

Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің түрлерін белгілеу, инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауы міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидаларын және әдістемесін бекіту туралы

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 27 сәуірдегі № 79 қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2018 жылғы 6 маусымда № 17008 болып тіркелді.

Ескерту. Қаулының тақырыбы жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 20.09.2021 № 89 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

"Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 49-бабының 3-тармағына, "Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеу, бақылау және қадағалау туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 12-бабының 9-3) тармақшасына және "Мемлекеттік статистика туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 16-бабы 3-тармағының 2) тармақшасына сәйкес Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:**

Ескерту. Кіріспе жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 20.09.2021 № 89 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

1. Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің мынадай түрлері:

мәні күн сайын кемінде 1 болатын меншікті капиталдың жеткіліктілігі коэффициенті;

мәні күн сайын:

К2-1 – кемінде 1;

К2-2 – кемінде 0,9;

К2-3 – кемінде 0,8;

К2-4 – кемінде 0,5 болатын мерзімді өтімділік коэффициенті белгіленсін

Ескерту. 1-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 23.11.2022 № 106 (01.04.2023 қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

2. Мыналар бекітілсін:

1) осы қаулыға 1-қосымшаға сәйкес Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу қағидалары;

2) осы қаулыға 2-қосымшаға сәйкес Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі.

Ескерту. 2-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 20.09.2021 № 89 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

3. Осы қаулыға қосымшаға сәйкес тізбе бойынша Қазақстан Республикасының нормативтік құқықтық актілерінің, сондай-ақ Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілерінің құрылымдық элементтерінің күші жойылды деп танылсын.

4. Банктік емес қаржы ұйымдарын реттеу департаменті (Шайқақова Г.Ж.) Қазақстан Республикасының заңнамасында белгіленген тәртіппен:

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

2) осы қаулы мемлекеттік тіркелген күннен бастап күнтізбелік он күн ішінде оның қазақ және орыс тілдеріндегі қағаз және электрондық түрдегі көшірмесін "Республикалық құқықтық ақпарат орталығы" шаруашылық жүргізу құқығындағы республикалық мемлекеттік кәсіпорнына Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің эталондық бақылау банкінде ресми жариялау және енгізу үшін жіберуді;

3) осы қаулыны ресми жарияланғаннан кейін Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ресми интернет-ресурсына орналастыруды;

4) осы қаулы мемлекеттік тіркелгеннен кейін он жұмыс күні ішінде Заң департаментіне осы қаулының осы тармағының 2), 3) тармақшаларында және 5-тармағында көзделген іс-шаралардың орындалуы туралы мәліметтерді ұсынуды қамтамасыз етсін.

5. Қаржылық қызметтерді тұтынушылардың құқықтарын қорғау және сыртқы коммуникациялар басқармасы (Терентьев А.Л.) осы қаулы мемлекеттік тіркелгеннен кейін күнтізбелік он күн ішінде оның көшірмесін мерзімді баспасөз басылымдарында ресми жариялауға жіберуді қамтамасыз етсін.

6. Осы қаулының орындалуын бақылау Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Төрағасының орынбасары Ж.Б. Құрмановқа жүктелсін.

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

Ұлттық Банк

Төрағасы

"КЕЛІСІЛДІ"

Қазақстан Республикасының

Ұлттық экономика министрлігі

Д. Ақышев

Статистика комитетінің Төрағасы

Н. Айдапкелов

2018 жылғы 22 мамыр

Қазақстан Республикасы
Ұлттық Банкі Басқармасының
2018 жылғы 27 сәуірдегі
№ 79 қаулысына
1-қосымша

**Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға тиісті
пруденциялық нормативтердің мәндерін есеп айырысу қағидалары**

**Ескерту. Қағидалар жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту
агенттігі Басқармасының 20.09.2021 № 89 (қолданысқа енгізілу тәртібін 4-тармақтан
қараңыз) қаулысымен.**

1-тарау. Жалпы ережелер

1. Осы инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауы міндетті пруденциялық нормативтерді есептеу әдістемесі (бұдан әрі - Әдістеме) "Бағалы қағаздар рыногы туралы" 2003 жылғы 2 шілдедегі Қазақстан Республикасының Заңы (бұдан әрі - Бағалы қағаздар рыногы туралы заң) 49-бабының 3-тармағына, "Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеу, бақылау және қадағалау туралы" 2003 жылғы 4 шілдедегі Қазақстан Республикасының Заңы 12-бабының 9-3) тармақшасына сәйкес әзірленді және инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың (бұдан әрі-инвестициялық портфельді басқарушылар) сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу тәртібін белгілейді.

**2-тарау. Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті
пруденциялық нормативтердің мәндерін есеп айырысу тәртібі**

2. Инвестициялық портфельді басқарушылар Қағидалардың қосымшасына сәйкес "Инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтері мәндері есебінің" кестесі бойынша алдыңғы жұмыс күнінің соңындағы, сондай-ақ ағымдағы жұмыс күнінің тура алдындағы әрбір демалыс күндерінің соңындағы жағдай бойынша әрбір жұмыс күні инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтері мәндерінің есебін жүргізеді.

3. Қағидалардың мақсаты үшін халықаралық қаржы ұйымдары деп мынадай ұйымдар түсініледі:

Азиялық даму банкі (Asian Development Bank);

Америкааралық даму банкі (Inter-American Development Bank);

Африкалық даму банкі (African Development Bank);

Еуразия даму банкі (Eurasian Development Bank);

Еуропа қайта құру және даму банкі (European Bank for Reconstruction and Development);

Еуропа инвестициялық банкі (European Investment Bank);

Еуропа Кеңесінің Даму Банкі (the Council of Europe Development Bank);

Жеке секторды дамыту жөніндегі исламдық корпорация (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector);

Ислам даму банкі (Islamic Development Bank);

Жан-жақты инвестицияларға кепілдік беру агенттігі (the Multilateral Investment Guarantee Agency);

Скандинавия инвестициялық банкі (the Nordic Investment Bank);

Халықаралық валюта қоры (the International Monetary Fund);

Халықаралық даму қауымдастығы (the International Development Association);

Халықаралық есеп айырысу банкі (the Bank for International Settlements);

Инвестициялық дауларды реттеу жөніндегі халықаралық орталық (the International Centre for Settlement of Investment Disputes);

Халықаралық қайта құру және даму банкі (International Bank for Reconstruction and Development);

Халықаралық қаржы корпорациясы (International Finance Corporation).

4. Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің рейтингтік бағаларынан басқа қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын реттеу, бақылау және қадағалау жөніндегі уәкілетті орган (бұдан әрі – уәкілетті орган) сондай-ақ, Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 8318 болып тіркелген, "Болу қажеттілігі қаржы ұйымдарының, Қазақстан Республикасының бейрезиденті-банктері филиалдарының, Қазақстан Республикасының бейрезиденті-сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары филиалдарының қызметін реттейтін Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес талап етілетін заңды тұлғалар және елдер үшін ең төменгі рейтингіні, осы рейтингіні беретін рейтингтік агенттіктер тізбесін белгілеу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2012 жылғы 24 желтоқсандағы № 385 қаулысымен белгіленген Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис), Fitch (Фич) агенттіктерінің және Қағидалардың 4-1-тармағында белгіленген талап сақталған жағдайда, Қағидалардың 4-2-тармағында белгіленген өлшемшарттарға сәйкес келетін рейтингтік агенттіктердің (бұдан әрі – басқа рейтингтік агенттіктер) бағаларын таниды.

Ескерту. 4-тармақ жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 31.07.2023 № 67 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

4-1. Пруденциялық нормативтерді есептеу кезінде Қағидалардың 4-2-тармағында белгіленген өлшемшарттарға сәйкес келетін рейтингтік агенттіктер берген ұзақ

мерзімді кредиттік рейтингтер халықаралық рейтингтік шкала бойынша тек рейтингтің шетелдік нысандарына қатысты пайдаланылады.

Ескерту. Қағидалар 4-1-тармақпен толықтырылды – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 31.07.2023 № 67 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

4-2. Қағидалардың мақсаттары үшін уәкілетті орган мынадай өлшемшарттарға сәйкес келетін рейтингтік агенттіктердің рейтингтік бағаларын таниды:

1) рейтингтік агенттік шыққан елінде реттелуге жатады және рейтингтік агенттіктің бағалауы пруденциялық реттеу шеңберінде танылады;

2) рейтингтік агенттіктің меншікті капиталының ең аз мөлшері кемінде 600 000 000 (алты жүз миллион) теңгеге балама соманы құрайды;

3) объективтілік, тәуелсіздік және жауапкершілік:

рейтингтік агенттік қолданатын әдіснама сенімді болып табылады және тарихи және (немесе) дефолт туралы күтілетін деректер негізінде тексеруге жатады, сондай-ақ рейтинг берілетін тұлғаның өзіне қабылдаған қаржылық міндеттемелерін орындау қабілетін айқындайтын барлық негізгі сандық және сапалық факторлардың толық сипаттамасын, сондай-ақ олардың кредиттік рейтингтерге және кредиттік рейтингтер бойынша болжамдарға әсерін сипаттауды қамтиды;

рейтингтік агенттікті мемлекеттік органдар немесе мемлекеттік органдардағы лауазымды адамдар, квазимемлекеттік сектор субъектілері немесе рейтингтік агенттіктің қызметіне араласпайтын және рейтингтерді беру процестеріне ықпалы жоқ саяси партиялар бақыламайды;

рейтингтік агенттіктің акцияларының кемінде 10 (он) пайызын тікелей иеленетін және рейтингтік агенттіктің рейтингтік қызметіне ықпалы жоқ тұлғаларды қоспағанда, рейтингтік агенттік рейтинг беретін, растайтын немесе қайта қарайтын заңды тұлғалар рейтингтік агенттіктің үлестес тұлғалары болып табылмайды;

рейтингтік агенттіктің рейтингтік әрекеттерге қатысатын рейтингтік талдаушылары рейтингтік әрекеттерді жүзеге асыру күніне дейін соңғы 3 (үш) жыл ішінде рейтинг берілетін тұлғамен еңбек немесе іскерлік қатынастарда тұрмайды және тұрмаған, сондай-ақ рейтинг берілетін тұлғаның немесе рейтинг берілетін тұлғаны бақылауды жүзеге асыратын немесе осындай тұлғаға елеулі ықпал ететін тұлғалардың бағалы қағаздарын, өзге де қаржы құралдарын немесе өзге де мүлкін тікелей немесе жанама, оның ішінде жақын туыстары арқылы иеленбейді;

рейтингтік агенттіктің ішкі аудит немесе ішкі бақылау, оның ішінде рейтингтік агенттіктің директорлар кеңесіне есеп беретін ішкі аудит функцияларын жүзеге асыратын қызметі бар;

рейтингтік агенттікте директорлар кеңесінің кемінде үштен бірі, бірақ кемінде екі мүшесі рейтингтік әрекеттерді, рейтингтік агенттіктің қызметтерін жарнамалауды және

клиенттерді тарту жөніндегі өзге де іс-қимылдарды жүзеге асырмайтын тәуелсіз мүшелер болып табылады;

рейтингтік агенттіктің әрбір акционерінің акцияларын тікелей немесе жанама иелену үлесі осы рейтингтік агенттіктің дауыс беретін акцияларының жалпы санының 50 (елу) пайызынан аспайды, егер акционер қаржы ұйымы болып табылған жағдайда, тікелей иелену үлесі 10 (он) пайыздан аспайды;

рейтингтік агенттіктің ішкі рәсімдері ақпаратты заңсыз пайдаланудың және жария етудің алдын алу шараларын көздейді және ақпараттың қорғалуын және құпиялылығын қамтамасыз етеді;

4) ақпараттың ашықтығы және оны жария ету:

рейтингтік агенттік рейтингтік агенттіктің интернет-ресурсында мына:

рейтингтік агенттік рейтингті айқындау кезінде қолданатын әдіснама;

соңғы жыл ішінде берілген кредиттік рейтингтердің, сондай-ақ соңғы аяқталған күнтізбелік жылдың соңындағы жағдай бойынша олардан түскен ақшалай түсімдердің үлесі рейтингтік агенттік түсімінің жылдық көлемінде бес және одан да көп пайызды құраған рейтинг берілетін тұлғалардың және өзге де тұлғалардың тізімі туралы ақпаратты жария етуді қамтамасыз етеді;

5) рейтингтердің сенімділігі:

рейтингтік агенттік рейтингтік қызметті кемінде соңғы 5 (бес) жыл тұрақты негізде жүзеге асырады;

рейтингтік агенттік кредиттік рейтингті берген және қайта қараған ұйымдар саны кемінде отыз, оның ішінде соңғы 3 (үш) жылда кемінде жиырма, оның ішінде кемінде бесеуі қаржы ұйымдары болды;

рейтингтік агенттіктің рейтинг тағайындаумен тікелей айналысатын қызметкерлерінің тиісті білімі, дағдылары мен тәжірибесі бар;

рейтингтік шешім қабылдайтын органның (бұдан әрі – рейтингтік комитет) қатысушысы болып табылатын, рейтингтік шешімдер қабылдау процесіне қатысатын кемінде бір қызметкердің рейтингтік агенттікте не талдамалық агенттікте не зерттеу орталығында не қаржы нарығында қызметті жүзеге асыратын қаржы ұйымында не аудиторлық ұйымда кемінде екі жыл жұмыс тәжірибесі бар;

рейтингтік комитеттің құрамында рейтинг берілетін тұлға және (немесе) оның қаржылық міндеттемелері немесе қаржы құралдары (бұдан әрі – рейтинг объектісі) үшін жетекші рейтингтік талдаушыны, рейтингтік комитеттің төрағасын және қаралып отырған рейтинг объектісі жатпайтын, рейтинг объектілері түрінде маманданған бір рейтингтік талдаушыны қоса алғанда, кемінде бес рейтингтік талдаушы болады (егер рейтингтік агенттік рейтинг объектілерінің әр түріне қатысты рейтингтер беру жөніндегі қызметті жүзеге асырған жағдайда);

рейтингтік агенттік берілген рейтингтерді мониторингтеуді тұрақты негізде жүзеге асырады, сондай-ақ рейтинг берілетін тұлғаның қаржылық жағдайындағы,

корпоративтік басқаруындағы немесе қызметінің өзге де аспектілеріндегі өзгерістерге, макроэкономикалық жағдайлардың немесе қаржы нарығы жағдайларының өзгеруіне байланысты өзгеретін факторларға уақтылы ден қоюды қамтамасыз етеді, бұл рейтинг берілген немесе ол соңғы қайта қаралған күннен немесе рейтингтік агенттік қолданылатын әдіснама соңғы қайта қаралған күннен бастап күнтізбелік 1 (бір) жылдан кешіктірілмей рейтингтердің нақты жаңартуларымен расталады;

Осы тармақтың 1), 2), 3), 4) және 5) тармақшаларында белгіленген өлшемшарттарға сәйкес келген кезде рейтингтік агенттік уәкілетті органға рейтингтік агенттіктің осы тармақтың 1), 2), 3), 4) және 5) тармақшаларында белгіленген өлшемдерге сәйкес келуін растайтын құжаттарды қоса бере отырып, пруденциялық реттеу мақсаттары үшін рейтингтік агенттіктің рейтингтік бағаларын қабылдау туралы сұрау салуды жібереді.

Рейтингтік агенттік осы тармақтың 1), 2), 3), 4) және 5) тармақшаларында белгіленген өлшемдерге сәйкес келген кезде уәкілетті орган ресми интернет-ресурста рейтингтік агенттіктің оның рейтингтік бағаларын қабылдау туралы сұрау салуын алған күннен бастап 30 (отыз) жұмыс күнінен кешіктірілмейтін мерзімде рейтингтік агенттік және рейтингтік агенттіктердің халықаралық рейтингтік шкалаларының салыстырмалылығы туралы мәліметтерді жариялайды.

Рейтингтік агенттік қолданатын әдіснамаларды уәкілетті орган рейтингтік агенттік уәкілетті органға алғаш рет жүгінген кезде және жылына кемінде 1 (бір) рет валидациялайды.

Рейтингтік агенттік қолданатын әдіснамаға өзгерістер енгізілген кезде рейтингтік агенттік 10 (он) жұмыс күнінен кешіктірілмейтін мерзімде осындай өзгерістердің себептері мен салдарын көрсете отырып, ақпаратты уәкілетті органға жібереді.

Ескерту. Қағидалар 4-2-тармақпен толықтырылды – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 31.07.2023 № 67 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін қолданысқа енгізіледі); жаңа редакцияда - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 19.07.2024 № 40 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткен соң қолданысқа енгізіледі) қаулыларымен.

5. Қағидалардың мақсаты үшін негізгі қор индекстері деп мынадай есептік көрсеткіштер (индекстер) түсініледі:

CAC 40 (Compagnie des Agents de Change 40 Index) (Компани дэ Эжон дэ Шанж 40 Индекс);

DAX (Deutscher Aktienindex) (Дойтче Акциениндекс);

DJIA (Dow Jones Industrial Average) (Дой Джонс Индастриал Эвередж);

EURO STOXX 50 (EURO STOXX 50 Price Index) (Юроп Эс Ти Оу Экс Экс 50 Прайс Индекс);

FTSE 100 (Financial Times Stock Exchange 100 Index) (Файнэншл Таймс Сток Эксчейндж 100 Индекс);

HSI (Hang Seng Index) (Ханг Сенг Индекс);
KASE (Kazakhstan Stock Exchange Index) (Қазақстан Сток Эксчейндж Индекс);
MSCI World Index (Morgan Stanley Capital International World Index) (Морган Стэнли Кэпитал Интернешнл Ворлд Индекс);
MOEX Russia (Moscow Exchange Russia Index) (Москоу Эксчейндж Раша Индекс);
NIKKEI 225 (Nikkei-225 Stock Average Index) (Никкэй-225 Сток Эвередж Индекс);
RTSI (Russian Trade System Index) (Рашен Трейд Систем Индекс);
S&P 500 (Standard and Poor's 500 Index) (Стандард энд Пурс 500 Индекс);
TOPIX 100 (Tokyo Stock Price 100 Index) (Токио Сток Прайс 100 Индекс);
NASDAQ-100 (Nasdaq-100 Index) (Насдак-100 Индекс).

6. Қағидалар ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығы бар инвестициялық портфельді басқарушыларға және "өмірді сақтандыру" саласында қызметті жүзеге асыратын, бағалы қағаздар нарығында инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыруға лицензиясы бар сақтандыру ұйымдарына қолданылмайды.

7. Сенімгерлікпен басқаруға берілген Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің алтынвалюта активтері және Қазақстан Республикасы Ұлттық қорының активтері инвестициялық портфельді басқарушылардың пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кезінде есепке алынбайды.

8. Қағидалардың инвестициялық портфельді басқарушының үлестес тұлғалары бөлігінде көзделген нормалары заңды тұлғаларға және олардың "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры" акционерлік қоғамының көрсетілген ұйымдардың дауыс беретін акцияларының жиырма бес және одан артық пайызын тікелей (банктер бойынша – жанама) иеленуі нәтижесінде инвестициялық портфельді басқарушымен үлестес болып табылатын үлестес тұлғаларына қолданылмайды.

9. Инвестициялық портфельді басқарушы бағалы қағаздар нарығында кәсіби қызметті қоса атқарған жағдайда, Бағалы қағаздар рыногы туралы заңның 49-бабының 3-тармағына сәйкес уәкілетті органның нормативтік құқықтық актісімен бекітілген, бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу тәртібі ескеріле отырып есептеледі.

10. Меншікті капитал жеткіліктілігінің коэффициенті және (немесе) өтімділік коэффициенті бұзылған жағдайда инвестициялық портфельді басқарушы бұзылған күннен бастап 3 (үш) жұмыс күні ішінде тиісті пруденциялық нормативті бұзу фактісі және себептері туралы, оны жою бойынша іс-шаралар жоспарымен қоса уәкілетті органға хабарлайды.

Инвестициялық портфельді
басқару жөніндегі қызметті
жүзеге асыратын ұйымдардың

**Инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтерінің мәндерін
есептеу кестесі**

**Ескерту. Қосымша жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту
агенттігі Басқармасының 27.11.2023 № 87 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін
күнтізбелік он күн өткеннен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.**

№	Көрсеткіштің атауы	Баланс бойынша сомасы	Есепке алынатын көлем (пайызбен)	Есептеу сомасы
1	2	3	4	5
1	Ақша және салымдардың барлығы, оның ішінде:			
1.1	инвестициялық портфельді басқарушының балансы бойынша активтер сомасының 10 (он) пайызынан аспайтын сомадағы кассадағы ақша		100	
1.2	осы қосымшаның 1.9 және 1.10- жолдарында көрсетілген Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің ағымдағы шоттарындағы ақша		100	
1.3	осы қосымшаның 1.11-жолында көрсетілген Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің ағымдағы шоттарындағы ақша		90	
	Қызметін Қазақстан Республикасының аумағында жүзеге асыратын немесе " Астана" халықаралық қаржы			

1.4	орталығының аумағында жұмыс істейтін орталық депозитарийдегі шоттардағы ақша		100	
1.5	инвестициялық портфельді басқарушының клирингтік ұйымның (орталық контрагенттің) кепілдік немесе резервтік қорларына жарналар, маржалық жарналар, қор биржасының сауда жүйесінде ашық сауда-саттық әдісімен және (немесе) орталық контрагенттің қатысуымен жасалған мәмілелер бойынша міндеттемелердің орындалуын толық және (немесе) ішінара қамтамасыз ету болып табылатын ақшасы		100	
1.6	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент-банкте ріндегі ағымдағы шоттардағы ақша		100	
	"Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасының Заңы 59-бабының 1-			

1.7	тармағында белгіленген функцияларды жүзеге асыратын, Standard & Poor's (Стандарт энд Пуэр) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB"-ден төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының бейрезидент-ұйымдарындағы шоттардағы ақша		100	
1.8	Бағалы қағаздарға қызмет көрсету мәселелері бойынша халықаралық қауымдастықтың мүшесі болып табылатын Қазақстан Республикасының бейрезидент-ұйымдарындағы шоттардағы ақша (International Securities Services Association) (Интернэшнл Секьюритис Сервисис Ассошиайшн)		100	
1.9	Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктері қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторының "премиум" санатына енгізілген эмитенттер немесе акциялары қор		100	

	биржасы индексінің өкілдік тізіміндегі эмитенттер болып табылатын жағдайда, осы банктердегі салымдар			
1.10	Мына талаптардың біреуіне сәйкес келетін, Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар: банктердің Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B"-ден төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzBB+"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар; Қазақстан Республикасының бейрезидент-бас банктері Standard & Poor's агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "A"-ден төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік		100	

	агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының резидент-еншілес банктері болып табылады			
1.11	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "В-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "kzBB"-дан "kzBB"-ға дейін рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар		90	
1.12	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің ұлттық шкаласы бойынша "АА-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар халықаралық қ а р ж ы ұйымдарындағы салымдар, Еуразия		100	

	даму банкіндегі Қазақстан Республикасының ұлттық валютасындағы салымдар			
1.13	Standard & Poor's (Стандарт энд Пуэр) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB-"-тен төмен емес ұзақ мерзімді немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар бейрезидент-банктердегі салымдар		100	
2	Борыштық бағалы қағаздар – барлығы, оның ішінде:			
2.1	Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі мен Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған, басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмиссияланғандарды қоса алғанда, Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары		100	
2.2	қызметін Қазақстан Республикасының аумағында жүзеге асыратын қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған борыштық бағалы қағаздар		100	

2.3	акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне тиесілі, кәсіпкерлік қызметпен байланысты емес жеке тұлғалардың ипотекалық қарыздарын сатып алуды жүзеге асыратын заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар		100	
2.4	Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес "Қазақстан Даму банкі", "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры", "Бәйтерек" ұлттық басқарушы холдингі", "Проблемалық кредиттер қоры" акционерлік қоғамдары шығарған борыштық бағалы қағаздар		100	
	Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары, немесе қор биржасының			

2.5	ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізу үшін қор биржасының талаптарына сәйкес келетін, "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасында жария сауда-саттыққа жіберілген, Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары		90	
2.6	сомасы осы мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздардың номиналдық құнының кемінде 50 (елу) пайызын өтейтін, "ДАМУ" кәсіпкерлікті дамыту қоры" акционерлік қоғамының және (немесе) "Қазақстан Даму банкі" акционерлік қоғамының кепілдіктері бар, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" не "Баламалы" алаңдары "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасының Кәсіпкерлік кодексіне сәйкес шағын немесе орта кәсіпкерлікке жатқызылған		95	

	субъектілер шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар			
2.7	Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы" алаңының " борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген, Қазақстан Республикасы з а ң д ы тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары немесе қор биржасының ресми тізімінің " Баламалы" алаңы " борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізу үшін қор биржасының талаптарына сәйкес келетін, "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасында жария сауда-саттыққа жіберілген, Қазақстан Республикасы з а ң д ы тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары		60	
	Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, Standard & Poor's (			

2.8	Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) ұлттық шкаласы бойынша "kzA-"-тен төмен емес рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары		100	
2.9	Қазақстан Республикасының және басқа да мемлекеттердің заңнамасына сәйкес шығарылған, Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B+"-тен "B-"-ке дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) ұлттық шкаласы бойынша "kzBBB+"-тен "kzBB		85	

	-"-ке дейінгі рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің ұлттық шкаласы бойынша осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының заңды тұлғаларының мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары			
2.10	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің "АА"-тен төмен емес халықаралық рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар халықаралық қаржы ұйымдары шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар, сондай-ақ Еуразия даму банкі шығарған және Қазақстан Республикасының ұлттық валютасында номинирленген бағалы қағаздар		100	
2.11	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB"-тен төмен емес тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар шет		100	

	мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары			
2.12	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB+"-тен "BB-"-ке дейін тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар шет мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары		90	
2.13	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B+"-тен "B-"-ке дейін тәуелсіз рейтингі немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар шет мемлекеттердің борыштық бағалы қағаздары		80	
2.14	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BBB+"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің рейтингі (эмитетінде бар) бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары		100	

2.15	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB+"-тен "BB-"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің рейтингі (эмитетінде бар) бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары		85	
2.16	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B+"-тен "B-"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің рейтингі (эмитентінде бар) бар шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары		70	
3	Акциялар және депозитарлық колхаттар – барлығы, оның ішінде:			
3.1	Қазақстан Республикасы заңды тұлғаларының және негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып		100	

	табылатын депозитарлық қолхаттар			
3.2	заңды тұлғалардың қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторы "премиум" санатының талаптарына сәйкес келетін акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар		100	
3.3	Қазақстан Республикасының резидент-заңды тұлғаларының қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңы "акциялар" секторының "стандарт" санатына енгізілген акциялары немесе Қазақстан Республикасының резидент-заңды тұлғаларының "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, ж а р и я сауда-саттыққа жіберілген акциялары және осы қосымшаның 3.4-жолында көрсетілген, базалық активі осы акциялар болып табылатын акциялар мен депозитарлық қолхаттарды қоспағанда, базалық		80	

	активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық колхаттар			
3.4	Қазақстан Республикасы з а ң д ы тұлғаларының қор биржасының ресми тізімінің "Баламалы " алаңы "акциялар" секторына енгізілген акциялары немесе Қазақстан Республикасы з а ң д ы тұлғаларының " А с т а н а " халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін, жария сауда-саттыққа жіберілген қор биржасының " Өңірлік акциялар нарығының сегменті" ресми тізімінің кіші бөліміне енгізілген акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық колхаттар		60	
3.5	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша " BBB-"-тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының з а ң д ы тұлғаларының және шетелдік		100	

	эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар			
3.6	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "BB+"-тен "BB-"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының з а ң д ы тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар		80	
3.7	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "B+"-тен "B-"-ке дейін рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар Қазақстан Республикасының з а ң д ы тұлғаларының және шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активі осы акциялар болып		60	

	табылатын депозитарлық қолхаттар			
4	Өзге бағалы қағаздар – барлығы, оның ішінде			
4.1	қор биржасының ресми тізіміне енгізілген инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары		70	
4.2	активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын немесе пайлары бойынша баға белгілеу негізгі қор индекстеріне байланыстырылған Exchange Traded Funds (ETF) (Эксчейндж Трэдэд Фандс) пайлары		90	
4.3	Morningstar (Морнингстар) рейтингтік агенттігінің "3 жұлдыздан" төмен емес рейтингтік бағасы бар Exchange Traded Funds (ETF) (Эксчейндж Трэдэд Фандс) Exchange Traded Commodities (ETC) (Эксчейндж Трэдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (ETN) (Эксчейндж Трэдэд Ноутс) пайлары		80	
4.4	орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар		100	

4.5	активтерінің құрамы Қазақстан Республикасының Кәсіпкерлік кодексіне сәйкес шағын немесе орта кәсіпкерлікке жатқызылған субъектілер шығарған, тек қана мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар есебінен қалыптастырылған, олар бойынша " Д А М У " кәсіпкерлікті дамыту қоры" акционерлік қоғамының және (немесе) " Қазақстанның Даму Банкі" акционерлік қоғамының кепілдігі бар, сомасы қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, осы мемлекеттік емес бағалы қағаздардың номиналды құнының кемінде 50 (елу) пайызын өтейтін инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары		95	
5	Өзге активтер - барлығы, оның ішінде:			
5.1	тазартылған бағалы металдар және металл шоттар		100	
	бағалы қағаздар нарығында кәсіби қызметті жүзеге асыру шеңберінде есептелген, бірақ төленбеген комиссиялық сыйақы бойынша (шарт талаптары			

5.2	бойынша мерзімі өтпеген) дебиторлық берешек (инвестициялық портфельді басқарушының үлестес тұлғаларының дебиторлық берешегін қоспағанда) - инвестициялық портфельді басқарушының балансы бойынша активтер сомасының 10 (он) пайызынан аспайтын сомада		100	
5.3	бағалы қағаздар эмитенттеріне бағалы қағаздар шығарылымы проспектісінде көзделген олардың айналыс мерзімінің өтуіне байланысты туындаған (бағалы қағаздар шығарылымы проспектісінің талаптары бойынша мерзімі өтпеген) бағалы қағаздардың номиналдық құнын төлеуге қойылатын талаптар		100	
5.4	инвестициялық портфельді басқарушының балансы бойынша активтер сомасының 5 (бес) пайызынан аспайтын сомада жылжымайтын мүлік түріндегі инвестициялық портфельді басқарушының негізгі құралдары		100	

6	Жиынтық өтімді активтер			
6.1	Өтімді активтер			
6.2	Өтімділігі жоғары активтер			
7	Баланс бойынша жиынтық міндеттемелер, оның ішінде:			
7.1	7 күнге дейін			
7.2	30 күнге дейін			
7.3	90 күнге дейін			
8	Меншікті капиталдың ең төменгі мөлшері			
8.1	ИПБ_От			
8.2	ЗА_ИПБ_От			
9	Меншікті капитал жеткіліктілігінің коэффициенті			
10	Мерзімді өтімділік коэффициенттері:			
10.1	К2-1			
10.2	К2-2			
10.3	К2-3			
10.4	К2-4			

Қазақстан Республикасы
Ұлттық Банкі Басқармасының
2018 жылғы 27 сәуірдегі
№ 79 қаулысына
2-қосымша

Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі

Ескерту. 2-қосымшамен толықтырылды – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 20.09.2021 № 89 (қолданысқа енгізілу тәртібін 4-тармақтан қараңыз); жаңа редакцияда – ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 27.11.2023 № 87 (алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткеннен кейін қолданысқа енгізіледі) қаулыларымен.

1-тарау. Жалпы ережелер

1. Осы инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың сақтауы міндетті пруденциялық нормативтерді есептеу әдістемесі (бұдан

әрі – Әдістеме) "Бағалы қағаздар рыногы туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 49-бабына, "Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеу, бақылау және кадағалау туралы" Қазақстан Республикасы Заңының 12-бабына сәйкес әзірленді және инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың (бұдан әрі - инвестициялық портфельді басқарушылар) сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу тәртібін белгілейді.

2-тарау. Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін есептеу әдістемесі

2. Меншікті капиталдың минималды мөлшерін есептеу мақсаттары үшін тиісті қаржы жылына арналған республикалық бюджет туралы заңда белгіленген айлық есептік көрсеткіштің (бұдан әрі - АЕК) мөлшері пайдаланылады.

3. Бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорымен жасалған шартқа сәйкес зейнетақы активтерін сенімгерлік басқаруды жүзеге асыратын инвестициялық портфельді басқарушы меншікті капиталдың жеткіліктілік коэффициентін мынадай формула бойынша есептейді:

$$K = (\Theta JA + \Theta A - M) / (MKMM + 3A_IPB_Ot),$$
 мұнда:

ӨЖА - Әдістеменің 6-тармағына сәйкес өтімділігі жоғары деп танылатын, есептеу күніне қолда бар инвестициялық портфельді басқарушының өтімділігі жоғары активтері;

ӨА - инвестициялық портфельді басқарушының есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 6-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын өтімді активтері;

М - есеп айырысу күніндегі баланс бойынша жиынтық міндеттемелер;

МКММ - меншікті капиталдың жеткіліктілігі есебіне алынатын инвестициялық портфельді басқарушының меншікті капиталының минималды мөлшері 440 000 (төрт жүз қырық мың) АЕК-ті құрайды;

3А_ИПБ_От - есептеу күніне инвестициялық басқарудағы активтердің мөлшері ретінде есептелген, 3А ИПБ операциялық тәуекел коэффициентіне көбейтілген активтерді сенімгерлік басқаруға байланысты операциялық тәуекел – 4%.

4. Инвестициялық портфельді басқарушы меншікті капиталдың жеткіліктілік коэффициентін мынадай формула бойынша есептейді:

$$K = (\Theta JA + \Theta A - M) / (MKMM + ИПБ_От),$$
 мұнда:

ӨЖА - Әдістеменің 6-тармағына сәйкес өтімділігі жоғары деп танылатын, есептеу күніне қолда бар инвестициялық портфельді басқарушының өтімділігі жоғары активтері;

ӨА - инвестициялық портфельді басқарушының есептеу күніне қолда бар, Әдістеменің 6-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын өтімді активтері;

М - есеп айырысу күніндегі баланс бойынша жиынтық міндеттемелер;

МКММ - меншікті капиталдың жеткіліктілігі есебіне алынатын инвестициялық портфельді басқарушының меншікті капиталының минималды мөлшері 50 000 (елу мың) АЕК-ті құрайды;

ИПБ_От - есептеу күніне инвестициялық басқарудағы активтердің мөлшері ретінде есептелген, ИПБ операциялық тәуекел коэффициентіне көбейтілген активтерді сенімгерлік басқаруға байланысты операциялық тәуекел – 0,1%.

5. Инвестициялық портфельді басқарушының мерзімді өтімділігі коэффициенттерінің ең төменгі мәні мынадай мөлшерде белгіленеді:

К2-1 – кемінде 1;

К2-2 – кемінде 0,9;

К2-3 – кемінде 0,8;

К2-4 – кемінде 0,5.

К2-1 мерзімді өтімділік коэффициенті өтелгенге дейінгі қалған мерзімі 0 (нөлден) бастап 7 (жеті) күнді қоса алғанда, жоғары активтер мөлшерінің мерзімді міндеттемелер мөлшеріне қатынасы ретінде есептеледі. Егер мерзімді міндеттемелердің мөлшері өтелгенге дейінгі қалған мерзімі 0 (нөлден) бастап 7 (жеті) күнді қоса алғанда, жоғары өтімді активтердің 10%-ынан кем болса, онда К2-1 мерзімді өтімділік коэффициенті есептелмейді және орындалған болып саналады.

К2-2 мерзімді өтімділік коэффициенті 0 (нөл) күннен 30 (отыз) күнге дейін қоса алғанда өтелгенге дейін қалған мерзімімен жиынтық өтімді активтер мөлшерінің мерзімді міндеттемелердің мөлшеріне қатынасы ретінде есептеледі. Егер өтелгенге дейін 0 (нөл) күннен 30 (отыз) күнге дейінгі қалған мерзімімен мерзімді міндеттемелердің мөлшері жиынтық өтімді активтердің 10%-ынан кем болса, онда К2-2 мерзімді өтімділік коэффициенті есептелмейді және орындалған болып саналады.

К2-3 мерзімді өтімділік коэффициенті 0 (нөл) күннен 90 (тоқсан) күнге дейін қоса алғанда өтелгенге дейін қалған мерзімімен жиынтық өтімді активтер мөлшерінің мерзімді міндеттемелер мөлшеріне қатынасы ретінде есептеледі. Егер өтелгенге дейін 0 (нөл) күннен 90 (тоқсан) күнге дейінгі қалған мерзімімен мерзімді міндеттемелердің мөлшері жиынтық өтімді активтердің 10%-ынан кем болса, онда К2-3 мерзімді өтімділік коэффициенті есептелмейді және орындалған болып саналады.

К2-4 мерзімді өтімділік коэффициенті жиынтық өтімді активтер мөлшерінің жиынтық міндеттемелер мөлшеріне қатынасы ретінде есептеледі. Егер жиынтық міндеттемелердің мөлшері жиынтық өтімді активтердің 10%-ынан кем болса, онда К2-4 мерзімді өтімділік коэффициенті есептелмейді және орындалған болып саналады.

Инвестициялық портфельді басқарушының есеп айырысу күнгі қолда бар өтімділігі жоғары және өтімді активтері Әдістemenің 6-тармағына сәйкес осындай деп танылады.

6. Инвестициялық портфельді басқарушының жоғары өтімді активтерінің есебіне осы қаулымен бекітілген Инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға міндетті пруденциялық нормативтердің мәндерін

есептеу қағидаларына (бұдан әрі - Қағидалар) қосымшаға сәйкес инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің 1.1, 1.2, 1.4, 1.5, 1.6, 1.7, 1.8, 1.9, 1.10, 1.12, 1.13, 2.1, 2.2, 2.3, 2.4, 2.8, 2.10, 2.11, 2.14, 3.1, 3.2, 3.5, 4.4, 5.1, 5.2, 5.3, 5.4-жолдарында көрсетілген активтер тиісті көлемдерде енгізіледі.

Инвестициялық портфельді басқарушының өтімді активтері ретінде Қағидаларға қосымшаға сәйкес Инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінің мына 1.3, 1.11, 2.5, 2.6, 2.7, 2.9, 2.12, 2.13, 2.15, 2.16, 3.3, 3.4, 3.6, 3.7, 4.1, 4.2, 4.3, 4.5-жолдарында көрсетілген активтер тиісті көлемдерде танылады:

7. Әдістеменің 6-тармағында көзделген өтімділігі жоғары активтердің есебіне мыналар енгізілмейді:

1) инвестициялық портфельді басқарушының міндеттемелері бойынша қамтамасыз ету болып табылатын және (немесе) инвестициялық портфельді басқарушының меншік құқығы шектелген активтер (репо операцияларын қоспағанда).

"Кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар Қағидаларға қосымшаға сәйкес Инвестициялық портфельді басқарушының пруденциялық нормативтерінің мәндерін есептеу кестесінде көрсетілген көлемде инвестициялық портфельді басқарушының өтімді активтерінің есебіне (орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздарды қоспағанда) енгізіледі.

Орталық контрагенттің қатысуымен жасалған "кері репо" операциясының нысанасы болып табылатын бағалы қағаздар инвестициялық портфельді басқарушының өтімді активтерінің есебіне толық көлемде енгізіледі;

2) өлшемдері қор биржасының акциялары нарығының индексі (қор биржасының өкілдік тізімі) есептеу мақсатында пайдаланылатын қор биржасының ресми тізіміне кіретін акцияларды қоспағанда, инвестициялық портфельді басқарушыға қатысты үлестес тұлғалар болып табылатын заңды тұлғалар шығарған бағалы қағаздар.

Қазақстан Республикасы
Ұлттық Банкі Басқармасының
2018 жылғы 27 сәуірдегі
№ 79 қаулысына
қосымша

Күші жойылған Қазақстан Республикасының нормативтік құқықтық актілерінің, сондай-ақ Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілерінің құрылымдық элементтерінің тізбесі

1. 2-тармақтың 2) тармақшасын қоспағанда, "Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативті белгілеу, Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтің

мәндерін есеп айырысу қағидаларын бекіту және Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне бағалы қағаздар нарығы мәселелері бойынша өзгерістер мен толықтыру енгізу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2014 жылғы 3 ақпандағы № 7 қаулысы (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 9410 болып тіркелген, 2014 жылғы 29 мамырда "Әділет" ақпараттық-құқықтық жүйесінде жарияланған).

2. "Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне қаржы ұйымдарының қызметін пруденциялық реттеу мәселелері бойынша өзгерістер мен толықтырулар енгізу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2014 жылғы 16 шілдедегі № 152 қаулысымен (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 9732 болып тіркелген, 2014 жылғы 18 қыркүйекте "Әділет" ақпараттық-құқықтық жүйесінде жарияланған) бекітілген Қазақстан Республикасының қаржы ұйымдарының қызметін пруденциялық реттеу мәселелері бойынша өзгерістер мен толықтырулар енгізілетін нормативтік құқықтық актілері тізбесінің 5-тармағы.

3. "Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне қор биржасы бағалы қағаздарының ресми тізімі мәселелері бойынша өзгерістер енгізу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2014 жылғы 24 желтоқсандағы № 244 қаулысымен (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 10339 болып тіркелген, 2015 жылғы 18 наурызда "Әділет" ақпараттық-құқықтық жүйесінде жарияланған) бекітілген Қор биржасы бағалы қағаздарының ресми тізімі мәселелері бойынша Қазақстан Республикасының өзгерістер енгізілетін нормативтік құқықтық актілері тізбесінің 14-тармағы.

4. "Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне бағалы қағаздар нарығы мәселелері бойынша өзгерістер енгізу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2015 жылғы 19 желтоқсандағы № 250 қаулысымен (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 13001 болып тіркелген, 2016 жылғы 29 ақпанда "Әділет" ақпараттық-құқықтық жүйесінде жарияланған) бекітілген Өзгерістер енгізілетін Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы мәселелері бойынша нормативтік құқықтық актілері тізбесінің 23-тармағы.

5. "Эмитенттерге және олардың қор биржасында айналысқа жіберілетін (жіберілген) бағалы қағаздарына, сондай-ақ қор биржасы тізімінің жекелеген санаттарына қойлатын талаптарды бекіту және Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне бағалы қағаздар нарығын реттеу мәселелері бойынша өзгерістер енгізу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2017 жылғы 27 наурыздағы № 54 қаулысының (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 15175 болып тіркелген, 2017 жылғы 14 маусымда Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің эталондық бақылау банкінде

жарияланған) 2-қосымшасына сәйкес Өзгерістер енгізілетін Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығын реттеу мәселелері бойынша нормативтік құқықтық актілері тізбесінің 9-тармағы.

6. "Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне бағалы қағаздар нарығына кәсіби қатысушылардың есептілікті ұсыну мәселелері бойынша өзгерістер мен толықтырулар енгізу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 29 қаңтардағы № 5 қаулысымен (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 16498 болып тіркелген, 2018 жылғы 19 наурызда Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің эталондық бақылау банкінде жарияланған) бекітілген Бағалы қағаздар нарығына кәсіби қатысушылардың есептілікті ұсыну мәселелері бойынша өзгерістер мен толықтырулар енгізілетін Қазақстан Республикасының нормативтік құқықтық актілері тізбесінің 2-тармағы.