

Қазақстан Республикасының кейбір нормативтік құқықтық актілеріне қаржы нарығын реттеу мәселелері бойынша өзгерістер мен толықтыру енгізу туралы

Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 2021 жылғы 15 ақпандағы № 31 қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2021 жылғы 16 ақпанда № 22229 болып тіркелді.

"Бағалы қағаздар рыногы туралы" 2003 жылғы 2 шілдедегі Қазақстан Республикасының Заңы 49-бабының 3-тармағына және 49-1-бабының екінші бөлігіне, "Қаржы нарығы мен қаржы ұйымдарын мемлекеттік реттеу, бақылау және қадағалау туралы" 2003 жылғы 4 шілдедегі Қазақстан Республикасының Заңы 9-тармағының 5) тармақшасына және 12-бабының 14-2) тармақшасына, "Мемлекеттік статистика туралы" 2010 жылғы 19 наурыздағы Қазақстан Республикасы Заңының 16-бабы 3-тармағының 2) тармақшасына, "Қазақстан Республикасында зейнетақымен қамсыздандыру туралы" 2013 жылғы 21 маусымдағы Қазақстан Республикасының Заңы 8-бабының 1) тармақшасына сәйкес Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігінің Басқармасы ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:

1. Осы қаулыға қосымшаға сәйкес Өзгерістер мен толықтыру енгізілетін Қазақстан Республикасының қаржы нарығын реттеу мәселелері бойынша нормативтік құқықтық актілерінің тізбесі бекітілсін.

2. Қаржы ұйымдарының әдіснамасы және пруденциялық реттеу департаменті Қазақстан Республикасының заңнамасында белгіленген тәртіппен:

1) Заң департаментімен бірлесіп осы қаулыны Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркеуді;

2) осы қаулыны ресми жарияланғаннан кейін Қазақстан Республикасы Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігінің ресми интернет-ресурсына орналастыруды;

3) осы қаулы мемлекеттік тіркелгеннен кейін он жұмыс күні ішінде Заң департаментіне осы тармақтың 2) тармақшасында көзделген іс-шараның орындалуы туралы мәліметтерді ұсынуды қамтамасыз етсін.

3. Осы қаулының орындалуын бақылау Қазақстан Республикасының Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Төрағасының жетекшілік ететін орынбасарына жүктелсін.

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

*Қазақстан Республикасының
Қаржы нарығын реттеу және
дамыту Агенттігінің Төрағасы*

М. Абылкасымова

"КЕЛІСІЛДІ"

Қазақстан Республикасының
Ұлттық Банкі
"КЕЛІСІЛДІ"
Қазақстан Республикасы Стратегиялық
жоспарлау және реформалар агенттігінің
Ұлттық статистика бюросы

Қазақстан Республикасының
Қаржы нарығын реттеу және
дамыту
Агенттігінің Басқармасының
2021 жылғы 15 ақпандағы
№ 31 Қаулыға
қосымша

Өзгерістер мен толықтыру енгізілетін Қазақстан Республикасының қаржы нарығын реттеу мәселелері бойынша нормативтік құқықтық актілерінің тізбесі

1. "Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және дилерлік қызметті, инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін тәуекелдерді басқару мен ішкі бақылау жүйесін қалыптастыру қағидаларын бекіту туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2013 жылғы 27 тамыздағы № 214 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 8796 болып тіркелген, 2013 жылғы 29 қарашада "Заң газеті" газетінде 181 (2382) жарияланған) мынадай өзгерістер енгізілсін:

көрсетілген қаулымен бекітілген Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және дилерлік қызметті, инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін тәуекелдерді басқару мен ішкі бақылау жүйесін қалыптастыру қағидаларында:

б-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

"6. Қағидаларда мынадай ұғымдар пайдаланылады:

1) ашық валюталық позиция - жекелеген шет мемлекеттің (шет мемлекеттер топтарының) валютасындағы талаптардың (міндеттемелердің) сол шетел валютасындағы міндеттемелерден (талаптардан) асып кетуі;

2) баға тәуекелі - қаржы құралдары құнының өзгеруі салдарынан қаржы құралдарының нарықтық құнына әсер ететін қаржы нарықтарындағы жағдайлар өзгерген жағдайда туындайтын шығыстардың (зиянның) туындау тәуекелі;

3) клиенттердің Басқарушы инвестициялық басқаруға қабылдаған активтері:
қабылдаған жеке және заңды тұлғалардың Басқарушы инвестициялық (сенімгерлік) басқаруға қабылдаған ақшасы, бағалы қағаздары, қаржы құралдары және өзге мүлкі;
инвестициялық қордың Басқарушы басқаруға қабылдаған активтері;

ерікті жинақтаушы зейнетақы жарналарын тарту құқығымен инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыруға лицензиясы бар Басқарушының басқаруындағы зейнетақы активтері;

бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорының "Қазақстан Республикасында зейнетақымен қамсыздандыру туралы" 2013 жылғы 21 маусымдағы Қазақстан Республикасының Заңы 35-1-бабына сәйкес Басқарушының сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері (бұдан әрі - сенімгерлік басқарудағы зейнетақы активтері);

4) бедел тәуекелі - жағымсыз қоғамдық пікір немесе брокерге және (немесе) дилерге, Басқарушыға деген сенімнің төмендеуі салдарынан шығыстардың (зиянның) туындау тәуекелі;

5) бэк-тестинг - тарихи деректерді пайдалану арқылы және есептелген нәтижелерді көрсетілген операцияларды жасаудың ағымдағы (нақты) нәтижелерімен салыстыра отырып тәуекелдерді өлшеу рәсімдерінің тиімділігін тексеру әдістері;

6) валюталық тәуекел - шетел валюталары бағамдарының өзгеруіне байланысты шығыстардың (зиянның) туындау тәуекелі. Шығыстардың (зиянның) қауіптілігі құндық мәніндегі валюталар бойынша позицияларды қайта бағалаудан туындайды;

7) гәп-позиция - клиент активтерінің және осы міндеттемелердің орындалу мерзімдеріне қарай клиенттің инвестициялық басқаруға не брокерлік қызмет көрсетуге берілген активтері бойынша міндеттемелердің арасындағы айырма немесе брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының меншікті өтімді активтерінің және міндеттемелердің орындалу мерзімдеріне қарай осы міндеттемелерінің арасындағы айырма;

8) елдің (трансферт) тәуекелі - шет мемлекеттің немесе шет мемлекет резидентінің міндеттемелер бойынша төлемге қабілетсіздігі немесе жауап беру ниетінің болмауы салдарынан шығыстардың (зиянның) туындау тәуекелі;

9) ішкі аудит қызметі - негізгі функциясы брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының қаржы-шаруашылық қызметіне бақылау жасау болып табылатын брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының бөлімшесі;

10) ішкі бақылау жүйесі - брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының рентабельдіктің ұзақ мерзімді мақсаттарын және Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы және инвестициялық қорлар туралы заңнамасын, брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының саясатын, ішкі қағидалар мен рәсімдерді сақтауға, брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының зиян тәуекелін немесе бедел тәуекелін төмендетуге мүмкіндік беретін қаржылық және басқарушылық есептіліктің сенімді жүйесін қолдауды іске асыруын қамтамасыз ететін ішкі бақылаудың рәсімдері мен саясатының жиынтығы;

11) ішкі құжаттар - брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының, олардың органдарының, құрылымдық бөлімшелерінің (филиалдарының, өкілдіктерінің), қызметкерлерінің қызметі талаптарын және тәртібін реттейтін құжаттар;

12) корпоративтік басқару - ұйымның тиімді жұмыс істеуін қамтамасыз етуге, оның акционерлерінің (қатысушыларының) құқықтары мен мүдделерін қорғауға бағытталған брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының жоғарғы органының, басқару органының (қадағалау кеңесінің), атқарушы органының және өзге де органдарының арасындағы өзара қарым-қатынастар кешенін білдіретін және акционерлерге (қатысушыларға) брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының қызметіне тиімді бақылау мен мониторинг жасауға мүмкіндік беретін брокерді және (немесе) дилерді, Басқарушыны стратегиялық және тактикалық басқару жүйесі;

13) кредиттік тәуекел - бағалы қағазды шығару талаптарымен белгіленген мерзімде инвесторға тиесілі негізгі борышты және сыйақыны эмитенттің төлемеуі немесе уақтылы төлемеуі салдарынан, сондай-ақ своптар, опциондар, форвардтар мен кредиттік тәуекелге ұшыраған өзге де қаржы құралдары бойынша және осы бағалы қағаздар мен қаржы құралдары бойынша есеп айырысуларды реттеу кезеңінде контрәріптестің міндеттемелерді орындамауына байланысты не контрәріптестің немесе клиенттің шартта көзделген немесе мәміле жасау барысында туындайтын өздерінің міндеттемелерін орындамауы немесе уақтылы орындамауы салдарынан туындайтын залал тәуекелін қамтитын шығыстардың (зиян) туындау тәуекелі;

14) контрәріптес - клиенттердің активтері және (немесе) брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының меншікті активтері есебінен қаржы құралдарымен жасалатын мәмілелерді жасау барысында брокерге және (немесе) дилерге, Басқарушыға қызмет көрсететін, осы заңды тұлға аумағында заңды тұлға ретінде тіркелген мемлекеттің заңнамасына сәйкес алынған қаржы құралдарымен мәмілелер жасауға құқық беретін лицензиясы не рұқсаты бар заңды тұлға;

15) құқықтық тәуекел - брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығы және инвестициялық қорлар туралы заңнамасының, ал Қазақстан Республикасының бейрезиденттерімен қатынастарда – басқа мемлекеттер заңнамасының талаптарын бұзуы не брокер және (немесе) дилер, Басқарушы практикасының олардың ішкі құжаттарына сәйкес келмеуі салдарынан шығыстардың (зиянның) туындау тәуекелі;

16) меншікті активтерді инвестициялау саясаты - инвестициялау объектілерінің тізбесін, брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының меншікті активтеріне қатысты инвестициялық қызметтің мақсатын, стратегиясын, талаптарын және шектеулерін, меншікті активтерді хеджирлеу мен әртараптандыру талаптарын айқындайтын құжат;

17) мүдделер қайшылығын басқару - брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының лауазымды тұлғасының немесе қызметкерінің мүдделері олардың шешімдер қабылдауының және міндеттерін орындауының объективтілігі мен тәуелсіздігіне ықпал етуі, сондай-ақ олардың брокер және (немесе) дилер, Басқарушы клиенттерінің және (немесе) брокер және (немесе) дилер, Басқарушы акционерлерінің

мүдделерінде әрекет жасау міндеттемесімен қайшы келуі мүмкін жағдайларды болдырмау тетіктерін жасау;

18) нарықтық тәуекел - қаржы нарықтарындағы қолайсыз жағдайға байланысты шығыстардың (зиянның) туындау тәуекелі. Нарықтық тәуекелдің макроэкономикалық сипаты бар, яғни қаржы жүйесінің макроэкономикалық көрсеткіштері нарықтық тәуекелдердің дереккөздері болып табылады;

19) операциялық тәуекел - ішкі процестерді жүзеге асыру, ақпараттық жүйелер мен технологиялардың жұмыс жасауы барысында қызметкерлер тарапынан жол берілген кемшіліктердің немесе қателіктердің нәтижесінде, сондай-ақ:

жауапкершілікті бөлуді, есеп берушілік пен басқару құрылымын қоса алғанда, брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының анық емес және тиімсіз ұйымдастыру құрылымына;

ақпараттық технологиялар саласындағы тиімсіз стратегияларына, саясатына және (немесе) стандарттарына, бағдарламалық қамтамасыз етуді пайдаланудағы кемшіліктеріне;

шындыққа сай келмейтін ақпаратқа не оны тиісінше пайдаланбауға;

қызметкерлерді тиімсіз түрде басқаруға және (немесе) брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының білікті емес штатына;

брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының қызметін жүзеге асыру процесінің жеткілікті түрде тиімді құрылмауына не ішкі қағидалардың сақталуына нашар бақылау жасалуына;

брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының қызметіне сыртқы ықпалдың болжанбаған немесе бақыланбайтын факторларына;

брокердің және (немесе) дилердің, Басқарушының қызметін реттейтін ішкі құжаттарда (қағидаларда) кемшіліктердің немесе қателердің болуына;

брокер және (немесе) дилер, Басқарушы басшылығының және қызметкерлерінің клиенттік база ауқымының тарылуына, клиенттердің және (немесе) контрәріптестердің брокерге және (немесе) дилерге, Басқарушыға деген сенімсіздігіне немесе оны жағымсыз қабылдауына алып келген кәсіби емес іс-әрекеттеріне байланысты тәуекелдер кіретін сыртқы оқиғалар салдарынан шығыстардың (зияндардың) туындау тәуекелі;

20) өтімділікті жоғалту тәуекелі - міндеттемелердің орындалмау не уақтылы орындамау ықтималдығына байланысты тәуекел. Бағалы қағаздардың активтер ретінде өтімділігін жоғалту тәуекелі олардың төмен шығындарымен және қолайлы бағалары бойынша тез сатылу мүмкіндігімен айқындалады;

21) пайыздық тәуекел - сыйақы мөлшерлемелерінің қолайсыз өзгеруі салдарынан шығыстардың (зияндардың) туындау тәуекелі, оған:

орналастырған активтер мен тартылған міндеттемелерді (белгіленген сыйақы мөлшерлемелері кезінде) қайтару және өтеу мерзімдерінің сәйкес келмеуінен шығыстардың (зияндардың) туындауына;

өзге тең жағдайларда ұқсас баға сипаттамасы болатын бірқатар құралдар бойынша алынатын және төленетін сыйақыны есептеу мен түзетудің түрлі әдістерін қолдануға байланысты (негізгі тәуекел) тәуекелдер кіреді;

22) стресс-тестинг - заңды немесе жеке тұлғаның қаржылық жағдайына ерекше, бірақ заңды немесе жеке тұлғаның қызметіне әсер етуі мүмкін ықтимал оқиғалардың ықтимал әсер етуін өлшеу әдістері;

23) тәуекелдерді басқару жүйесі – төрт негізгі элемент: тәуекелді бағалау, тәуекелді өлшеу, тәуекелді бақылау және тәуекелді мониторингтеу кіретін процесс;

24) төлем қабілетсіздігі тәуекелі - брокермен және (немесе) дилермен немесе брокер және (немесе) дилер болып табылатын Басқарушымен брокерлік қызмет көрсетуге шарт жасасқан клиенттің мәміле жасау нәтижесінде туындаған ақша және (немесе) бағалы қағаздарды жеткізу бойынша міндеттемелерді орындамау тәуекелі;

25) форс-мажор жағдайы - төтенше және еңсерілмейтін (осы жағдайлар кезінде) оқиға (дүлей күш);

26) "stop-loss" лимиттері - қаржы құралдарымен жасалатын операциялар бойынша шығынның жол берілетін шекті деңгейі;

27) "take profit" лимиттері - қаржы құралдарымен операциялар бойынша кірістердің жол берілетін шекті деңгейі;

28) VAR (Value at Risk) моделі - берілген уақыт кезеңі ішінде берілген ықтималдық дәрежесімен инвестициялық портфельдің белгілі бір позициялары бойынша ең жоғары ықтимал шығындарын сипаттайтын модель.";

40-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

"40. Клиенттердің басқаруға қабылданған активтерін, оның ішінде зейнетақы активтерін, инвестициялық қорлардың активтерін және (немесе) Басқарушының немесе Басқарушы болып табылатын брокердің және (немесе) дилердің меншікті активтерін тиімді басқаруды қамтамасыз ету мақсатында Басқарушының немесе Басқарушы болып табылатын брокердің және (немесе) дилердің жауапты бөлімшесі:

1) жарты жылдықта кем дегенде бір рет:

қалыптасып отырған геосаяси жағдайларға, инвестициялау валютасына және экономика саласына қарай инвестициялау нарықтарының тартымдылық дәрежесі бойынша макроэкономикалық талдау жасауды;

2) тоқсанына кем дегенде бір рет:

эмитенттің қаржылық жағдайын талдауды қоса алғанда, эмитенттерді және олар шығарған (берген) қаржы құралдарына, қабылданған міндеттемелер бойынша жауап беру қабілетіне, осы эмитенттердің қаржы құралдарына инвестициялауға және осы тәуекелдердің уәкілетті орган Басқарушы үшін белгілеген пруденциялық

нормативтерінің және өзге де нормалар мен лимиттердің мәніне әсер етуіне байланысты тәуекелдерге талдау жасауды;

портфельдің құрылымы, кірістіліктің өзгеру динамикасы туралы мәліметтерді қамтитын инвестициялық портфельге талдау, зиян тартқызатын позицияларға және портфельдің құрылымын оңтайландыру жөніндегі ұсыныстарға талдау жасауды;

инвестициялық басқаруға қабылдану болжанып отырған активтер мөлшерінің, сондай-ақ олардың орындалу мерзімдері бойынша басқаруға қабылданған инвестициялық портфель (портфельдер) міндеттемелері құрылымының болжамы (ақшаның және (немесе) инвестициялық басқаруға берілген активтердің сомасы туралы ақпарат кіретін, құрылымын, клиенттерді, оның ішінде ерікті жинақтаушы зейнетақы жарналарының салымшыларын (зейнетақы төлемдерінің алушыларын), инвестициялық қор пайшыларын, акционерлерін талдау негізінде) қамтылатын талдауды;

сенімгерлік басқаруға қабылдауға болжанған зейнетақы активтерінің мөлшерін, сондай-ақ сенімгерлік басқаруға қабылданған (инвестициялық портфель (портфельде) міндеттемелерінің құрылымын олардың орындалу мерзімдері бойынша бодау қамтылатын талдауды;

3) күн сайынғы негізде:

міндеттемелерді белгіленген мерзімдер ішінде өтеу үшін қажетті өтімді активтерді жұмылдыру қабілетінің өзгеруін ескере отырып, меншікті активтер және клиенттердің активтері бойынша гәп-позициялар лимиттерінің сақталуын шолу, оның ішінде шетел валютасындағы міндеттемелерді өтеу үшін қажетті шетел валютасындағы өтімді активтерді қалыптастыру қабілетінің мониторингі кіретін ақша ағынын (өтімділікті) басқаруды жүргізеді.";

49-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

"49. Ерікті зейнетақы жарналарын тарту құқығы бар Басқарушының инвестициялық комитетінің құрамына мыналар кіреді:

1) басшы қызметкерлер;

2) тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшенің басшысы;

3) Басқарушыға қатысты үлестес заңды тұлғалардың бір мезгілде басшы қызметкерлері не ірі акционерлері болып табылмайтын Басқарушының қызметкерлері." ;

51-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

"51. Клиенттердің инвестициялық басқаруға қабылданған активтерінің (Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкімен жасалған шартқа сәйкес басқаруға қабылданған зейнетақы активтерін және сенімгерлік басқарудағы зейнетақы активтерін қоспағанда) және (немесе) Басқарушының немесе Қағидалардың 48 және 49-тармақтарында белгіленген талаптарға сәйкес келетін Басқарушы, инвестициялық комитет болып

табылатын брокердің және (немесе) дилердің меншікті қаражаты есебінен қаржы құралдарымен мәмілелер жасасу туралы шешімдер қабылдау жөніндегі функцияларды қоса атқаруға жол беріледі.";

97-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

"97. Басқарушының немесе Басқарушы болып табылатын брокердің және (немесе) дилердің атқарушы органы өз функцияларын жүзеге асыру үшін Қағидалардың 96-тармағында көрсетілген ақпаратқа қосымша:

1) Басқарушының немесе Басқарушы болып табылатын брокердің және (немесе) дилердің инвестициялық шешімді қабылдау үшін қажетті ақпаратты жинауды, өңдеуді және талдауды жүзеге асыратын бөлімшесінен - клиенттердің инвестициялық басқаруға берілген активтерін және (немесе) меншікті активтерін инвестициялық басқару нәтижелері туралы есепті - тоқсан сайынғы негізде;

2) Басқарушының немесе Басқарушы болып табылатын брокердің және (немесе) дилердің тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшесінен - белгіленген инвестициялау лимиттерін сақтау (пайдалану) туралы ақпаратты -тоқсан сайынғы негізде;

3) Басқарушының немесе Басқарушы болып табылатын брокердің және (немесе) дилердің клиенттердің (инвестициялық қорлардың) инвестициялық басқаруға қабылданған активтерін және (немесе) меншікті активтерді басқаруды және тәуекелдерді басқаруды жүзеге асыратын бөлімшелерінен - бөлімшелердің не қызметкерлердің белгіленген инвестициялау лимиттерін бұзуы туралы ақпаратты - ақпараттың туындауына қарай;

4) клиенттердің (инвестициялық қорлардың) инвестициялық басқаруға қабылданған активтерін және (немесе) Басқарушының немесе Басқарушы болып табылатын брокердің және (немесе) дилердің меншікті активтерін инвестициялық басқаруды жүзеге асыратын бөлімшеден - қабылданған инвестициялық шешімдер туралы есепті - жарты жылда кем дегенде бір рет алады."

**2. Күші жойылды - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі
Басқармасының 07.06.2023 № 42 (01.07.2023 бастап қолданысқа енгізіледі) қаулысымен**

3. "Банктің пруденциялық нормативтерінің және сақталуы міндетті өзге де нормалары мен лимиттерінің нормативтік мәндері мен оларды есептеу әдістемелерін, капиталының мөлшерін және Ашық валюталық позицияны есептеу қағидалары мен оның лимиттерін белгілеу туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2017 жылғы 13 қыркүйектегі № 170 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 15886 болып тіркелген, Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің эталондық бақылау банкінде 2017 жылғы 25 қазанда жарияланған) мынадай өзгеріс енгізілсін:

көрсетілген қаулымен бекітілген Ашық валюталық позицияны есептеу қағидалары мен оның лимиттерінде:

2-1-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

"2-1. Банктер форвардтық келісімшарттарды банктің валюталық тәуекелін басқару мақсатында жасаған кезде және форвардтық келісімшарт бойынша контрагент мынадай талаптардың біріне сәйкес келген кезде олармен операциялар жасайды:

өз қызметін уәкілетті орган берген лицензияға сәйкес жүзеге асыратын Қазақстан Республикасының резиденті-қаржы ұйымы болып табылатын болса;

өзінің орналасқан жерінің елінде банк, сақтандыру ұйымы, инвестициялық компания, инвестициялық холдинг, инвестициялық банк, брокерлік компания, басқарушы компания, сенімгерлік басқару компаниясы, биржада қаржы құралдарымен немесе туынды қаржы құралдарымен сауда бойынша мүшелігі бар компания мәртебесі бар және Экономикалық ынтымақтастық және даму ұйымына мүше мемлекеттердің аумағында тіркелген Қазақстан Республикасының бейрезидент-заңды тұлғасы болып табылатын болса;

Standard & Poog's рейтинг агенттігінің "BB"-ден төмен емес кредиттік рейтингі немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингі бар және тізбесі Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 20095 болып тіркелген, "Банктік және сақтандыру қызметінің, бағалы қағаздар рыногының кәсіби қатысушылары қызметінің және бағалы қағаздар рыногында лицензияланатын басқа да қызмет түрлерінің, акционерлік инвестициялық қорлар және микроқаржылық қызметті жүзеге асыратын ұйымдар қызметінің мақсаттары үшін офшорлық аймақтардың тізбесін белгілеу туралы" Қазақстан Республикасының Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 2020 жылғы 24 ақпандағы № 8 қаулысымен белгіленген офшорлық аймақтарда тіркелмеген Қазақстан Республикасының бейрезидент-заңды тұлғасы болып табылатын болса;

өзінің қаржы-шаруашылық қызметі үшін форвардтық келісімшарт жасасқан Қазақстан Республикасының резиденті-заңды тұлғасы болып табылатын болса (контрагенттің төлем қабілеттілігіне, форвардтық келісімшарттың нысаналы мақсатына банк жүргізген талдаумен, контрагенттің шоттары бойынша айналымдармен және (немесе) форвардтық келісімшарт жасасу мақсатын растайтын өзге де құжаттармен расталады);

дауыс беретін акцияларының немесе жарғылық капиталға қатысу үлестерінің 50 (елу) пайызынан астамы мемлекетке тиесілі Қазақстан Республикасының резидент-заңды тұлғасы болып табылатын болса;

банктің орналастырылған (артықшылық берілген және банк сатып алған акцияларды шегергенде) акцияларының 50 (елу) пайызынан астамын тікелей немесе жанама иеленетін заңды тұлға болып табылатын болса.

Қағидалардың мақсаттары үшін форвардтық келісімшарт мынадай факторлар (бірақ олармен шектелмей) негізінде валюталық тәуекелі басқару мақсатында жасалған деп танылады:

мәміле банктің активтерін немесе міндеттемелерін валюта бағамдарының қолайсыз қозғалысынан қорғауға бағытталған құрал болып табылады;

мәміле бойынша оны орындау үшін негіздер бар;

мәміле оның мазмұнына, экономикалық тұрғыдан орынды болуына немесе ресімделуіне объективті мәселелер тудырмайды."

4. "Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің, сондай-ақ олардың мәнінің сақталуын сипаттайтын көрсеткіштердің түрлерін белгілеу, Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға тиісті пруденциялық нормативтердің мәндерін есеп айырысу қағидаларын бекіту туралы" Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 27 сәуірдегі № 79 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 17008 болып тіркелген, 2018 жылғы 12 маусымда Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің эталондық бақылау банкінде жарияланған) мынадай өзгеріс пен толықтыру енгізілсін:

көрсетілген қаулымен бекітілген Инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға тиісті пруденциялық нормативтердің мәндерін есеп айырысу қағидаларында:

6-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

"6. Инвестициялық портфельді басқарушының меншікті капиталының жеткіліктілігі коэффициенті мына формула бойынша есептеледі:

$K = (\Theta A - M) / MKTM$, мұндағы:

ΘA - инвестициялық портфельді басқарушының есептеу күнгі жағдай бойынша қолдағы бар, Қағидалардың 11-тармағына сәйкес өтімді деп танылатын өтімді активтері;

M - есептеу күнгі жағдай бойынша қолдағы бар міндеттемелер;

$MKTM$ - инвестициялық портфельді басқарушының меншікті капиталының меншікті капиталдың жеткіліктілігінің есебіне қабылданатын, Қағидалардың 8-тармағына сәйкес есептелген ең төмен мөлшері. Бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорымен жасалған шартқа сәйкес зейнетақы активтерін сенімгерлік басқаруды жүзеге асыратын инвестициялық портфельді басқарушы үшін $MKTM$ Қағидалардың 8-1-тармағына сәйкес, басқаруға қабылданған өзге активтердің мөлшеріне қарамастан есептеледі.";

мынадай мазмұндағы 8-1-тармақпен толықтырылсын:

"8-1. Егер:

1) сенімгерлік басқаруға қабылданған зейнетақы активтерінің ағымдағы құны мынадай болған кезде меншікті капитал 3 000 000 000 (үш миллиард) және одан да көп, бірақ 5 000 000 000 (бес миллиард) теңгеден аз болса:

меншікті капиталдың 10 еселенген мөлшерінен аз болса, онда МКТМ 1 029 000 (бір миллион жиырма тоғыз мың) АЕК-ге тең болады;

меншікті капиталдың 10 еселенген мөлшерінен көп болса, онда МКТМ 1 029 000 (бір миллион жиырма тоғыз мың) АЕК-ге + (БҚЗА – 10 * МК) * 0,10 тең болады, мұндағы БҚЗА сенімгерлік басқаруға қабылданған зейнетақы активтері, МК есептеу күнгі жағдай бойынша меншікті капиталдың мөлшері болып табылады;

2) сенімгерлік басқаруға қабылданған зейнетақы активтерінің ағымдағы құны мынадай болған кезде меншікті капитал 5 000 000 000 (бес миллиард) теңге болса:

200 000 000 000 (екі жүз миллиард) теңгеден аз болса, онда МКТМ 1 800 000 (бір миллион сегіз жүз мың) АЕК-ге тең болады;

200 000 000 000 (екі жүз миллиард) теңгеден көп болса, онда МКТМ 1 800 000 (бір миллион сегіз жүз мың) АЕК-ге + (БҚЗА - 200 000 000 000 (екі жүз миллиард) теңге) * 0,05 тең болады, мұндағы БҚЗА сенімгерлік басқаруға қабылданған зейнетақы активтері болып табылады."

5. "Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар үшін пруденциялық нормативтердің, сондай-ақ олардың мәнінің сақталуын сипаттайтын көрсеткіштердің түрлерін белгілеу, Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға тиісті пруденциялық нормативтердің мәндерін есеп айырысу қағидаларын бекіту туралы" Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Басқармасының 2018 жылғы 27 сәуірдегі № 80 қаулысына (Нормативтік құқықтық актілерді мемлекеттік тіркеу тізілімінде № 17005 болып тіркелген, 2018 жылғы 13 маусымда Қазақстан Республикасы Нормативтік құқықтық актілерінің эталондық бақылау банкінде жарияланған) мынадай өзгерістер енгізілсін:

көрсетілген қаулымен бекітілген Бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыратын ұйымдар сақтауға тиісті пруденциялық нормативтердің мәндерін есеп айырысу қағидаларында:

21-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

"21. ИПБ1 немесе ИПБ2 меншікті капиталдың жеткіліктілігі коэффициенті мына формула бойынша есептеледі:

$$K = (\Theta A - M) / \text{МКТМ},$$
 мұндағы:

ΘA - Қағидалардың 24-тармағына сәйкес өтімді болып танылатын, есептеу күнгі жағдай бойынша қолда бар ИПБ1 немесе ИПБ2-нің өтімді активтері;

M - есептеу күніндегі қолда бар баланс бойынша міндеттемелер;

МКТМ - меншікті капиталдың жеткіліктілігінің есебіне қабылданатын, Қағидалардың 23-тармағына сәйкес есептелген ИПБ1 немесе ИПБ2-нің меншікті

капиталының ең төменгі мөлшері. Бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қорымен жасалған шартқа сәйкес зейнетақы активтерін сенімгерлік басқаруды жүзеге асыратын ИПБ1 немесе ИПБ2 үшін МКТМ Қағидалардың 23-тармағының 3) және 4) тармақшаларына сәйкес, басқаруға қабылданған өзге активтердің мөлшеріне қарамастан есептеледі.";

23-тармақ мынадай редакцияда жазылсын:

"23. Егер:

1) ИПБ1 басқаруға қабылдаған активтердің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден аз болса, онда МКТМ 107 000 (бір жүз жеті мың) АЕК-ге тең болады;

ИПБ1 басқаруға қабылдаған активтердің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден көп болса, онда МКТМ 107 000 (бір жүз жеті мың) АЕК + (БҚА - 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңге)* 0,0001-ге тең болады, мұндағы БҚА инвестициялық басқаруға қабылданған активтер болып табылады;

2) ИПБ2 басқаруға қабылдаған активтердің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден аз болса, онда МКТМ 85 000 (сексен бес мың) АЕК-ге тең болады;

ИПБ2 басқаруға қабылдаған активтердің құны 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңгеден көп болса, онда МКТМ 85 000 (сексен бес мың) АЕК + (БҚА - 40 000 000 000 (қырық миллиард) теңге)* 0,0001-ге тең болады, мұндағы БҚА инвестициялық басқаруға қабылданған активтер болып табылады;

3) сенімгерлік басқаруға қабылданған зейнетақы активтерінің ағымдағы құны мынадай болған кезде ИПБ1 немесе ИПБ2 меншікті капиталы 3 000 000 000 (үш миллиард) және одан да көп, бірақ 5 000 000 000 (бес миллиард) теңгеден аз болса:

ИПБ1 немесе ИПБ2 меншікті капиталының 10 еселеген мөлшерінен аз болса, онда МКТМ 1 029 000 (бір миллион жиырма тоғыз мың) АЕК-ге тең болады;

ИПБ1 немесе ИПБ2 меншікті капиталының 10 еселеген мөлшерінен көп болса, онда МКТМ 1 029 000 (бір миллион жиырма тоғыз мың) АЕК-ге + (БҚЗА – 10 * МК *0,10 тең болады, мұндағы БҚЗА сенімгерлік басқаруға қабылданған зейнетақы активтері, МК есептеу күнгі жағдай бойынша ИПБ1 немесе ИПБ2 меншікті капиталының мөлшері болып табылады;

4) сенімгерлік басқаруға қабылданған зейнетақы активтерінің ағымдағы құны мынадай болған кезде ИПБ1 немесе ИПБ2 меншікті капиталы 5 000 000 000 (бес миллиард) теңге болса:

200 000 000 000 (екі жүз миллиард) теңгеден кем болса, МКТМ 1 800 000 (бір миллион сегіз жүз мың) АЕК-ке тең;

200 000 000 000 (екі жүз миллиард) теңгеден көп, онда МКТМ 1 800 000 (бір миллион сегіз жүз мың) АЕК-ке тең + (БҚЗА - 200 000 000 000 (екі жүз миллиард) теңге)* 0,05, мұндағы БҚЗА - ИПБ1 немесе ИПБ2 сенімгерлік басқаруға қабылданған зейнетақы активтері болып табылады."

мәселелері бойынша өзгерістер
мен толықтыру енгізілетін
нормативтік құқықтық
актілерінің тізбесіне
қосымша

Ескерту. Қосымшаның күші жойылды - ҚР Қаржы нарығын реттеу және дамыту агенттігі Басқармасының 07.06.2023 № 42 (01.07.2023 бастап қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

© 2012. Қазақстан Республикасы Әділет министрлігінің «Қазақстан Республикасының Заңнама және құқықтық ақпарат институты» ШЖҚ РМК