған және әлеуетті мүдделер қақтығыстарын басқаруға бағытталған рәсімдердің тиімділігін тексеру;

11) қаржы құралдарының құны мен кірістілігін бағалау бөлігіндегі әдістемені қоса алғанда, орталық контрагенттің ішкі құжаттарының талаптарына сәйкес жүзеге асырылатын қаржы құралының құнын бағалаудың дұрыстығын және дәйектілігін тоқсан сайынғы тексеру.

Ескерту. 51-тармаққа өзгеріс енгізілді – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 24.09.2018 № 217 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

52. Ішкі бақылау жүйелерінің бірдейлігін және тиімділігін бағалау, орталық контрагент бөлімшелерінің жүктелген функциялар мен міндеттерді орындау жағдайы туралы уақтылы және дәйекті ақпаратпен қамтамасыз ету, сондай-ақ жұмысты жақсарту жөніндегі ұтымды және тиімді ұсынымдарды беру ішкі аудиттің мақсаты болып табылады.

53. Директорлар кеңесі ішкі бақылау жүйесінің жағдайын объективті бағалау және оларды жетілдіру бойынша ұсынымдар беру жолымен тиісті ішкі бақылау жүйесінің болуын және жұмыс істеуін қамтамасыз ету бойынша функцияларын жүзеге асырған кезде туындайтын міндеттерді шешу мақсатымен ішкі аудит қызметі құрылады.

54. Ішкі аудит қызметінің қызметкерлеріне орталық контрагенттің басқа бөлімшелері қызметкерлерінің функциялары мен міндеттері жүктелмейді.

55. Ішкі аудит қызметі өз қызметінде "Акционерлік қоғамдар туралы" 2003 жылғы 13 мамырдағы Қазақстан Республикасы Заңының, Талаптардың және ішкі бақылау жүйесін ұйымдастыру және ішкі аудит қызметі туралы ережелерді қоса алғанда, орталық контрагенттің ішкі құжаттарының талаптарын басшылыққа алады.

56. Ішкі аудит қызметі орталық контрагенттің кез келген бөлімшесінің немесе органының қызметіне тексеру тағайындайды. Ішкі аудит қызметі орталық контрагенттің ішкі құжаттарында белгіленген талаптармен және тәртіпте орталық контрагенттің директорлар кеңесінің алдында үнемі есеп береді.

57. Ішкі аудит қызметі орталық контрагенттің директорлар кеңесі бекітетін ішкі аудиттің жоспары мен ішкі аудит бағдарламасын жасайды.

58. Ішкі аудит қызметі мынадай мәселелерді:

1) ішкі бақылау жүйесінің жұмысын;

2) директорлар кеңесіне ішкі аудит қызметінің жұмысы туралы есептілік дайындауды;

3) директорлар кеңесіне, басқармаға және сыртқы пайдаланушыларға берілетін орталық контрагенттің қызметі шеңберінде кез келген мәліметтер мен ақпараттың шынайылығы мен дәлдігін;

4) ішкі немесе сыртқы аудиторлар анықтаған бухгалтерлік есептегі немесе ішкі аудиттегі кез келген елеулі кемшіліктерді;

5) орталық контрагенттің ішкі құжаттарымен ішкі аудит қызметінің құзыретіне жататын мәселелерді қарайды.

59. Ішкі аудит қызметінің негізгі функциялары мыналар:

1) ішкі бақылау жүйесінің тиімділігін тексеру және бағалау;

2) тәуекелдерді бағалау әдістемесін және тәуекелдерді басқару рәсімдерін (әдістемелерін, бағдарламаларын, қағидаларын, тәртіптерін және операциялар мен мәмілелер жасау рәсімдерін) қолдану толықтығын және тиімділігін тексеру;

3) деректер базасының тұтастығы мен оларды рұқсат берілмеген кіруден қорғауды, күтпеген жағдайларда іс-қимыл жоспарларының болуын қоса алғанда, орталық контрагенттің ішкі жүйесі жұмысының тиімділігін тексеру;

4) бухгалтерлік есеп пен есептіліктің шынайылығын, толықтығын, объективтілігі мен уақтылығын, сондай-ақ ақпарат пен есептілікті жинақтау мен берудің сенімділігі мен уақтылығын тексеру;

5) Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасына сәйкес өзге мәліметтердің шынайылығын, толықтығын, объективтілігі мен уақтылы ұсынылуын тексеру;

6) орталық контрагент мүлігінің сақталуын қамтамасыз етудің қолданылып жүрген тәсілдерін (әдістерін) тексеру;

7) орталық контрагент жасаған операциялардың экономикалық мақсатқа сай екенін және тиімділігін бағалау;

8) ішкі бақылау процестері мен рәсімдерін тексеру;

9) Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы туралы заңнамасы талаптарының сақталуын бақылау мақсатында құрылған жүйелерді тексеру;

10) орталық контрагенттің қызметкерлерді басқару қызметінің жұмысын бағалау;

11) орталық контрагенттің бөлімшелерін тексеру нәтижелері бойынша орталық контрагенттің бөлімшелері мен органдары қабылдаған тәуекелдер деңгейін төмендетуді қамтамасыз ететін шаралардың тиімділігіне бақылауды жүзеге асыру;

12) орталық контрагенттің ішкі құжаттарында ішкі аудит қызметінің құзыретіне жатқызылған басқа мәселелерді қарау болып табылады.

Орталық контрагенттің
тәуекелдерді басқару жүйесіне
орталық контрагенттің
тәуекелдері мониторингінің,
оларды бақылау мен басқарудың
шарттары мен тәртібіне
қойылатын талаптарға
қосымша

нысан

" _____ " жыл үшін

" _____ "

(орталық контрагенттің атауы)

тәуекелдерді басқару жүйесіне қойылатын талаптардың орындалуын бағалау бойынша есеп

№	Талаптардың тиісті абзацының, тармақшасының, тармағының нұсқауы	Талаптар абзацының, тармақшасының, тармағының талаптарына сәйкестігін бағалау	Анықталған кемшіліктер	Кемшіліктерді жою бойынша қажетті іс-шаралар, адамдар мен іс-шараларды орындау мерзімдері	Жауапты орындаушылар

Тәуекелдерді басқару жүйелеріне қойылатын талаптарға сәйкестігін бағалау:

Кестені толтыру бойынша түсініктеме

Тәуекелдерді басқару жүйесіне қойылатын талаптарға сәйкестігін бағалау мынадай критерийлердің үш балдық жүйесі бойынша жүзеге асырылады: талапқа сай, ішінара талапқа сай, талапқа сай емес:

1) "талапқа сай" бағалау орталық контрагент тәуекелдерді басқару жүйелеріне қойылатын талаптардың критерийлерін қандай да бір маңызды кемшіліктерсіз орындауы кезінде шығарылады.

2) "ішінара талапқа сай" бағалау орталық контрагент тәуекелдерді басқару жүйелеріне қойылатын талаптардың нақты критерийін сақтауда қолжеткізу мүмкіндігіне қатысты маңызды күмән пайда болуына жеткілікті болып есептелмейтін кемшіліктер анықталған кезде шығарылады.

3) "талапқа сай емес" бағалау орталық контрагент тәуекелдерді басқару жүйелеріне қойылатын талаптардың критерийін орындамаған кезде шығарылады.

Егер тәуекелдерді басқару жүйелеріне қойылатын жекелеген талаптар орталық контрагентке қатысты қолданылмайтын жағдайда, талаптың осы критерийіне сәйкестігін бағалау жүзеге асырылмайды және "қолданылмайды" деген тиісті жазбамен белгіленеді.

Орталық контрагенттің бірінші басшысы (не оның орнындағы адам

тегі, аты, әкесінің аты (бар болса) қолы күні

Тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшенің басшысы

тегі, аты, әкесінің аты (бар болса) қолы күні

Ішкі аудит қызметінің басшысы

тегі, аты, әкесінің аты (бар болса) қолы күні